



LDB
EMPRESAS

PARAIBUNA
JUNHO 2024



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 28.06.2024.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

74,24%

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	0,61	-0,08	0,38	3,84	20.995.551,54	19,70	6.543.333.888,45	0,32
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,81	-0,51	-0,99	-1,23	1.788.429,91	1,68	4.649.802.742,18	0,04
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,72	-0,18	0,37	3,20	1.216.215,33	1,14	4.972.766.310,86	0,02
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,70	-0,22	0,26	3,11	1.061.709,94	1,00	5.571.325.652,69	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,71	-0,24	0,20	2,96	15.412.212,71	14,46	4.585.046.250,25	0,34
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,72	-0,18	0,37	3,21	5.698.511,73	5,35	7.303.046.549,52	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,42	-0,14	0,17	2,36	13.820.977,17	12,97	4.858.229.912,84	0,28
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,27	-0,16	0,24	2,99	59.993.608,33	56,30		

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 FLUXO FIC	0,06	0,04	0,71	4,71	129.525,70	0,12	5.048.562.747,13	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	3,82	-0,50	-0,98	-1,28	1.737.198,97	1,63	843.817.661,01	0,21
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,07	0,04	0,19	0,19	2.845.828,95	2,67	17.821.452.916,03	0,02
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11	0,04	0,83	5,69	5.572.306,21	5,23	11.692.368.410,92	0,05
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	1,91	-0,29	-0,20	1,81	3.350.362,67	3,14	683.118.622,81	0,49
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	1,73	-0,18	0,36	3,15	3.616.750,35	3,39	827.438.439,72	0,44
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,06	0,04	0,71	4,70	1.475.527,37	1,38	976.883.009,20	0,15
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,22	-0,11	0,33	3,42	18.727.500,22	17,57		

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	5,46	-0,51	-0,51	-0,68	391.058,77	0,37	29.308.725,49	1,33
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea a	5,46	-0,51	-0,51	-0,68	391.058,77	0,37		
		Renda Fixa	1,24	-0,15	0,26	3,06	79.112.167,32	74,24		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

11,77%

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 DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	14,63	-1,03	1,09	-5,85	1.199.108,27	1,13	723.051.001,32	0,17
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	14,32	-0,30	1,53	-12,65	806.685,73	0,76	697.103.232,93	0,12
BB	BB	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	13,49	0,00	-0,07	-12,82	0,00	0,00	1.108.199.259,35	0,00
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	13,73	-0,14	1,13	-7,60	2.819.130,95	2,65	715.959.885,20	0,39
BRAM	BEM	BRADERCO F I A SELECTION	14,89	-0,75	-0,13	-13,33	1.000.932,02	0,94	305.744.233,44	0,33
BRAM	BRADERCO	BRADERCO FIA DIVIDENDOS	13,32	-0,32	1,90	-7,95	3.943.822,92	3,70	492.416.001,18	0,80
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	14,18	-0,64	1,00	-9,38	1.982.551,99	1,86	547.635.436,93	0,36
ITAU	ITAU	ITAU SMALL CAP VALUATION FIC FIA	18,16	-1,02	0,09	-12,64	795.286,19	0,75	324.127.395,49	0,25
Sub-total Artigo 8º I			13,67	-0,48	1,31	-9,32	12.547.518,07	11,77		
Renda Variável			13,67	-0,48	1,31	-9,32	12.547.518,07	11,77		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,30%

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				
BB	BB	BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	13,62	0,06	9,77	30,18	1.934.767,67	1,82	1.649.294.012,28	0,12
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	13,96	0,88	12,73	39,52	2.650.008,77	2,49	2.736.870.167,13	0,10
Sub-total Artigo 9º III			13,56	0,53	11,46	35,42	4.584.776,44	4,30		
Investimentos no Exterior			13,56	0,53	11,46	35,42	4.584.776,44	4,30		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,69%

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	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11,06	-0,28	3,90	16,70	1.870.252,54	1,75	1.972.213.735,46	0,09
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,17	-0,33	0,00	1,90	2.630.039,36	2,47	1.296.788.455,13	0,20
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	4,16	-0,63	-0,74	-0,89	1.803.935,70	1,69	200.458.217,42	0,90
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	11,05	-0,28	3,96	16,75	1.869.566,22	1,75	1.326.345.413,32	0,14
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI	0,24	0,06	0,85	5,16	2.149.737,68	2,02	103.501.722,35	2,08
Sub-total Artigo 10º I			4,51	-0,28	1,44	6,99	10.323.531,50	9,69		
Investimentos Estruturados			4,51	-0,28	1,44	6,99	10.323.531,50	9,69		
Total			3,02	-0,17	0,91	2,49	106.567.993,33	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	59.993.608,33	56,30	0,00	27,53	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	18.727.500,22	17,57	0,00	14,60	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	391.058,77	0,37	0,00	0,43	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	79.112.167,32	74,24					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	12.547.518,07	11,77	0,00	2,44	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	12.547.518,07	11,77					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	4.584.776,44	4,30	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	4.584.776,44	4,30					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	10.323.531,50	9,69	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	10.323.531,50	9,69					15,00
Total		106.567.993,33	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	0,24 30,51	2,99 57,30	0,94 36,97	2,99 57,30	8,23 70,36	143.335,66	1.740.048,83
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,33 41,64	3,42 65,46	1,38 54,45	3,42 65,46	9,09 77,76	52.088,78	522.255,42
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,51 -64,53	-0,68 -13,09	0,75 29,54	-0,68 -13,09	-7,59 -64,90	-1.999,59	-2.690,61
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,31 -0,17	-9,32 -1,66	-5,73 -2,45	-9,32 -1,66	0,17 -4,76	147.846,29	-1.566.018,56
Artigo 9º III % do CDI	11,46 1.454,15	35,42 678,32	18,25 721,18	35,42 678,32	47,88 409,52	471.521,56	1.199.097,27
Artigo 10º I % do CDI	1,44 182,38	6,99 133,81	1,98 78,22	6,99 133,81	15,48 132,44	146.324,16	674.141,98
PARAIBUNA (Total)						959.116,86	2.566.834,33

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	20.915.457,54	0,00	0,00	0,00	20.995.551,54	80.094,00	716.489,34
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	1.806.225,86	0,00	0,00	0,00	1.788.429,91	-17.795,95	-22.188,10
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1.211.685,38	0,00	0,00	0,00	1.216.215,33	4.529,95	37.726,19
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1.059.000,34	0,00	0,00	0,00	1.061.709,94	2.709,60	32.057,40
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.382.192,91	0,00	0,00	0,00	15.412.212,71	30.019,80	442.409,45
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.677.371,39	0,00	0,00	0,00	5.698.511,73	21.140,34	177.253,14
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	14.298.339,25	0,00	-500.000,00	0,00	13.820.977,17	22.637,92	356.301,41
	60.350.272,67	0,00	-500.000,00	0,00	59.993.608,33	143.335,66	

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	199.314,89	793.989,08	-865.849,31	0,00	129.525,70	2.071,04	24.134,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B	1.754.407,97	0,00	0,00	0,00	1.737.198,97	-17.209,00	-22.503,84
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.842.118,45	0,00	0,00	2.845.828,95	3.710,50	3.710,50
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	5.526.171,27	0,00	0,00	0,00	5.572.306,21	46.134,94	299.784,10
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	3.357.212,76	0,00	0,00	0,00	3.350.362,67	-6.850,09	59.485,35
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	3.603.862,97	0,00	0,00	0,00	3.616.750,35	12.887,38	110.413,71
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	1.588.777,88	200.549,60	-325.144,12	0,00	1.475.527,37	11.344,01	47.231,18
	16.029.747,74	3.836.657,13	-1.190.993,43	0,00	18.727.500,22	52.088,78	

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	393.058,36	0,00	0,00	0,00	391.058,77	-1.999,59	-2.690,61
	393.058,36	0,00	0,00	0,00	391.058,77	-1.999,59	

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	1.186.135,95	0,00	0,00	0,00	1.199.108,27	12.972,32	-74.460,35
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	794.491,73	0,00	0,00	0,00	806.685,73	12.194,00	-116.782,39
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	2.233.002,31	0,00	-2.231.525,37	0,00	0,00	-1.476,94	-328.085,27
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	2.787.566,25	0,00	0,00	0,00	2.819.130,95	31.564,70	-231.843,21
BRADESCO F I A SELECTION	1.002.217,41	0,00	0,00	0,00	1.000.932,02	-1.285,39	-153.946,13
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	3.870.284,25	0,00	0,00	0,00	3.943.822,92	73.538,67	-340.554,73
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	1.962.944,80	0,00	0,00	0,00	1.982.551,99	19.607,19	-205.239,44
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	794.554,45	0,00	0,00	0,00	795.286,19	731,74	-115.107,04
	14.631.197,15	0,00	-2.231.525,37	0,00	12.547.518,07	147.846,29	

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 GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	1.762.548,52	0,00	0,00	0,00	1.934.767,67	172.219,15	448.512,45
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2.350.706,36	0,00	0,00	0,00	2.650.008,77	299.302,41	750.584,82

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	4.113.254,88	0,00	0,00	0,00	4.584.776,44	471.521,56	

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	1.800.043,16	0,00	0,00	0,00	1.870.252,54	70.209,38	267.608,45
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	2.629.956,13	0,00	0,00	0,00	2.630.039,36	83,23	49.028,64
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	1.817.381,96	0,00	0,00	0,00	1.803.935,70	-13.446,26	-16.160,34
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	1.798.292,33	0,00	0,00	0,00	1.869.566,22	71.273,89	268.226,48
ITAU INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI	2.131.533,76	0,00	0,00	0,00	2.149.737,68	18.203,92	105.438,75
	10.177.207,34	0,00	0,00	0,00	10.323.531,50	146.324,16	

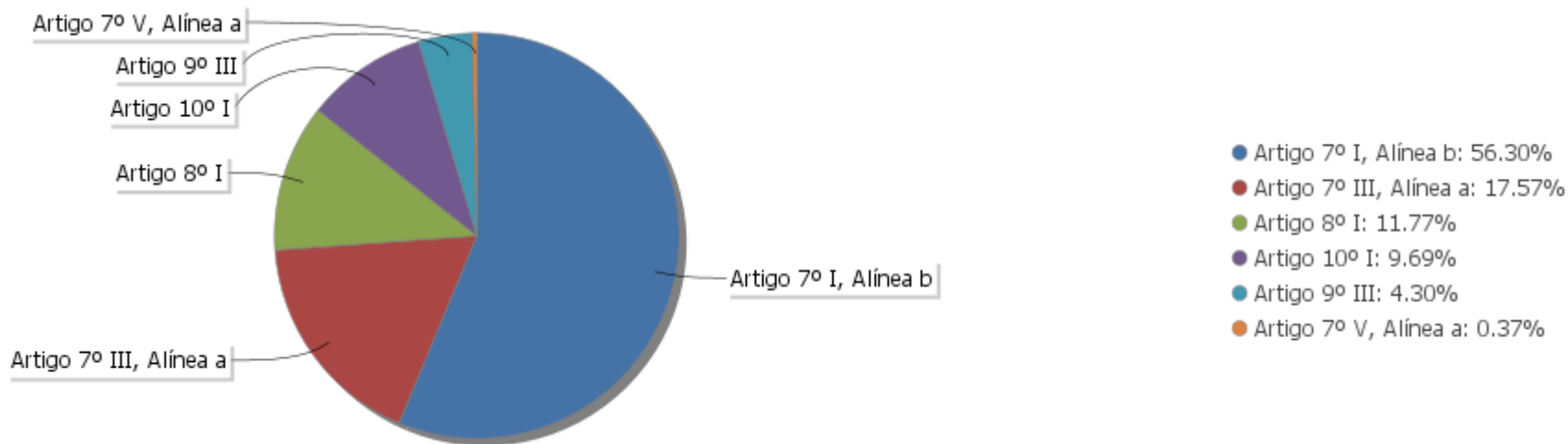
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

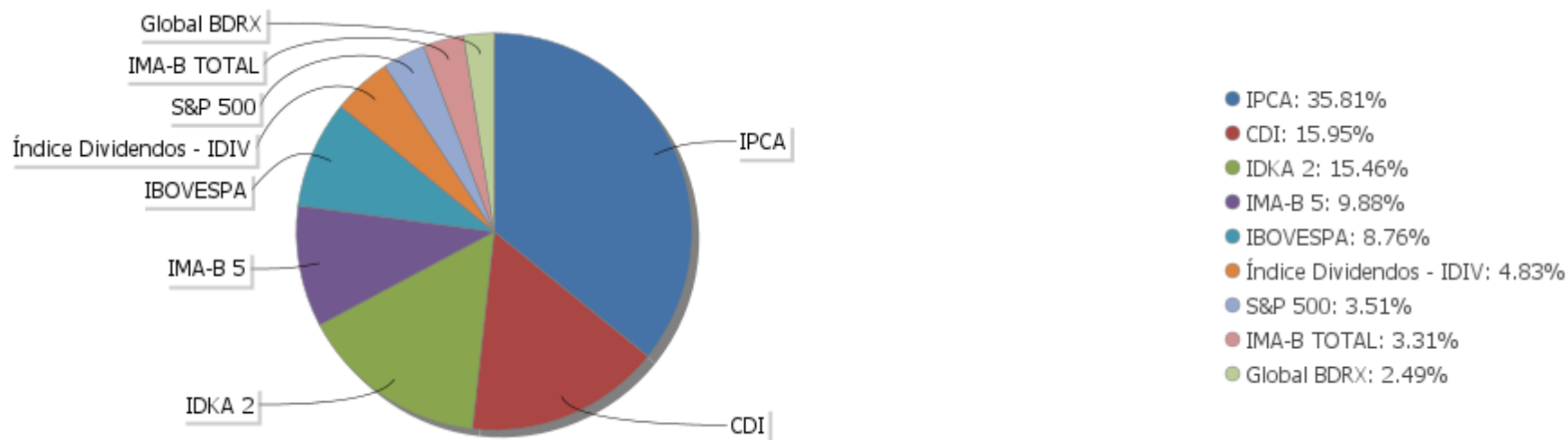
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	101.766.310,39	95,49		101.766.310,39	95,49	
de 31 dias a 365 dias	4.801.682,94	4,51		106.567.993,33	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00		106.567.993,33	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

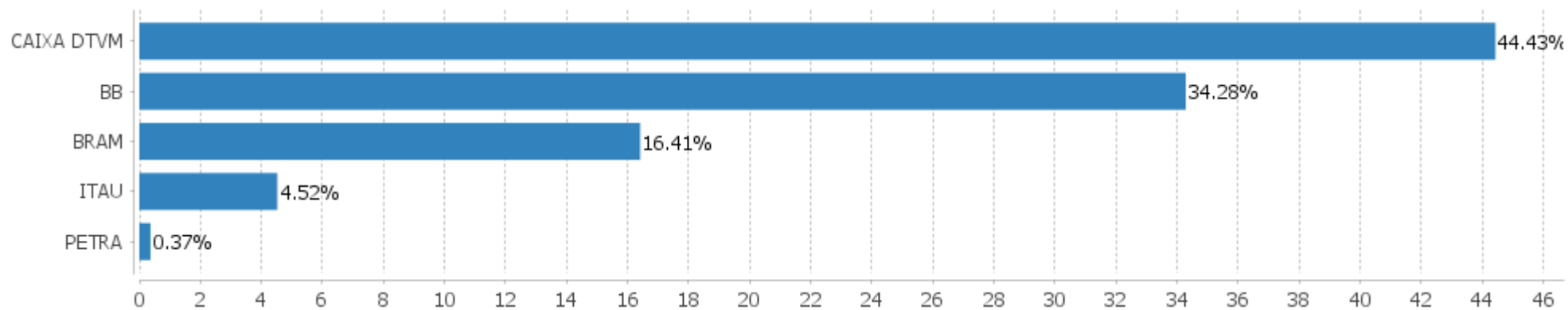


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2024	-0,03	1,06	0,73	-0,83	0,63	0,91							2,49
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54	0,80	0,86	0,59							4,94
p.p. indexador	-0,87	-0,14	0,19	-1,64	-0,23	0,32							-2,46
2023	1,70	-0,41	0,81	1,07	1,83	2,74	1,40	-0,24	0,09	-0,57	3,37	2,18	14,80
IPCA + 4,96%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,65	0,32	0,52	0,67	0,65	0,65	0,67	0,95	9,75
p.p. indexador	0,75	-1,60	-0,35	0,11	1,17	2,42	0,87	-0,91	-0,55	-1,22	2,70	1,23	5,05
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

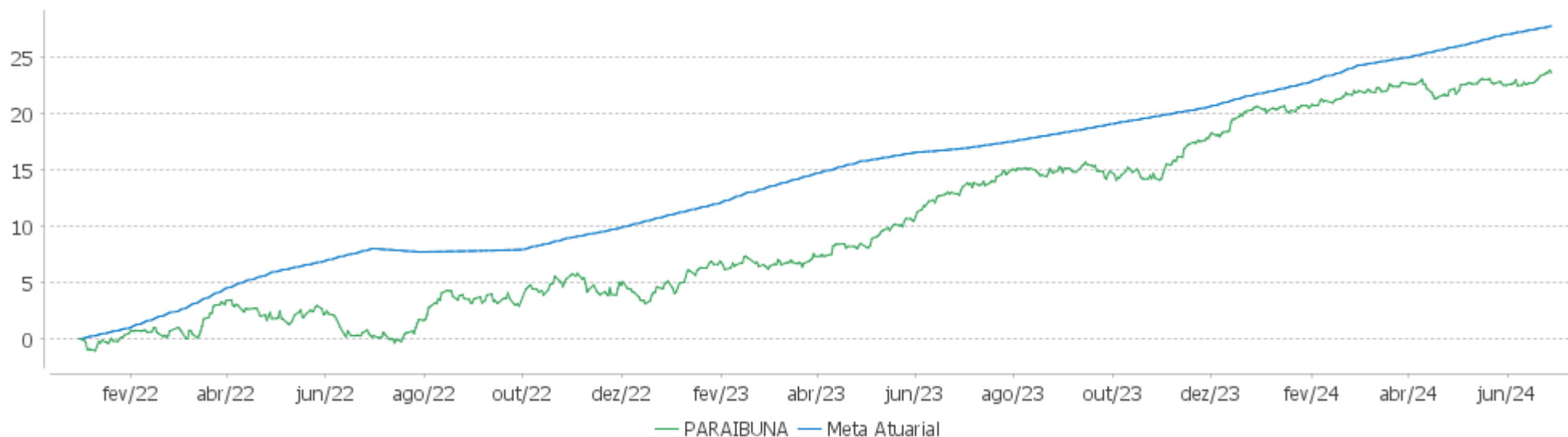
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	13	43,33	03 meses	0,70	2,28	-1,57	2,64
Meses abaixo - Meta Atuarial	17	56,67	06 meses	2,49	4,94	-2,46	2,53
			12 meses	8,96	9,32	-0,36	3,02
			24 meses	23,45	18,28	5,18	3,75
Maior rentabilidade da Carteira	3,37	2023-11	Desde 31/12/2021	23,65	27,70	-4,05	3,95
Menor rentabilidade da Carteira	-1,95	2022-06					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

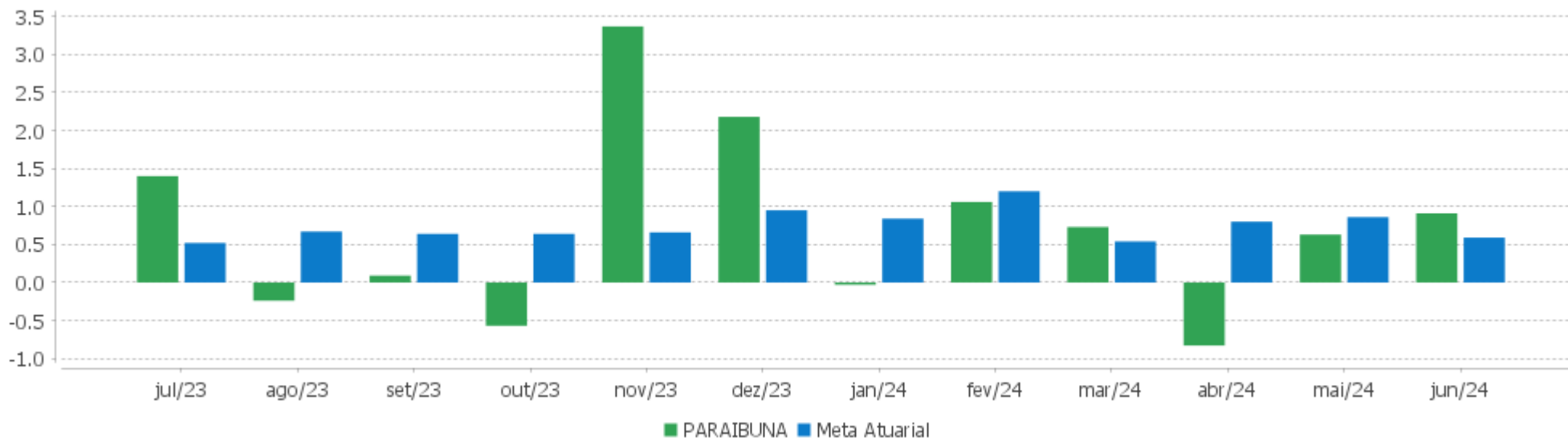


Patrimônio Líquido



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.	0,37 -0,02	3,21 -0,11	1,18 -0,06	3,21 -0,11	8,00 -0,23	18,98 -0,31	30,69 -0,61
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IDKA 2 p.p.	0,26 0,08	3,11 -0,10	1,05 0,09	3,11 -0,10	8,11 -0,26	18,30 -0,13	29,95 -0,45
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,17 -0,04	2,36 -0,12	0,55 -0,50	2,36 -0,12	7,39 3,17	23,06 15,54	27,65 7,35
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,20 0,02	2,96 -0,25	0,86 -0,09	2,96 -0,25	8,08 -0,29	18,05 -0,38	29,46 -0,94
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,37 -0,02	3,20 -0,12	1,18 -0,06	3,20 -0,12	7,97 -0,26	18,82 -0,48	30,38 -0,92
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,38 0,17	3,84 1,35	1,40 0,34	3,84 1,35	9,79 5,56	25,12 17,60	31,72 11,41
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,99 -0,02	-1,23 -0,13	-1,33 -0,06	-1,23 -0,13	2,76 -0,30	16,42 -0,59	20,47 -0,95
FIDC PREMIUM % do CDI	-0,51 -64,53	-0,68 -13,09	0,75 29,54	-0,68 -13,09	-7,59 -64,90	-6,82 -25,43	-62,53 -165,44
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,36 -0,03	3,15 -0,17	1,16 -0,08	3,15 -0,17	7,88 -0,35	18,60 -0,70	29,83 -1,47
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,83 105,90	5,69 108,90	2,69 106,17	5,69 108,90	12,72 108,82	28,36 105,76	40,37 106,82
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,98 -0,01	-1,28 -0,18	-1,34 -0,07	-1,28 -0,18	2,67 -0,39	16,26 -0,75	20,42 -1,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,79 100,10	5,24 100,37	2,53 99,91	5,24 100,37	11,71 100,14	26,83 100,06	38,23 101,15
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,71 90,20	4,71 90,16	2,27 89,82	4,71 90,16	10,59 90,55	24,34 90,76	33,64 89,02
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES % do CDI	0,71 89,74	4,70 90,00	2,27 89,81	4,70 90,00	10,59 90,59	23,51 87,67	32,30 85,47
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA Var. IPCA p.p.	-0,20 -0,41	1,81 -0,68	0,27 -0,78	1,81 -0,68	7,18 2,95	22,58 15,06	28,41 8,10
BRADESCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,90 -0,09	-7,95 -4,54	-4,99 -5,41	-7,95 -4,54	3,14 -8,95	21,06 -10,91	5,52 -21,04
BRADESCO F I A SELECTION	-0,13	-13,33	-10,63	-13,33	-7,64	10,00	-18,58

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-1,61	-5,67	-7,35	-5,67	-12,57	-15,74	-16,29
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,09 -0,90	-5,85 -2,44	-7,70 -8,12	-5,85 -2,44	0,15 -11,94	28,15 -3,82	4,26 -22,30
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	1,90 0,41	-11,11 -3,45	-3,95 -0,67	-11,11 -3,45	0,53 -4,40	13,12 -12,62	-7,05 -4,76
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,09 -1,39	-12,64 -4,98	-9,61 -6,33	-12,64 -4,98	-9,60 -14,53	6,31 -19,43	-28,47 -26,18
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	1,53 0,05	-12,65 -4,99	-6,02 -2,75	-12,65 -4,99	-0,46 -5,38	5,66 -20,08	-29,27 -26,99
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	1,00 -0,48	-9,38 -1,72	-6,70 -3,42	-9,38 -1,72	-1,76 -6,69	13,42 -12,32	-18,27 -15,99
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,13 -0,35	-7,60 0,06	-3,48 -0,20	-7,60 0,06	3,60 -1,33	13,77 -11,97	-5,18 -2,90
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	12,73 -0,06	39,52 -1,55	21,34 -0,40	39,52 -1,55	52,18 -2,61	72,57 -4,56	50,01 -5,70
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA Var. IBOVESPA p.p.	9,77 8,29	30,18 37,84	14,26 17,54	30,18 37,84	42,38 37,45	57,22 31,48	41,18 43,47
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	0,00 0,40	1,90 36,38	0,13 5,04	1,90 36,38	8,57 73,31	23,52 87,71	26,39 69,83
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	3,90 -5,83	16,70 -14,75	5,01 -10,61	16,70 -14,75	29,37 -12,16	66,02 12,93	56,49 15,29
ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI % do CDI	0,85 108,33	5,16 98,78	2,54 100,49	5,16 98,78	11,62 99,41	26,82 100,02	38,43 101,69
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP % do CDI	-0,74 -93,85	-0,89 -17,01	-1,94 -76,85	-0,89 -17,01	6,09 52,08	21,55 80,36	25,89 68,50
ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI Var. S&P 500 p.p.	3,96 -5,77	16,75 -14,70	5,07 -10,56	16,75 -14,70	29,39 -12,14	66,04 12,95	56,41 15,21
PARAIBUNA Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,91 0,32	2,49 -2,46	0,70 -1,57	2,49 -2,46	8,96 -0,35	23,45 5,14	
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15

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 GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	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 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
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
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 ALOCAÇÃO 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 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 ALOCAÇÃO 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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	D+1 du	D+0	D+23 du	D+25 du		1,50
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, 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	0,63	4,51	2,00	4,51	10,95	26,28	35,36	38,12	46,42
IRF-M 1+	-0,72	0,22	-1,14	0,22	6,61	26,65	25,36	23,98	38,61
IRF-M TOTAL	-0,29	1,51	-0,17	1,51	7,89	25,94	28,16	28,34	40,94
IMA-B 5	0,39	3,32	1,24	3,32	8,23	19,30	31,30	39,26	51,54
IMA-B 5+	-2,25	-5,04	-3,58	-5,04	-1,43	14,67	12,20	21,76	24,16
IMA-B TOTAL	-0,97	-1,10	-1,27	-1,10	3,07	17,01	21,42	30,44	36,89
IMA-GERAL TOTAL	0,05	2,42	0,77	2,42	8,23	23,40	29,99	34,60	43,37
IDKA 2	0,18	3,21	0,95	3,21	8,37	18,43	30,40	39,61	51,85
IDKA 20	-5,03	-12,09	-7,87	-12,09	-8,64	12,55	-2,74	9,26	4,14
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28	30,35	22,72
IBRX 100	1,51	-7,20	-3,03	-7,20	5,59	24,17	-4,44	30,28	24,20
IBRX 50	1,63	-6,12	-2,15	-6,12	7,39	26,37	-2,31	34,31	25,00
SMALL CAP	-0,39	-14,85	-11,23	-14,85	-11,96	5,47	-36,29	-11,04	-6,45
Índice Consumo - ICON	0,69	-14,03	-7,46	-14,03	-15,14	-8,69	-50,90	-42,61	-34,58
Índice Dividendos - IDIV	1,99	-3,41	0,42	-3,41	12,09	31,97	26,56	56,67	56,43

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	9,73	31,45	15,63	31,45	41,53	53,09	41,20	78,79	169,26

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,04	1,08	-1,78	1,08	6,09	19,73	21,51	19,28	27,46

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,28	26,67	13,94	26,67	35,48	42,62	23,79	55,10	122,26

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,21	2,48	1,05	2,48	4,23	7,52	20,30	30,35	33,12
INPC	0,25	2,68	1,08	2,68	3,70	6,81	19,54	30,56	33,63
IGPM	0,81	1,10	2,03	1,10	2,45	-4,57	5,64	43,41	53,90
SELIC	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,52	4,48	2,05	4,48	8,35	16,22	35,24	52,37	61,87
IPCA + 5,00%	0,60	4,97	2,29	4,97	9,38	18,45	39,16	58,28	69,77
IPCA + 5,50%	0,64	5,22	2,42	5,22	9,89	19,57	41,15	61,30	73,84
IPCA + 5,89%	0,67	5,41	2,51	5,41	10,29	20,45	42,71	63,69	77,07
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15	64,37	77,99
INPC + 4,00%	0,56	4,68	2,08	4,68	7,80	15,45	34,38	52,62	62,48
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24	64,64	78,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
560	03/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.824,06	1.352,25832200	2,8279064280
541	04/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	119,41	42,21062200	2,8289088280
545	04/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	10.860,75	4.353,39105200	2,4947790000
547	04/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	966,71	0,00	387,49324000	2,4947790000
546	05/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	147,78	59,21484400	2,4956600000
552	05/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	4.629,74	1.855,11643200	2,4956600000
558	05/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	72.339,19	25.561,99561804	2,8299508020
567	07/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	893,20	315,40366100	2,8319265470
553	10/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	199.582,89	0,00	79.887,47948605	2,4983000000
556	10/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	139.074,04	55.667,46810200	2,4983000000
570	10/06/2024	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	500.000,00	257.702,07074700	1,9402250000
551	12/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	5.429,43	2.171,71852600	2,5000610000
544	17/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	24.768,50	9.896,68497000	2,5027070000
561	19/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	774.069,86	0,00	272.566,78344100	2,8399273390
557	20/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	19.919,22	0,00	7.011,54024800	2,8409192980
565	21/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	610.593,08	0,00	189.766,62226300	3,2175999800
566	21/06/2024	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	0,00	2.231.525,37	865.258,67893400	2,5790268530
554	24/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	258,79	103,22189300	2,5071220000
559	24/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	525.023,44	184.676,84041908	2,8429305960
543	25/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	55,00	21,92955700	2,5080070000
548	25/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.231.525,37	0,00	693.012,79690300	3,2200348680
562	25/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	55,00	21,92955600	2,5080070000
555	26/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	55.023,44	19.340,60054000	2,8449706040
564	26/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.610,00	565,91094400	2,8449706040
568	26/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	1.896,08	755,74395900	2,5088920000
550	27/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	157.296,27	55.270,14707293	2,8459535270
542	28/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	121.168,03	48.261,42399900	2,5106600000
549	28/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	45.385,28	15.941,68598500	2,8469560900

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
563	28/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.335,02	1.522,68593647	2,8469560900
569	28/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	16.800,98	6.691,85789000	2,5106600000
Total			3.836.657,13	3.922.518,80		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.295.697,64

Value-At-Risk: 1,22%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,54	0,68		0,39	-0,35	0,26	79.112.167,32	74,24
Artigo 8º	12,39	6,17		0,64	0,04	1,31	12.547.518,07	11,77
Artigo 9º	15,45	6,51		0,03	0,69	11,46	4.584.776,44	4,30
Artigo 10º	2,96	2,03		0,15	0,22	1,44	10.323.531,50	9,69
PARAIBUNA		1,22		1,22			106.567.993,33	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,68%

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	1,00	0,42	0,06	0,42	-0,41	0,38	20.995.551,54	19,70
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,99	2,16	0,03	0,01	-0,44	-0,99	1.788.429,91	1,68
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,72	0,91	0,01	0,01	-0,24	0,37	1.216.215,33	1,14
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,95	0,99	0,01	0,16	-0,27	0,26	1.061.709,94	1,00
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,07	1,10	0,11	0,24	-0,29	0,20	15.412.212,71	14,46
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,71	0,91	0,04	0,01	-0,24	0,37	5.698.511,73	5,35
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,85	0,72	0,07	0,72	-0,33	0,17	13.820.977,17	12,97
Sub-total	1,61	0,73	0,32		-0,34	0,24	59.993.608,33	56,30

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,01	0,01	0,00	0,01	-5,87	0,71	129.525,70	0,12
BB PREV RF IMA-B	3,99	2,16	0,02	0,02	-0,44	-0,98	1.737.198,97	1,63
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,04	0,02	0,00	0,02	0,02	0,79	2.845.828,95	2,67
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,04	-0,00	0,04	0,98	0,83	5.572.306,21	5,23
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	2,60	1,06	0,03	1,06	-0,38	-0,20	3.350.362,67	3,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	1,77	0,91	0,02	0,02	-0,24	0,36	3.616.750,35	3,39
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	0,01	0,00	0,00	-119,43	0,71	1.475.527,37	1,38
Sub-total	1,29	0,55	0,07		-0,36	0,33	18.727.500,22	17,57

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC PREMIUM	1,81	0,00	-0,00	0,01	-0,72	-0,51	391.058,77	0,37
Sub-total	1,81	0,00	-0,00		-0,72	-0,51	391.058,77	0,37

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,17%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	14,54	6,61	0,06	3,93	0,02	1,09	1.199.108,27	1,13
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	13,34	6,45	0,04	1,76	0,06	1,53	806.685,73	0,76
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	10,61	NaN	0,00	NaN	0,10	1,90	0,00	0,00
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	11,30	6,03	0,13	1,12	0,03	1,13	2.819.130,95	2,65
BRADESCO F I A SELECTION	15,33	7,72	0,06	3,26	-0,06	-0,13	1.000.932,02	0,94
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	11,53	5,58	0,17	2,48	0,10	1,90	3.943.822,92	3,70
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	14,11	7,03	0,11	2,72	0,01	1,00	1.982.551,99	1,86
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	17,11	8,57	0,05	4,84	-0,04	0,09	795.286,19	0,75
Sub-total	12,39	6,17	0,64		0,04	1,31	12.547.518,07	11,77

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,03%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6,22	4,79	0,05	4,84	0,50	3,90	1.870.252,54	1,75
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP	3,91	1,21	0,02	1,21	-0,20	0,00	2.630.039,36	2,47
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE	6,97	2,24	0,03	2,24	-0,22	-0,74	1.803.935,70	1,69

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MULTIMERCADO LP								
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	6,20	4,86	0,05	4,84	0,51	3,96	1.869.566,22	1,75
ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI	0,15	0,07	0,00	0,07	0,44	0,85	2.149.737,68	2,02
Sub-total	2,96	2,03	0,15		0,22	1,44	10.323.531,50	9,69

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,51%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	13,26	7,06	0,04	9,41	0,68	9,77	1.934.767,67	1,82
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,32	6,46	-0,00	0,94	0,69	12,73	2.650.008,77	2,49
Sub-total	15,45	6,51	0,03		0,69	11,46	4.584.776,44	4,30

(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 (%)