



LDB
EMPRESAS

PARAIBUNA
MAIO 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 31.05.2024.

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 72,64%

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	0,80	0,08	0,72	3,44	20.915.457,54	19,79	6.634.026.168,29	0,32
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,87	0,24	1,31	-0,24	1.806.225,86	1,71	4.952.904.793,10	0,04
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,74	0,10	1,03	2,82	1.211.685,38	1,15	5.119.005.015,74	0,02
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,68	0,10	1,05	2,85	1.059.000,34	1,00	5.636.977.789,94	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,68	0,12	1,03	2,75	15.382.192,91	14,55	4.696.964.699,86	0,33
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,73	0,10	1,03	2,83	5.677.371,39	5,37	7.617.915.472,63	0,07
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,46	0,11	0,70	2,19	14.298.339,25	13,53	5.032.963.943,31	0,28
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,31	0,11	0,85	2,74	60.350.272,67	57,10		

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	0,07	0,03	0,75	3,97	199.314,89	0,19	4.168.595.178,55	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	3,89	0,24	1,29	-0,30	1.754.407,97	1,66	895.169.054,72	0,20
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11	0,04	0,88	4,81	5.526.171,27	5,23	11.765.933.444,23	0,05
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	1,91	0,15	0,86	2,02	3.357.212,76	3,18	732.663.879,16	0,46
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	1,74	0,10	1,03	2,78	3.603.862,97	3,41	859.846.340,10	0,42
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,06	0,04	0,75	3,96	1.588.777,88	1,50	1.036.556.809,11	0,15
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,24	0,10	0,94	3,08	16.029.747,74	15,17		

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	5,45	-0,29	-0,29	-0,18	393.058,36	0,37	81.898.860,94	0,48
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea a	5,45	-0,29	-0,29	-0,18	393.058,36	0,37		
		Renda Fixa	1,28	0,10	0,87	2,80	76.773.078,77	72,64		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

13,84%

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	14,90	-1,36	-2,78	-6,87	1.186.135,95	1,12	693.988.875,88	0,17
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	14,61	-0,50	-3,43	-13,97	794.491,73	0,75	697.387.504,79	0,11
BB	BB	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	13,97	-0,32	-2,90	-12,76	2.233.002,31	2,11	1.102.566.729,67	0,20
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	14,14	-0,11	-2,30	-8,63	2.787.566,25	2,64	720.297.340,35	0,39
BRAM	BEM	BRADERSCO F I A SELECTION	14,94	-0,91	-4,06	-13,22	1.002.217,41	0,95	367.214.275,19	0,27
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FIA DIVIDENDOS	13,67	-0,58	-3,74	-9,67	3.870.284,25	3,66	489.323.342,99	0,79
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	14,43	-0,63	-2,74	-10,28	1.962.944,80	1,86	563.082.096,98	0,35
ITAU	ITAU	ITAU SMALL CAP VALUATION FIC FIA	18,22	-0,68	-2,11	-12,72	794.554,45	0,75	331.311.154,59	0,24
Sub-total Artigo 8º I			13,97	-0,55	-3,04	-10,49	14.631.197,15	13,84		
Renda Variável			13,97	-0,55	-3,04	-10,49	14.631.197,15	13,84		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,89%

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	13,61	-1,14	6,26	18,59	1.762.548,52	1,67	1.482.610.552,39	0,12
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	13,53	-0,46	6,78	23,76	2.350.706,36	2,22	2.462.872.316,84	0,10
Sub-total Artigo 9º III			13,32	-0,75	6,56	21,49	4.113.254,88	3,89		
Investimentos no Exterior			13,32	-0,75	6,56	21,49	4.113.254,88	3,89		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,63%

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	11,35	0,16	5,07	12,32	1.800.043,16	1,70	1.884.343.751,95	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,05	0,13	0,50	1,90	2.629.956,13	2,49	1.356.398.338,59	0,19
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	3,80	0,17	0,10	-0,15	1.817.381,96	1,72	208.664.300,67	0,87
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	11,33	0,16	5,06	12,30	1.798.292,33	1,70	1.417.555.977,45	0,13
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI	0,28	0,04	0,83	4,27	2.131.533,76	2,02	107.315.154,82	1,99
Sub-total Artigo 10º I			4,57	0,13	2,06	5,47	10.177.207,34	9,63		
Investimentos Estruturados			4,57	0,13	2,06	5,47	10.177.207,34	9,63		
Total			3,09	-0,02	0,63	1,56	105.694.738,14	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	60.350.272,67	57,10	0,00	27,53	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	16.029.747,74	15,17	0,00	14,60	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	393.058,36	0,37	0,00	0,43	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	76.773.078,77	72,64					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	14.631.197,15	13,84	0,00	2,44	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	14.631.197,15	13,84					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	4.113.254,88	3,89	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	4.113.254,88	3,89					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	10.177.207,34	9,63	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	10.177.207,34	9,63					15,00
Total		105.694.738,14	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	0,85 102,55	2,74 62,40	1,43 55,52	4,04 75,73	9,69 80,73	507.505,57	1.596.713,17
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,94 112,95	3,08 70,02	1,72 66,68	4,53 84,91	10,31 85,84	151.654,01	470.166,64
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,29 -34,27	-0,18 -3,99	0,76 29,55	-0,66 -12,38	-7,58 -63,15	-1.125,64	-691,02
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-3,04 -0,01	-10,49 -1,48	-7,21 -1,84	-5,19 -1,08	7,33 -5,37	-459.500,41	-1.713.864,85
Artigo 9º III % do CDI	6,56 786,71	21,49 488,60	9,20 357,07	24,87 466,27	33,87 282,12	253.070,70	727.575,71
Artigo 10º I % do CDI	2,06 247,64	5,47 124,37	2,17 84,10	8,29 155,35	17,64 146,91	205.775,88	527.817,82
PARAIBUNA (Total)						657.380,11	1.607.717,47

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	20.157.800,30	610.593,08	0,00	0,00	20.915.457,54	147.064,16	636.395,34
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	1.782.949,53	0,00	0,00	0,00	1.806.225,86	23.276,33	-4.392,15
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1.199.372,41	0,00	0,00	0,00	1.211.685,38	12.312,97	33.196,24
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1.048.000,58	0,00	0,00	0,00	1.059.000,34	10.999,76	29.347,80
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.225.883,57	0,00	0,00	0,00	15.382.192,91	156.309,34	412.389,65
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.619.618,94	0,00	0,00	0,00	5.677.371,39	57.752,45	156.112,80
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	14.198.548,69	0,00	0,00	0,00	14.298.339,25	99.790,56	333.663,49
	59.232.174,02	610.593,08	0,00	0,00	60.350.272,67	507.505,57	

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	343.474,07	861.777,85	-1.009.498,29	0,00	199.314,89	3.561,26	22.063,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B	1.731.998,78	0,00	0,00	0,00	1.754.407,97	22.409,19	-5.294,84
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	5.477.945,96	0,00	0,00	0,00	5.526.171,27	48.225,31	253.649,16
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINAMICA	3.328.538,29	0,00	0,00	0,00	3.357.212,76	28.674,47	66.335,44
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	3.567.270,70	0,00	0,00	0,00	3.603.862,97	36.592,27	97.526,33
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	1.644.770,41	122.629,38	-190.813,42	0,00	1.588.777,88	12.191,51	35.887,17
	16.093.998,21	984.407,23	-1.200.311,71	0,00	16.029.747,74	151.654,01	

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	394.184,00	0,00	0,00	0,00	393.058,36	-1.125,64	-691,02
	394.184,00	0,00	0,00	0,00	393.058,36	-1.125,64	

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	1.220.094,67	0,00	0,00	0,00	1.186.135,95	-33.958,72	-87.432,67
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	822.715,08	0,00	0,00	0,00	794.491,73	-28.223,35	-128.976,39
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	2.299.690,30	0,00	0,00	0,00	2.233.002,31	-66.687,99	-326.608,33
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	2.853.142,54	0,00	0,00	0,00	2.787.566,25	-65.576,29	-263.407,91
BRADESCO F I A SELECTION	1.044.598,87	0,00	0,00	0,00	1.002.217,41	-42.381,46	-152.660,74
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	4.020.600,28	0,00	0,00	0,00	3.870.284,25	-150.316,03	-414.093,40
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	2.018.176,73	0,00	0,00	0,00	1.962.944,80	-55.231,93	-224.846,63
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	811.679,09	0,00	0,00	0,00	794.554,45	-17.124,64	-115.838,78
	15.090.697,56	0,00	0,00	0,00	14.631.197,15	-459.500,41	

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	1.658.698,03	0,00	0,00	0,00	1.762.548,52	103.850,49	276.293,30
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2.201.486,15	0,00	0,00	0,00	2.350.706,36	149.220,21	451.282,41
	3.860.184,18	0,00	0,00	0,00	4.113.254,88	253.070,70	

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	1.713.228,87	0,00	0,00	0,00	1.800.043,16	86.814,29	197.399,07
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	2.616.878,14	0,00	0,00	0,00	2.629.956,13	13.077,99	48.945,41
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	1.815.657,01	0,00	0,00	0,00	1.817.381,96	1.724,95	-2.714,08
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	1.711.621,24	0,00	0,00	0,00	1.798.292,33	86.671,09	196.952,59
ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI	2.114.046,20	0,00	0,00	0,00	2.131.533,76	17.487,56	87.234,83
	9.971.431,46	0,00	0,00	0,00	10.177.207,34	205.775,88	

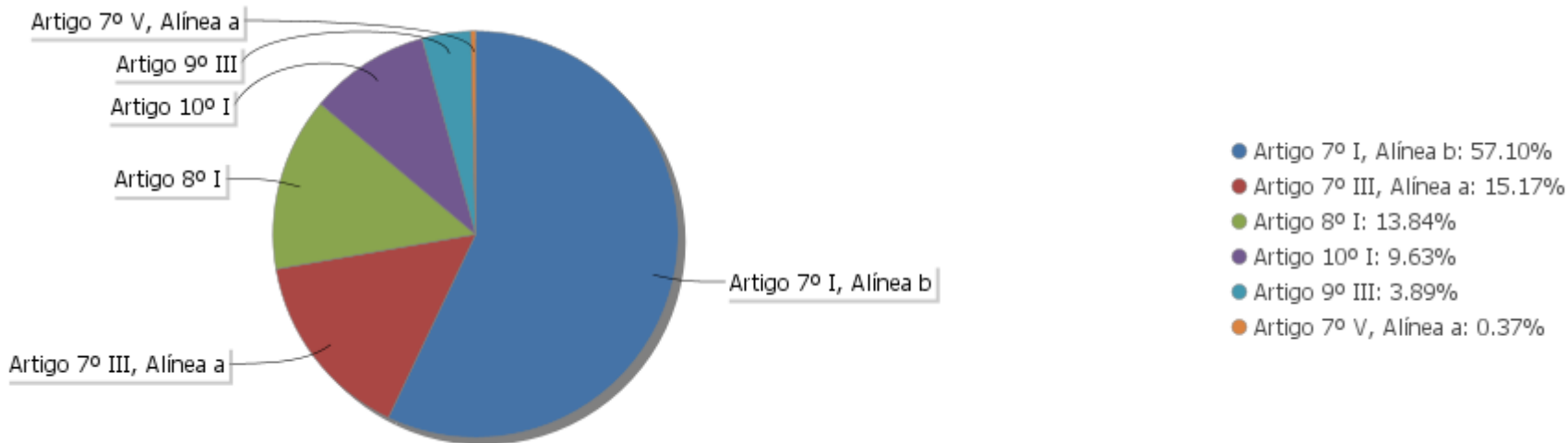
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

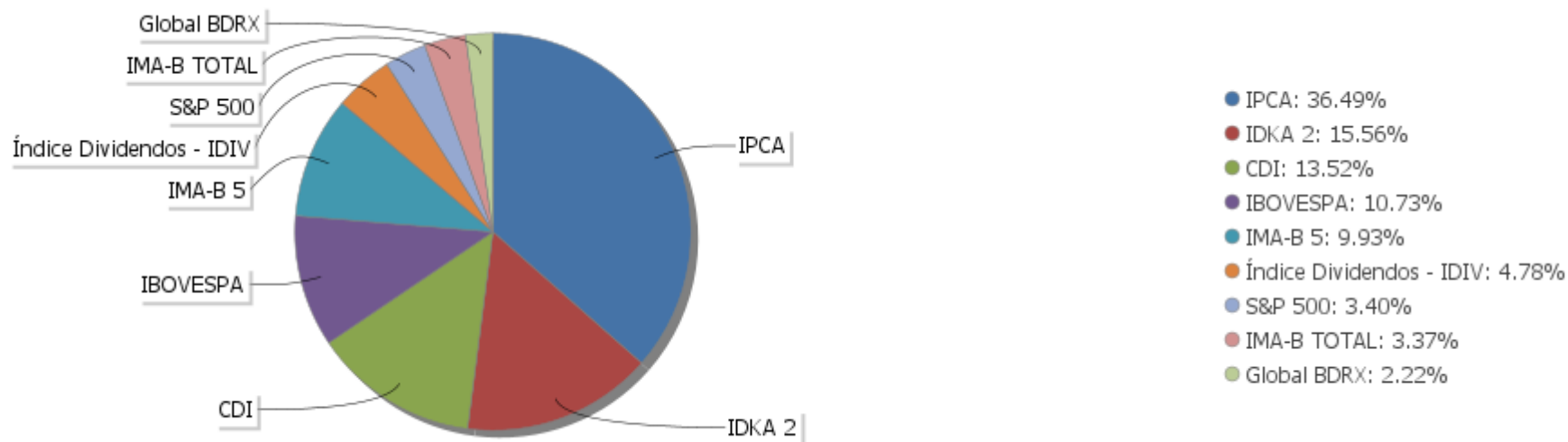
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	100.944.227,09	95,51		100.944.227,09	95,51	
de 31 dias a 365 dias	4.750.511,05	4,49		105.694.738,14	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00		105.694.738,14	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

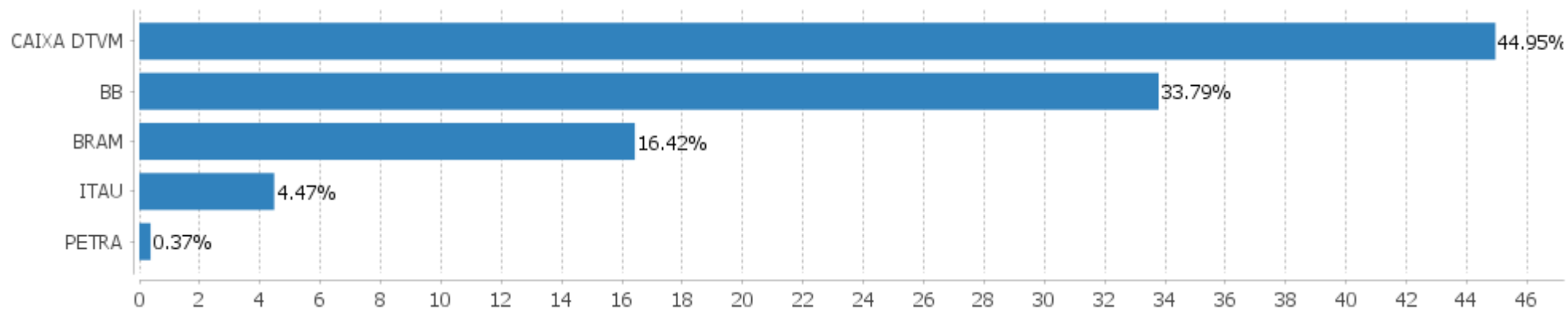


Alocação Por Estratégia



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								1,56
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54	0,80	0,86								4,32
p.p. indexador	-0,87	-0,14	0,19	-1,64	-0,23								-2,77
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

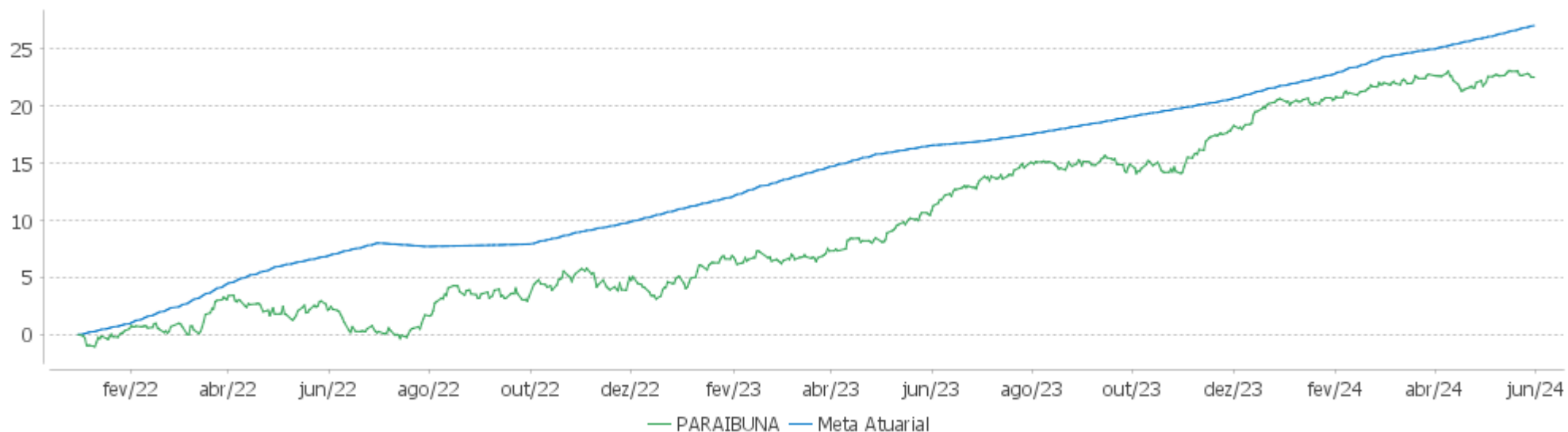
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	12	41,38	03 meses	0,52	2,23	-1,70	2,63
Meses abaixo - Meta Atuarial	17	58,62	06 meses	3,77	5,31	-1,54	2,61
			12 meses	10,94	9,03	1,91	3,09
			24 meses	19,96	18,83	1,13	3,84
Maior rentabilidade da Carteira	3,37	2023-11	Desde 31/12/2021	22,53	26,94	-4,41	3,99
Menor rentabilidade da Carteira	-1,95	2022-06					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

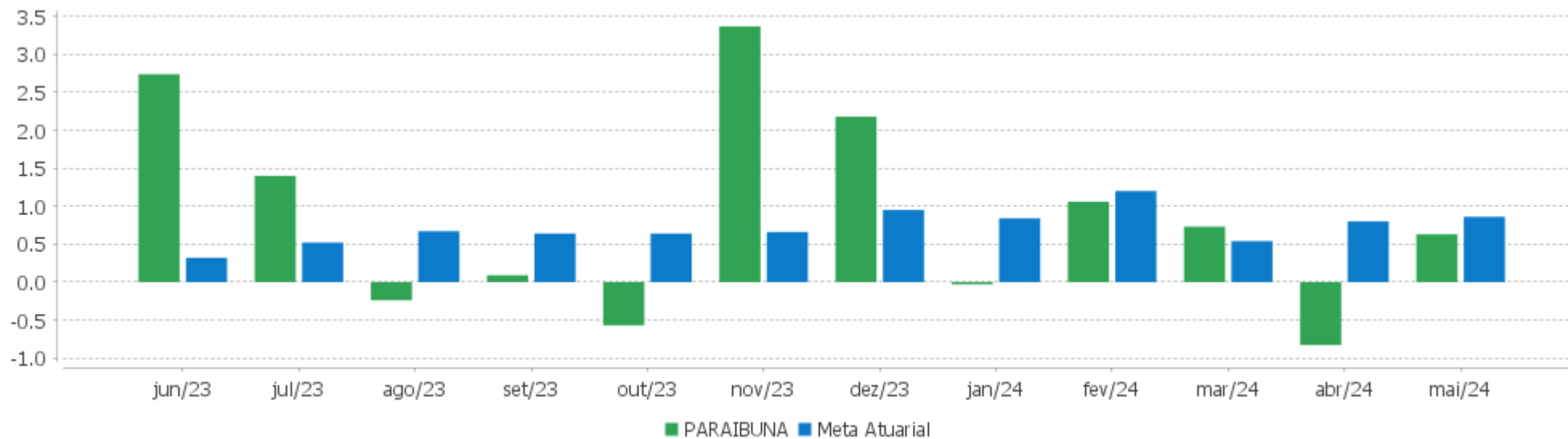


Patrimônio Líquido



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.	1,03 -0,02	2,83 -0,09	1,56 -0,06	4,31 -0,12	8,70 -0,23	18,94 -0,29	30,01 -0,61
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IDKA 2 p.p.	1,05 -0,02	2,85 -0,18	1,67 -0,10	4,31 -0,22	8,93 -0,30	18,31 -0,46	29,50 -0,26
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,70 0,24	2,19 -0,08	0,96 -0,04	3,42 0,58	9,47 5,54	23,13 15,12	27,43 6,74
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	2,82 -0,10	1,56 -0,06	4,30 -0,12	8,68 -0,26	18,75 -0,48	29,66 -0,96
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,03 -0,04	2,75 -0,27	1,56 -0,21	4,20 -0,33	8,99 -0,24	18,09 -0,69	28,84 -0,91
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,72 0,26	3,44 1,17	1,78 0,78	4,42 1,58	11,34 7,41	25,22 17,21	31,28 10,59
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,31 -0,02	-0,24 -0,11	-0,29 -0,06	2,49 -0,12	6,25 -0,31	17,16 -0,56	22,13 -1,00
FIDC PREMIUM % do CDI	-0,29 -34,27	-0,18 -3,99	0,76 29,55	-0,66 -12,38	-7,58 -63,15	-6,90 -25,45	-62,40 -168,04
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	2,78 -0,14	1,54 -0,08	4,26 -0,16	8,60 -0,34	18,50 -0,73	29,18 -1,43
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,88 105,64	4,81 109,38	2,76 107,27	5,79 108,62	13,05 108,74	28,67 105,80	39,70 106,91
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,29 -0,04	-0,30 -0,17	-0,32 -0,09	2,44 -0,18	6,16 -0,40	16,93 -0,79	22,10 -1,03
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,75 89,44	3,97 90,22	2,32 89,93	4,82 90,39	10,90 90,80	24,61 90,82	33,00 88,86
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES % do CDI	0,75 89,86	3,96 90,12	2,32 89,96	4,81 90,17	10,90 90,79	23,72 87,52	31,68 85,32
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA Var. IPCA p.p.	0,86 0,40	2,02 -0,25	0,97 -0,03	3,60 0,76	9,56 5,63	23,23 15,21	29,09 8,41
BRADESCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-3,74 -2,75	-9,67 -4,37	-7,12 -4,39	-4,69 -5,93	9,99 -9,57	7,89 -10,65	3,15 -18,25
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-4,06 -1,02	-13,22 -4,21	-11,05 -5,68	-7,79 -3,68	-0,11 -12,82	-2,17 -11,82	-16,77 -13,50
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	-2,78	-6,87	-7,56	0,72	9,44	13,03	1,99

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.	-1,79	-1,57	-4,83	-0,53	-10,12	-5,51	-19,41
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-2,90 0,14	-12,76 -3,75	-7,23 -1,86	-8,21 -4,10	7,50 -5,20	-3,15 -12,80	-9,50 -6,24
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,11 0,93	-12,72 -3,72	-7,97 -2,61	-6,22 -2,11	-3,70 -16,40	-9,06 -18,71	-27,69 -24,42
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-3,43 -0,39	-13,97 -4,96	-9,72 -4,35	-9,15 -5,04	5,29 -7,41	-8,25 -17,90	-30,52 -27,26
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	-2,74 0,30	-10,28 -1,27	-7,07 -1,70	-5,43 -1,32	5,91 -6,79	0,52 -9,13	-17,74 -14,48
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,30 0,74	-8,63 0,37	-4,82 0,55	-3,12 0,99	10,82 -1,89	-0,56 -10,22	-6,97 -3,70
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	6,78 -0,54	23,76 -1,31	11,38 -0,92	26,96 -1,66	35,62 -2,28	54,35 -3,94	31,48 -6,18
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA Var. IBOVESPA p.p.	6,26 9,30	18,59 27,60	6,42 11,79	22,19 26,30	31,61 18,90	43,37 33,72	25,73 28,99
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	0,50 59,97	1,90 43,12	0,81 31,58	3,75 70,28	10,54 87,75	22,53 83,14	26,18 70,49
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	5,07 -1,15	12,32 -7,47	4,50 -4,42	18,15 -4,56	33,23 3,36	47,36 5,79	54,71 28,95
ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI % do CDI	0,83 99,26	4,27 97,02	2,51 97,28	5,27 98,87	12,17 101,33	26,94 99,42	37,79 101,78
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP % do CDI	0,10 11,40	-0,15 -3,39	-0,70 -27,17	1,38 25,95	8,82 73,43	21,45 79,15	26,83 72,26
ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI Var. S&P 500 p.p.	5,06 -1,15	12,30 -7,49	4,52 -4,41	18,11 -4,60	33,16 3,29	47,27 5,71	54,48 28,72
PARAIBUNA Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,63 -0,23	1,56 -2,77	0,52 -1,70	3,77 -1,54	10,94 1,92	19,96 1,07	
CDI	0,83	4,40	2,58	5,33	12,01	27,10	37,13
IBOVESPA	-3,04	-9,01	-5,37	-4,11	12,70	9,65	-3,26
INPC + 6,00%	0,95	4,91	2,51	5,98	9,49	20,37	42,77
IPCA + 6,00%	0,95	4,76	2,49	5,83	10,11	21,28	43,64

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 PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINAMICA	D+0	D+0	D+3 du	D+4 du		0,40
BRADESCO 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
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FIXA SIMPLES						
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 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	0,78	3,85	2,21	4,80	11,56	26,65	34,79	37,63	46,34
IRF-M 1+	0,60	0,94	-0,00	2,69	10,22	27,67	26,53	26,17	43,40
IRF-M TOTAL	0,66	1,81	0,67	3,32	10,51	26,78	28,81	29,73	44,40
IMA-B 5	1,05	2,92	1,62	4,42	8,94	19,23	30,62	40,27	53,54
IMA-B 5+	1,59	-2,85	-1,91	0,98	4,24	16,02	15,73	28,10	33,44
IMA-B TOTAL	1,33	-0,13	-0,23	2,62	6,56	17,72	23,13	34,41	43,39
IMA-GERAL TOTAL	0,95	2,37	1,25	4,04	10,06	23,87	30,39	35,87	46,18
IDKA 2	1,07	3,03	1,78	4,53	9,23	18,78	29,76	40,74	53,45
IDKA 20	2,01	-7,44	-4,45	-1,34	1,87	15,01	3,51	19,85	17,13
CDI	0,83	4,40	2,58	5,33	12,01	27,10	37,13	40,12	46,96

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,04	-9,01	-5,37	-4,11	12,70	9,65	-3,26	39,70	25,83
IBRX 100	-3,18	-8,57	-5,17	-3,56	13,24	8,19	-5,26	39,86	27,37
IBRX 50	-3,11	-7,63	-4,50	-2,72	14,94	9,84	-3,24	44,50	28,06
SMALL CAP	-3,38	-14,52	-8,96	-8,50	-4,39	-11,41	-35,21	2,20	0,47
Índice Consumo - ICON	-2,26	-14,63	-6,94	-9,52	-7,70	-22,28	-50,93	-37,26	-32,43
Índice Dividendos - IDIV	-0,99	-5,29	-2,73	1,24	19,55	18,54	21,40	67,35	58,14

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	6,22	19,79	8,92	22,70	29,87	41,57	25,76	67,46	155,07

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,02	2,14	0,66	6,48	12,24	19,92	20,09	27,27	32,50

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	5,22	16,99	8,53	20,14	25,00	33,38	10,61	48,94	112,32

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,46	2,27	1,00	2,84	3,93	8,02	20,69	30,41	32,86
INPC	0,46	2,42	1,02	2,99	3,34	7,20	19,96	30,63	33,31
IGPM	0,89	0,28	0,73	1,02	-0,34	-4,79	5,42	44,47	53,87
SELIC	0,83	4,40	2,58	5,33	12,00	27,10	37,13	40,12	46,96

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,79	3,94	2,00	4,85	8,05	16,78	35,69	52,47	61,52
IPCA + 5,00%	0,87	4,35	2,24	5,34	9,08	19,02	39,63	58,39	69,40
IPCA + 5,50%	0,91	4,55	2,36	5,59	9,60	20,15	41,63	61,42	73,46
IPCA + 5,89%	0,94	4,71	2,46	5,78	10,00	21,03	43,20	63,81	76,67
IPCA + 6,00%	0,95	4,76	2,49	5,83	10,11	21,28	43,64	64,49	77,59
INPC + 4,00%	0,79	4,09	2,02	4,99	7,44	15,90	34,87	52,72	62,06
INPC + 6,00%	0,95	4,91	2,51	5,98	9,49	20,37	42,77	64,76	78,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
516	02/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	39,60	15,99746200	2,4753910000
532	03/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	105,47	37,56046800	2,8080055000
540	03/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	18.080,51	6.438,91545100	2,8080055000
515	06/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	24.919,46	10.059,60347700	2,4771810000
525	06/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	1.391,40	561,68627400	2,4771810000
531	06/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	827,70	294,65729100	2,8090260270
524	08/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	4.985,94	2.011,29422800	2,4789710000
530	08/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	893,20	317,74955700	2,8110188700
514	09/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	2.191,89	883,87446900	2,4798680000
539	09/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	48.217,92	17.147,06710300	2,8120214210
538	13/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	47.116,39	16.743,42122900	2,8140240490
513	14/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.629,38	0,00	1.059,16914900	2,4824930000
523	14/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	4.833,76	1.947,13933700	2,4824930000
537	15/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	26.168,73	0,00	9.292,84836000	2,8160074270
512	17/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	420,00	169,00572400	2,4851200000
522	17/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	280,00	112,67061300	2,4851200000
526	17/05/2024	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	610.593,08	0,00	439.205,63040100	1,3902214310
536	17/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	835.609,12	0,00	296.527,96347400	2,8179774690
529	20/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	980,00	347,64414100	2,8189745910
511	22/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	150,00	60,29519800	2,4877520000
520	22/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	125,00	50,24616200	2,4877520000
521	22/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	9.202,16	3.698,98609600	2,4877520000
510	24/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	120.000,00	0,00	48.202,31475500	2,4895070000
519	24/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	3.403,43	1.367,11002100	2,4895070000
535	24/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	711.718,12	252.125,87268500	2,8228682460
509	27/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	55,00	22,08484400	2,4903860000
518	27/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	55,00	22,08491800	2,4903860000
528	28/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.724,50	964,46020800	2,8248962230

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
534	28/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	169.127,89	59.870,47900100	2,8248962230
508	29/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	120.098,87	48.191,00396000	2,4921430000
517	29/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	18.621,65	7.472,14353800	2,4921430000
527	29/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.957,65	2.462,11169400	2,8258872320
533	29/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.748,94	972,77059400	2,8258872320
507	31/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	40,26	16,14905500	2,4930230000
Total			1.595.000,31	1.200.311,71		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.265.481,40

Value-At-Risk: 1,20%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,93	0,47		0,24	0,04	0,87	76.773.078,77	72,64
Artigo 8º	10,31	5,93		0,75	-0,38	-3,04	14.631.197,15	13,84
Artigo 9º	8,91	6,04		0,05	0,64	6,56	4.113.254,88	3,89
Artigo 10º	3,91	2,09		0,15	0,31	2,06	10.177.207,34	9,63
PARAIBUNA		1,20		1,20			105.694.738,14	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,47%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,74	0,34	0,04	0,35	-0,15	0,72	20.915.457,54	19,79
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,70	1,18	0,01	0,02	0,17	1,31	1.806.225,86	1,71
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,15	0,55	0,00	0,01	0,17	1,03	1.211.685,38	1,15
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,23	0,63	0,00	0,11	0,18	1,05	1.059.000,34	1,00
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,39	0,64	0,06	0,12	0,14	1,03	15.382.192,91	14,55
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,15	0,57	0,02	0,00	0,17	1,03	5.677.371,39	5,37
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,96	0,63	0,06	0,63	-0,14	0,70	14.298.339,25	13,53
Sub-total	0,95	0,49	0,20		0,02	0,85	60.350.272,67	57,10

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	-6,27	0,75	199.314,89	0,19
BB PREV RF IMA-B	2,70	1,20	0,01	0,03	0,17	1,29	1.754.407,97	1,66
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,07	-0,00	0,07	0,65	0,88	5.526.171,27	5,23
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	1,66	0,76	0,02	0,76	0,02	0,86	3.357.212,76	3,18
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	1,15	0,57	0,01	0,01	0,17	1,03	3.603.862,97	3,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,01	0,01	0,00	0,00	-12,94	0,75	1.588.777,88	1,50
Sub-total	0,85	0,40	0,04		0,13	0,94	16.029.747,74	15,17

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC PREMIUM	0,99	0,01	-0,00	0,01	-1,13	-0,29	393.058,36	0,37
Sub-total	0,99	0,01	-0,00		-1,13	-0,29	393.058,36	0,37

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,93%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	15,16	6,54	0,06	4,26	-0,24	-2,78	1.186.135,95	1,12
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	10,11	6,43	0,04	1,72	-0,42	-3,43	794.491,73	0,75
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	8,68	5,67	0,11	1,63	-0,43	-2,90	2.233.002,31	2,11
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	9,08	6,09	0,14	1,01	-0,34	-2,30	2.787.566,25	2,64
BRADESCO F I A SELECTION	12,90	6,77	0,06	2,77	-0,38	-4,06	1.002.217,41	0,95
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	10,09	5,80	0,18	2,74	-0,45	-3,74	3.870.284,25	3,66
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	11,86	6,36	0,11	2,49	-0,30	-2,74	1.962.944,80	1,86
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	14,49	7,70	0,05	4,40	-0,20	-2,11	794.554,45	0,75
Sub-total	10,31	5,93	0,75		-0,38	-3,04	14.631.197,15	13,84

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,09%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	8,53	5,13	0,05	3,87	0,50	5,07	1.800.043,16	1,70
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP	2,64	1,08	0,02	1,08	-0,13	0,50	2.629.956,13	2,49
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	4,71	1,97	0,03	1,97	-0,16	0,10	1.817.381,96	1,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	8,52	5,13	0,05	3,87	0,50	5,06	1.798.292,33	1,70
ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI	0,13	0,08	0,00	0,08	-0,05	0,83	2.131.533,76	2,02
Sub-total	3,91	2,09	0,15		0,31	2,06	10.177.207,34	9,63

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,04%

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	9,45	7,01	0,04	9,19	0,57	6,26	1.762.548,52	1,67
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	9,51	5,64	0,01	0,82	0,63	6,78	2.350.706,36	2,22
Sub-total	8,91	6,04	0,05		0,64	6,56	4.113.254,88	3,89

(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 (%)