



**LDB**  
EMPRESAS

**PARAIBUNA**  
SETEMBRO 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 30.09.2024.

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 80,71%

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	0,65	0,02	0,71	6,65	21.565.220,34	19,42	6.153.638.080,30	0,35
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,93	-0,25	-0,69	0,60	1.821.396,71	1,64	4.321.577.868,21	0,04
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,77	-0,08	0,38	5,06	1.238.132,69	1,12	4.696.596.123,48	0,03
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,81	-0,08	0,48	5,06	1.081.756,03	0,97	4.976.909.586,20	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,90	-0,09	0,40	4,73	15.677.857,91	14,12	4.168.680.215,13	0,38
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,76	-0,08	0,38	5,14	5.804.855,62	5,23	6.913.810.528,18	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,34	-0,01	0,52	4,59	14.122.348,31	12,72	4.436.237.468,68	0,32
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,32</b>	<b>-0,04</b>	<b>0,50</b>	<b>5,25</b>	<b>61.311.567,61</b>	<b>55,22</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,04	0,04	0,75	7,19	1.007.947,13	0,91	3.861.447.255,05	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	3,93	-0,25	-0,70	0,47	1.767.989,49	1,59	744.394.081,32	0,24
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,05	0,04	0,84	2,93	6.814.955,55	6,14	20.065.228.623,01	0,03
BRASESCO	BRASESCO	BRASESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,10	0,04	0,88	8,67	9.871.809,33	8,89	14.753.446.791,76	0,07
BRAM	BRASESCO	BRASESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	2,07	-0,06	0,31	4,03	3.423.628,40	3,08	635.919.188,76	0,54
BRAM	BRASESCO	BRASESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	1,78	-0,08	0,38	5,05	3.683.357,87	3,32	721.455.054,23	0,51
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,04	0,04	0,75	7,17	1.340.157,52	1,21	1.178.841.947,20	0,11
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>1,13</b>	<b>-0,00</b>	<b>0,62</b>	<b>6,07</b>	<b>27.909.845,29</b>	<b>25,14</b>		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PETRA	FINAXIS	FIDC PREMIUM	5,43	-0,40	-0,40	-1,96	386.041,05	0,35	28.932.663,18	1,33
		<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>	<b>5,43</b>	<b>-0,40</b>	<b>-0,40</b>	<b>-1,96</b>	<b>386.041,05</b>	<b>0,35</b>		
		Renda Fixa	1,25	-0,03	0,53	5,42	89.607.453,95	80,71		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL

5,46%

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	14,61	-0,33	-1,88	0,54	1.280.481,31	1,15	810.531.909,31	0,16
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	13,16	-0,81	-1,73	-6,42	864.190,44	0,78	707.744.441,02	0,12
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	14,00	-0,67	-2,32	-7,65	1.066.527,12	0,96	315.351.858,83	0,34
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	13,69	-0,58	-4,06	-6,56	2.044.373,03	1,84	529.758.123,01	0,39
ITAU	ITAU	ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	18,10	-0,64	-4,21	-11,44	806.246,91	0,73	305.357.202,75	0,26
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>12,98</b>	<b>-0,58</b>	<b>-3,00</b>	<b>-5,30</b>	<b>6.061.818,81</b>	<b>5,46</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>12,98</b>	<b>-0,58</b>	<b>-3,00</b>	<b>-5,30</b>	<b>6.061.818,81</b>	<b>5,46</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,17%

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	15,47	0,57	0,17	31,57	1.955.463,88	1,76	1.573.122.577,07	0,12
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	15,68	0,53	-0,32	40,56	2.669.843,85	2,40	2.640.148.103,06	0,10
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>15,32</b>	<b>0,55</b>	<b>-0,12</b>	<b>36,61</b>	<b>4.625.307,73</b>	<b>4,17</b>		
Investimentos no Exterior			15,32	0,55	-0,12	36,61	4.625.307,73	4,17		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,66%

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	12,47	0,39	2,33	24,07	1.988.382,13	1,79	2.032.300.517,82	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,10	-0,05	0,09	4,73	2.703.040,15	2,43	1.212.000.877,97	0,22
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	4,69	-0,10	-0,49	1,36	1.844.832,94	1,66	187.345.272,63	0,98
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	12,45	0,39	2,35	24,15	1.988.049,45	1,79	1.402.848.275,13	0,14
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI	0,19	0,04	0,85	7,89	2.205.582,65	1,99	98.154.127,22	2,25
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>5,06</b>	<b>0,12</b>	<b>0,97</b>	<b>11,20</b>	<b>10.729.887,32</b>	<b>9,66</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>5,06</b>	<b>0,12</b>	<b>0,97</b>	<b>11,20</b>	<b>10.729.887,32</b>	<b>9,66</b>		
<b>Total</b>			<b>2,75</b>	<b>-0,02</b>	<b>0,35</b>	<b>5,22</b>	<b>111.024.467,81</b>	<b>100,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	61.311.567,61	55,22	0,00	27,53	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	27.909.845,29	25,14	0,00	14,60	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	386.041,05	0,35	0,00	0,43	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>89.607.453,95</b>	<b>80,71</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	6.061.818,81	5,46	0,00	2,44	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>6.061.818,81</b>	<b>5,46</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	4.625.307,73	4,17	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>4.625.307,73</b>	<b>4,17</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	10.729.887,32	9,66	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>10.729.887,32</b>	<b>9,66</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>111.024.467,81</b>	<b>100,00</b>					



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades por Artigo**

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,50 60,19	5,25 65,76	2,20 83,48	3,15 60,30	8,36 75,63	306.304,65	3.058.008,11
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,62 74,25	6,07 76,01	2,57 97,57	3,98 76,14	9,57 86,60	171.563,28	1.138.813,34
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,40 -47,60	-1,96 -24,50	-1,28 -48,76	-0,55 -10,43	-7,51 -67,90	-1.539,07	-7.708,33
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-3,00 0,08	-5,30 -3,53	4,43 -1,95	-1,55 -4,45	7,10 -5,98	-187.196,89	-1.093.039,30
Artigo 9º III % do CDI	-0,12 -13,84	36,61 458,23	0,88 33,59	19,29 368,99	47,04 425,48	-5.345,68	1.239.628,56
Artigo 10º I % do CDI	0,97 115,94	11,20 140,14	3,94 149,57	5,99 114,63	19,01 171,94	102.790,70	1.080.497,80
<b>PARAIBUNA (Total)</b>						<b>386.576,99</b>	<b>5.416.200,18</b>

**RESULTADO POR ATIVO**

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	21.413.865,43	0,00	0,00	0,00	21.565.220,34	151.354,91	1.286.158,14
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	1.833.972,61	0,00	0,00	0,00	1.821.396,71	-12.575,90	10.778,70
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1.233.450,38	0,00	0,00	0,00	1.238.132,69	4.682,31	59.643,55
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1.076.615,08	0,00	0,00	0,00	1.081.756,03	5.140,95	52.103,49
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.615.930,75	0,00	0,00	0,00	15.677.857,91	61.927,16	708.054,65
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.782.772,73	0,00	0,00	0,00	5.804.855,62	22.082,89	283.597,03
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	14.048.655,98	0,00	0,00	0,00	14.122.348,31	73.692,33	657.672,55
	61.005.262,96	0,00	0,00	0,00	61.311.567,61	306.304,65	

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	1.215.870,11	770.154,64	-987.820,17	0,00	1.007.947,13	9.742,55	48.751,48

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B	1.780.413,32	0,00	0,00	0,00	1.767.989,49	-12.423,83	8.286,68
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	6.151.358,17	610.593,08	0,00	0,00	6.814.955,55	53.004,30	141.057,86
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	9.785.210,32	0,00	0,00	0,00	9.871.809,33	86.599,01	550.659,97
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	3.413.049,79	0,00	0,00	0,00	3.423.628,40	10.578,61	132.751,08
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	3.669.519,18	0,00	0,00	0,00	3.683.357,87	13.838,69	177.021,23
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	1.366.519,16	139.001,46	-175.587,05	0,00	1.340.157,52	10.223,95	80.285,04
	27.381.940,05	1.519.749,18	-1.163.407,22	0,00	27.909.845,29	171.563,28	

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	387.580,12	0,00	0,00	0,00	386.041,05	-1.539,07	-7.708,33
	387.580,12	0,00	0,00	0,00	386.041,05	-1.539,07	

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	1.304.999,71	0,00	0,00	0,00	1.280.481,31	-24.518,40	6.912,69
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	879.446,46	0,00	0,00	0,00	864.190,44	-15.256,02	-59.277,68
BRADESCO F I A SELECTION	1.091.908,57	0,00	0,00	0,00	1.066.527,12	-25.381,45	-88.351,03
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	2.130.981,50	0,00	0,00	0,00	2.044.373,03	-86.608,47	-143.418,40
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	841.679,46	0,00	0,00	0,00	806.246,91	-35.432,55	-104.146,32
	6.249.015,70	0,00	0,00	0,00	6.061.818,81	-187.196,89	

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	1.952.121,56	0,00	0,00	0,00	1.955.463,88	3.342,32	469.208,66
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2.678.531,85	0,00	0,00	0,00	2.669.843,85	-8.688,00	770.419,90
	4.630.653,41	0,00	0,00	0,00	4.625.307,73	-5.345,68	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.943.131,07	0,00	0,00	0,00	1.988.382,13	45.251,06	385.738,04
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	2.700.671,22	0,00	0,00	0,00	2.703.040,15	2.368,93	122.029,43
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	1.853.895,76	0,00	0,00	0,00	1.844.832,94	-9.062,82	24.736,90
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	1.942.456,14	0,00	0,00	0,00	1.988.049,45	45.593,31	386.709,71
ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI	2.186.942,43	0,00	0,00	0,00	2.205.582,65	18.640,22	161.283,72
	10.627.096,62	0,00	0,00	0,00	10.729.887,32	102.790,70	

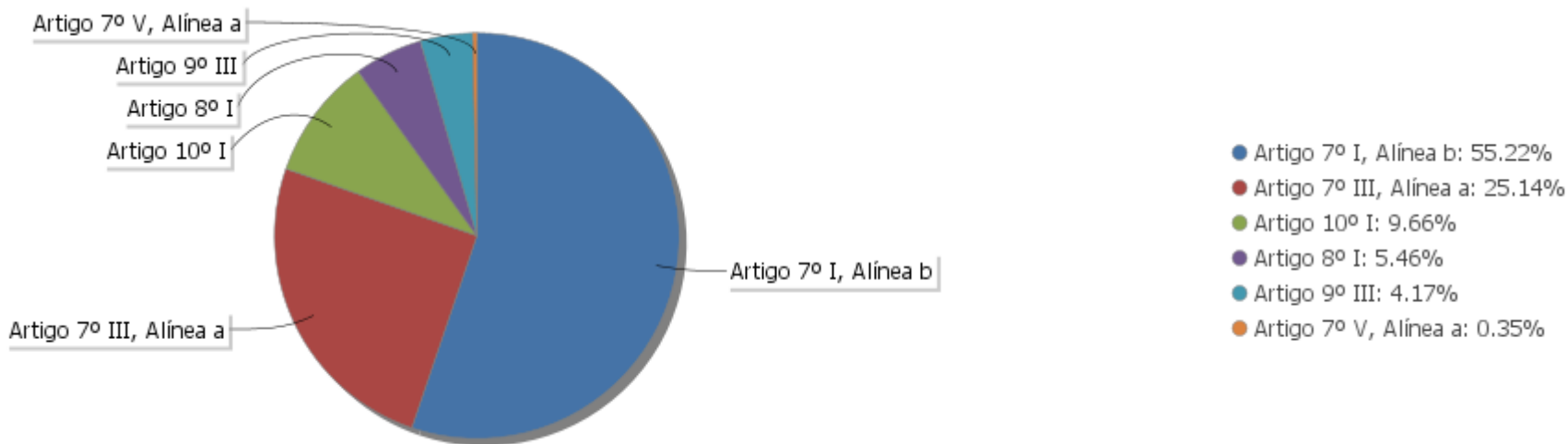
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

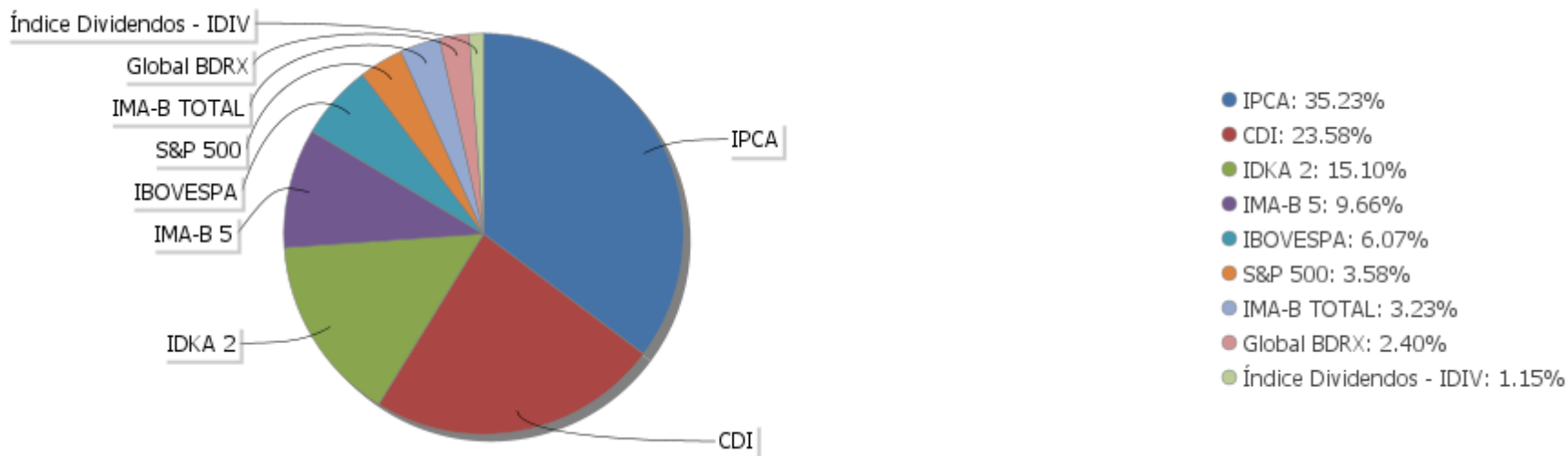
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	108.980.094,78	98,16		108.980.094,78	98,16	
de 31 dias a 365 dias	2.044.373,03	1,84		111.024.467,81	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00		111.024.467,81	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

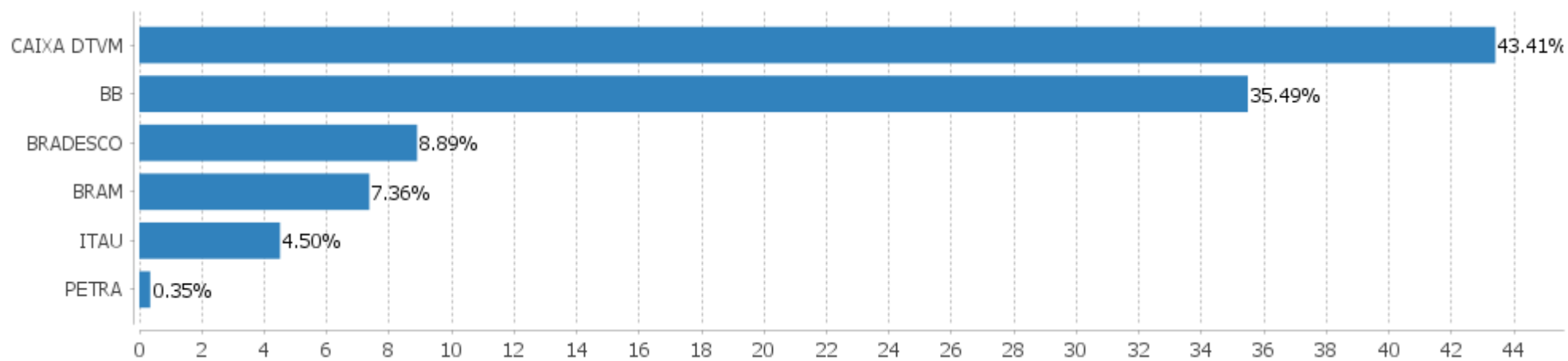


Alocação Por Estratégia



## 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	1,22	1,08	0,35				5,22
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54	0,80	0,86	0,59	0,82	0,40	0,84				7,13
p.p. indexador	-0,87	-0,14	0,19	-1,64	-0,23	0,32	0,40	0,67	-0,50				-1,91
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**

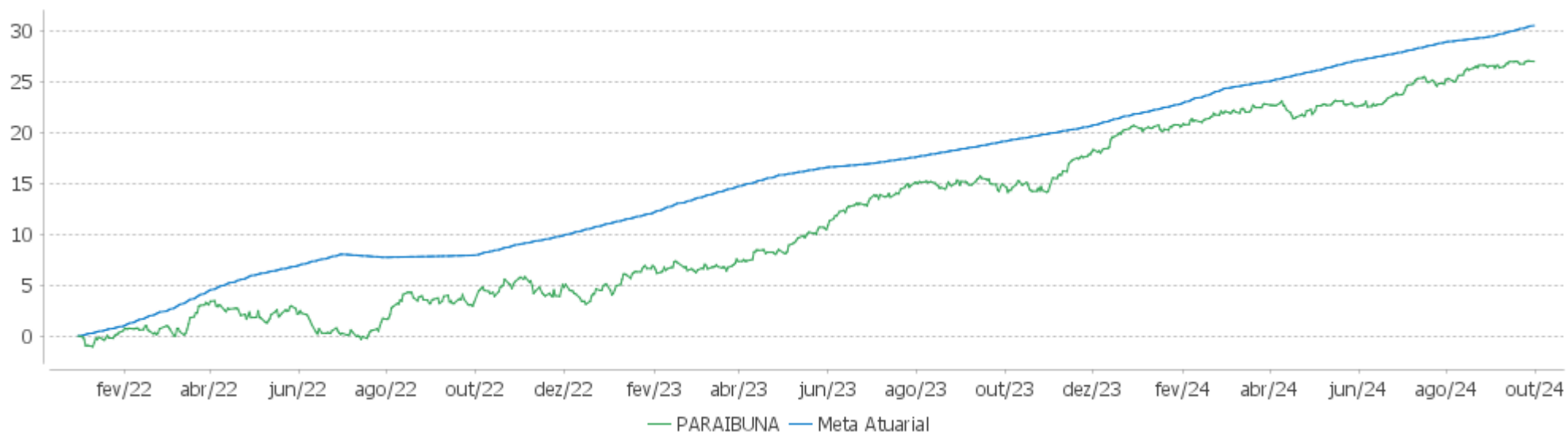
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	15	45,45	03 meses	2,67	2,08	0,59	2,08
Meses abaixo - Meta Atuarial	18	54,55	06 meses	3,39	4,41	-1,01	2,37
			12 meses	10,50	9,57	0,93	2,75
			24 meses	22,90	20,88	2,02	3,45
Desde 31/12/2021				26,95	30,36	-3,40	3,81

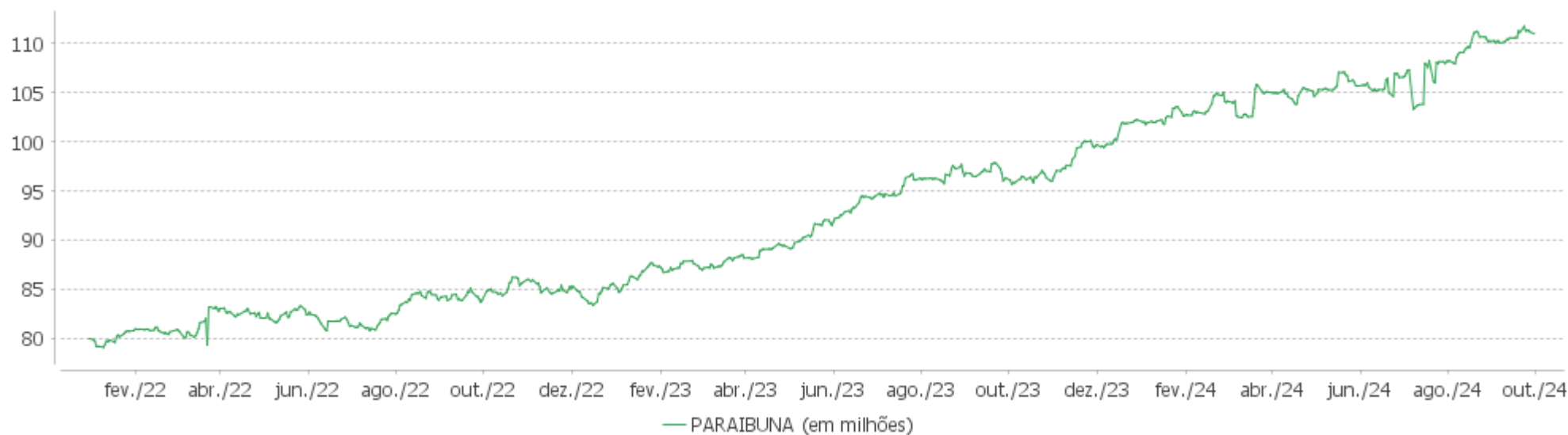
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,37	2023-11
Menor rentabilidade da Carteira	-1,95	2022-06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



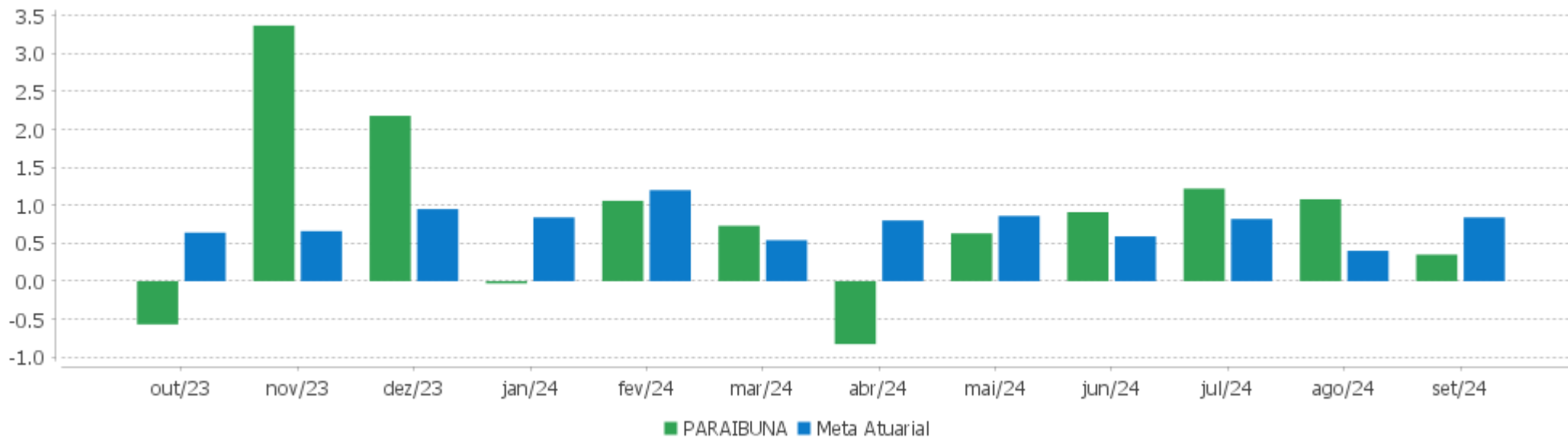
Patrimônio Líquido





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.	0,38 -0,02	5,14 -0,17	1,87 -0,05	3,07 -0,11	8,21 -0,23	20,61 -0,45	31,64 -0,61
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IDKA 2 p.p.	0,48 0,09	5,06 0,05	1,89 0,14	2,95 0,24	8,09 0,04	20,22 -0,17	30,71 -0,42
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,52 0,08	4,59 1,29	2,18 1,38	2,74 0,88	7,65 3,22	21,44 11,61	32,91 15,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,38 -0,02	5,06 -0,24	1,80 -0,12	3,00 -0,18	8,13 -0,30	20,47 -0,59	31,28 -0,97
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,40 0,00	4,73 -0,28	1,72 -0,02	2,60 -0,12	7,72 -0,33	19,96 -0,44	30,11 -1,01
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	6,65 3,35	2,71 1,91	4,15 2,28	9,77 5,34	24,69 14,85	35,92 18,20
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,69 -0,02	0,60 -0,22	1,84 -0,09	0,49 -0,15	5,34 -0,28	16,66 -0,62	24,76 -1,01
FIDC PREMIUM % do CDI	-0,40 -47,60	-1,96 -24,50	-1,28 -48,76	-0,55 -10,43	-7,51 -67,90	-6,60 -25,39	-62,75 -158,03
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,38 -0,03	5,05 -0,25	1,84 -0,08	3,02 -0,16	8,10 -0,33	20,32 -0,74	30,90 -1,36
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,88 106,08	8,67 108,47	2,82 107,20	5,58 106,79	11,94 108,00	27,59 106,19	42,37 106,70
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,70 -0,03	0,47 -0,35	1,77 -0,17	0,40 -0,24	5,19 -0,42	16,51 -0,76	24,58 -1,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,84 100,90	8,11 101,54	2,73 103,75	5,33 101,89	11,17 101,08	26,07 100,35	40,17 101,16
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,75 90,22	7,19 90,04	2,38 90,26	4,70 89,93	9,96 90,07	23,52 90,51	35,60 89,66
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES % do CDI	0,75 89,83	7,17 89,73	2,36 89,66	4,69 89,61	9,94 89,96	22,88 88,05	34,20 86,12
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA Var. IPCA p.p.	0,31 -0,13	4,03 0,73	2,19 1,39	2,47 0,60	7,82 3,40	21,65 11,81	32,35 14,63
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-2,32 0,75	-7,65 -5,88	6,55 0,17	-4,77 -7,67	3,34 -9,74	2,93 -16,86	1,75 -17,03
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	-1,88	0,54	6,79	-1,44	12,01	25,23	21,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,16	-3,71	-1,14	-9,81	-7,47	-11,17	-24,67
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,21 -1,13	-11,44 -9,67	1,38 -5,01	-8,36 -11,26	-1,81 -14,89	-4,86 -24,65	-16,96 -35,73
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-1,73 1,34	-6,42 -4,65	7,13 0,74	0,67 -2,22	6,02 -7,06	2,69 -17,10	-11,53 -30,31
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	-4,06 -0,99	-6,56 -4,79	3,12 -3,27	-3,79 -6,68	3,20 -9,89	4,83 -14,97	-3,61 -22,39
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-0,32 -0,12	40,56 -1,40	0,75 0,12	22,25 -0,25	51,31 -1,67	81,77 -4,63	40,30 -4,59
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,17 3,25	31,57 33,34	1,07 -5,31	15,48 12,58	41,58 28,49	63,92 44,12	30,48 11,70
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	0,09 10,51	4,73 59,17	2,78 105,47	2,91 55,60	9,84 88,99	21,02 80,90	33,16 83,51
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	2,33 4,06	24,07 -11,88	6,32 2,89	11,65 -7,94	40,19 -6,02	81,31 19,37	64,51 30,52
ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI % do CDI	0,85 102,17	7,89 98,74	2,60 98,71	5,21 99,58	11,06 100,00	25,89 99,63	40,14 101,07
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP % do CDI	-0,49 -58,60	1,36 17,01	2,27 86,15	0,28 5,33	6,43 58,18	16,65 64,07	31,19 78,54
ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI Var. S&P 500 p.p.	2,35 4,08	24,15 -11,80	6,34 2,91	11,73 -7,86	40,26 -5,95	81,32 19,38	64,46 30,47
PARAIBUNA Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,35 -0,50	5,22 -1,91	2,67 0,59	3,39 -1,01	10,50 0,93	22,90 2,01	
CDI	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71
IBOVESPA	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78
INPC + 6,00%	0,97	7,93	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78
IPCA + 6,00%	0,93	7,95	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10

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 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 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
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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Indexadores**

**Renda Fixa**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,82	7,18	2,55	4,60	10,28	25,21	37,49	40,92	47,32
IRF-M 1+	0,11	2,50	2,27	1,11	7,67	22,81	31,70	27,56	37,27
IRF-M TOTAL	0,34	3,90	2,36	2,19	8,45	23,17	33,03	31,68	40,32
IMA-B 5	0,40	5,30	1,92	3,18	8,43	21,06	32,25	40,12	50,27
IMA-B 5+	-1,42	-2,62	2,55	-1,13	3,64	14,16	20,09	23,93	21,86
IMA-B TOTAL	-0,67	0,82	1,94	0,64	5,61	17,28	25,78	31,70	34,48
IMA-GERAL TOTAL	0,34	4,99	2,51	3,30	8,98	22,61	33,94	37,26	43,22
IDKA 2	0,39	5,01	1,75	2,72	8,05	20,40	31,12	39,27	50,42
IDKA 20	-3,07	-9,14	3,35	-4,78	0,20	8,96	10,04	12,27	2,29
CDI	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71	43,89	49,01

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78	39,34	25,84
IBRX 100	-2,97	-1,23	6,43	3,20	13,53	19,31	17,72	38,71	26,80
IBRX 50	-3,26	-0,22	6,28	4,00	14,18	20,25	20,95	43,28	28,92
SMALL CAP	-4,41	-13,67	1,39	-9,99	-3,75	-6,59	-23,80	-11,80	-13,37
Índice Consumo - ICON	-4,71	-11,22	3,27	-4,43	-0,29	-18,06	-40,81	-41,80	-42,40
Índice Dividendos - IDIV	-0,72	4,25	7,93	8,38	19,48	36,40	46,24	74,87	57,72

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Investimentos Estruturados**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-1,73	35,95	3,43	19,59	46,21	61,94	33,99	65,50	153,26

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-2,58	-0,16	-1,24	-3,00	2,69	10,54	21,74	18,29	23,16

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-1,59	31,85	4,09	18,60	41,09	55,11	20,24	45,57	114,03

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,44	3,31	0,80	1,86	4,42	9,84	17,71	29,77	33,84
INPC	0,48	3,29	0,60	1,69	4,09	8,78	16,60	29,18	34,20
IGPM	0,62	2,64	1,52	3,58	4,53	-1,71	6,40	32,85	56,68
SELIC	0,83	7,99	2,63	5,23	11,05	25,98	39,71	43,89	49,01

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,77	6,41	1,84	3,93	8,58	18,75	32,35	51,72	62,74
IPCA + 5,00%	0,85	7,18	2,10	4,44	9,62	21,03	36,19	57,62	70,69
IPCA + 5,50%	0,89	7,56	2,22	4,69	10,14	22,18	38,14	60,63	74,78
IPCA + 5,89%	0,92	7,86	2,32	4,89	10,55	23,08	39,67	63,01	78,02
IPCA + 6,00%	0,93	7,95	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10	63,69	78,95
INPC + 4,00%	0,81	6,39	1,64	3,75	8,24	17,60	31,10	51,03	63,17
INPC + 6,00%	0,97	7,93	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78	62,93	79,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
664	03/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	75,44	26,05910200	2,8949577950
672	03/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	22.482,22	7.765,99231900	2,8949577950
663	04/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.200,00	414,36679700	2,8959849320
647	05/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	26.269,60	10.284,14017300	2,5543800000
648	06/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	423,46	165,71952800	2,5552810000
657	10/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	4.265,70	1.668,19050300	2,5570820000
662	10/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.431,99	493,78361000	2,9000355020
656	13/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	5.429,43	2.121,04757800	2,5597870000
671	16/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	19.846,86	0,00	6.834,12357400	2,9040826940
661	17/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	790,00	271,93800900	2,9050738550
655	18/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	147,78	57,67025600	2,5624980000
670	19/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	750.070,47	0,00	258.001,60163000	2,9072318360
646	20/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	3.001,46	0,00	1.170,46649200	2,5643280000
654	20/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	5.283,31	2.060,30971300	2,5643280000
660	20/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	144,25	49,60011200	2,9082595840
653	23/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	1.668,16	650,28987400	2,5652560000
665	23/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	610.593,08	0,00	184.742,81994200	3,3050977580
669	23/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	237,31	0,00	81,56981200	2,9092870750
645	24/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	136.000,00	0,00	52.996,97917200	2,5661840000
652	24/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	256,62	100,00057400	2,5661840000
668	24/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	785.048,00	269.744,24691700	2,9103419590
644	25/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	69,00	26,87848000	2,5671110000
651	25/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	69,00	26,87835700	2,5671110000
659	26/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	665,00	228,32941500	2,9124587420
650	27/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	119,00	46,32209900	2,5689680000
667	27/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	168.190,82	57.728,13384700	2,9134983030
643	30/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	116.662,32	45.395,69930100	2,5698980000
649	30/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	14.923,67	5.807,10593800	2,5698980000



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
658	30/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.638,41	2.277,65744200	2,9145778810
666	30/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.154,04	395,95442200	2,9145778810
<b>Total</b>			<b>1.519.749,18</b>	<b>1.163.407,22</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.074.300,22

Value-At-Risk: 0,97%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,09	0,65		0,33	-0,27	0,53	89.607.453,95	80,71
Artigo 8º	11,59	6,35		0,26	-0,33	-3,00	6.061.818,81	5,46
Artigo 9º	17,80	9,51		0,15	-0,05	-0,12	4.625.307,73	4,17
Artigo 10º	5,29	3,00		0,23	0,03	0,97	10.729.887,32	9,66
PARAIBUNA		0,97		0,97			111.024.467,81	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,65%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,37	0,42	0,05	0,43	-0,34	0,71	21.565.220,34	19,42
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,93	2,00	0,02	0,04	-0,39	-0,69	1.821.396,71	1,64
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,02	1,01	0,01	0,04	-0,22	0,38	1.238.132,69	1,12
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,72	1,12	0,01	0,23	-0,21	0,48	1.081.756,03	0,97
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,94	1,22	0,10	0,25	-0,23	0,40	15.677.857,91	14,12
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,03	1,01	0,03	0,01	-0,22	0,38	5.804.855,62	5,23
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,18	0,66	0,05	0,66	-0,26	0,52	14.122.348,31	12,72
<b>Sub-total</b>	1,25	0,77	0,27		-0,27	0,50	61.311.567,61	55,22

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,01	-0,00	0,01	-4,25	0,75	1.007.947,13	0,91
BB PREV RF IMA-B	3,93	2,03	0,02	0,04	-0,39	-0,70	1.767.989,49	1,59
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,02	0,02	0,00	0,02	0,33	0,84	6.814.955,55	6,14
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,04	0,05	-0,00	0,05	1,20	0,88	9.871.809,33	8,89
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	1,87	1,15	0,02	1,15	-0,28	0,31	3.423.628,40	3,08

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,03	1,05	0,02	0,05	-0,23	0,38	3.683.357,87	3,32
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,01	0,00	-0,00	0,00	-12,17	0,75	1.340.157,52	1,21
<b>Sub-total</b>	0,73	0,40	0,06		-0,29	0,62	27.909.845,29	25,14

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC PREMIUM	1,38	0,10	-0,00	0,10	-0,89	-0,40	386.041,05	0,35
<b>Sub-total</b>	1,38	0,10	-0,00		-0,89	-0,40	386.041,05	0,35

**Investimentos Estruturados**

Value-At-Risk: 3,00%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,63	7,43	0,09	6,12	0,11	2,33	1.988.382,13	1,79
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP	2,58	1,50	0,03	1,50	-0,29	0,09	2.703.040,15	2,43
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	4,68	2,41	0,03	2,41	-0,28	-0,49	1.844.832,94	1,66
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	13,64	7,42	0,09	6,12	0,11	2,35	1.988.049,45	1,79
ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI	0,18	0,08	-0,00	0,08	0,10	0,85	2.205.582,65	1,99
<b>Sub-total</b>	5,29	3,00	0,23		0,03	0,97	10.729.887,32	9,66

**Renda Variável**

Value-At-Risk: 6,35%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	10,81	6,39	0,05	3,75	-0,25	-1,88	1.280.481,31	1,15
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	13,37	6,07	0,03	2,20	-0,19	-1,73	864.190,44	0,78
BRADESCO F I A SELECTION	11,21	6,68	0,04	3,09	-0,28	-2,32	1.066.527,12	0,96
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	12,35	6,34	0,09	2,87	-0,40	-4,06	2.044.373,03	1,84

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	15,61	8,66	0,05	5,32	-0,32	-4,21	806.246,91	0,73
<b>Sub-total</b>	11,59	6,35	0,26		-0,33	-3,00	6.061.818,81	5,46

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,51%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	16,76	10,19	0,08	11,48	-0,04	0,17	1.955.463,88	1,76
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,83	9,23	0,07	1,21	-0,06	-0,32	2.669.843,85	2,40
<b>Sub-total</b>	17,80	9,51	0,15		-0,05	-0,12	4.625.307,73	4,17

(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 (%)