



PATO BRANCO CONSOLIDADO
OUTUBRO 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 31.10.2024.

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

RENTA FIXA	77,83%
------------	--------

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 IRF-M 1+	3,71	0,00	-0,06	2,06	0,00	0,00	186.414.059,41	0,00
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,65	0,04	0,75	7,45	10.845.298,07	6,59	6.119.978.979,94	0,18
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,62	0,02	0,72	5,81	15.703.359,07	9,54	4.542.033.919,19	0,35
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,73	0,16	-1,65	-4,49	2.153.658,29	1,31	1.040.926.627,96	0,21
BB	BB	BB PREV RF IRF M	2,61	-0,04	0,19	3,90	7.561.826,56	4,60	3.147.997.721,72	0,24
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI	2,44	-0,00	0,66	4,59	398.315,56	0,24	1.290.318.483,15	0,03
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,70	0,01	0,81	5,91	216.991,27	0,13	4.919.072.193,80	0,00
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	3,70	0,02	-0,47	0,56	375.524,40	0,23	926.725.723,11	0,04
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,04	0,04	0,93	2,30	17.973.917,14	10,92	30.241.561.842,62	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,61	0,02	0,72	5,89	21.826.622,00	13,26	6.810.595.873,00	0,32
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,68	0,16	-1,65	-4,32	5.275.079,97	3,21	1.114.378.615,42	0,47
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	3,70	0,00	-0,03	2,26	0,00	0,00	829.918.870,45	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,61	-0,04	0,19	3,89	2.557.433,42	1,55	1.440.836.653,46	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,24	0,03	0,86	5,49	7.460.942,26	4,53	4.085.747.193,68	0,18
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,86	0,03	0,46	4,82	92.348.968,01	56,12		

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	0,85	8,10	23.542,33	0,01	4.036.357.184,84	0,00
BRABESCO	BRABESCO	BRABESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,10	0,04	0,93	9,68	10.341.110,86	6,28	15.416.999.740,59	0,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,09	0,04	0,92	9,07	25.355.970,30	15,41	6.312.602.841,59	0,40
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA ATIVA LONGO PRAZO	0,81	0,00	0,89	7,21	0,00	0,00	643.521.816,97	0,00
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,15	0,04	0,92	8,73	35.720.623,49	21,71		
Renda Fixa			1,37	0,03	0,57	5,87	128.069.591,50	77,83		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

4,79%

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 BOLSA AMERICANA FIA	12,16	-1,52	-0,15	22,56	6.252.025,49	3,80	1.483.622.244,40	0,42
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	19,28	-1,55	-0,81	-13,16	758.209,66	0,46	70.924.974,02	1,07
BB	BB	BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	13,22	-0,48	-0,28	-0,28	877.641,58	0,53	833.908.897,61	0,11
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	12,50	0,00	0,88	-5,59	0,00	0,00	0,00	
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	11,98	0,00	-0,48	-2,36	0,00	0,00	291.005.049,09	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	14,06	0,00	-1,53	-9,31	0,00	0,00	175.540.133,66	0,00
Sub-total Artigo 8º I			11,59	-1,41	-0,78	-1,59	7.887.876,73	4,79		
Renda Variável			11,59	-1,41	-0,78	-1,59	7.887.876,73	4,79		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

8,63%

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 ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	15,20	-1,38	5,52	37,78	6.423.751,41	3,90	946.781.944,53	0,68
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIA BDR NÍVEL I	13,56	-1,24	5,82	43,12	2.303.406,97	1,40	200.695.462,52	1,15
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	15,43	-1,25	5,92	48,88	5.472.120,79	3,33	2.836.421.099,25	0,19
Sub-total Artigo 9º III			14,87	-1,31	5,73	43,39	14.199.279,17	8,63		
Investimentos no Exterior			14,87	-1,31	5,73	43,39	14.199.279,17	8,63		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

8,75%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA	12,13	-1,75	-0,39	23,08	2.952.888,18	1,79	934.437.229,61	0,32
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12,09	-1,75	-0,34	23,65	11.446.291,78	6,96	2.064.997.259,47	0,55
Sub-total Artigo 10º I			10,41	-1,75	-0,35	18,80	14.399.179,96	8,75		
Investimentos Estruturados			10,41	-1,75	-0,35	18,80	14.399.179,96	8,75		
Total			2,29	-0,31	0,87	7,85	164.555.927,36	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	75.091,88
Sub-total Disponibilidades Financeiras	75.091,88
Total	164.631.019,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	92.348.968,01	56,12	0,00	64,51	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	35.720.623,49	21,71	0,00	15,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	128.069.591,50	77,83					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	7.887.876,73	4,79	0,00	0,49	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	7.887.876,73	4,79					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	14.199.279,17	8,63	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	14.199.279,17	8,63					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	14.399.179,96	8,75	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	14.399.179,96	8,75					15,00
Total		164.555.927,36	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	Atribuição Desemp. (%)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,46 49,29	4,82 53,60	1,53 57,69	3,66 69,37	8,61 78,46	439.500,66	0,27	4.311.303,61
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,92 99,59	8,73 97,11	2,65 99,87	5,22 99,00	10,83 98,64	276.648,76	0,17	2.958.719,97
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,78 0,81	-1,59 1,74	2,30 0,68	4,82 1,81	15,94 1,30	-44.116,59	-0,03	-53.141,99
Artigo 9º III % do CDI	5,73 617,54	43,39 482,51	6,51 245,32	26,29 498,84	56,53 514,88	766.026,74	0,48	2.401.622,72
Artigo 10º I % do CDI	-0,35 -37,70	18,80 209,11	4,49 169,09	12,97 246,07	30,94 281,80	-43.778,63	-0,03	2.128.728,25
PATO BRANCO CONSOLIDADO (Total)						1.394.280,94	0,87	11.747.232,56

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 IRF-M 1+	3.324.455,30	0,00	-3.322.566,10	0,00	0,00	-1.889,20	66.928,24
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	10.764.749,40	0,00	0,00	0,00	10.845.298,07	80.548,67	750.806,32
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	15.591.558,35	0,00	0,00	0,00	15.703.359,07	111.800,72	861.966,26
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	2.189.825,69	0,00	0,00	0,00	2.153.658,29	-36.167,40	-101.138,65
BB PREV RF IRF M	7.547.660,13	0,00	0,00	0,00	7.561.826,56	14.166,43	284.385,85
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI	395.697,86	0,00	0,00	0,00	398.315,56	2.617,70	17.683,50
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	215.268,96	0,00	-18,59	0,00	216.991,27	1.740,90	571.847,24
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	377.290,66	0,00	0,00	0,00	375.524,40	-1.766,26	2.408,21
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	14.510.707,43	6.816.224,30	-3.487.353,33	0,00	17.973.917,14	134.338,74	309.162,47
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.671.163,68	0,00	0,00	0,00	21.826.622,00	155.458,32	1.212.385,84
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.363.848,65	0,00	0,00	0,00	5.275.079,97	-88.768,68	-237.986,29
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	2.966.259,95	0,00	-2.965.415,03	0,00	0,00	-844,92	65.650,80
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.552.637,61	0,00	0,00	0,00	2.557.433,42	4.795,81	96.377,30
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	7.397.472,43	0,00	0,00	0,00	7.460.942,26	63.469,83	387.449,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	94.868.596,10	6.816.224,30	-9.775.353,05	0,00	92.348.968,01	439.500,66	

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	20.579,01	49.882,54	-47.278,78	0,00	23.542,33	359,56	326.340,20
BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	3.082.747,57	7.224.958,44	0,00	0,00	10.341.110,86	33.404,85	219.399,14
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	25.125.191,67	0,00	0,00	0,00	25.355.970,30	230.778,63	2.108.839,87
FIC FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA ATIVA LONGO PRAZO	1.357.438,34	0,00	-1.369.544,06	0,00	0,00	12.105,72	294.850,19
	29.585.956,59	7.274.840,98	-1.416.822,84	0,00	35.720.623,49	276.648,76	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	5.932.128,88	329.468,46	0,00	0,00	6.252.025,49	-9.571,85	543.000,50
BB AÇÕES CONSUMO FIC	764.405,03	0,00	0,00	0,00	758.209,66	-6.195,37	-114.928,02
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	0,00	880.088,93	0,00	0,00	877.641,58	-2.447,35	-2.447,35
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	872.383,75	0,00	-880.088,93	0,00	0,00	7.705,18	-52.134,50
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	1.058.377,05	0,00	-1.053.304,35	0,00	0,00	-5.072,70	-25.477,52
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	1.865.229,50	0,00	-1.836.695,00	0,00	0,00	-28.534,50	-188.584,99
	10.492.524,21	1.209.557,39	-3.770.088,28	0,00	7.887.876,73	-44.116,59	

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	5.760.521,28	329.468,46	0,00	0,00	6.423.751,41	333.761,67	980.053,87
BRADESCO INSTITUCIONAL FIA BDR NÍVEL I	1.846.672,15	329.468,46	0,00	0,00	2.303.406,97	127.266,36	257.061,14
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4.837.653,64	329.468,44	0,00	0,00	5.472.120,79	304.998,71	1.164.507,71
	12.444.847,07	988.405,36	0,00	0,00	14.199.279,17	766.026,74	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA	2.631.618,43	329.468,46	0,00	0,00	2.952.888,18	-8.198,71	267.116,36
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11.152.403,24	329.468,46	0,00	0,00	11.446.291,78	-35.579,92	1.745.556,37
	13.784.021,67	658.936,92	0,00	0,00	14.399.179,96	-43.778,63	

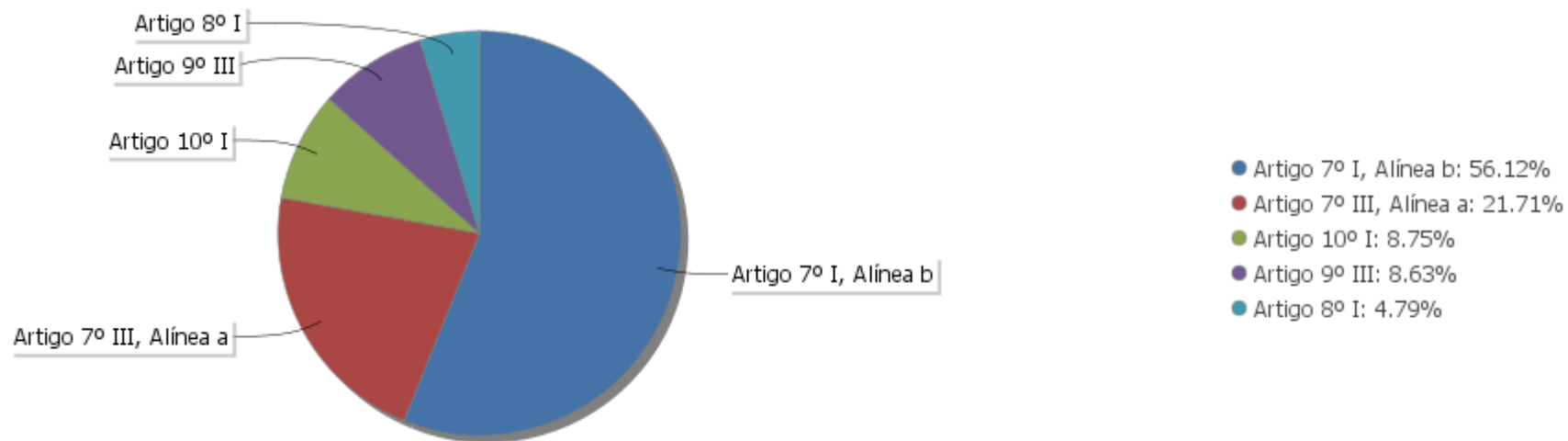
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

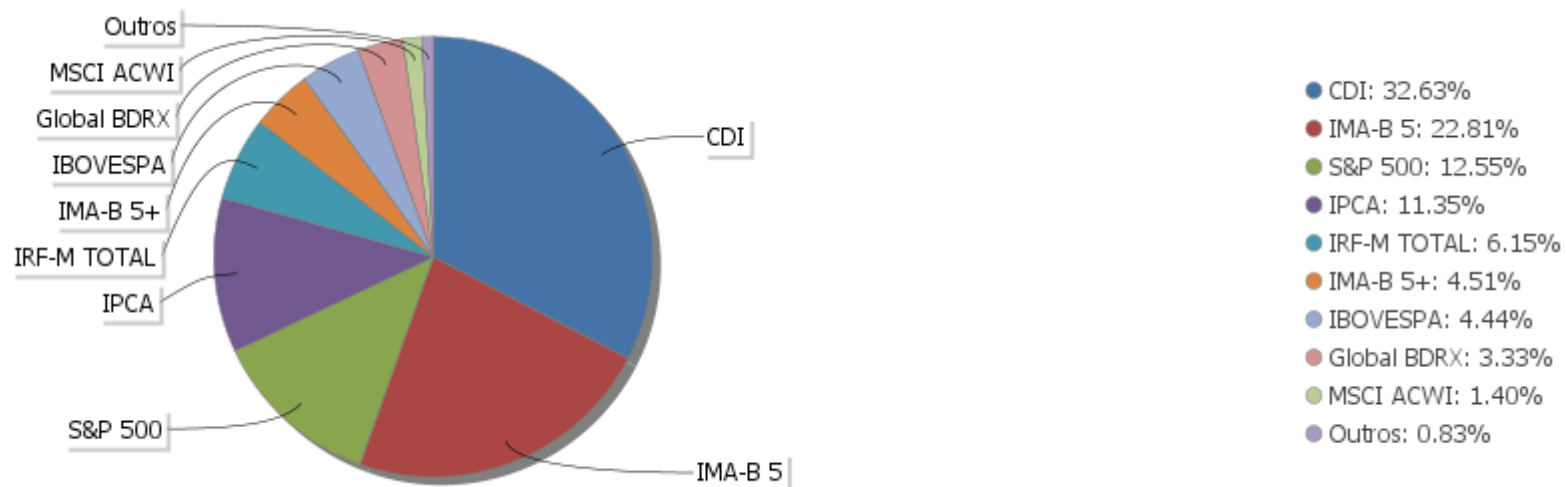
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	163.782.087,40	99,53	64,00	163.782.087,40	99,53	64,00
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	1,00	163.782.087,40	99,53	65,00
acima de 365 dias	773.839,96	0,47	35,00	164.555.927,36	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

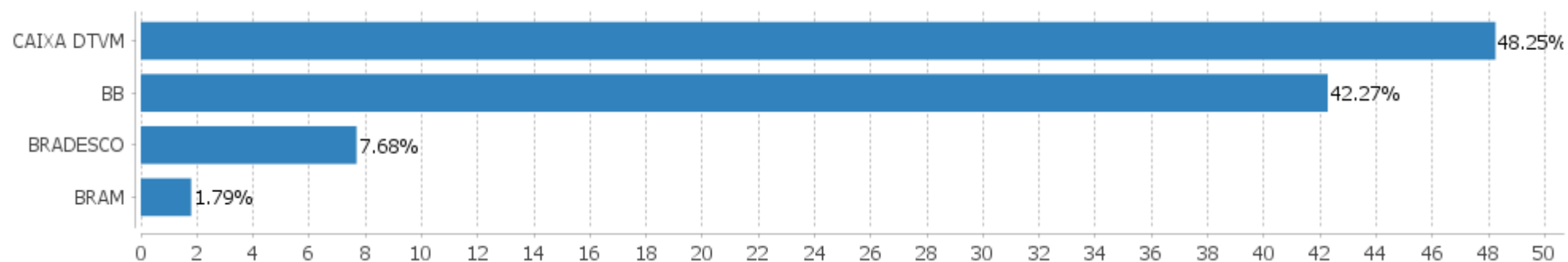


Alocação Por Estratégia



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	0,44	0,96	0,80	-0,56	1,19	1,05	1,12	1,18	0,54	0,87			7,85
IPCA + 5,08%	0,86	1,21	0,55	0,82	0,88	0,60	0,84	0,41	0,86	1,02			8,33
p.p. indexador	-0,42	-0,25	0,25	-1,37	0,32	0,44	0,29	0,77	-0,32	-0,14			-0,48
2023	1,67	0,15	1,31	1,08	1,45	2,00	1,20	0,32	0,09	-0,15	2,58	1,77	14,29
IPCA + 4,94%	0,95	1,19	1,15	0,96	0,65	0,32	0,52	0,67	0,64	0,64	0,66	0,95	9,73
p.p. indexador	0,71	-1,04	0,15	0,13	0,79	1,68	0,68	-0,35	-0,56	-0,79	1,92	0,83	4,56
2022	0,03	0,32	2,29	-0,93	0,93	-1,28	1,54	0,83	-0,11	2,36	-0,24	0,13	5,96
IPCA + 4,92%	0,94	1,38	2,05	1,43	0,89	1,07	-0,28	0,08	0,11	0,97	0,79	1,04	10,97
p.p. indexador	-0,92	-1,06	0,25	-2,35	0,04	-2,35	1,83	0,76	-0,22	1,39	-1,03	-0,91	-5,01
2021	-0,68	-1,34	1,19	0,93	1,38	0,02	-0,65	-0,43	-0,72	-1,16	1,06	1,45	0,99
IPCA + 5,43%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,97	1,43	1,34	1,61	1,68	1,37	1,22	16,01
p.p. indexador	-1,35	-2,58	-0,23	0,20	0,11	-0,95	-2,08	-1,77	-2,33	-2,83	-0,32	0,23	-15,02
2020	0,47	-0,63	-5,97	2,01	2,51	1,89	2,32	-0,99	-1,37	-0,16	3,13	2,95	5,94
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,65
p.p. indexador	-0,25	-1,29	-6,54	1,87	2,44	1,15	1,43	-1,71	-2,49	-1,50	1,78	1,09	-4,70
2019	1,43	0,31	0,54	0,84	1,61	1,98	1,00	0,11	1,77	1,74	-0,36	1,55	13,24
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	0,60	-0,58	-0,66	-0,22	0,97	1,53	0,28	-0,51	1,32	1,11	-1,33	-0,09	2,65

Performance Sobre a Meta Atuarial

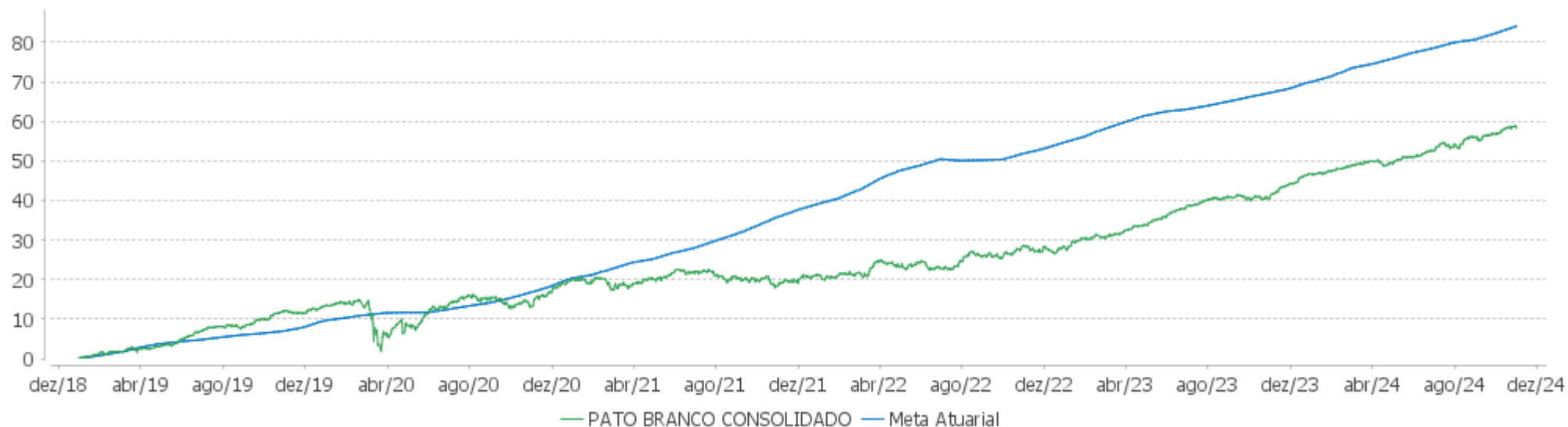
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	33	47,14	03 meses	2,61	2,30	0,31	2,76
Meses abaixo - Meta Atuarial	37	52,86	06 meses	6,10	4,69	1,41	2,54
			12 meses	12,59	10,08	2,51	2,29
			24 meses	23,12	21,06	2,07	2,52
			36 meses	33,90	35,34	-1,44	3,16
			48 meses	40,05	57,97	-17,92	3,59
			60 meses	41,41	73,78	-32,37	5,53
			Desde 31/12/2018	58,26	87,25	-28,99	5,21

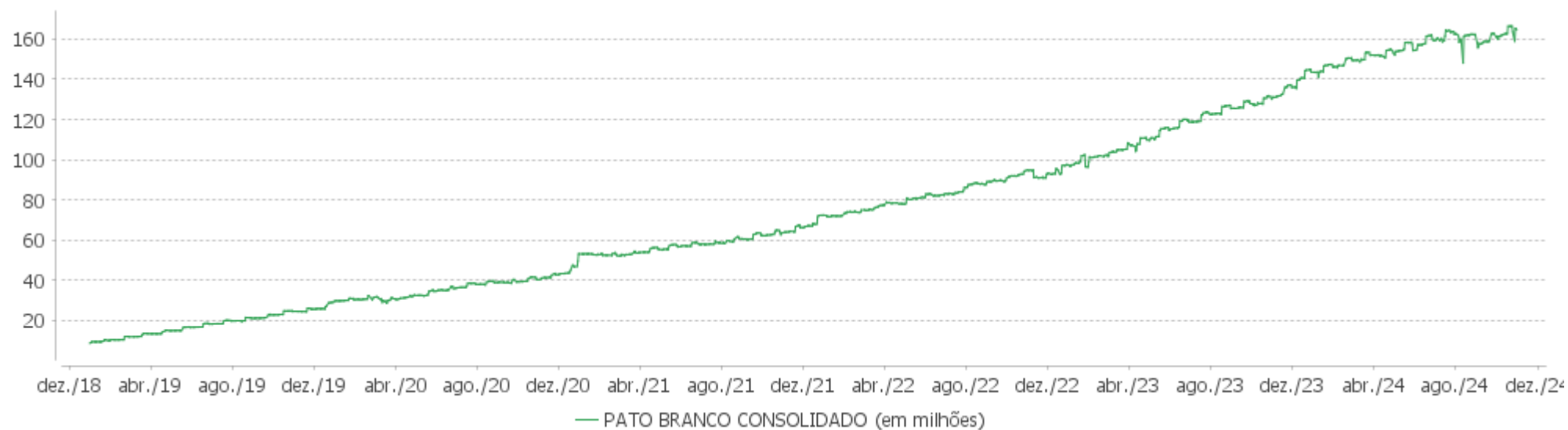
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,13	2020-11
Menor rentabilidade da Carteira	-5,97	2020-03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

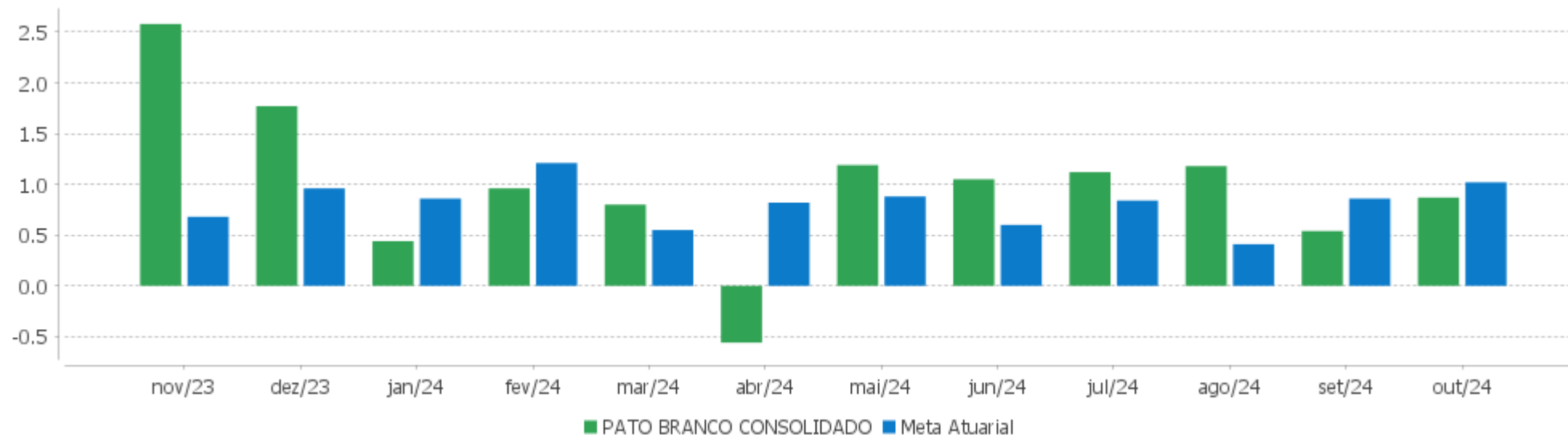


Patrimônio Líquido



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.	0,72 -0,02	5,89 -0,19	1,69 -0,05	4,04 -0,12	9,33 -0,24	19,24 -0,43	34,25 -0,64
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,66 -0,35	4,59 -3,67	1,65 -0,63	3,61 -1,04	9,09 -0,92	18,47 -2,59	
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,72 -0,02	5,81 -0,27	1,62 -0,12	3,97 -0,18	9,26 -0,31	19,08 -0,58	33,93 -0,97
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,93 100,71	8,98 99,81	2,66 100,31	5,27 99,94	10,95 99,71	25,75 99,55	40,24 99,77
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,19 -0,02	3,89 -0,22	1,15 -0,06	2,81 -0,13	8,01 -0,26	21,83 -0,46	36,26 -0,65
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,65 0,00	-4,32 -0,08	-2,32 -0,01	0,07 -0,08	2,80 -0,13	11,02 -0,52	21,93 -0,93
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,18 -0,03	2,11 -0,23	0,48 -0,08	1,85 -0,15	7,12 -0,27	20,75 -0,77	34,90 -1,29
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IDKA 2 p.p.	0,81 0,00	5,91 0,05	1,93 0,13	4,06 0,21	9,33 -0,05	18,99 -0,26	33,44 -0,71
BB PREV IRF-M 1+ Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,18 -0,04	1,93 -0,42	0,49 -0,07	1,81 -0,20	6,93 -0,46	20,36 -1,15	34,77 -1,42
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,86 0,30	5,49 1,60	2,07 1,09	3,96 1,91	8,29 3,54	21,29 11,48	34,95 18,04
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,75 0,19	7,45 3,57	2,42 1,44	4,63 2,58	9,66 4,90	24,36 14,55	38,17 21,26
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,19 -0,02	3,90 -0,22	1,16 -0,05	2,82 -0,12	8,01 -0,26	21,47 -0,82	35,80 -1,11
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI Var. IPCA p.p.	-0,47 -1,03	0,56 -3,33	-0,35 -1,33	2,07 0,02	5,67 0,91	15,12 5,31	
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,65 0,01	-4,49 -0,25	-2,36 -0,05	0,01 -0,14	2,62 -0,30	10,79 -0,75	21,67 -1,19
BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA % do CDI	0,93 99,97	9,68 107,60	2,75 103,74	5,56 105,54	11,80 107,47	27,41 105,95	42,87 106,28
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,85 91,14	8,10 90,09	2,40 90,56	4,75 90,13	9,90 90,14	23,39 90,42	36,21 89,77
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,92	9,07	2,66	5,34	11,18	26,34	41,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	98,98	100,88	100,25	101,22	101,80	101,80	102,64
FIC FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA ATIVA LONGO PRAZO	0,78	7,09	2,29	4,47	9,43	22,01	35,77
% do CDI	83,58	78,84	86,47	84,83	85,89	85,07	88,69
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	-1,18	-7,43	0,90	1,60	10,72	4,05	14,38
Var. IBOVESPA p.p.	0,42	-4,10	-0,72	-1,41	-3,93	-7,74	-10,94
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	-2,03	-9,77	-2,49	-1,99	5,57	4,15	32,65
Var. IBOVESPA p.p.	-0,43	-6,44	-4,11	-5,00	-9,07	-7,63	7,32
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	-1,61	-3,47	1,57	2,92	14,25	11,36	24,90
Var. IBOVESPA p.p.	-0,01	-0,14	-0,04	-0,09	-0,40	-0,42	-0,43
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	-0,15	22,56	3,92	15,11	39,90	57,54	41,85
Var. S&P 500 p.p.	-5,15	-20,20	-1,51	-11,47	-15,53	-4,41	15,00
BB AÇÕES CONSUMO FIC	-0,81	-13,16	-0,61	-0,59	6,85	-25,64	-37,72
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,79	-1,92	-1,83	-2,21	-2,58	-2,73	-3,28
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	0,88	-5,59	4,56	5,97	10,65	-2,42	-2,47
Var. IBOVESPA p.p.	2,48	-2,26	2,94	2,96	-4,00	-14,21	-27,79
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5,92	48,88	6,17	28,45	62,54	89,30	33,96
Var. Global BDRX p.p.	-0,10	-1,62	-0,21	-0,68	-2,23	-5,72	-4,24
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	5,52	37,78	6,99	23,87	50,39	62,50	20,84
Var. IBOVESPA p.p.	7,11	41,11	5,37	20,86	35,75	50,71	-4,49
BRADESCO INSTITUCIONAL FIA BDR NÍVEL I	5,82	43,12	5,97	27,30	55,85	65,85	26,49
Var. MSCI ACWI p.p.	2,19	6,49	1,65	4,41	6,50	9,85	12,13
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-0,34	23,65	4,51	15,67	42,23	66,12	52,31
Var. S&P 500 p.p.	-5,34	-19,11	-0,92	-10,91	-13,19	4,17	25,46
BRADESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA	-0,39	23,08	4,36	15,40	41,46	64,31	49,68
Var. S&P 500 p.p.	-5,40	-19,67	-1,07	-11,18	-13,96	2,35	22,83
PATO BRANCO CONSOLIDADO	0,87	7,85	2,61	6,10	12,59	23,12	33,90
Var. IPCA + 5,08% p.p.	-0,14	-0,48	0,31	1,41	2,49	1,87	-1,75
CDI	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87	40,33
IBOVESPA	-1,60	-3,33	1,61	3,01	14,64	11,79	25,33
INPC + 6,00%	1,15	9,17	2,50	5,04	10,90	22,40	38,12
IPCA + 6,00%	1,10	9,13	2,54	5,16	11,07	23,38	39,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		
BB AÇÕES CONSUMO FIC	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,60
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB PREV IRF-M 1+	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,30
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 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+2 du	D+2 du		0,20
BB PREV RF IRF M	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI						
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA			D+0	D+1 du		1,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FIA BDR NÍVEL I			D+1 du	D+4 du		0,80
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 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
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA ATIVA LONGO PRAZO	D+0	D+0		D +1		

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	0,84	8,08	2,45	4,88	10,15	25,01	39,40	41,88	47,64
IRF-M 1+	-0,14	2,35	0,56	2,01	7,39	21,52	36,19	28,16	34,10
IRF-M TOTAL	0,21	4,12	1,21	2,94	8,27	22,29	36,91	32,39	38,26
IMA-B 5	0,74	6,08	1,74	4,16	9,57	19,66	34,90	40,87	48,92
IMA-B 5+	-1,66	-4,23	-2,31	0,15	2,92	11,54	22,86	21,61	14,50
IMA-B TOTAL	-0,65	0,16	-0,80	1,63	5,62	15,10	28,22	30,57	29,26
IMA-GERAL TOTAL	0,38	5,39	1,52	3,92	9,08	21,85	36,23	37,66	41,34
IDKA 2	0,81	5,86	1,81	3,85	9,37	19,24	34,15	40,34	49,79
IDKA 20	-4,24	-13,00	-6,80	-4,11	-2,93	4,69	12,47	6,78	-7,39
CDI	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87	40,33	45,00	49,67

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-1,60	-3,33	1,61	3,01	14,64	11,79	25,33	38,06	20,98
IBRX 100	-1,53	-2,74	1,84	2,99	15,29	11,28	24,40	37,33	22,16
IBRX 50	-1,49	-1,71	1,51	3,10	15,95	12,48	27,12	41,91	24,29
SMALL CAP	-1,37	-14,85	-1,46	-3,76	2,51	-14,14	-14,08	-10,98	-16,47
Índice Consumo - ICON	-0,02	-11,24	1,22	1,62	9,43	-22,91	-34,44	-40,10	-41,26
Índice Dividendos - IDIV	-1,72	2,45	4,09	7,11	21,24	28,86	50,07	70,74	52,68

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	5,00	42,76	5,43	26,58	55,42	61,95	26,85	74,67	171,04

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-3,06	-3,22	-4,75	-5,23	1,56	7,13	19,78	15,83	14,79

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,63	36,63	4,32	22,90	49,35	56,01	14,35	51,21	124,74

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	3,88	0,98	2,05	4,76	9,81	16,91	29,39	34,46
INPC	0,61	3,92	0,95	1,93	4,60	8,93	15,97	28,82	34,96
IGPM	1,52	4,20	2,45	4,83	5,59	0,76	7,33	30,65	58,00
SELIC	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87	40,33	45,00	49,67

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,92	7,39	2,02	4,13	8,97	18,77	31,51	51,32	63,49
IPCA + 5,00%	1,01	8,26	2,28	4,65	10,02	21,06	35,34	57,21	71,47
IPCA + 5,50%	1,05	8,69	2,41	4,90	10,54	22,22	37,28	60,22	75,58
IPCA + 5,89%	1,09	9,03	2,51	5,10	10,95	23,12	38,81	62,60	78,84
IPCA + 6,00%	1,10	9,13	2,54	5,16	11,07	23,38	39,24	63,27	79,77
INPC + 4,00%	0,97	7,43	1,99	4,02	8,80	17,82	30,45	50,65	64,10
INPC + 6,00%	1,15	9,17	2,50	5,04	10,90	22,40	38,12	62,56	80,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
997	01/10/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	905,62	0,00	248,50069200	3,6443359190
1009	01/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	354,20	121,48155500	2,9156689600
1008	02/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4,30	1,47424000	2,9167569870
996	03/10/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	1.932.034,29	529.679,52199900	3,6475533030
988	03/10/2024	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	329.468,46	0,00	129.283,37193800	2,5484210000
1007	03/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6,70	2,29617400	2,9178973960
1013	03/10/2024	BRADESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA	329.468,46	0,00	61.073,14132000	5,3946539000
990	04/10/2024	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	329.468,46	0,00	103.753,38042900	3,1754961490
983	04/10/2024	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	329.468,44	0,00	38.240,46880847	8,6157008600
1012	04/10/2024	BRADESCO INSTITUCIONAL FIA BDR NÍVEL I	329.468,46	0,00	28.572,51409640	11,5309580000
1022	04/10/2024	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	329.468,46	0,00	144.828,65979500	2,2748844080
995	07/10/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	26.601,91	7.286,46277800	3,6508674800
1006	09/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	49.879,30	0,00	17.066,08562100	2,9227147400
1005	10/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	16.307,48	5.577,98039300	2,9235455940
1004	17/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.574,87	537,79932300	2,9283599500
994	18/10/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	3.492.752,58	0,00	953.446,92131100	3,6632900080
1003	18/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	0,12	0,04096500	2,9293154120
1014	24/10/2024	BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	247.349,25	0,00	27.511,59431500	8,9907277120
1018	24/10/2024	BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	102.030,10	0,00	11.348,36903100	8,9907277120
1015	24/10/2024	BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	39.609,08	0,00	4.405,54789900	8,9907277120
1019	24/10/2024	BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	272.035,78	0,00	30.257,37030700	8,9907277120
1016	24/10/2024	BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	176.360,44	0,00	19.615,81372100	8,9907277120
1017	24/10/2024	BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	42.704,28	0,00	4.749,81341900	8,9907277120
1021	24/10/2024	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	0,00	880.088,93	729.247,07009800	1,2068460250
993	25/10/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	8.583,30	2.338,20899200	3,6708865760
986	25/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	2.965.415,03	935.676,74382800	3,1692729883
1002	25/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	18,59	6,33417800	2,9348716910
989	28/10/2024	BB PREV IRF-M 1+	0,00	3.322.566,10	2.273.518,56722800	1,4614202619

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
998	28/10/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	18,59	4,74337000	3,9191547970
987	28/10/2024	FIC FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA ATIVA LONGO PRAZO	0,00	1.369.544,06	979,85461100	1.397,7012963202
992	29/10/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	3.322.566,10	0,00	904.382,51605000	3,6738504350
991	29/10/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	1.520.133,83	413.771,28897700	3,6738504350
1001	29/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3,24	0,00	1,10315900	2,9370189040
1010	29/10/2024	BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	4.334.959,09	0,00	238.973,28621144	18,1399317000
985	30/10/2024	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	0,00	1.053.304,35	356.353,63049500	2,9557839737
984	30/10/2024	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	0,00	1.836.695,00	807.381,75841800	2,2748780002
1000	30/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	15,35	5,22442300	2,9381236560
1011	30/10/2024	BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	2.889.999,35	0,00	159.253,63300000	18,1471487000
999	31/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	28.997,17	9.865,57610300	2,9392272380
Total			16.947.964,95	14.962.264,17		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 2.649.674,89

Value-At-Risk: 1,61%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,25	0,66	5,00	0,06	-0,27	0,59	128.069.591,50	77,83
Artigo 8º	8,59	5,86	20,00	0,26	-0,20	-0,78	7.887.876,73	4,79
Artigo 9º	13,55	9,09	20,00	0,65	0,35	5,73	14.199.279,17	8,63
Artigo 10º	11,15	7,77	20,00	0,64	-0,11	-0,35	14.399.179,96	8,75
PATO BRANCO CONSOLIDADO		1,61		1,61			164.555.927,36	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,66%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV IRF-M 1+	3,99	NaN	0,00	NaN	-0,28	-0,18	0,00	0,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,54	0,33	0,00	0,34	-0,33	0,75	10.845.298,07	6,59
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,86	1,03	0,01	0,04	-0,11	0,72	15.703.359,07	9,54
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,77	3,70	0,01	0,03	-0,45	-1,65	2.153.658,29	1,31
BB PREV RF IRF M	2,66	1,43	0,01	0,02	-0,28	0,19	7.561.826,56	4,60
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI	2,19	1,53	0,00	1,53	-0,12	0,66	398.315,56	0,24
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,82	1,14	0,00	0,21	-0,07	0,81	216.991,27	0,13
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	3,75	2,29	0,00	2,30	-0,37	-0,47	375.524,40	0,23
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,06	0,01	-0,00	0,01	0,12	0,93	17.973.917,14	10,92
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,86	1,03	0,01	0,01	-0,11	0,72	21.826.622,00	13,26
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,73	3,66	0,01	0,05	-0,45	-1,65	5.275.079,97	3,21
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	4,02	NaN	0,00	NaN	-0,27	-0,18	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,67	1,43	0,00	0,01	-0,28	0,19	2.557.433,42	1,55
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,86	0,61	0,00	0,61	-0,08	0,86	7.460.942,26	4,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	1,69	0,91	0,06		-0,28	0,46	92.348.968,01	56,12

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	0,02	-0,00	0,02	-1,34	0,85	23.542,33	0,01
BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,05	0,03	0,00	0,03	-0,01	0,93	10.341.110,86	6,28
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,08	0,04	-0,00	0,04	-0,12	0,92	25.355.970,30	15,41
FIC FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA ATIVA LONGO PRAZO	1,52	NaN	0,00	NaN	-0,10	0,78	0,00	0,00
Sub-total	0,10	0,03	0,00		-0,04	0,92	35.720.623,49	21,71

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,77%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA	11,17	7,79	0,13	6,18	-0,12	-0,39	2.952.888,18	1,79
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11,15	7,76	0,51	6,17	-0,11	-0,34	11.446.291,78	6,96
Sub-total	11,15	7,77	0,64		-0,11	-0,35	14.399.179,96	8,75

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,09%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	13,64	10,03	0,34	10,85	0,34	5,52	6.423.751,41	3,90
BRADESCO INSTITUCIONAL FIA BDR NÍVEL I	13,16	7,70	0,08	4,72	0,37	5,82	2.303.406,97	1,40
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	13,86	8,97	0,23	1,01	0,36	5,92	5.472.120,79	3,33
Sub-total	13,55	9,09	0,65		0,35	5,73	14.199.279,17	8,63

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,86%

Artigo 8º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	10,55	6,85	0,24	5,95	-0,10	-0,15	6.252.025,49	3,80
BB AÇÕES CONSUMO FIC	15,80	8,02	0,01	0,77	-0,11	-0,81	758.209,66	0,46
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	9,34	5,52	0,01	1,44	-0,23	-1,18	877.641,58	0,53
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	8,02	NaN	0,00	NaN	-0,01	0,88	0,00	0,00
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	9,69	NaN	0,00	NaN	-0,26	-1,61	0,00	0,00
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	10,72	NaN	0,00	NaN	-0,28	-2,03	0,00	0,00
Sub-total	8,59	5,86	0,26		-0,20	-0,78	7.887.876,73	4,79

(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 (%)