



**LDB**  
EMPRESAS

**PATO BRANCO CONSOLIDADO**  
AGOSTO 2022



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 31.08.2022.

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

79,65%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF M	3,71	2,05	5,38	457.227,55	0,52	3.858.033.696,96	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,62	0,05	6,58	9.691.827,72	10,99	9.644.358.000,69	0,10
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,74	-0,04	6,17	10.588.760,07	12,00	9.083.863.850,50	0,12
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	5,34	2,57	4,39	686.174,18	0,78	706.486.379,31	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,70	2,04	5,40	431.955,77	0,49	1.901.885.299,87	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,65	0,01	6,48	9.104.671,21	10,32	6.457.640.882,23	0,14
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,40	0,61	6,77	5.881.734,72	6,67	2.464.660.149,14	0,24
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,49	1,21	5,39	7.216.124,19	8,18	4.651.858.401,06	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,65	1,47	6,96	5.035.555,70	5,71	5.888.909.396,66	0,09
BB	BB	BB PREV IRF-M 1+	5,37	2,60	4,51	829.436,83	0,94	133.639.036,29	0,62
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,33</b>	<b>0,49</b>	<b>6,20</b>	<b>49.923.467,94</b>	<b>56,59</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	1,08	7,01	1.729.655,21	1,96	3.244.269.098,03	0,05
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,65	-0,02	0,06	289.393,40	0,33	1.169.481.458,66	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,20	1,20	8,05	12.926.415,83	14,65	4.714.682.255,57	0,27
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,15	1,16	2,18	423.124,95	0,48	7.527.431.395,42	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,16	1,21	1,21	1.012.095,92	1,15	6.775.226.177,02	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,58	1,57	7,26	3.971.777,83	4,50	798.552.666,46	0,50
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,44</b>	<b>1,25</b>	<b>7,72</b>	<b>20.352.463,14</b>	<b>23,07</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,83</b>	<b>0,71</b>	<b>6,61</b>	<b>70.275.931,08</b>	<b>79,65</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

13,08%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	26,42	6,44	-13,35	974.500,30	1,10	152.133.527,10	0,64
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,60	6,58	3,72	2.396.505,85	2,72	890.869.419,69	0,27
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	22,48	7,06	12,83	1.650.810,72	1,87	241.072.165,79	0,68
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	20,08	6,15	4,60	883.360,19	1,00	510.891.282,92	0,17
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,89	6,54	3,13	607.161,17	0,69	2.019.893.410,51	0,03
BB	BB	BB AÇÕES ENERGIA FI	17,59	1,13	6,29	1.020.167,28	1,16	307.755.913,79	0,33
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	21,06	-3,34	-13,18	3.132.398,64	3,55	1.478.325.790,61	0,21
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	20,43	8,77	-1,30	874.545,24	0,99	1.073.248.348,98	0,08
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>18,07</b>	<b>3,38</b>	<b>-2,08</b>	<b>11.539.449,39</b>	<b>13,08</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>17,26</b>	<b>3,38</b>	<b>-2,08</b>	<b>11.539.449,39</b>	<b>13,08</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,06%

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	22,38	-3,92	-25,19	659.722,35	0,75	2.252.028.422,82	0,03
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	21,36	-4,11	-24,97	664.849,02	0,75	769.685.606,72	0,09
BB	BB	BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS FIC DE FIA - BDR ETF NÍVEL I	21,62	-6,50	-18,82	470.004,77	0,53	141.125.042,69	0,33
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES BDR NÍVEL I	21,37	-6,16	-6,16	19.770,81	0,02	126.912.339,80	0,02
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>19,18</b>	<b>-4,68</b>	<b>-23,52</b>	<b>1.814.346,95</b>	<b>2,06</b>		
Investimentos no Exterior			19,18	-4,68	-23,52	1.814.346,95	2,06		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

5,21%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,26	2,21	7,59	186.441,77	0,21	2.224.441.492,24	0,01
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	2,86	1,09	6,93	1.764.926,71	2,00	120.293.717,65	1,47
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA	21,14	-3,26	-3,26	403.240,73	0,46	874.486.573,23	0,05
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	21,09	-3,24	-12,18	2.242.037,31	2,54	1.976.589.170,89	0,11
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>13,16</b>	<b>-1,30</b>	<b>-4,30</b>	<b>4.596.646,52</b>	<b>5,21</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>13,16</b>	<b>-1,30</b>	<b>-4,30</b>	<b>4.596.646,52</b>	<b>5,21</b>		
<b>Total</b>			<b>4,26</b>	<b>0,83</b>	<b>3,75</b>	<b>88.226.373,94</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	49.923.467,94	56,59	0,00	34,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	20.352.463,14	23,07	0,00	20,00	60,00	0,00	60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>70.275.931,08</b>	<b>79,65</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	11.539.449,39	13,08	0,00	19,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>11.539.449,39</b>	<b>13,08</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	1.814.346,95	2,06	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>1.814.346,95</b>	<b>2,06</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	4.596.646,52	5,21	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>4.596.646,52</b>	<b>5,21</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>88.226.373,94</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	0,49 41,61	6,20 80,20	1,07 32,92	5,05 82,04	8,57 83,98	239.066,54	2.679.928,87
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,25 106,67	7,72 99,81	2,98 91,68	5,92 96,22		248.973,46	1.226.563,15
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	3,38 -2,78	-2,08 -6,56	-0,90 0,74	-2,31 0,89		377.693,71	-244.761,82
Artigo 9º III % do CDI	-4,68 -400,92	-23,52 -304,11	-0,64 -19,64	-11,53 -187,29	-16,44 -161,13	-89.708,04	-550.211,28
Artigo 10º I % do CDI	-1,30 -111,64	-4,30 -55,63	-0,20 -6,21	-0,80 -13,06		-57.535,92	-177.783,73
<b>PATO BRANCO CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>718.489,75</b>	<b>2.933.735,19</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 IRF-M 1+	574.470,02	240.044,47	0,00	0,00	829.436,83	14.922,34	25.434,98
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	7.130.183,97	0,00	0,00	0,00	7.216.124,19	85.940,22	368.933,57
BB PREV RF IDKA2	10.593.480,53	0,00	0,00	0,00	10.588.760,07	-4.720,46	556.672,91
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	9.104.114,54	0,00	0,00	0,00	9.104.671,21	556,67	505.111,42
BB PREV RF IRF M	448.034,53	0,00	0,00	0,00	457.227,55	9.193,02	23.360,81
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.687.215,58	0,00	0,00	0,00	9.691.827,72	4.612,14	475.451,94
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	434.953,38	240.044,47	0,00	0,00	686.174,18	11.176,33	18.758,07
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	423.309,86	0,00	0,00	0,00	431.955,77	8.645,91	22.145,41
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	4.962.477,68	0,00	0,00	0,00	5.035.555,70	73.078,02	327.742,86
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	5.846.072,37	0,00	0,00	0,00	5.881.734,72	35.662,35	356.316,90
					49.923.467,94	0,00	0,00

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



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	1.683.632,35	66.470,53	-38.943,96	0,00	1.729.655,21	18.496,29	99.675,63
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	418.288,38	0,00	0,00	0,00	423.124,95	4.836,57	9.018,11
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1.000.000,00	0,00	0,00	0,00	1.012.095,92	12.095,92	12.095,92
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	289.451,70	0,00	0,00	0,00	289.393,40	-58,30	168,87
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	12.228.927,89	545.270,81	0,00	0,00	12.926.415,83	152.217,13	844.812,10
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	3.910.391,98	0,00	0,00	0,00	3.971.777,83	61.385,85	260.792,52
					20.352.463,14	0,00	0,00

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	3.240.714,99	0,00	0,00	0,00	3.132.398,64	-108.316,35	-474.332,50
BB AÇÕES CONSUMO FIC	915.527,77	0,00	0,00	0,00	974.500,30	58.972,53	-150.166,63
BB AÇÕES ENERGIA FI	1.008.745,80	0,00	0,00	0,00	1.020.167,28	11.421,48	60.353,08
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	2.248.624,15	0,00	0,00	0,00	2.396.505,85	147.881,70	85.969,97
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	804.038,77	0,00	0,00	0,00	874.545,24	70.506,47	-11.527,52
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	832.199,91	0,00	0,00	0,00	883.360,19	51.160,28	38.869,79
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	1.542.003,81	0,00	0,00	0,00	1.650.810,72	108.806,91	187.759,10
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	569.900,48	0,00	0,00	0,00	607.161,17	37.260,69	18.312,89
					11.539.449,39	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS FIC DE FIA - BDR ETF NÍVEL I	502.701,21	0,00	0,00	0,00	470.004,77	-32.696,44	-108.993,15
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	679.635,37	14.045,90	0,00	0,00	664.849,02	-28.832,25	-217.750,11
BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	21.068,87	0,00	0,00	19.770,81	-1.298,06	-1.298,06
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	686.603,64	0,00	0,00	0,00	659.722,35	-26.881,29	-222.169,96
					1.814.346,95	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	1.745.938,11	0,00	0,00	0,00	1.764.926,71	18.988,60	108.387,63
BRADESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA	168.702,55	240.044,47	0,00	0,00	403.240,73	-5.506,29	-5.506,29
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.317.091,80	0,00	0,00	0,00	2.242.037,31	-75.054,49	-293.817,79
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	182.405,51	0,00	0,00	0,00	186.441,77	4.036,26	13.152,72
					4.596.646,52	0,00	0,00

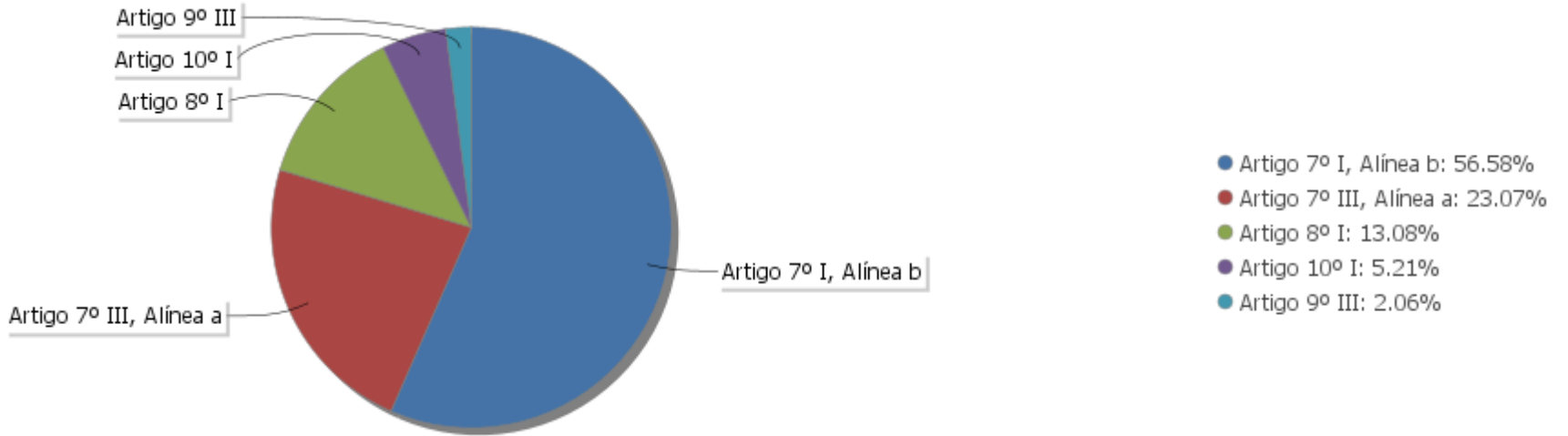
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

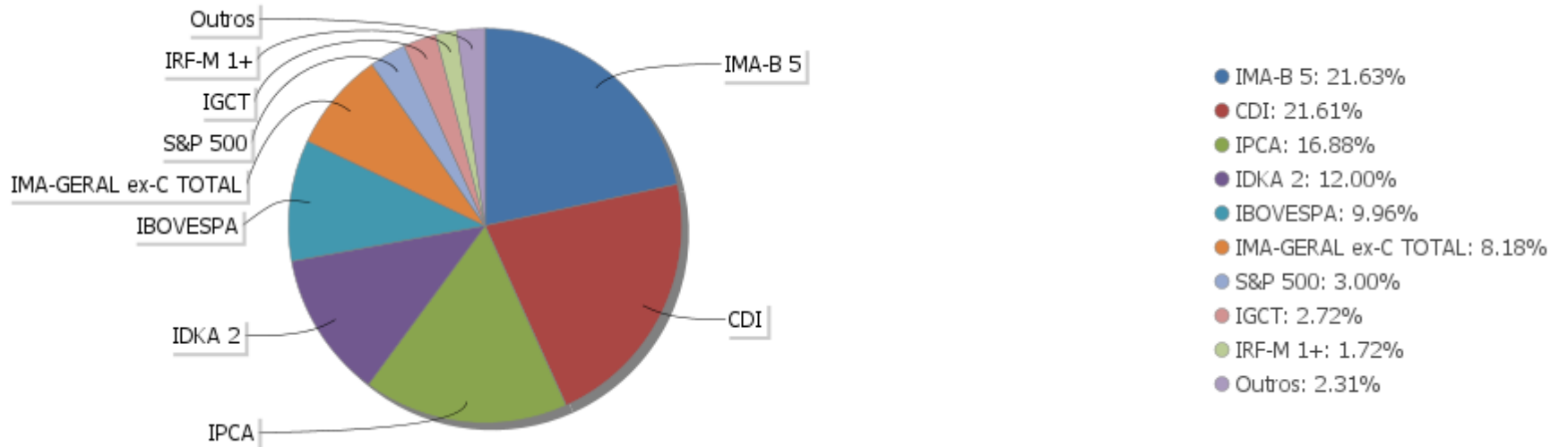
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	87.619.212,77	99,31	87.619.212,77	99,31
de 31 a 365 dias	607.161,17	0,69	88.226.373,94	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	88.226.373,94	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

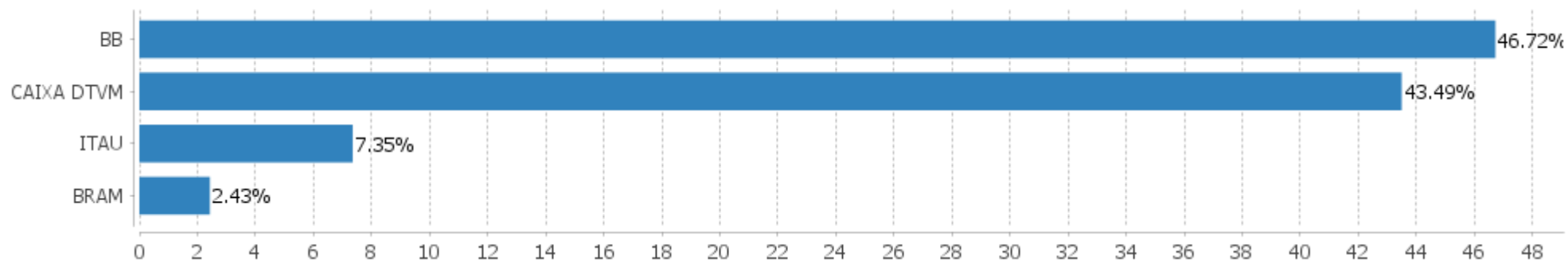


Alocação Por Estratégia



## 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
2022	0,03	0,32	2,29	-0,93	0,93	-1,28	1,54	0,83					3,75
IPCA + 4,92%	0,94	1,38	2,05	1,43	0,89	1,07	-0,28	0,08					7,79
p.p. indexador	-0,92	-1,06	0,25	-2,35	0,04	-2,35	1,83	0,76					-4,04
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

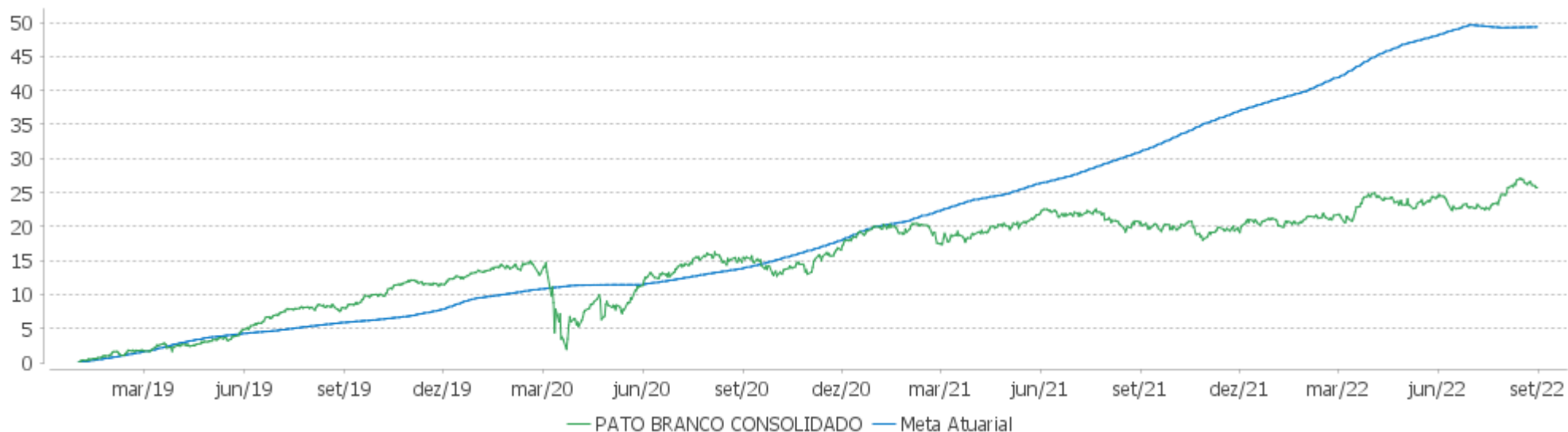
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

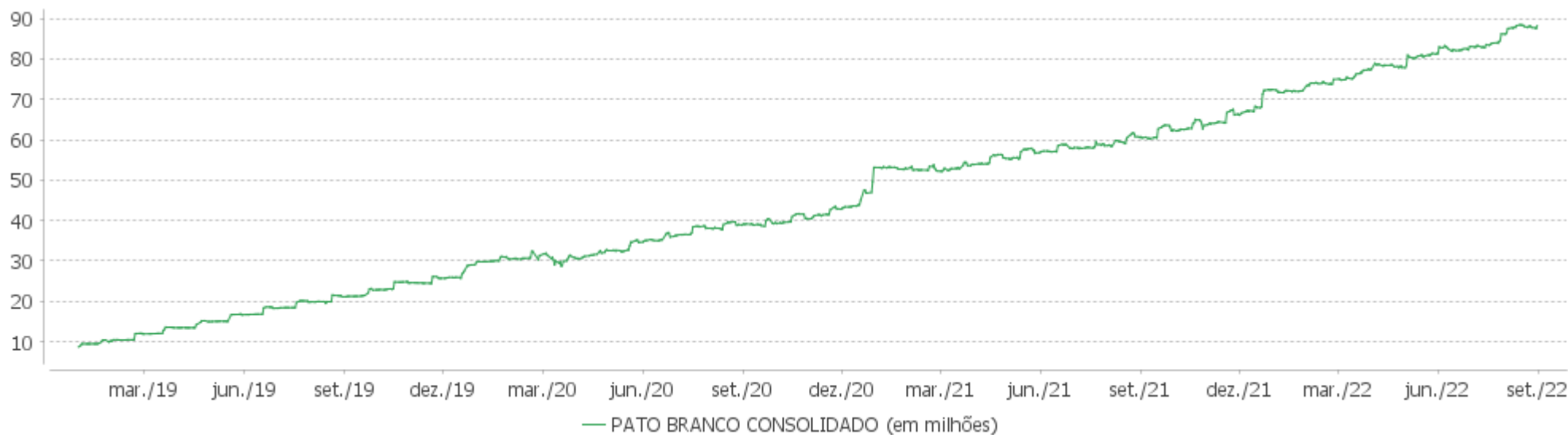
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	19	43,18	03 meses	1,08	0,87	0,21	3,80
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	56,82	06 meses	3,39	5,33	-1,94	4,33
			12 meses	4,38	14,26	-9,88	4,26
			24 meses	9,55	32,29	-22,74	4,56
			36 meses	16,31	43,55	-27,24	6,78
Maior rentabilidade da Carteira	3,13	2020-11	Desde 31/12/2018	25,72	53,02	-27,30	6,23
Menor rentabilidade da Carteira	-5,97	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Evolução**

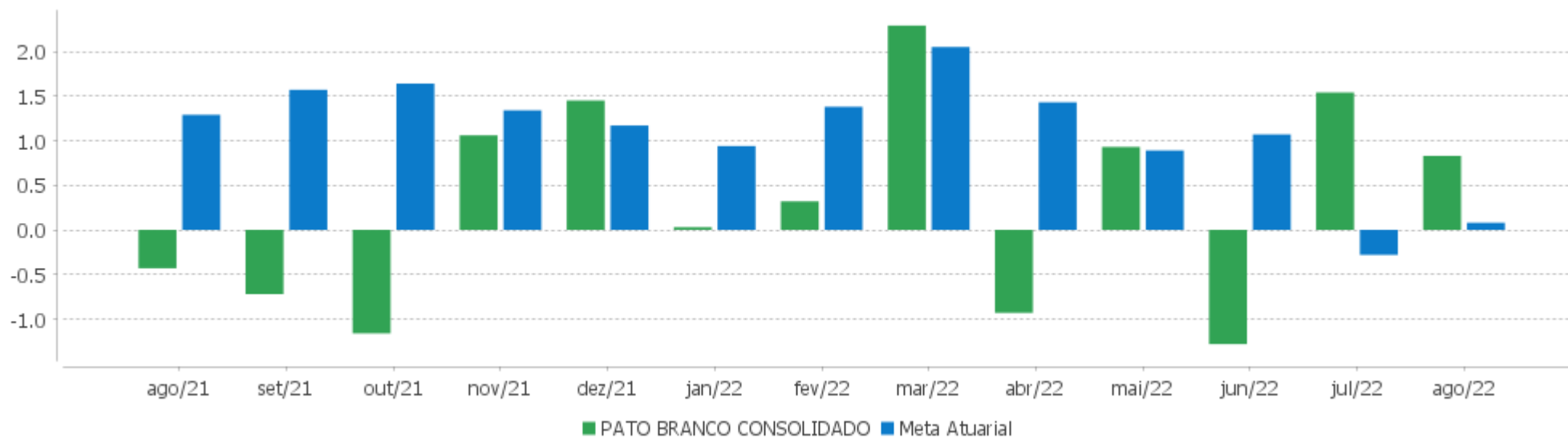


**Patrimônio Líquido**



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 IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	2,57 -0,03	4,39 -0,21	3,80 -0,13	4,48 -0,14	4,46 -0,34	0,72 -0,60	11,20 -0,90
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,05 0,05	6,58 -0,04	0,40 0,06	5,38 -0,00	9,75 -0,13	14,69 -0,43	24,92 -0,83
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	-0,04 0,32	6,17 -0,10	0,00 0,07	4,95 0,05	9,27 -0,16	14,82 -0,16	24,78 -1,36
BB PREV IRF-M 1+ Var. IRF-M 1+ p.p.	2,60 -0,01	4,51 -0,09	3,81 -0,11	4,62 -0,00	4,59 -0,21	0,77 -0,55	10,92 -1,18
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,21	5,39	1,95	4,70	6,43	7,49	13,99
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,47 1,83	6,96 2,57	2,51 2,88	5,40 2,61	8,49 -0,24	8,48 -10,77	18,47 -3,69
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,01 0,01	6,48 -0,15	0,32 -0,02	5,28 -0,10	9,60 -0,28	14,55 -0,57	24,81 -0,95
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	2,05 -0,00	5,38 -0,10	3,56 -0,05	4,92 -0,04	5,97 -0,20	4,34 -0,51	13,13 -0,84
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	2,04 -0,01	5,40 -0,08	3,54 -0,06	4,86 -0,10	6,03 -0,14	4,45 -0,40	13,31 -0,66
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,61 0,97	6,77 2,37	2,21 2,59	5,23 2,44	9,98 1,25	11,78 -7,48	17,08 -5,08
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02 -0,02	6,28 -0,34	0,24 -0,10	5,11 -0,28	9,37 -0,51	13,52 -1,60	23,99 -1,77
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,21 103,60	8,14 105,29	3,40 104,69	6,43 104,45	10,90 106,83	14,08 106,86	17,79 101,27
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA % do CDI	1,16 99,03	7,53 97,33	3,20 98,47	5,93 96,35	9,97 97,77	12,58 95,44	16,70 95,08
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	1,08 92,53	7,01 90,63	2,99 92,07	5,60 90,98	9,08 89,02	10,75 81,55	13,83 78,73
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	1,20 102,75	8,05 104,12	3,30 101,46	6,22 101,04	10,64 104,32	13,69 103,89	17,83 101,50
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	1,57 1,93	7,26 2,86	2,29 2,66	5,42 2,63	9,43 0,70	9,06 -10,19	
BB AÇÕES ENERGIA FI	1,13	6,29	-1,22	4,08	0,34	8,22	6,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	96,97	81,29	-37,66	66,23	3,35	62,36	38,31
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA Var. IBOVESPA p.p.	7,06 0,89	12,83 8,35	2,57 4,22	8,14 11,33	6,17 13,96	18,83 8,61	20,84 12,55
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	6,15 -0,02	4,60 0,12	-1,44 0,20	-2,99 0,20	-7,72 0,07	9,97 -0,25	7,90 -0,39
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,34 -9,51	-13,18 -17,67	-2,23 -0,59	-5,81 -2,61	-7,22 0,57	20,28 10,06	
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	6,54 0,37	3,13 -1,35	0,39 2,03	3,02 6,21	-11,29 -3,50	7,56 -2,66	4,72 -3,57
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	6,58 -0,14	3,72 -0,73	-1,83 -0,17	-3,56 -0,41	-9,46 -0,90	8,39 -2,09	7,97 -3,19
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	8,77 2,61	-1,30 -5,79	0,04 1,69	0,16 3,36	-18,16 -10,36	-2,27 -12,49	-1,07 -9,37
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	6,44 0,28	-13,35 -17,84	-0,77 0,88	-13,03 -9,83	-32,26 -24,46	-33,14 -43,35	-29,19 -37,48
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-3,92 -0,87	-25,19 -0,74	4,51 -0,69	-10,76 -0,68	-16,57 -1,26	-3,06 -3,72	63,70 -5,37
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-4,11 -10,27	-24,97 -29,45	3,33 4,97	-10,86 -7,67	-15,28 -7,48	-2,60 -12,82	59,41 51,12
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS FIC DE FIA - BDR ETF NÍVEL I Var. MSCI ACWI p.p.	-6,50 -2,47	-18,82 5,79	-11,48 -14,33	-13,48 -1,93	-17,97 -1,25		
BRADERCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES BDR NÍVEL I Var. MSCI ACWI p.p.	-3,66 0,38	-23,40 1,22	5,48 2,63	-8,91 2,64	-12,79 3,92	2,78 3,55	
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI % do CDI	1,09 93,15	6,93 89,64	1,77 54,48	5,11 83,03	8,21 80,45	9,93 75,36	
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	2,21 189,52	7,59 98,12	2,61 80,34	5,35 86,95	7,70 75,46	12,73 96,59	19,01 108,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-3,24 1,18	-12,18 10,81	-1,75 -6,57	-5,28 3,82	-5,31 6,64	23,21 16,25	44,11 -25,02
BRADERCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA Var. S&P 500 p.p.	-3,26 1,15	-12,53 10,46	-1,88 -6,70	-5,50 3,60	-5,89 6,05	22,69 15,74	45,46 -23,67
PATO BRANCO CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,92% p.p.	0,83 0,76	3,75 -4,04	1,08 0,21	3,39 -1,94	4,38 -9,70	9,55 -21,70	16,31 -24,75
CDI	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18	17,57
IBOVESPA	6,16	4,48	-1,64	-3,20	-7,79	10,22	8,29

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
INPC + 6,00%	0,22	8,80	1,22	6,02	15,36	34,99	47,30
IPCA + 6,00%	0,17	8,53	1,13	5,88	15,25	33,96	45,46

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 BOLSAS EUROPEIAS FIC DE FIA - BDR ETF NÍVEL I						
BB AÇÕES CONSUMO FIC	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES ENERGIA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,60
BB AÇÕES GOVERNANÇA 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 MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	D+1 du	D+0		D+4 du	Será devida taxa de performance de 20% (vinte por cento), com baseno resultado do fundo, sobre a rentabilidade que exceder 100% da variação do Certificado de Depósito Interfinanceiro - CDI, após a dedução de todas as despesas do FUNDO, inclusive taxa de administração.	
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA 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 IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IRF M	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA			D+0	D+1 du		1,20
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES 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 IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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 CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	D+0	D+0		D +1		
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	1,90
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40

**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	1,23	7,40	3,25	5,94	9,04	11,48	17,12	25,79	34,47
IRF-M 1+	2,60	4,60	3,92	4,62	4,80	1,32	12,10	35,02	42,44
IRF-M TOTAL	2,05	5,49	3,60	4,96	6,17	4,85	13,97	32,97	40,86
IMA-B 5	0,00	6,62	0,35	5,38	9,88	15,12	25,75	43,90	53,48
IMA-B 5+	2,49	2,65	-0,51	4,31	1,44	3,27	8,13	49,44	53,36
IMA-B TOTAL	1,10	4,57	-0,15	4,78	5,54	8,99	16,23	48,22	54,99
IMA-GERAL TOTAL	1,40	6,45	2,32	5,44	7,87	9,89	17,04	35,56	43,86
IDKA 2	-0,36	6,28	-0,07	4,90	9,42	14,98	26,14	42,02	53,43
IDKA 20	5,45	-0,98	-1,32	2,60	-6,74	-6,09	-6,32	50,07	49,07
CDI	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18	17,57	24,95	33,50

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,16	4,48	-1,64	-3,20	-7,79	10,22	8,29	42,84	54,62
IBRX 100	6,15	4,48	-2,00	-3,64	-8,18	10,99	9,74	48,00	58,88
IBRX 50	6,33	4,81	-1,81	-4,31	-7,38	13,10	10,63	42,79	55,02
SMALL CAP	10,90	-6,34	-2,42	-4,48	-22,25	-9,05	-3,57	45,68	42,28
IFIX	5,76	6,11	5,52	8,58	8,23	6,98	12,03	39,12	42,81
Índice Consumo - ICON	6,66		-0,20	-12,18	-31,25	-30,97	-26,99	10,55	-1,44
Índice Dividendos - IDIV	4,27	11,21	-2,58	5,93	4,28	24,51	19,98	80,27	80,79

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,36	4,39	-0,37	2,79	8,73	19,25	22,16	26,35	31,65
INPC	-0,31	4,65	-0,29	2,93	8,83	20,17	23,70	27,76	32,42
IGPM	-0,70	7,63	0,09	3,81	8,59	42,37	60,92	68,88	83,90
SELIC	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18	17,57	24,95	33,51

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-4,42	-22,99	4,82	-9,10	-11,94	6,95	69,12	70,71	163,33
MSCI ACWI	-4,03	-24,62	2,86	-11,55	-16,72	-0,77	50,18	46,85	110,90

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	-0,00	7,16	0,64	4,86	13,08	28,96	37,39	47,72	60,02
IPCA + 5,00%	0,08	7,84	0,89	5,37	14,16	31,45	41,39	53,46	67,82
IPCA + 5,50%	0,13	8,19	1,01	5,63	14,71	32,70	43,41	56,39	71,84
IPCA + 5,89%	0,16	8,45	1,11	5,83	15,13	33,68	45,01	58,71	75,02
IPCA + 6,00%	0,17	8,53	1,13	5,88	15,25	33,96	45,46	59,36	75,93
INPC + 4,00%	0,05	7,43	0,72	5,00	13,18	29,95	39,12	49,37	60,95
INPC + 6,00%	0,22	8,80	1,22	6,02	15,36	34,99	47,30	61,15	76,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
407	01/08/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.738,59	4.211,35615100	2,3124593720
400	03/08/2022	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	14.045,90	0,00	6.269,40856500	2,2403867690
408	03/08/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	50.000,00	0,00	21.602,60432300	2,3145357500
403	03/08/2022	BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES BDR NÍVEL I	21.068,87	0,00	2.613,57267715	8,0613293000
406	04/08/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	545.270,81	0,00	335.718,12889918	1,6241923300
409	10/08/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	23.631,91	10.186,86722600	2,3198407790
402	10/08/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	16.470,53	0,00	7.099,85364000	2,3198407790
410	19/08/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.275,00	547,79349700	2,3275194170
411	24/08/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.900,00	1.673,18607200	2,3308824200
401	31/08/2022	BB PREV IRF-M 1+	240.044,47	0,00	202.735,83331300	1,1840258630
412	31/08/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	398,46	170,54590000	2,3363798190
404	31/08/2022	BRADESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA	240.044,47	0,00	72.121,23797808	3,3283465000
405	31/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	240.044,47	0,00	93.795,19968983	2,5592404600
<b>Total</b>			<b>1.366.989,52</b>	<b>38.943,96</b>		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.900.092,15

Value-At-Risk: 2,15%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PATO BRANCO CONSOLIDADO		2,15	2,15			88.226.373,94	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,81%

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 IRF M		1,62	0,00	0,02			457.227,55	0,52
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,10	0,06	0,04			9.691.827,72	10,99
BB PREV RF IDKA2		1,38	0,08	0,34			10.588.760,07	12,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		2,42	0,01	0,02			686.174,18	0,78
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,61	0,00	0,03			431.955,77	0,49
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,10	0,06	0,03			9.104.671,21	10,32
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		0,82	0,02	0,84			5.881.734,72	6,67
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,01	0,05	1,01			7.216.124,19	8,18
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,24	0,03	1,27			5.035.555,70	5,71
BB PREV IRF-M 1+		2,42	0,01	0,06			829.436,83	0,94
<b>Sub-total</b>	<b>2,47</b>	<b>1,04</b>	<b>0,32</b>		<b>-0,28</b>	<b>0,49</b>	<b>49.923.467,94</b>	<b>56,59</b>

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		0,03	0,00	0,01			1.729.655,21	1,96
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5		1,13	0,00	0,04			289.393,40	0,33
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,03	0,00	0,03			12.926.415,83	14,65
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA		0,05	0,00	0,03			423.124,95	0,48
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,02	0,00	0,02			1.012.095,92	1,15
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		1,45	0,03	1,47			3.971.777,83	4,50

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
<b>Sub-total</b>	0,32	0,30	0,03		0,25	1,25	20.352.463,14	23,07

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,98%

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 CONSUMO FIC		12,23	0,11	8,48			974.500,30	1,10
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		9,55	0,22	0,12			2.396.505,85	2,72
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA		9,29	0,15	4,67			1.650.810,72	1,87
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA		9,86	0,08	0,20			883.360,19	1,00
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		9,69	0,06	4,56			607.161,17	0,69
BB AÇÕES ENERGIA FI		7,42	0,05	7,42			1.020.167,28	1,16
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA		15,74	0,49	11,37			3.132.398,64	3,55
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI		9,33	0,08	2,43			874.545,24	0,99
<b>Sub-total</b>	16,93	9,98	1,25		0,13	3,38	11.539.449,39	13,08

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 8,55%

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
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		1,68	0,00	1,68			186.441,77	0,21
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI		0,75	0,01	0,75			1.764.926,71	2,00
BRADESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA		14,60	0,06	8,38			403.240,73	0,46
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		14,64	0,33	8,42			2.242.037,31	2,54
<b>Sub-total</b>	10,88	8,55	0,40		-0,23	-1,30	4.596.646,52	5,21

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,53%

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
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

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
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		12,06	0,05	2,87			659.722,35	0,75
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I		11,68	0,05	12,92			664.849,02	0,75
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS FIC DE FIA - BDR ETF NÍVEL I		13,04	0,05	12,01			470.004,77	0,53
BRDESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES BDR NÍVEL I		11,38	0,00	5,43			19.770,81	0,02
<b>Sub-total</b>	20,46	10,53	0,15		-0,29	-4,68	1.814.346,95	2,06