



PATO BRANCO CONSOLIDADO
JULHO 2023



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 31.07.2023.

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	85,83%
------------	--------

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 PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI	4,35	0,16	0,82	1,78	390.645,00	0,32	978.255.076,45	0,04
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,46	0,06	0,79	9,61	8.149.103,33	6,65	5.898.923.569,05	0,14
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	5,92	0,31	0,71	2,91	395.000,58	0,32	948.103.613,02	0,04
BB	BB	BB PREV RF IRF M	3,37	0,15	0,78	10,30	5.794.387,59	4,73	2.921.880.225,01	0,20
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,32	0,12	0,95	8,02	18.604.185,08	15,18	8.226.261.315,96	0,23
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,48	0,09	0,94	7,57	11.761.965,97	9,60	6.277.767.899,83	0,19
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,02	0,38	0,69	4,02	399.252,17	0,33	1.449.653.568,31	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,98	0,37	0,74	2,17	1.493.730,81	1,22	1.449.210.635,92	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	5,04	0,19	0,80	12,14	1.554.638,68	1,27	1.530.052.591,57	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,34	0,15	0,88	10,52	1.222.078,05	1,00	1.825.912.846,83	0,07
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,34	0,12	0,95	8,01	13.875.124,34	11,32	5.434.496.212,00	0,26
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,45	0,12	0,89	9,23	6.060.033,63	4,94	5.462.057.088,14	0,11
BRAM	BRASESCO	BRASESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,02	0,05	1,04	7,48	510.617,08	0,42	10.276.254.687,90	0,00
BB	BB	BB PREV IRF-M 1+	5,07	0,19	0,81	12,07	1.890.833,09	1,54	339.500.701,57	0,56
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,37	0,12	0,90	8,55	72.101.595,40	58,83		

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	0,02	0,05	0,98	7,02	5.275.456,68	4,30	3.542.574.797,77	0,15
BRAM	BRASESCO	BRASESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,34	0,12	0,95	7,95	321.266,37	0,26	946.252.745,21	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,08	0,05	1,15	7,72	21.369.861,87	17,44	5.833.199.134,59	0,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,06	0,06	1,18	7,79	1.656.102,04	1,35	8.447.360.930,23	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,61	0,10	1,00	8,84	4.464.474,24	3,64	759.378.428,92	0,59
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,32	0,06	1,10	7,78	33.087.161,20	27,00		
Renda Fixa			1,72	0,10	0,96	8,27	105.188.756,60	85,83		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

6,68%

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 CONSUMO FIC	28,18	0,94	2,08	9,90	906.507,94	0,74	126.847.411,24	0,71
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21,14	1,51	3,45	10,18	2.320.690,72	1,89	815.496.559,66	0,28
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	23,02	0,82	1,24	20,13	1.857.885,53	1,52	217.577.112,88	0,85
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	20,70	1,43	3,16	10,71	981.011,26	0,80	437.413.506,86	0,22
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	20,64	0,84	2,64	8,36	251.053,79	0,20	483.820.683,81	0,05
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	17,72	0,13	3,28	20,19	1.016.725,81	0,83	1.266.206.469,70	0,08
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	21,75	1,59	4,53	7,41	855.132,73	0,70	877.152.038,75	0,10
Sub-total Artigo 8º I			17,17	1,10	2,82	16,32	8.189.007,78	6,68		
Renda Variável			17,17	1,10	2,82	16,32	8.189.007,78	6,68		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,20%

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				
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIA BDR NÍVEL I	20,87	0,08	1,35	7,86	20.837,24	0,02	114.759.833,18	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	22,96	0,17	2,12	16,95	737.051,33	0,60	2.066.727.306,72	0,04
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	21,37	0,13	2,12	9,42	718.496,37	0,59	657.045.723,31	0,11
Sub-total Artigo 9º III			19,69	0,15	2,11	14,86	1.476.384,94	1,20		
Investimentos no Exterior			19,69	0,15	2,11	14,86	1.476.384,94	1,20		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

6,28%

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	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	4,25	0,35	1,48	8,24	208.098,02	0,17	1.577.035.964,16	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	0,46	0,05	0,99	7,62	762.433,94	0,62	1.628.550.372,57	0,05
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	1,37	0,15	1,00	7,63	1.970.451,44	1,61	130.645.354,54	1,51
BRAM	BRABESCO	BRABESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA	18,79	0,10	3,60	24,10	500.884,67	0,41	667.173.742,50	0,08
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	18,78	0,11	3,64	24,55	4.255.033,46	3,47	1.655.052.227,35	0,26
Sub-total Artigo 10º I			10,66	0,12	2,63	17,18	7.696.901,53	6,28		
Investimentos Estruturados			10,66	0,12	2,63	17,18	7.696.901,53	6,28		
Total			3,22	0,17	1,20	9,19	122.551.050,85	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	336.435,52
Sub-total Disponibilidades Financeiras	336.435,52
Total	122.887.486,37

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	72.101.595,40	58,83	0,00	29,51	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	33.087.161,20	27,00	0,00	15,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	105.188.756,60	85,83					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	8.189.007,78	6,68	0,00	0,49	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	8.189.007,78	6,68					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	1.476.384,94	1,20	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	1.476.384,94	1,20					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	7.696.901,53	6,28	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	7.696.901,53	6,28					15,00
Total		122.551.050,85	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,90 84,24	8,55 111,88	3,44 104,09	7,33 113,73	12,09 88,97	641.709,73	4.946.938,99
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,10 102,63	7,78 101,79	3,60 109,09	6,63 102,83	13,61 100,18	356.477,58	2.293.021,58
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	2,82 -0,45	16,32 5,19	16,98 0,22	12,02 4,51	16,18 -2,02	224.454,95	1.143.443,75
Artigo 9º III % do CDI	2,11 196,37	14,86 194,56	7,57 229,32	9,77 151,56	10,10 74,39	30.438,21	229.141,08
Artigo 10º I % do CDI	2,63 244,87	17,18 224,87	8,69 263,08	12,69 196,98	17,42 128,23	196.876,64	1.081.203,61
PATO BRANCO CONSOLIDADO (Total)						1.449.957,11	9.693.749,01

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+	1.875.695,25	0,00	0,00	0,00	1.890.833,09	15.137,84	159.461,89
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	8.085.505,19	0,00	0,00	0,00	8.149.103,33	63.598,14	714.575,67
BB PREV RF IDKA2	11.652.051,83	0,00	0,00	0,00	11.761.965,97	109.914,14	825.663,93
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	13.744.531,68	0,00	0,00	0,00	13.875.124,34	130.592,66	943.482,70
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	396.520,51	0,00	0,00	0,00	399.252,17	2.731,66	15.424,12
BB PREV RF IRF M	5.749.558,42	0,00	0,00	0,00	5.794.387,59	44.829,17	304.065,10
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI	387.471,92	0,00	0,00	0,00	390.645,00	3.173,08	6.816,95
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	392.200,84	0,00	0,00	0,00	395.000,58	2.799,74	11.172,53
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	505.385,93	0,00	0,00	0,00	510.617,08	5.231,15	35.520,07
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	18.428.817,51	0,00	0,00	0,00	18.604.185,08	175.367,57	1.184.853,29
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	746.247,07	735.757,87	0,00	0,00	1.493.730,81	11.725,87	22.215,07
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.500.667,61	41.692,29	0,00	0,00	1.554.638,68	12.278,78	105.789,81
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.211.387,90	0,00	0,00	0,00	1.222.078,05	10.690,15	80.506,34
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	6.006.393,85	0,00	0,00	0,00	6.060.033,63	53.639,78	504.915,69

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					72.101.595,40	641.709,73	

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	3.529.692,02	3.118.152,35	-1.420.176,64	0,00	5.275.456,68	47.788,95	279.186,38
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1.636.735,00	0,00	0,00	0,00	1.656.102,04	19.367,04	119.734,40
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	318.249,90	0,00	0,00	0,00	321.266,37	3.016,47	23.665,26
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	21.127.556,88	0,00	0,00	0,00	21.369.861,87	242.304,99	1.507.982,67
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	4.420.474,11	0,00	0,00	0,00	4.464.474,24	44.000,13	362.452,87
					33.087.161,20	356.477,58	

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	984.397,06	0,00	0,00	0,00	1.016.725,81	32.328,75	352.527,00
BB AÇÕES CONSUMO FIC	888.001,53	0,00	0,00	0,00	906.507,94	18.506,41	81.673,92
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	2.243.386,18	0,00	0,00	0,00	2.320.690,72	77.304,54	204.109,04
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	818.063,22	0,00	0,00	0,00	855.132,73	37.069,51	58.957,89
BRADESCO F I A SELECTION	244.600,57	0,00	0,00	0,00	251.053,79	6.453,22	19.362,09
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	950.994,16	0,00	0,00	0,00	981.011,26	30.017,10	94.873,82
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	1.835.110,11	0,00	0,00	0,00	1.857.885,53	22.775,42	311.317,51
					8.189.007,78	224.454,95	

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	703.607,28	0,00	0,00	0,00	718.496,37	14.889,09	61.852,13
BRADESCO INSTITUCIONAL FIA BDR NÍVEL I	20.559,38	0,00	0,00	0,00	20.837,24	277,86	1.518,98
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	721.780,07	0,00	0,00	0,00	737.051,33	15.271,26	106.840,73
					1.476.384,94	30.438,21	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	1.950.946,67	0,00	0,00	0,00	1.970.451,44	19.504,77	139.635,29
BRADESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA	483.486,31	0,00	0,00	0,00	500.884,67	17.398,36	97.279,58
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.105.580,46	0,00	0,00	0,00	4.255.033,46	149.453,00	774.467,92
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	754.942,13	0,00	0,00	0,00	762.433,94	7.491,81	53.984,42
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	205.069,32	0,00	0,00	0,00	208.098,02	3.028,70	15.836,40
					7.696.901,53	196.876,64	

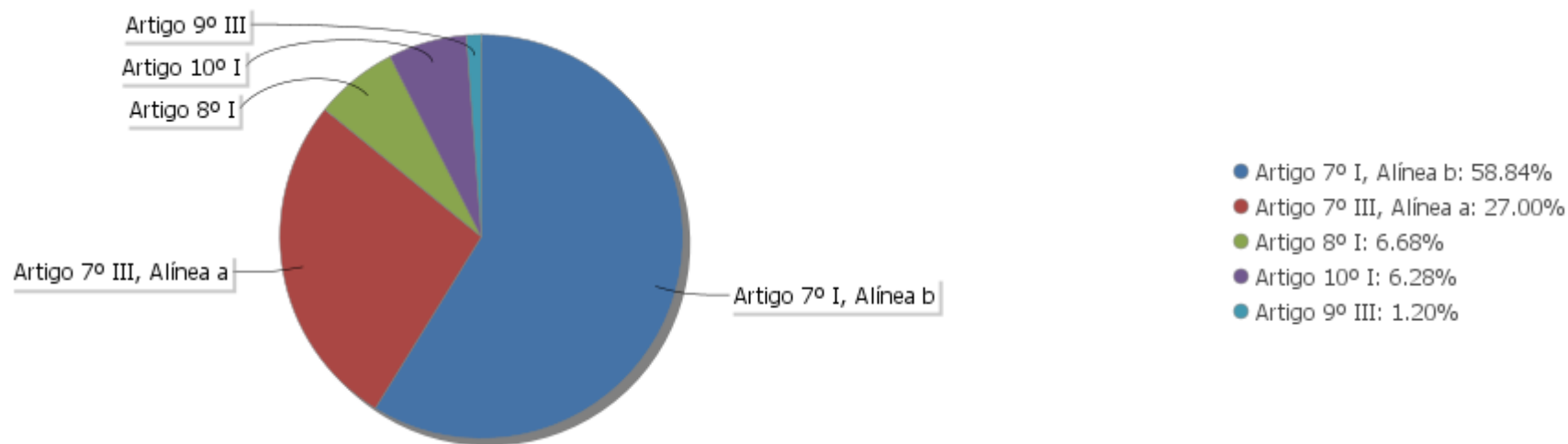
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

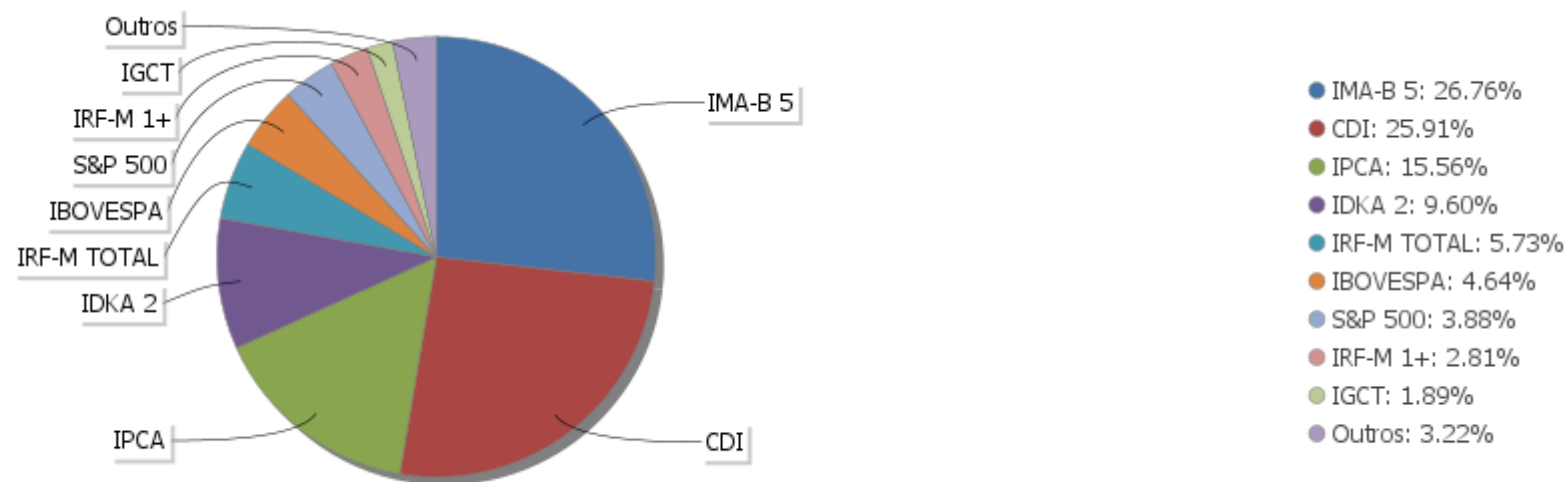
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	121.765.405,27	99,36	121.765.405,27	99,36	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	121.765.405,27	99,36	
acima de 365 dias	785.645,58	0,64	122.551.050,85	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

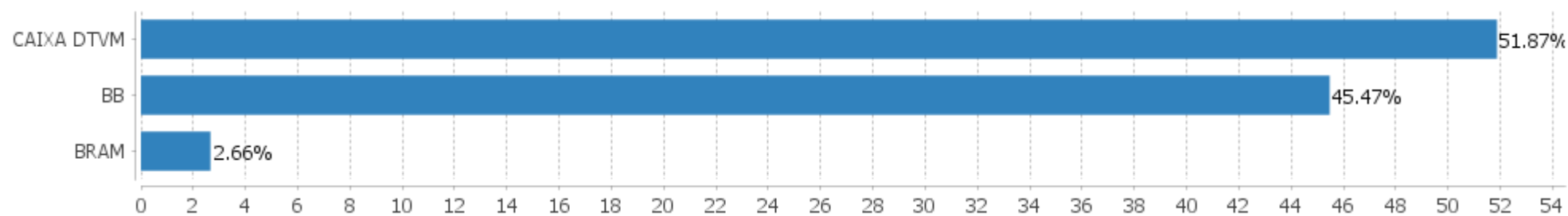


Alocação Por Estratégia



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
2023	1,67	0,15	1,31	1,08	1,45	2,00	1,20						9,19
IPCA + 4,94%	0,95	1,19	1,15	0,96	0,65	0,32	0,52						5,89
p.p. indexador	0,72	-1,04	0,15	0,13	0,79	1,68	0,68						3,30
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

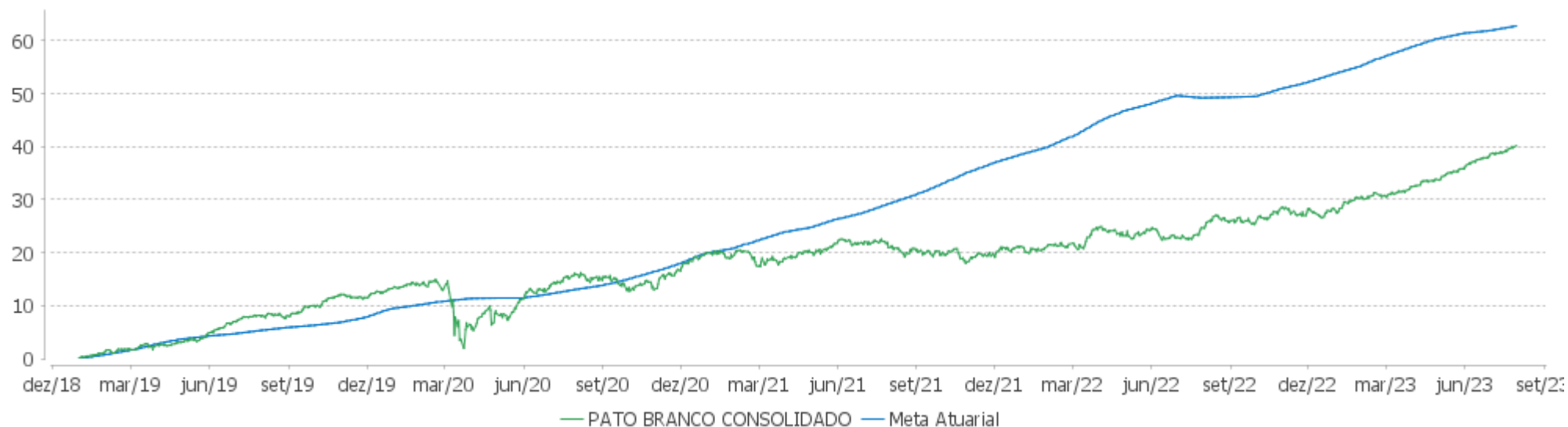
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	26	47,27	03 meses	4,72	1,51	3,22	1,78
Meses abaixo - Meta Atuarial	29	52,73	06 meses	7,40	4,89	2,51	2,10
			12 meses	12,44	9,10	3,34	3,22
			24 meses	15,90	26,23	-10,33	3,80
			36 meses	20,96	45,25	-24,30	4,23
			48 meses	29,85	57,46	-27,61	6,09
			Desde 31/12/2018	40,19	66,81	-26,62	5,75

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

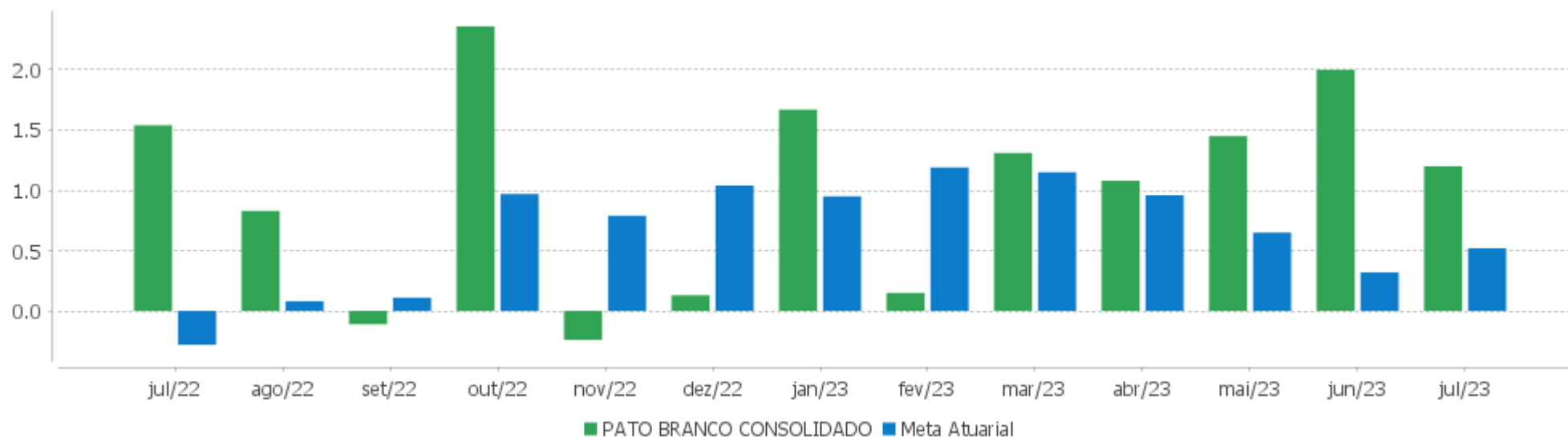


Patrimônio Líquido



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.	0,95 -0,02	8,02 -0,06	2,64 0,02	6,56 -0,04	11,20 -0,09	22,15 -0,32	27,97 -0,69
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,82 0,29	10,10 4,17	3,35 1,83	8,80 3,88	12,42 3,25		
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA % do CDI	1,04 96,56	7,48 97,86	3,25 98,46	6,31 97,87	13,31 97,97	23,70 97,74	26,29 96,38
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,95 -0,02	8,01 -0,08	2,61 -0,01	6,54 -0,05	11,09 -0,19	21,88 -0,59	27,72 -0,94
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,88 -0,00	10,52 -0,07	5,26 -0,03	9,56 -0,12	16,33 -0,10	20,12 -0,29	18,16 -0,57
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	0,74 0,01	15,32 -0,43	8,20 -0,22	16,81 -0,41	18,84 -0,54	14,41 -1,12	14,63 -1,30
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	0,80 -0,02	12,14 -0,19	6,40 -0,04	11,33 -0,20	17,85 -0,50	18,64 -0,91	14,36 -1,19
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,94 -0,04	7,57 -0,27	2,37 0,11	6,04 -0,26	10,71 0,16	21,24 -0,49	28,04 -0,84
BB PREV IRF-M 1+ Var. IRF-M 1+ p.p.	0,81 -0,01	12,07 -0,26	6,39 -0,04	11,32 -0,20	17,79 -0,57	18,65 -0,90	14,25 -1,30
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,89 0,77	9,23 6,23	4,88 4,61	8,11 5,66	14,71 10,72	20,86 6,40	21,94 -2,81
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,79 0,67	9,61 6,62	4,54 4,27	8,91 6,45	14,14 10,15	21,06 6,59	22,46 -2,30
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,78 -0,11	10,30 -0,29	5,13 -0,17	9,40 -0,27	15,98 -0,46	19,65 -0,76	17,62 -1,10
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI Var. IPCA p.p.	0,71 0,59	12,57 9,57	5,83 5,56	12,25 9,80	15,21 11,22		
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	0,69 -0,04	15,45 -0,29	8,30 -0,12	16,93 -0,29	18,90 -0,48	14,69 -0,85	14,67 -1,25
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,95 -0,03	7,95 -0,13	2,60 -0,02	6,50 -0,10	10,99 -0,30	21,51 -0,96	26,56 -2,10
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,18 110,38	7,79 102,00	3,52 106,48	6,59 102,28	13,99 103,01	25,52 105,22	28,71 105,28
BB PREV RF FLUXO FIC	0,98	7,02	3,06	5,93	12,47	21,74	23,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	91,73	91,90	92,50	91,96	91,82	89,64	85,51
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	1,15	7,72	3,59	6,55	13,76	24,97	27,99
% do CDI	106,99	101,10	108,60	101,68	101,29	102,95	102,61
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,00	8,84	4,42	7,78	14,17	21,28	22,15
Var. IPCA p.p.	0,88	5,84	4,15	5,32	10,18	6,81	-2,61
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	1,24	20,13	17,02	15,50	20,49	17,40	28,85
Var. IBOVESPA p.p.	-2,02	9,00	0,25	7,99	2,28	17,28	10,36
BRADESCO F I A SELECTION	2,64	8,36	17,40	4,26	15,00	-4,88	10,97
Var. IBOVESPA p.p.	-0,63	-2,77	0,63	-3,24	-3,20	-5,00	-7,52
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	3,16	10,71	16,36	7,17	17,88	-0,08	17,93
Var. IBOVESPA p.p.	-0,11	-0,42	-0,41	-0,33	-0,32	-0,20	-0,56
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	3,28	20,19	10,09	13,47	15,98	14,96	54,07
Var. IBOVESPA p.p.	0,02	9,06	-6,68	5,96	-2,22	14,84	35,58
BB AÇÕES CONSUMO FIC	2,08	9,90	25,97	6,54	-0,99	-39,56	-38,88
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,14	-0,88	0,28	-1,06	-1,73	-1,97	-3,12
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	3,45	10,18	17,22	6,33	15,96	-4,59	14,08
Var. IGCT p.p.	-0,07	-1,11	-0,39	-1,08	-1,77	-2,30	-3,94
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	4,53	7,41	14,49	0,67	6,35	-22,27	-7,62
Var. IBOVESPA p.p.	1,27	-3,72	-2,28	-6,83	-11,85	-22,39	-26,12
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2,12	16,95	8,55	12,11	7,35	-4,52	24,72
Var. Global BDRX p.p.	-0,01	-0,64	-0,13	-0,55	-1,22	-1,52	-4,48
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	2,12	9,42	6,67	7,40	3,63	-5,70	20,69
Var. IBOVESPA p.p.	-1,15	-1,71	-10,09	-0,11	-14,58	-5,81	2,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FIA BDR NÍVEL I	1,35	7,86	4,76	5,97	1,54	-5,87	23,61
Var. MSCI ACWI p.p.	-0,53	1,72	2,40	4,56	0,21	3,73	6,86
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	1,00	7,63	2,95	6,34	12,86	20,60	23,12
% do CDI	93,26	99,83	89,18	98,43	94,66	84,95	84,78
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	0,99	7,62	3,61	6,45	13,69	25,44	27,81
% do CDI	92,57	99,74	109,39	100,13	100,79	104,91	101,96
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP	1,48	8,24	5,19	6,95	14,09	18,57	25,65
% do CDI	137,77	107,81	157,24	107,82	103,69	76,56	94,05
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3,64	24,55	12,24	16,92	20,80	22,16	64,50
Var. S&P 500 p.p.	2,19	15,93	7,89	12,25	19,26	25,50	36,67
BRADESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA	3,60	24,10	12,02	16,58	20,16	20,78	62,94
Var. S&P 500 p.p.	2,15	15,49	7,66	11,91	18,63	24,12	35,11
PATO BRANCO CONSOLIDADO	1,20	9,19	4,72	7,40	12,44	15,90	20,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 4,92% p.p.	0,68	3,30	3,22	2,51	3,34	-10,11	-23,11
CDI	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27
IBOVESPA	3,27	11,13	16,77	7,50	18,20	0,12	18,49
INPC + 6,00%	0,40	6,09	1,66	5,07	9,71	28,04	49,03
IPCA + 6,00%	0,61	6,51	1,76	5,41	10,21	28,55	48,45

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 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 base no 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 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 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 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 PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS	D+0	D+0	D+0	D+0		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
VÉRTICE 2030 FI						
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
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 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
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
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+0	A taxa de performance será apurada e provisionada diariamente, devendo ser paga à ADMINISTRADORA semestralmente, por período vencido, no primeiro dia útil do mês subsequente a cada semestre civil	0,70
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	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
RF						
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	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	1,07	7,81	3,44	6,64	13,84	23,07	25,52	32,43	42,08
IRF-M 1+	0,82	12,33	6,44	11,52	18,36	19,55	15,56	29,44	53,47
IRF-M TOTAL	0,89	10,59	5,29	9,67	16,44	20,41	18,73	30,37	50,29
IMA-B 5	0,97	8,08	2,62	6,60	11,29	22,46	28,66	40,02	59,74
IMA-B 5+	0,73	15,74	8,42	17,22	19,37	15,53	15,93	24,98	73,16
IMA-B TOTAL	0,81	12,27	5,83	12,27	15,46	19,21	22,22	32,19	68,50
IMA-GERAL TOTAL	0,98	9,70	4,55	8,94	14,59	21,41	23,44	32,48	52,87
IDKA 2	0,98	7,84	2,26	6,31	10,55	21,73	28,89	40,07	57,72
IDKA 20	0,76	23,26	14,33	29,18	28,75	8,83	7,52	12,84	82,11
CDI	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27	32,66	41,08

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,27	11,13	16,77	7,50	18,20	0,12	18,49	19,77	53,93
IBRX 100	3,32	10,13	16,52	6,40	16,39	-2,60	17,59	20,13	57,20
IBRX 50	3,70	8,84	16,09	5,28	16,73	-1,88	19,92	20,20	51,93
SMALL CAP	3,12	16,80	26,65	13,48	17,47	-20,79	-4,84	2,63	47,75
Índice Consumo - ICON	2,22	10,79	25,68	7,60	0,74	-37,60	-35,76	-27,95	-0,79
Índice Dividendos - IDIV	2,84	12,41	12,81	6,16	18,72	18,15	34,93	39,66	97,67

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	1,45	8,61	4,36	4,67	1,54	-3,34	27,84	93,91	105,76

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,33	11,51	11,86	13,33	13,61	13,21	16,98	20,22	48,40

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	1,88	6,14	2,36	1,41	1,33	-9,61	16,75	69,84	71,77

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,12	2,99	0,27	2,45	3,99	14,46	24,76	27,64	31,75
INPC	-0,09	2,59	0,17	2,13	3,53	14,01	25,24	28,62	32,68
IGPM	-0,72	-5,15	-4,43	-5,35	-7,72	1,58	35,94	48,54	58,04
SELIC	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27	32,66	41,08

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,45	5,34	1,27	4,43	8,14	23,77	40,25	49,25	60,17
IPCA + 5,00%	0,53	5,93	1,52	4,92	9,17	26,15	44,31	55,05	67,99
IPCA + 5,50%	0,57	6,22	1,64	5,16	9,69	27,35	46,37	58,02	72,01
IPCA + 5,89%	0,60	6,44	1,74	5,35	10,09	28,29	47,99	60,36	75,20
IPCA + 6,00%	0,61	6,51	1,76	5,41	10,21	28,55	48,45	61,03	76,11
INPC + 4,00%	0,24	4,94	1,17	4,10	7,65	23,27	40,79	50,39	61,30
INPC + 6,00%	0,40	6,09	1,66	5,07	9,71	28,04	49,03	62,26	77,35

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
616	03/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.549,71	3.707,67981000	2,5756566070
606	04/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.183,26	0,00	1.235,33609800	2,5768371900
617	04/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4,14	1,60662100	2,5768371900
603	06/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.183,26	1.234,19816500	2,5792130390
613	06/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.183,26	0,00	1.093,30603000	2,9115910000
615	06/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	49.996,70	0,00	19.384,47861500	2,5792130390
611	07/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	16.841,36	0,00	6.526,59294200	2,5804213850
618	07/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	23.846,77	9.241,42472900	2,5804213850
607	14/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	38.509,03	0,00	14.889,56475500	2,5863099850
604	18/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.009.622,00	0,00	1.162.599,95675600	2,5886995630
605	20/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	38.509,03	14.861,70249500	2,5911587190
619	20/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3,30	1,27356200	2,5911587190
614	21/07/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	735.757,87	0,00	238.759,16977900	3,0815900000
612	21/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	38.509,03	0,00	13.156,16083200	2,9270720000
610	24/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	201,50	77,69191100	2,5935775870
608	24/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	22.970,62	8.856,73138000	2,5935775870
620	24/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.353,30	1.678,49229600	2,5935775870
609	31/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.317.227,60	506.680,21224900	2,5997218130
621	31/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	327,41	125,94039800	2,5997218130
Total			3.895.602,51	1.420.176,64		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.121.038,08

Value-At-Risk: 0,91%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PATO BRANCO CONSOLIDADO		0,91	0,91			122.551.050,85	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,60%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI		1,34	0,00	1,33			390.645,00	0,32
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		0,71	0,03	0,71			8.149.103,33	6,65
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI		1,77	0,00	1,77			395.000,58	0,32
BB PREV RF IRF M		1,18	0,04	0,07			5.794.387,59	4,73
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,77	0,07	0,03			18.604.185,08	15,18
BB PREV RF IDKA2		0,77	0,04	0,19			11.761.965,97	9,60
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,48	0,01	0,06			399.252,17	0,33
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,53	0,02	0,06			1.493.730,81	1,22
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		1,74	0,01	0,03			1.554.638,68	1,27
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,18	0,01	0,02			1.222.078,05	1,00
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		0,79	0,06	0,03			13.875.124,34	11,32
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,80	0,02	0,82			6.060.033,63	4,94
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA		0,01	0,00	0,01			510.617,08	0,42
BB PREV IRF-M 1+		1,75	0,02	0,03			1.890.833,09	1,54
Sub-total	1,65	0,83	0,34		-0,10	0,90	72.101.595,40	58,83

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	0,00	0,01			5.275.456,68	4,30

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5		0,77	0,00	0,03			321.266,37	0,26
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,04	0,00	0,04			21.369.861,87	17,44
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,03			1.656.102,04	1,35
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,48	0,01	0,50			4.464.474,24	3,64
Sub-total	0,22	0,09	0,01		0,13	1,10	33.087.161,20	27,00

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,80%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		11,47	0,07	0,59			906.507,94	0,74
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		8,65	0,13	0,41			2.320.690,72	1,89
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA		8,44	0,10	3,65			1.857.885,53	1,52
FIA CAIXA BRASIL IBOVESA		8,73	0,06	0,17			981.011,26	0,80
BRADESCO F I A SELECTION		7,85	0,01	2,77			251.053,79	0,20
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA		5,89	0,02	9,60			1.016.725,81	0,83
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI		9,34	0,05	1,99			855.132,73	0,70
Sub-total	14,19	7,80	0,44		0,12	2,82	8.189.007,78	6,68

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,88%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP		1,49	0,00	1,49			208.098,02	0,17
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP		0,17	0,00	0,17			762.433,94	0,62
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI		0,61	0,01	0,61			1.970.451,44	1,61
BRADESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA		6,19	0,01	5,24			500.884,67	0,41
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,20	0,10	5,26			4.255.033,46	3,47
Sub-total	5,05	3,88	0,12		0,31	2,63	7.696.901,53	6,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,45%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO INSTITUCIONAL FIA BDR NÍVEL I		6,02	-0,00	4,17			20.837,24	0,02
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,85	0,00	0,55			737.051,33	0,60
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I		6,26	-0,00	11,48			718.496,37	0,59
Sub-total	11,09	6,45	0,00		0,09	2,11	1.476.384,94	1,20