



PATO BRANCO CONSOLIDADO
JULHO 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 31.07.2024.

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	80,29%
------------	--------

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+	3,62	0,30	1,51	1,43	3.302.243,74	2,03	302.563.150,26	1,09
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,60	0,09	1,04	4,91	10.588.939,22	6,51	6.518.185.291,57	0,16
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,74	0,09	0,89	4,12	15.452.406,80	9,50	4.921.617.196,95	0,31
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	6,20	0,48	3,20	-2,18	2.205.691,43	1,36	1.220.483.112,09	0,18
BB	BB	BB PREV RF IRF M	2,57	0,22	1,32	2,70	7.474.951,49	4,59	3.693.985.248,16	0,20
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI	2,73	0,13	0,90	2,89	391.858,96	0,24	1.269.402.732,93	0,03
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,75	0,09	0,76	3,90	12.815.642,54	7,88	5.421.914.339,44	0,24
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	4,06	0,24	1,76	0,91	387.920,00	0,24	957.317.490,43	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,73	0,09	0,89	4,13	21.464.095,16	13,19	7.242.310.243,82	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,13	0,48	3,20	-2,04	5.400.372,30	3,32	1.166.611.040,66	0,46
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,60	0,31	1,54	1,62	2.946.828,77	1,81	932.577.821,18	0,32
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,57	0,22	1,33	2,71	2.528.347,67	1,55	1.777.075.206,22	0,14
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,33	0,08	0,96	3,35	7.309.405,14	4,49	4.733.163.653,12	0,15
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,99	0,15	1,18	3,24	92.268.703,22	56,72		

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	0,06	0,04	0,82	5,56	5.711.281,15	3,51	3.802.123.463,62	0,15
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,10	0,05	1,00	6,74	2.779.715,13	1,71	12.128.254.135,40	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,11	0,04	0,96	6,25	24.699.095,60	15,18	5.517.362.915,13	0,45
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,91	0,03	0,86	4,69	5.167.539,62	3,18	679.812.650,50	0,76
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,19	0,04	0,93	5,93	38.357.631,50	23,58		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

1,44

0,12

1,11

4,01

130.626.334,72

80,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL

6,02%

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	11,50	1,75	1,46	17,93	5.056.258,59	3,11	1.442.743.838,13	0,35
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	20,40	0,27	1,69	-12,63	762.861,83	0,47	79.557.281,31	0,96
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	13,78	1,12	3,36	-9,71	841.721,75	0,52	711.686.146,83	0,12
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	14,63	1,34	4,15	-9,73	235.295,55	0,14	310.051.057,29	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	12,86	1,18	2,95	-4,96	1.025.258,26	0,63	296.036.389,06	0,35
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	14,70	1,73	4,00	-7,46	1.874.176,07	1,15	190.164.207,65	0,99
Sub-total Artigo 8º I			12,48	1,51	2,41	-3,80	9.795.572,05	6,02		
Renda Variável			12,48	1,51	2,41	-3,80	9.795.572,05	6,02		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,39%

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	14,61	3,83	-0,58	28,78	5.028.478,17	3,09	875.073.419,71	0,57
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIA BDR NÍVEL I	12,99	2,83	1,93	35,06	1.193.804,41	0,73	192.426.703,53	0,62
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	14,92	4,01	0,51	40,23	4.170.079,02	2,56	2.714.087.550,41	0,15
Sub-total Artigo 9º III			14,40	3,79	0,20	34,63	10.392.361,60	6,39		
Investimentos no Exterior			14,40	3,79	0,20	34,63	10.392.361,60	6,39		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,30%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	1,88	0,00	1,34	3,56	0,00	0,00	105.064.401,49	0,00
BRAM	BRADERCO	BRADERCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA	11,51	1,48	1,33	17,94	1.873.851,53	1,15	851.289.722,60	0,22
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11,52	1,48	1,38	18,31	9.998.144,98	6,15	1.927.124.130,10	0,52
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	0,40	0,00	0,25	4,53	0,00	0,00	1.003.261.487,48	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCAAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,20	0,00	1,21	3,13	0,00	0,00	1.259.936.928,71	0,00
Sub-total Artigo 10º I			8,23	1,48	1,01	13,70	11.871.996,51	7,30		
Investimentos Estruturados			8,23	1,48	1,01	13,70	11.871.996,51	7,30		
Total			2,21	0,52	1,12	5,10	162.686.264,88	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	757,80
Sub-total Disponibilidades Financeiras	757,80
Total	162.687.022,68

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	92.268.703,22	56,72	0,00	64,51	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	38.357.631,50	23,58	0,00	15,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	130.626.334,72	80,29					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	9.795.572,05	6,02	0,00	0,49	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	9.795.572,05	6,02					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	10.392.361,60	6,39	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	10.392.361,60	6,39					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	11.871.996,51	7,30	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	11.871.996,51	7,30					15,00
Total		162.686.264,88	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	1,18 129,61	3,24 52,47	2,09 82,11	2,73 53,00	7,59 65,96	1.072.236,70	2.905.975,17
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,93 102,47	5,93 95,95	2,50 98,12	4,91 95,15	11,14 96,75	353.405,21	2.137.793,45
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	2,41 -0,61	-3,80 1,07	2,47 1,10	0,25 0,33	3,16 -1,52	184.897,55	-333.957,05
Artigo 9º III % do CDI	0,20 22,37	34,63 560,70	18,57 728,38	28,93 560,65	43,65 379,22	-8.460,87	1.448.926,43
Artigo 10º I % do CDI	1,01 111,31	13,70 221,90	8,12 318,40	12,22 236,77	20,52 178,30	167.783,61	1.504.359,00
PATO BRANCO CONSOLIDADO (Total)						1.769.862,20	7.663.097,00

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+	3.253.254,81	0,00	0,00	0,00	3.302.243,74	48.988,93	46.605,88
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	10.480.386,81	0,00	0,00	0,00	10.588.939,22	108.552,41	494.447,47
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	15.315.557,42	0,00	0,00	0,00	15.452.406,80	136.849,38	611.013,99
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	2.137.361,22	0,00	0,00	0,00	2.205.691,43	68.330,21	-49.105,51
BB PREV RF IRF M	7.377.583,06	0,00	0,00	0,00	7.474.951,49	97.368,43	197.510,78
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI	388.347,44	0,00	0,00	0,00	391.858,96	3.511,52	11.226,90
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	12.718.522,14	0,00	0,00	0,00	12.815.642,54	97.120,40	479.946,79
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	381.212,96	0,00	0,00	0,00	387.920,00	6.707,04	3.518,34
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.274.151,96	0,00	0,00	0,00	21.464.095,16	189.943,20	849.859,00
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.233.033,11	0,00	0,00	0,00	5.400.372,30	167.339,19	-112.693,96
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.902.212,89	0,00	0,00	0,00	2.946.828,77	44.615,88	47.064,54
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.495.232,48	0,00	0,00	0,00	2.528.347,67	33.115,19	67.291,55
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	7.239.610,22	0,00	0,00	0,00	7.309.405,14	69.794,92	235.912,11
	91.196.466,52	0,00	0,00	0,00	92.268.703,22	1.072.236,70	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	5.213.580,03	3.445.716,34	-2.994.871,16	0,00	5.711.281,15	46.855,94	312.266,30
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	2.752.316,56	0,00	0,00	0,00	2.779.715,13	27.398,57	132.879,98
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	24.463.933,74	0,00	0,00	0,00	24.699.095,60	235.161,86	1.451.965,17
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	5.123.550,78	0,00	0,00	0,00	5.167.539,62	43.988,84	231.391,43
	37.553.381,11	3.445.716,34	-2.994.871,16	0,00	38.357.631,50	353.405,21	

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	3.957.089,31	1.065.139,81	0,00	0,00	5.056.258,59	34.029,47	298.640,70
BB AÇÕES CONSUMO FIC	750.215,95	0,00	0,00	0,00	762.861,83	12.645,88	-110.275,85
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	814.333,84	0,00	0,00	0,00	841.721,75	27.387,91	-90.501,68
BRADESCO F I A SELECTION	225.911,80	0,00	0,00	0,00	235.295,55	9.383,75	-25.362,11
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	995.921,44	0,00	0,00	0,00	1.025.258,26	29.336,82	-53.523,61
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	1.802.062,35	0,00	0,00	0,00	1.874.176,07	72.113,72	-151.103,92
	8.545.534,69	1.065.139,81	0,00	0,00	9.795.572,05	184.897,55	

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	4.010.618,39	1.065.139,81	0,00	0,00	5.028.478,17	-47.280,03	536.187,73
BRADESCO INSTITUCIONAL FIA BDR NÍVEL I	635.898,71	534.671,27	0,00	0,00	1.193.804,41	23.234,43	98.865,68
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	3.625.244,02	529.250,27	0,00	0,00	4.170.079,02	15.584,73	813.873,02
	8.271.761,12	2.129.061,35	0,00	0,00	10.392.361,60	-8.460,87	

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	2.102.183,06	0,00	-2.130.279,62	0,00	0,00	28.096,56	73.134,12
BRADESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA	1.325.251,85	534.671,28	0,00	0,00	1.873.851,53	13.928,40	139.486,82

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	9.347.939,02	529.250,27	0,00	0,00	9.998.144,98	120.955,69	1.248.816,66
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	831.052,63	0,00	-833.169,33	0,00	0,00	2.116,70	36.084,64
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	222.644,95	0,00	-225.331,21	0,00	0,00	2.686,26	6.836,76
	13.829.071,51	1.063.921,55	-3.188.780,16	0,00	11.871.996,51	167.783,61	

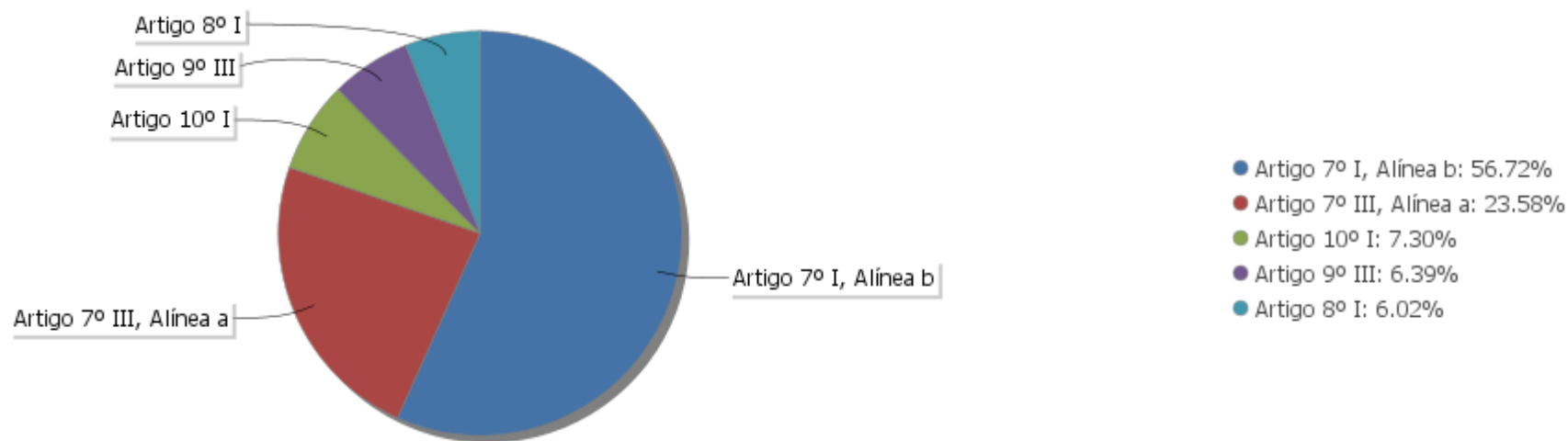
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

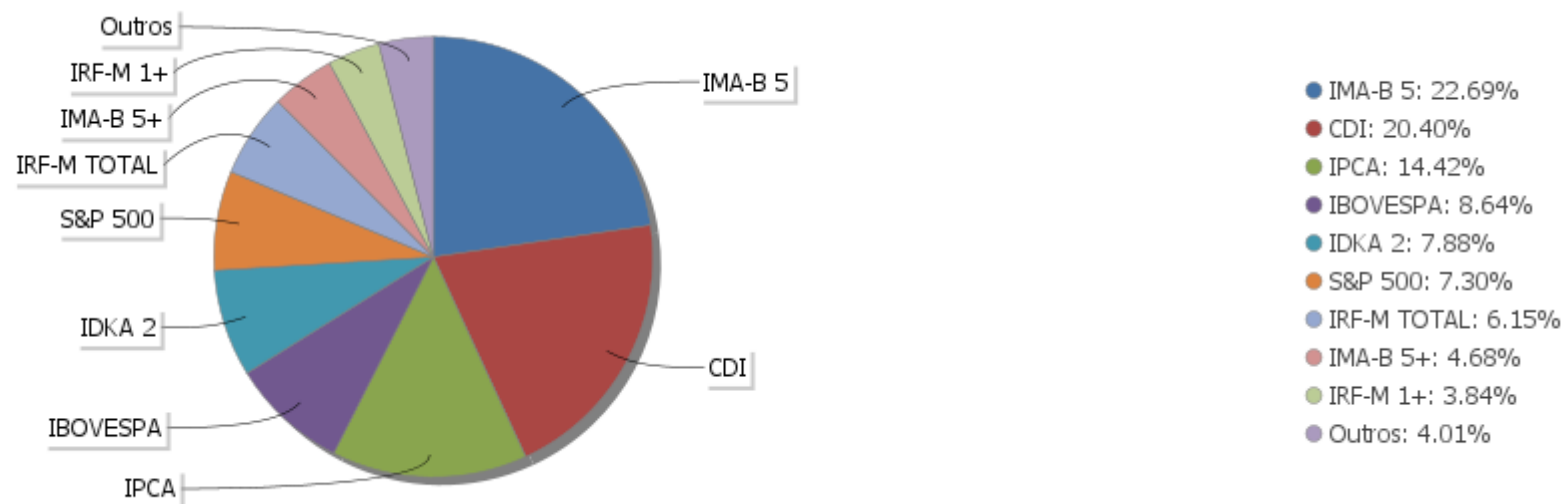
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	161.906.485,92	99,52	64,00	161.906.485,92	99,52	64,00
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	1,00	161.906.485,92	99,52	65,00
acima de 365 dias	779.778,96	0,48	35,00	162.686.264,88	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

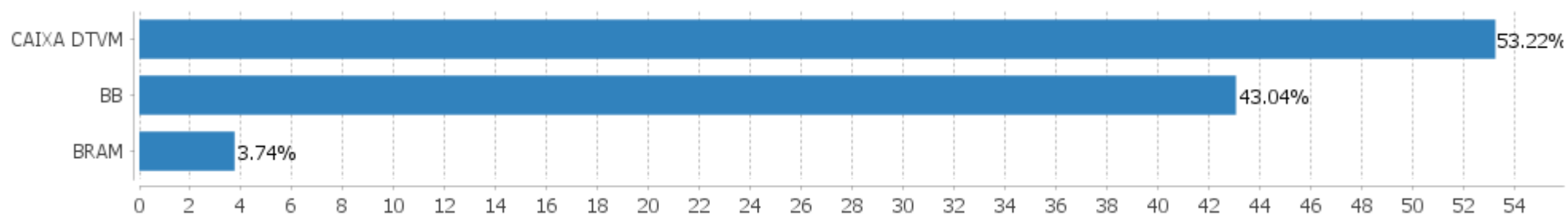


Alocação Por Estratégia



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						5,10
IPCA + 5,08%	0,86	1,21	0,55	0,82	0,88	0,60	0,84						5,89
p.p. indexador	-0,42	-0,25	0,25	-1,37	0,32	0,44	0,29						-0,79
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

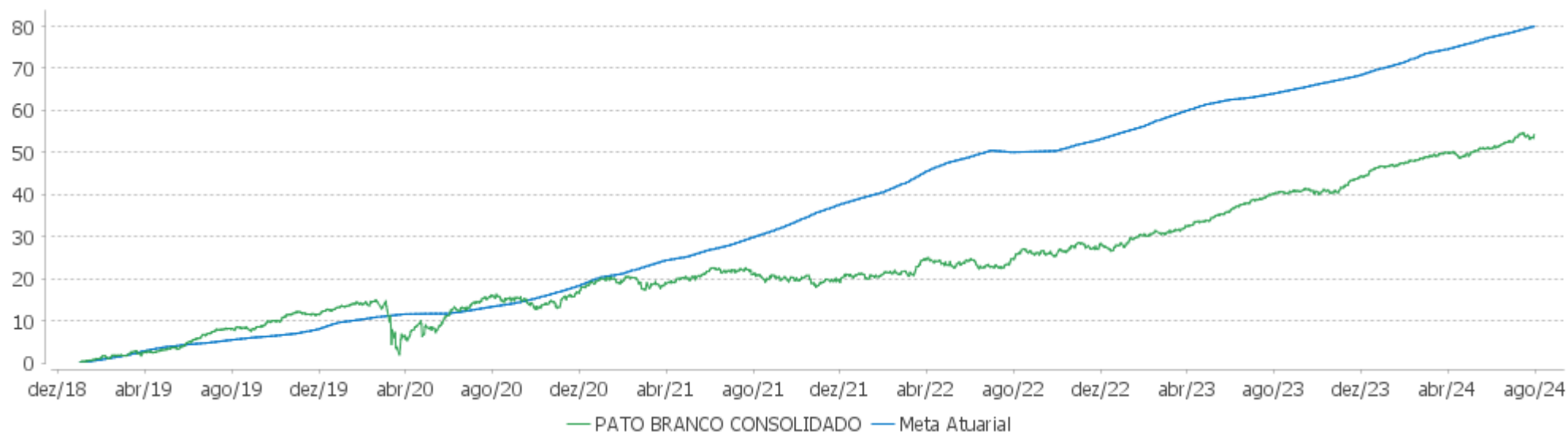
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	32	47,76	03 meses	3,40	2,33	1,06	2,32
Meses abaixo - Meta Atuarial	35	52,24	06 meses	4,64	4,99	-0,35	2,15
			12 meses	10,01	9,72	0,28	2,21
			24 meses	23,70	19,71	3,99	2,76
			36 meses	27,50	38,50	-11,00	3,36
			48 meses	33,06	59,38	-26,32	3,83
			60 meses	42,84	72,77	-29,93	5,53
			Desde 31/12/2018	54,22	83,03	-28,81	5,29

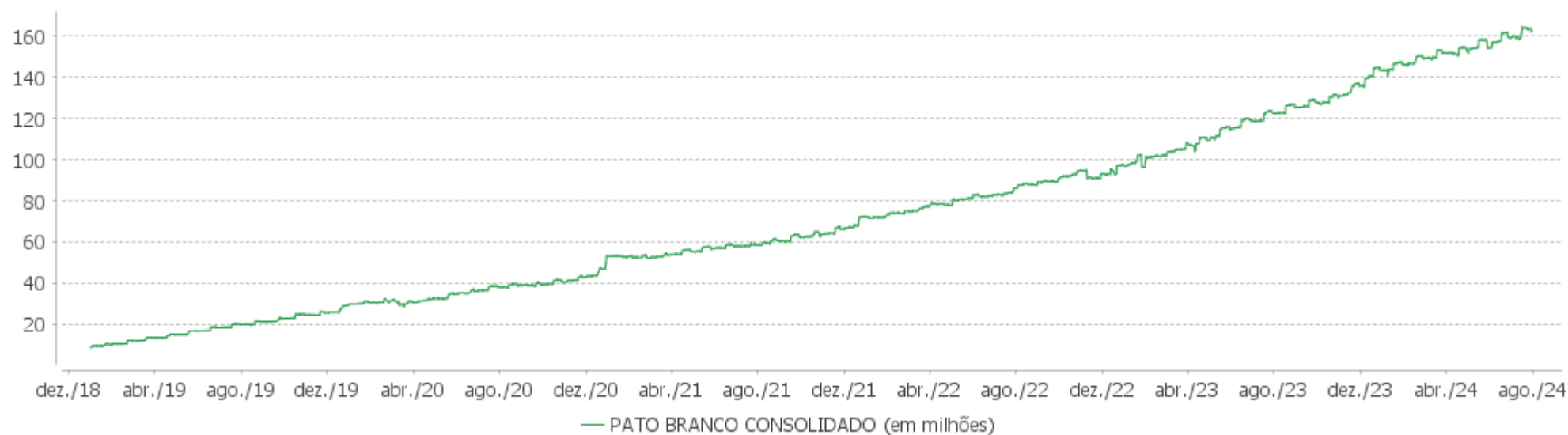
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,13	2020-11
Menor rentabilidade da Carteira	-5,97	2020-03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

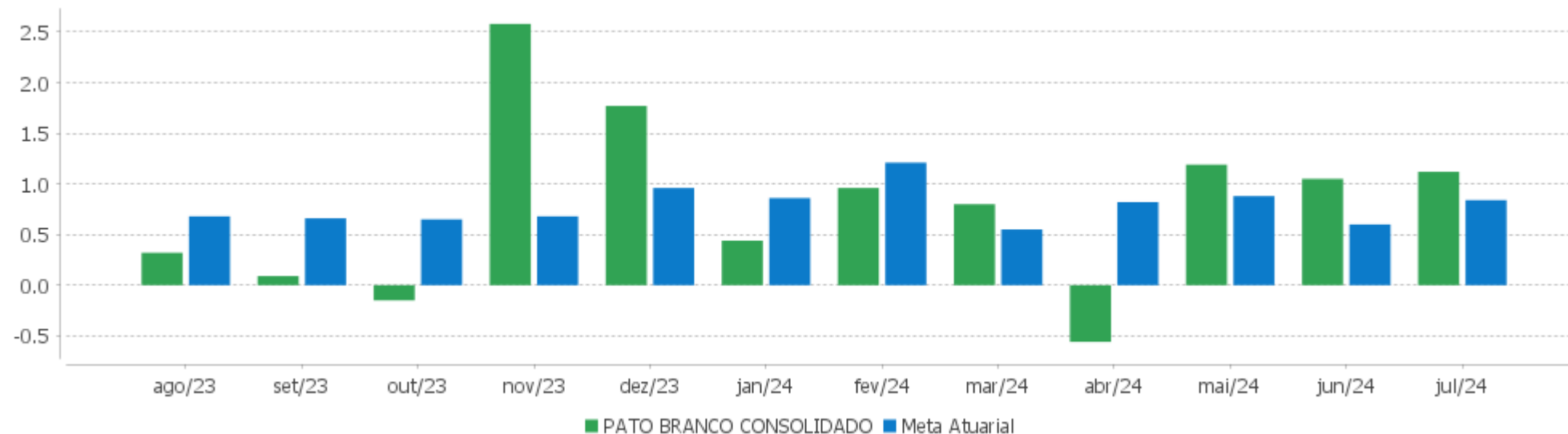


Patrimônio Líquido



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.	0,89 -0,02	4,13 -0,13	2,31 -0,06	3,45 -0,12	7,93 -0,23	20,02 -0,35	31,84 -0,63
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,90 0,08	2,89 -2,95	1,93 -0,38	2,33 -2,62	6,20 -3,50	19,39 -0,37	
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,89 -0,02	4,12 -0,14	2,31 -0,06	3,44 -0,12	7,91 -0,25	19,88 -0,49	31,52 -0,94
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,33 -0,01	2,71 -0,16	1,64 -0,06	2,03 -0,16	8,10 -0,28	25,75 -0,43	29,84 -0,65
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	3,20 -0,04	-2,04 -0,08	2,45 -0,07	-0,60 -0,09	1,00 -0,03	20,02 -0,58	15,55 -1,17
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	1,54 -0,02	1,62 -0,15	1,37 -0,07	1,03 -0,14	7,10 -0,28	26,22 -0,87	27,07 -1,31
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IDKA 2 p.p.	0,76 0,01	3,90 -0,08	2,08 0,08	3,17 0,01	7,92 -0,20	19,47 -0,05	30,83 -0,78
BB PREV IRF-M 1+ Var. IRF-M 1+ p.p.	1,51 -0,05	1,43 -0,34	1,31 -0,13	0,86 -0,31	6,85 -0,53	25,86 -1,24	26,78 -1,59
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,96 0,58	3,35 0,47	1,85 0,79	2,67 0,23	7,47 2,97	23,28 14,61	29,89 10,28
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,32 -0,02	2,70 -0,17	1,64 -0,06	2,03 -0,16	8,07 -0,30	25,34 -0,85	29,31 -1,19
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	1,04 0,66	4,91 2,04	2,15 1,10	4,03 1,59	10,06 5,56	25,62 16,95	33,23 13,62
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI Var. IPCA p.p.	1,76 1,38	0,91 -1,96	2,43 1,38	1,27 -1,18	3,57 -0,92	19,33 10,66	
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	3,20 -0,04	-2,18 -0,21	2,42 -0,10	-0,67 -0,17	0,71 -0,31	19,75 -0,85	15,51 -1,21
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,00 109,74	6,74 109,10	2,74 107,26	5,59 108,36	12,51 108,72	28,26 106,00	41,22 106,93
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,82 90,28	5,56 90,11	2,29 89,90	4,64 90,01	10,41 90,42	24,18 90,70	34,41 89,25
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,96 105,97	6,25 101,13	2,61 102,20	5,19 100,54	11,83 102,77	27,22 102,10	39,75 103,10
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,86	4,69	2,13	3,77	8,50	23,88	31,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,48	1,81	1,07	1,33	4,01	15,21	11,98
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	4,00	-7,46	0,52	-3,91	0,88	21,54	18,43
Var. IBOVESPA p.p.	0,98	-2,59	-0,85	-3,83	-3,80	-2,19	13,62
BRADESCO FIA SELECTION	4,15	-9,73	-0,20	-5,69	-6,28	7,78	-10,85
Var. IBOVESPA p.p.	1,13	-4,86	-1,57	-5,61	-10,96	-15,95	-15,66
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	2,95	-4,96	1,32	-0,24	4,51	23,20	4,43
Var. IBOVESPA p.p.	-0,08	-0,09	-0,05	-0,16	-0,17	-0,54	-0,38
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	1,46	17,93	10,77	15,99	25,13	45,13	43,85
Var. IBOVESPA p.p.	-1,57	22,80	9,39	16,07	20,45	21,40	39,05
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	3,36	-9,71	1,35	-4,78	-1,57	4,69	-23,49
Var. IBOVESPA p.p.	0,34	-4,84	-0,02	-4,70	-6,25	-19,05	-28,29
BB AÇÕES CONSUMO FIC	1,69	-12,63	0,02	-4,82	-15,85	-16,68	-49,14
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,32	-0,32	-0,37	-0,48	-0,53	-1,99	-1,98
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,51	40,23	20,99	34,11	49,78	60,78	43,02
Var. Global BDRX p.p.	0,22	-1,25	-0,40	-0,91	-2,21	-4,23	-4,42
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	-0,58	28,78	15,78	23,53	37,24	42,22	29,42
Var. IBOVESPA p.p.	-3,60	33,65	14,40	23,61	32,56	18,48	24,62
BRADESCO INSTITUCIONAL FIA BDR NÍVEL I	1,93	35,06	20,13	30,21	44,68	46,91	36,18
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,47	4,08	2,33	2,87	7,19	7,59	11,90
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	1,22	3,44	1,70	2,88	7,99	21,88	30,24
% do CDI	134,92	55,70	66,50	55,88	69,43	82,07	78,43
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	0,85	5,15	2,25	4,18	9,93	24,98	37,89
% do CDI	93,63	83,34	88,19	80,99	86,24	93,70	98,29
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP	1,34	3,26	1,85	2,74	8,42	23,69	28,55
% do CDI	147,62	52,85	72,50	53,08	73,18	88,89	74,07
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1,38	18,31	10,67	16,35	26,54	52,86	54,59
Var. S&P 500 p.p.	-1,63	-17,10	-9,39	-13,92	-17,16	6,95	15,69
BRADESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA	1,33	17,94	10,58	16,07	25,83	51,20	51,98
Var. S&P 500 p.p.	-1,68	-17,46	-9,48	-14,20	-17,87	5,29	13,08
PATO BRANCO CONSOLIDADO	1,12	5,10	3,40	4,64	10,01	23,70	27,50
Var. IPCA + 5,08% p.p.	0,29	-0,79	1,06	-0,35	0,22	3,75	-11,20
CDI	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55
IBOVESPA	3,02	-4,87	1,37	-0,08	4,68	23,74	4,80
INPC + 6,00%	0,79	6,50	2,48	5,36	10,28	20,99	41,20
IPCA + 6,00%	0,92	6,43	2,56	5,45	10,74	22,05	42,36

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 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 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	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO 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
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 RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
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	0,94	5,49	2,37	4,62	10,81	26,14	36,37	39,08	46,74
IRF-M 1+	1,55	1,77	1,44	1,17	7,38	27,10	28,37	24,09	39,00
IRF-M TOTAL	1,34	2,87	1,71	2,19	8,37	26,19	30,49	28,67	41,29
IMA-B 5	0,91	4,27	2,37	3,56	8,16	20,37	32,46	39,16	51,45
IMA-B 5+	3,24	-1,97	2,52	-0,51	1,03	20,60	16,72	17,12	26,27
IMA-B TOTAL	2,09	0,97	2,45	1,43	4,38	20,51	24,43	27,57	37,98
IMA-GERAL TOTAL	1,36	3,81	2,36	3,33	8,64	24,49	31,89	34,10	43,92
IDKA 2	0,75	3,98	2,01	3,15	8,12	19,52	31,61	39,35	51,45
IDKA 20	6,19	-6,65	2,88	-3,43	-3,72	23,96	4,78	3,52	8,64
CDI	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55	41,92	47,93

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,02	-4,87	1,37	-0,08	4,68	23,74	4,80	24,04	25,38
IBRX 100	2,90	-4,51	1,13	0,00	5,15	22,39	2,42	23,65	26,33
IBRX 50	3,15	-3,17	1,57	1,02	6,82	24,69	4,81	28,10	28,40
SMALL CAP	1,49	-13,59	-2,33	-7,53	-13,35	1,79	-31,36	-17,55	-11,07
Índice Consumo - ICON	2,01	-12,31	0,40	-4,34	-15,32	-14,69	-47,16	-45,60	-38,99
Índice Dividendos - IDIV	1,89	-1,58	2,90	2,00	11,06	31,85	31,21	49,86	55,10

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	3,01	35,40	20,06	30,27	43,70	45,91	38,90	83,71	178,66

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,52	1,61	-0,50	0,94	5,24	19,57	19,14	23,11	26,52

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,40	30,98	17,81	27,34	37,49	39,32	24,28	60,53	133,51

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,38	2,87	1,05	2,44	4,50	8,67	19,61	30,37	33,38
INPC	0,26	2,95	0,97	2,36	4,06	7,73	18,64	30,33	33,84
IGPM	0,61	1,71	2,33	1,64	3,82	-4,19	5,46	41,14	54,22
SELIC	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55	41,92	47,93

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,74	5,25	2,07	4,46	8,66	17,50	34,49	52,40	62,17
IPCA + 5,00%	0,83	5,84	2,31	4,95	9,70	19,76	38,39	58,31	70,09
IPCA + 5,50%	0,87	6,14	2,44	5,20	10,22	20,90	40,36	61,34	74,17
IPCA + 5,89%	0,91	6,37	2,53	5,39	10,63	21,79	41,92	63,72	77,40
IPCA + 6,00%	0,92	6,43	2,56	5,45	10,74	22,05	42,36	64,40	78,32
INPC + 4,00%	0,62	5,33	1,98	4,37	8,21	16,49	33,39	52,35	62,74
INPC + 6,00%	0,79	6,50	2,48	5,36	10,28	20,99	41,20	64,35	78,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
922	01/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	239,07	83,94348476	2,8479875560
900	01/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	6,66	0,00	2,33849336	2,8479875560
910	01/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	158.960,61	55.815,06480431	2,8479875560
923	02/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4,30	1,50930153	2,8489999670
901	02/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	9.701,71	0,00	3.405,30365475	2,8489999670
920	04/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	50.000,00	0,00	17.537,49871219	2,8510337090
924	08/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3,35	1,17418140	2,8530514930
903	08/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.069.342,55	374.806,60710949	2,8530514930
912	08/07/2024	BRADESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA	534.671,28	0,00	102.075,19888837	5,2380136000
916	08/07/2024	FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	0,00	833.169,33	284.502,90915958	2,9285090000
913	09/07/2024	BRADESCO INSTITUCIONAL FIA BDR NÍVEL I	534.671,27	0,00	47.303,45008429	11,3030079000
929	09/07/2024	FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP	0,00	225.331,21	49.272,87378100	4,5731290000
925	10/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	12.824,68	4.491,88366804	2,8550783920
926	11/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.580,00	553,20357980	2,8560914240
908	12/07/2024	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	0,00	2.130.279,62	1.566.344,84289457	1,3600323260
914	12/07/2024	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	529.250,27	0,00	212.339,93067912	2,4924670000
917	15/07/2024	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	529.250,27	0,00	61.388,42282234	8,6213368200
909	16/07/2024	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	1.065.139,81	0,00	476.869,47007528	2,2336087270
907	16/07/2024	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	1.065.139,81	0,00	334.596,38796020	3,1833571680
921	17/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	6,66	0,00	2,32855656	2,8601409570
902	17/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3.386.001,31	0,00	1.183.858,19472044	2,8601409570
927	24/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1,60	0,55842427	2,8652049740
911	25/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	90,26	31,49093292	2,8662218500
904	25/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	16.353,86	5.705,72023237	2,8662218500
905	30/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.252.422,64	436.496,80688753	2,8692595690
928	31/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	30.324,89	10.565,16988980	2,8702699830
906	31/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	452.723,35	157.728,48989168	2,8702699830
Total			7.703.839,05	6.183.651,32		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 2.116.225,68

Value-At-Risk: 1,30%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,66	0,83	5,00	0,43	0,12	1,10	130.626.334,72	80,29
Artigo 8º	10,96	4,62	20,00	0,25	0,14	2,41	9.795.572,05	6,02
Artigo 9º	20,11	7,40	20,00	0,26	-0,04	0,20	10.392.361,60	6,39
Artigo 10º	13,28	5,68	20,00	0,36	0,01	1,01	11.871.996,51	7,30
PATO BRANCO CONSOLIDADO		1,30		1,30			162.686.264,88	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,83%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV IRF-M 1+	4,20	2,00	0,02	0,04	0,14	1,51	3.302.243,74	2,03
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,92	0,43	0,02	0,43	0,14	1,04	10.588.939,22	6,51
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,76	1,01	0,06	0,01	-0,01	0,89	15.452.406,80	9,50
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	7,16	3,16	0,02	0,04	0,32	3,20	2.205.691,43	1,36
BB PREV RF IRF M	2,96	1,42	0,04	0,02	0,14	1,32	7.474.951,49	4,59
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI	2,86	1,65	0,00	1,65	-0,00	0,90	391.858,96	0,24
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,98	1,12	0,05	0,19	-0,07	0,76	12.815.642,54	7,88
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	4,96	2,39	0,00	2,38	0,17	1,76	387.920,00	0,24
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,76	1,01	0,08	0,01	-0,01	0,89	21.464.095,16	13,19
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,12	3,13	0,06	0,04	0,32	3,20	5.400.372,30	3,32
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,19	2,00	0,02	0,03	0,15	1,54	2.946.828,77	1,81
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,96	1,42	0,01	0,02	0,14	1,33	2.528.347,67	1,55
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,35	0,73	0,02	0,73	0,04	0,96	7.309.405,14	4,49
Sub-total	2,31	1,14	0,42		0,12	1,18	92.268.703,22	56,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	0,01	-0,00	0,01	-17,80	0,82	5.711.281,15	3,51
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11	0,04	-0,00	0,04	0,78	1,00	2.779.715,13	1,71
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,06	0,05	0,00	0,05	0,85	0,96	24.699.095,60	15,18
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,42	0,50	0,01	0,50	-0,11	0,86	5.167.539,62	3,18
Sub-total	0,09	0,10	0,01		0,26	0,93	38.357.631,50	23,58

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,68%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	2,38	NaN	0,00	NaN	0,13	1,22	0,00	0,00
BRADESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA	13,66	5,70	0,06	5,38	0,03	1,33	1.873.851,53	1,15
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,61	5,68	0,31	5,37	0,03	1,38	9.998.144,98	6,15
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	0,35	NaN	0,00	NaN	-0,17	0,85	0,00	0,00
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,59	NaN	0,00	NaN	0,12	1,34	0,00	0,00
Sub-total	13,28	5,68	0,36		0,01	1,01	11.871.996,51	7,30

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,40%

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	20,88	8,20	0,17	9,67	-0,07	-0,58	5.028.478,17	3,09
BRADESCO INSTITUCIONAL FIA BDR NÍVEL I	16,16	6,40	0,02	4,14	0,06	1,93	1.193.804,41	0,73
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	21,18	7,37	0,08	1,06	-0,02	0,51	4.170.079,02	2,56
Sub-total	20,11	7,40	0,26		-0,04	0,20	10.392.361,60	6,39

Renda Variável

Value-At-Risk: 4,62%

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	13,55	5,18	0,14	6,57	0,04	1,46	5.056.258,59	3,11
BB AÇÕES CONSUMO FIC	16,77	8,78	0,02	0,27	0,05	1,69	762.861,83	0,47
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	9,98	6,35	0,02	1,79	0,25	3,36	841.721,75	0,52
BRADESCO F I A SELECTION	12,11	7,52	0,01	3,16	0,27	4,15	235.295,55	0,14
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	9,86	5,46	0,02	0,11	0,21	2,95	1.025.258,26	0,63
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	14,74	6,83	0,04	3,04	0,21	4,00	1.874.176,07	1,15
Sub-total	10,96	4,62	0,25		0,14	2,41	9.795.572,05	6,02

(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 (%)