



COTIA
AGOSTO 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 31.08.2023.

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

RENTA FIXA

64,78%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,030000%)	2,86	0,03	0,56	0,56	42.530.101,69	4,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,685000%)	1,08	0,03	0,73	7,45	42.241.024,62	4,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,080000%)	0,41	0,04	0,77	7,71	8.909.118,80	0,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,255000%)	0,41	0,04	0,78	7,83	40.951.054,39	3,93
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,60	0,03	0,74	7,62	134.631.299,50	12,92

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,37	0,03	1,12	8,82	3.382.659,71	0,32	6.785.029.538,03	0,05
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4,72	-0,65	-0,52	11,85	10.070.259,65	0,97	418.018.599,03	2,41
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,89	-0,64	-0,40	11,65	82.047.126,12	7,88	5.260.991.740,78	1,56
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,94	-0,63	-0,37	11,72	18.073.839,10	1,73	5.279.029.725,18	0,34
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,36	0,03	1,11	8,92	29.087.751,80	2,79	7.477.458.112,25	0,39
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,24	-0,24	0,60	8,67	141.537.373,35	13,59	8.195.443.440,71	1,73
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,38	-0,19	0,74	8,36	28.567.761,14	2,74	6.160.923.946,07	0,46
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPKA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,48	-0,17	0,77	8,41	72.620.807,93	6,97	5.504.316.744,32	1,32
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,26	-0,24	0,58	8,63	11.869.868,75	1,14	5.437.581.646,17	0,22
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,93	-0,36	0,37	11,68	6.049.736,14	0,58	2.203.872.085,49	0,27
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,45	-0,19	0,63	9,92	28.955.459,80	2,78	5.643.739.686,42	0,51
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,36	-0,31	0,40	8,98	432.262.643,49	41,49		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,05	1,24	8,97	31.000.446,87	2,98	14.797.589.893,96	0,21
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,04	1,16	8,81	52.841.460,77	5,07	14.734.335.445,36	0,36
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	1,05	8,15	5.933.271,62	0,57	3.554.344.878,79	0,17
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,84	-0,15	0,65	8,87	18.186.548,46	1,75	2.919.877.676,62	0,62
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,37	0,01	1,09	8,89	107.961.727,72	10,36		
Renda Fixa			1,74	-0,19	0,58	8,77	674.855.670,71	64,78		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

17,14%

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 SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	20,60	-1,40	-4,30	3,94	6.052.784,53	0,58	1.338.682.696,87	0,45
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	18,87	-1,60	-4,18	5,62	18.161.713,09	1,74	562.805.403,27	3,23
SAFRA	SAFRA	SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	18,23	-1,53	-2,52	5,26	5.693.833,05	0,55	66.415.406,84	8,57
CAIXA DTVM	CEF	FIA BRASIL IBX-50	20,42	-1,55	-5,86	2,74	10.893.320,20	1,05	634.558.685,41	1,72
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	19,58	-1,42	-5,15	5,19	4.871.217,99	0,47	342.756.430,76	1,42
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,73	-1,60	-5,20	4,45	20.466.230,97	1,96	758.125.877,46	2,70
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	18,94	-1,94	-6,24	6,99	3.995.856,65	0,38	811.429.533,50	0,49
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	21,21	-1,70	-5,14	5,41	14.884.182,90	1,43	675.035.615,55	2,20
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,51	-1,62	-3,45	9,23	16.293.957,31	1,56	936.636.791,99	1,74
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19,06	-0,77	-4,95	-3,99	3.386.678,07	0,33	1.414.031.639,81	0,24
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	20,29	-1,68	-5,81	1,76	6.923.687,82	0,66	838.931.503,08	0,83
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	17,24	-0,02	-0,75	19,29	36.664.365,35	3,52	1.236.273.116,90	2,97
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	19,87	-1,57	-4,72	6,08	9.276.263,77	0,89	643.202.156,44	1,44
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	22,64	-2,08	-8,99	-1,85	5.755.263,99	0,55	154.290.602,67	3,73
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	20,18	-1,46	-5,67	4,61	7.498.531,14	0,72	151.582.014,92	4,95
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	22,18	-1,30	-4,22	9,08	4.468.189,46	0,43	176.964.622,29	2,52
SAFRA	SAFRA	SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	24,22	-1,54	-4,34	18,77	3.228.531,88	0,31	62.449.293,82	5,17
Sub-total Artigo 8º I			16,77	-1,27	-4,10	7,74	178.514.608,17	17,14		
Renda Variável			16,77	-1,27	-4,10	7,74	178.514.608,17	17,14		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

8,16%

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				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	22,55	1,65	2,90	20,35	54.638.049,93	5,24	2.114.296.555,90	2,58
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	20,95	1,49	3,77	13,19	30.412.769,02	2,92	732.547.750,88	4,15
Sub-total Artigo 9º III			21,64	1,59	3,21	17,63	85.050.818,95	8,16		
Investimentos no Exterior			21,64	1,59	3,21	17,63	85.050.818,95	8,16		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,92%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	18,07	-0,09	-0,96	22,95	18.238.827,51	1,75	583.410.718,64	3,13
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	18,24	-0,08	-0,92	23,40	72.676.230,92	6,98	1.616.038.532,30	4,50
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	18,19	-0,08	-0,95	23,26	12.467.885,28	1,20	1.203.059.018,22	1,04
Sub-total Artigo 10º I			18,21	-0,08	-0,93	23,31	103.382.943,71	9,92		
Investimentos Estruturados			18,21	-0,08	-0,93	23,31	103.382.943,71	9,92		
Total			4,80	-0,22	-0,21	10,50	1.041.804.041,54	100,00		

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 a	Títulos do Tesouro Nacional	134.631.299,50	12,92	0,00	35,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	432.262.643,49	41,49	0,00	30,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	107.961.727,72	10,36	0,00	11,50	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	674.855.670,71	64,78					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	178.514.608,17	17,14	0,00	3,50	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	178.514.608,17	17,14					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	85.050.818,95	8,16	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	85.050.818,95	8,16					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	103.382.943,71	9,92	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	103.382.943,71	9,92					15,00
Total		1.041.804.041,54	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 a % do CDI	0,74 64,58	7,62 85,96	1,71 51,41	5,33 79,82	10,37 76,55	937.780,21	7.002.930,22
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,40 35,09	8,98 101,28	2,63 79,18	6,31 94,50	12,08 89,15	1.603.427,60	35.012.185,97
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,09 95,66	8,89 100,29	3,31 99,83	6,83 102,34	13,37 98,64	1.317.049,19	11.788.136,48
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,10 0,99	7,74 2,27	6,59 -0,25	10,29 -0,01	5,31 -0,37	-7.630.729,52	12.830.392,32
Artigo 9º III % do CDI	3,21 281,77	17,63 198,84	5,48 165,04	12,91 193,28	12,95 95,57	2.645.354,92	12.044.482,84
Artigo 10º I % do CDI	-0,93 -81,48	23,31 262,85	9,84 296,58	17,85 267,29	23,59 174,05	-968.671,03	19.540.310,72
COTIA (Total)						-2.095.788,63	98.218.438,55

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150826 (5,030000%)	0,00	43.513.378,31	0,00	1.220.839,07	42.530.101,69	237.562,45	237.562,45
NTN-B 150830 (5,685000%)	43.151.507,25	0,00	0,00	1.220.871,64	42.241.024,62	310.389,01	3.026.772,39
NTN-B 150830 (6,080000%)	9.103.679,64	0,00	0,00	263.097,84	8.909.118,80	68.537,00	660.129,94
NTN-B 150830 (6,255000%)	41.850.634,28	0,00	0,00	1.220.871,64	40.951.054,39	321.291,75	3.078.465,44
					134.631.299,50	937.780,21	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IDKA2	28.358.128,65	0,00	0,00	0,00	28.567.761,14	209.632,49	2.204.619,65
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	40.005.921,16	42.717.396,70	0,00	0,00	82.047.126,12	-676.191,74	3.694.056,32
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	11.801.317,16	0,00	0,00	0,00	11.869.868,75	68.551,59	943.341,03
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	3.345.333,01	0,00	0,00	0,00	3.382.659,71	37.326,70	274.203,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	72.062.735,59	0,00	0,00	0,00	72.620.807,93	558.072,34	6.007.583,70
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	181.385.731,52	0,00	-40.873.254,39	0,00	141.537.373,35	1.024.896,22	15.167.313,26
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.143.547,47	2.000.000,00	0,00	0,00	18.073.839,10	-69.708,37	1.109.835,22
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.768.235,35	0,00	0,00	0,00	29.087.751,80	319.516,45	2.383.237,51
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	25.407.044,18	3.387.080,96	0,00	0,00	28.955.459,80	161.334,66	1.528.491,53
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	6.027.417,19	0,00	0,00	0,00	6.049.736,14	22.318,95	632.755,27
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	10.122.581,34	0,00	0,00	0,00	10.070.259,65	-52.321,69	1.066.749,26
					432.262.643,49	1.603.427,60	

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	6.137.136,62	0,00	-267.677,81	0,00	5.933.271,62	63.812,81	138.762,96
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	97.430.439,09	0,00	-45.345.104,71	0,00	52.841.460,77	756.126,39	7.159.182,36
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	30.621.589,86	0,00	0,00	0,00	31.000.446,87	378.857,01	2.922.624,92
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	18.068.295,48	0,00	0,00	0,00	18.186.548,46	118.252,98	1.280.485,63
					107.961.727,72	1.317.049,19	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	4.261.754,38	0,00	0,00	0,00	3.995.856,65	-265.897,73	261.023,81
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	36.939.610,76	0,00	0,00	0,00	36.664.365,35	-275.245,41	5.929.798,73
BB AÇÕES DIVIDENDOS	18.953.323,38	0,00	0,00	0,00	18.161.713,09	-791.610,29	966.416,82
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21.588.679,16	0,00	0,00	0,00	20.466.230,97	-1.122.448,19	872.575,12
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	6.324.685,14	0,00	0,00	0,00	6.052.784,53	-271.900,61	229.497,05
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	7.351.104,02	0,00	0,00	0,00	6.923.687,82	-427.416,20	119.617,28
FIA BRASIL IBX-50	11.570.906,00	0,00	0,00	0,00	10.893.320,20	-677.585,80	290.197,47
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	15.690.565,25	0,00	0,00	0,00	14.884.182,90	-806.382,35	763.868,43
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	16.875.914,58	0,00	0,00	0,00	16.293.957,31	-581.957,27	1.377.482,29
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	9.735.804,80	0,00	0,00	0,00	9.276.263,77	-459.541,03	531.883,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	3.562.944,52	0,00	0,00	0,00	3.386.678,07	-176.266,45	-140.841,91
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	5.135.652,56	0,00	0,00	0,00	4.871.217,99	-264.434,57	240.345,68
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	6.323.723,92	0,00	0,00	0,00	5.755.263,99	-568.459,93	-108.377,04
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	7.949.561,07	0,00	0,00	0,00	7.498.531,14	-451.029,93	330.316,18
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	4.664.849,12	0,00	0,00	0,00	4.468.189,46	-196.659,66	371.954,22
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	5.841.116,56	0,00	0,00	0,00	5.693.833,05	-147.283,51	284.338,52
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	3.375.142,47	0,00	0,00	0,00	3.228.531,88	-146.610,59	510.295,91
					178.514.608,17	-7.630.729,52	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	53.096.287,70	0,00	0,00	0,00	54.638.049,93	1.541.762,23	8.610.607,79
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	29.309.176,33	0,00	0,00	0,00	30.412.769,02	1.103.592,69	3.433.875,05
					85.050.818,95	2.645.354,92	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	73.348.686,71	0,00	0,00	0,00	72.676.230,92	-672.455,79	13.783.491,57
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	12.586.894,12	0,00	0,00	0,00	12.467.885,28	-119.008,84	2.352.736,32
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	18.416.033,91	0,00	0,00	0,00	18.238.827,51	-177.206,40	3.404.082,83
					103.382.943,71	-968.671,03	

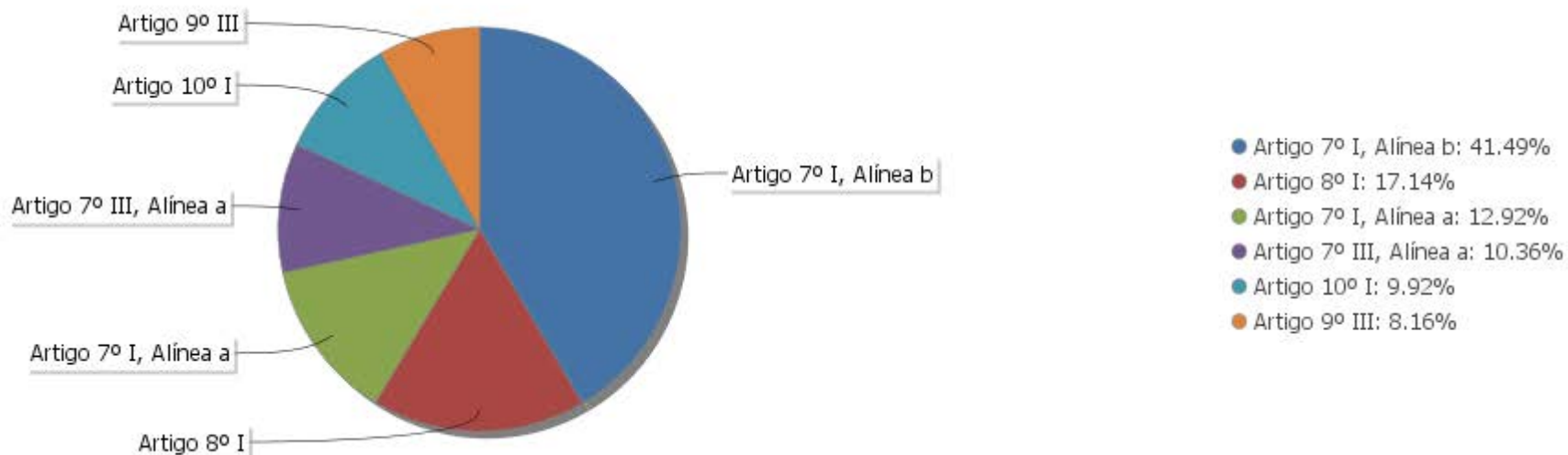
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

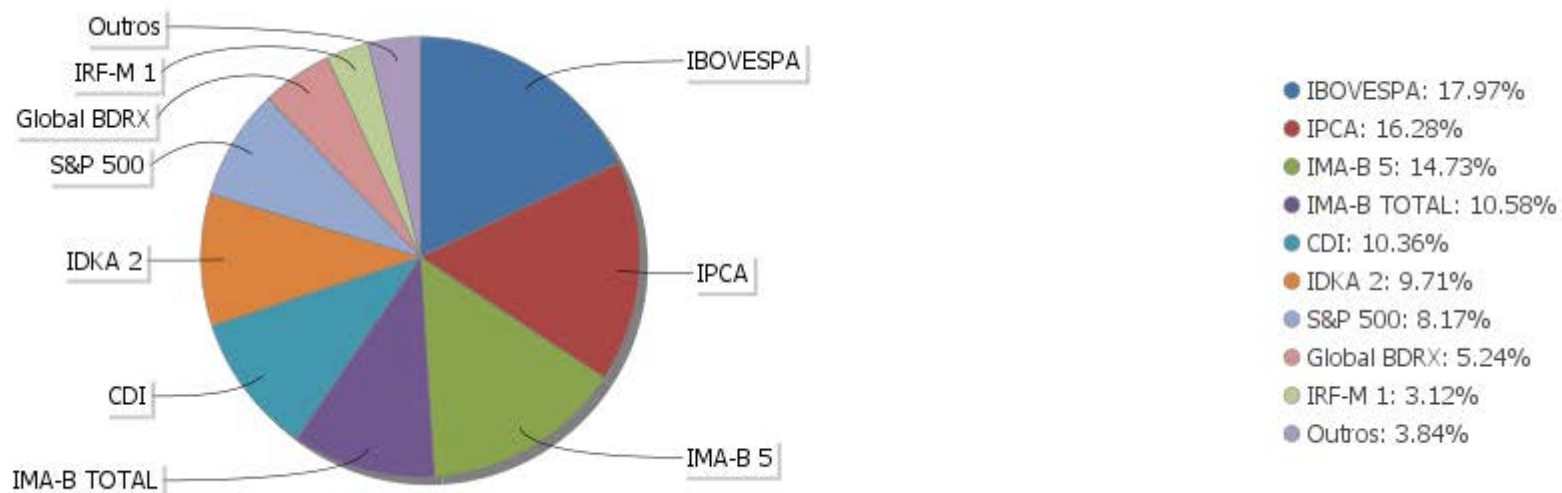
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	838.685.987,58	80,50	838.685.987,58	80,50	
de 31 dias a 365 dias	68.486.754,46	6,57	907.172.742,04	87,08	
acima de 365 dias	134.631.299,50	12,92	1.041.804.041,54	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

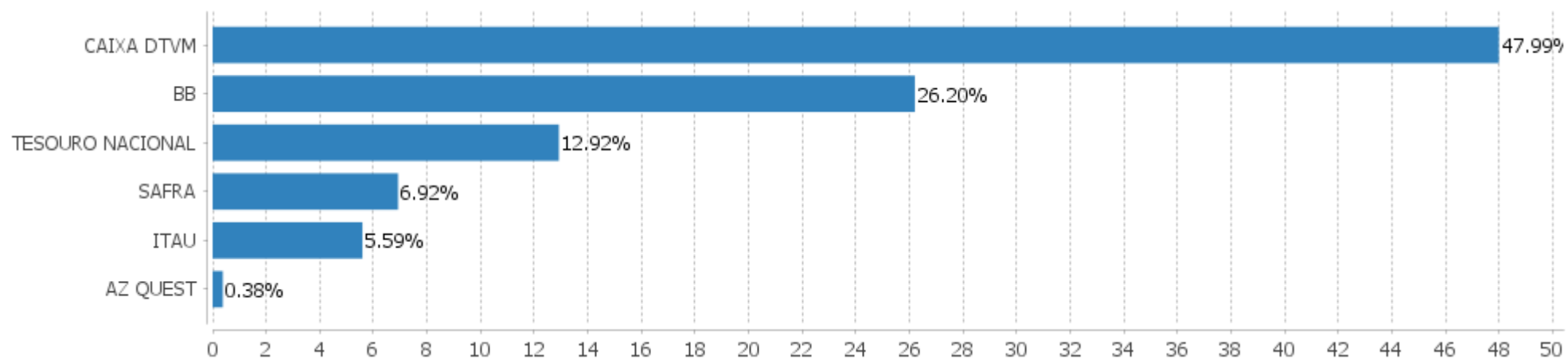


Alocação Por Estratégia



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	2,34	-0,48	1,26	1,17	1,64	2,70	1,67	-0,21					10,50
IPCA + 4,88%	0,95	1,18	1,15	0,95	0,65	0,32	0,52	0,67					6,56
p.p. indexador	1,39	-1,67	0,11	0,22	0,99	2,38	1,16	-0,87					3,94
2022	-0,60	-0,41	2,55	-2,43	0,69	-2,47	2,48	0,48	-1,13	3,05	0,20	-0,77	1,47
IPCA + 4,88%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,28	0,07	0,11	0,97	0,79	1,04	10,93
p.p. indexador	-1,54	-1,78	0,50	-3,85	-0,20	-3,54	2,77	0,41	-1,24	2,08	-0,59	-1,81	-9,46
2021	-0,21	-0,66	1,09	1,18	1,16	0,12	-0,23	-0,29	-1,34	-0,40	0,93	1,63	2,96
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,67	1,37	1,22	15,99
p.p. indexador	-0,88	-1,90	-0,32	0,45	-0,11	-0,86	-1,66	-1,63	-2,95	-2,08	-0,45	0,41	-13,03
2020	0,49	-0,32	-3,56	1,40	1,62	1,41	1,59	-0,08	-0,74	-0,16	2,49	2,57	6,75
IPCA + 5,85%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,85	10,61
p.p. indexador	-0,21	-0,98	-4,13	1,26	1,55	0,68	0,71	-0,80	-1,86	-1,50	1,14	0,72	-3,85
2019	1,23	0,48	0,57	0,84	0,95	1,23	0,79	0,30	1,39	1,36	-0,05	1,42	11,03
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	0,40	-0,41	-0,62	-0,22	0,31	0,78	0,07	-0,32	0,94	0,72	-1,02	-0,23	0,44
2018	0,86	0,51	0,95	0,49	-0,51	0,40	1,00	0,18	0,69	1,76	0,42	0,86	7,85
IPCA + 6,00%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	0,06	-0,23	0,37	-0,22	-1,40	-1,35	0,15	-0,27	-0,23	0,80	0,16	0,24	-2,07
2017	1,58	2,23	1,12	0,32	-0,10	0,50	2,52	1,12	1,18	0,19	-0,06	0,55	11,68
IPCA + 6,00%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	0,68	1,48	0,33	-0,23	-0,92	0,24	1,79	0,39	0,55	-0,72	-0,80	-0,35	2,64

Performance Sobre a Meta Atuarial

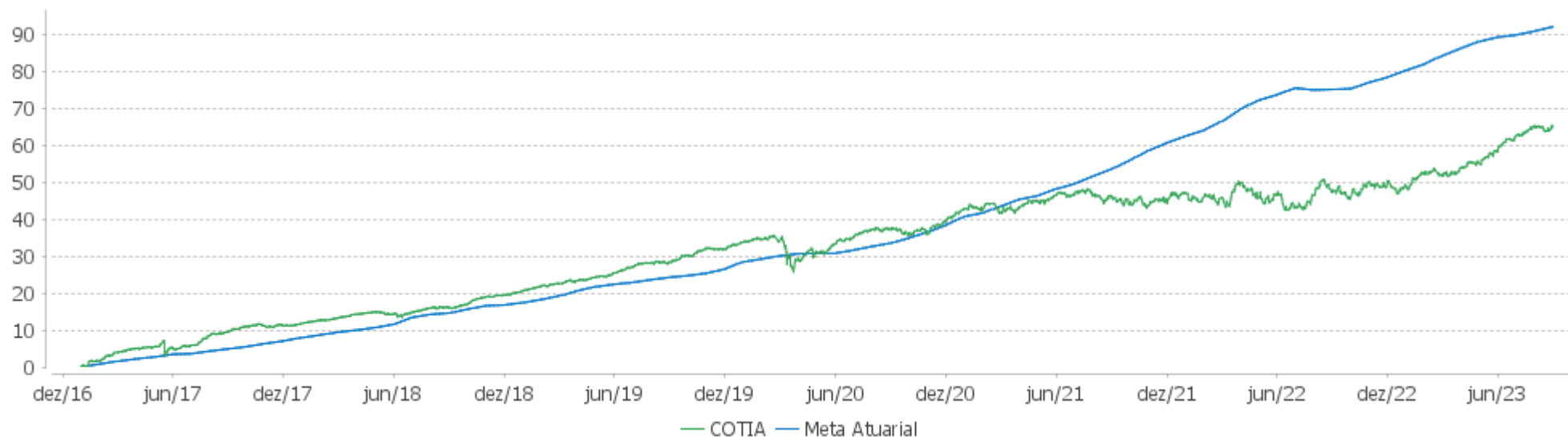
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	37	46,25
Meses abaixo - Meta Atuarial	43	53,75
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,05	2022-10
Menor rentabilidade da Carteira	-3,56	2020-03

Relatório

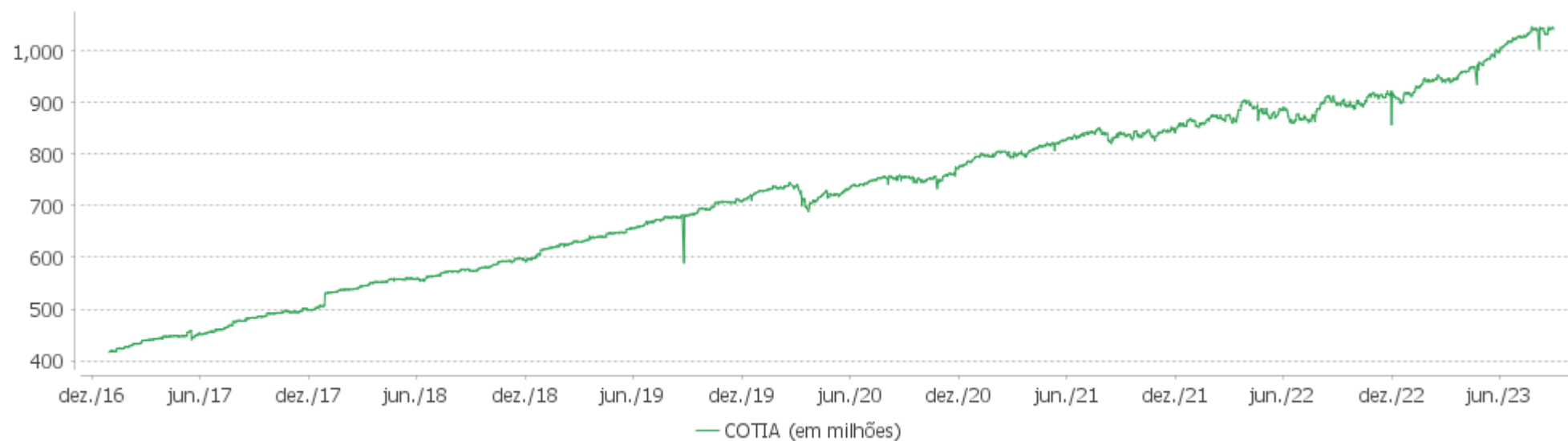
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	4,20	1,51	2,69	3,31
06 meses	8,50	4,33	4,17	3,57
12 meses	11,94	9,69	2,25	4,80
24 meses	13,00	25,30	-12,29	5,78
36 meses	20,26	45,03	-24,77	5,31
48 meses	28,38	57,33	-28,96	5,45
60 meses	41,99	72,37	-30,38	4,92
Desde 30/12/2016	64,81	101,03	-36,22	4,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

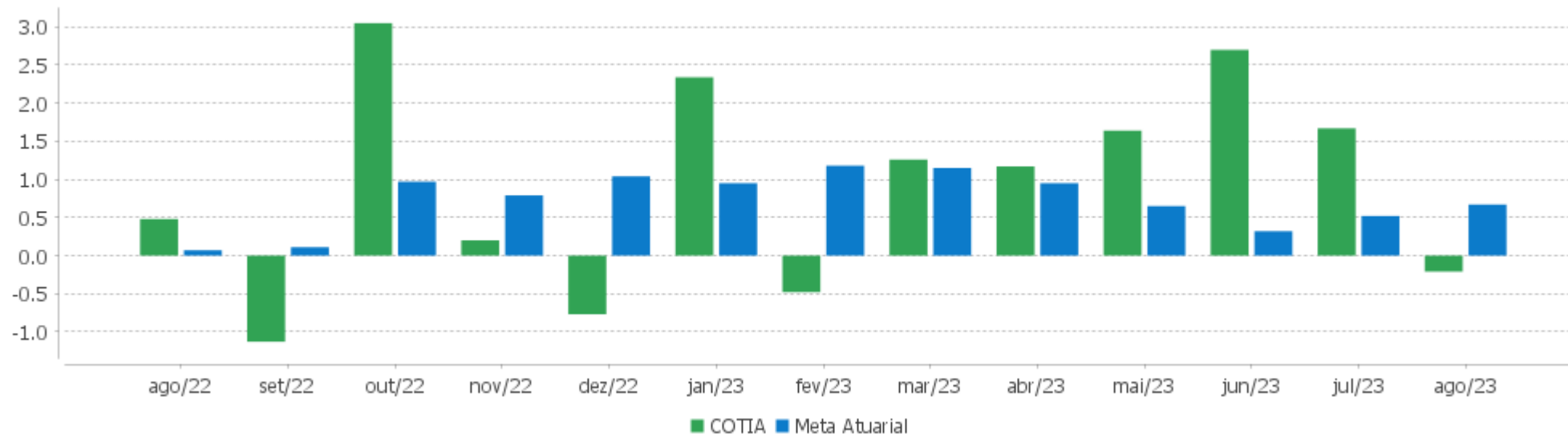


Patrimônio Líquido



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
NTN-B 150830 (6,255000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,55	7,83 4,60	1,80 1,53	5,49 3,66	10,83 6,22	21,54 7,80	
NTN-B 150830 (5,685000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,50	7,45 4,21	1,65 1,38	5,20 3,37	10,23 5,63	20,49 6,75	
NTN-B 150826 (5,030000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,44	4,02 0,79	1,49 1,22	4,87 3,04	6,50 1,89		
NTN-B 150830 (6,080000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,54	7,71 4,48	1,75 1,48	5,40 3,57	10,64 6,04	24,81 11,07	36,41 11,66
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,37 0,01	11,72 -0,12	2,79 -0,04	10,37 -0,06	13,51 -0,26	19,64 -0,43	23,24 -0,75
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,60 -0,01	8,67 -0,08	2,60 -0,06	5,72 -0,04	11,81 -0,16	22,71 -0,31	28,23 -0,66
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,74 -0,03	8,36 -0,30	2,73 -0,02	5,26 -0,16	11,57 -0,23	21,91 -0,42	28,11 -0,44
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,63 0,40	9,92 6,69	3,67 3,40	7,75 5,92	13,76 9,15	23,41 9,67	23,40 -1,35
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,12 -0,03	8,82 -0,23	3,37 -0,07	6,66 -0,16	13,40 -0,34	23,37 -0,66	25,63 -1,17
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,58 -0,03	8,63 -0,11	2,58 -0,08	5,68 -0,08	11,73 -0,24	22,46 -0,57	27,99 -0,91
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,77 0,01	8,41 -0,26	2,76 0,01	5,32 -0,10	11,53 -0,27	21,66 -0,68	27,54 -1,01
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,52 -0,14	11,85 0,00	2,47 -0,36	10,29 -0,14	13,71 -0,05	17,13 -2,94	17,92 -6,07
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,11 -0,03	8,92 -0,13	3,38 -0,06	6,69 -0,13	13,51 -0,23	23,50 -0,53	25,97 -0,83
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,40 -0,02	11,65 -0,20	2,71 -0,12	10,26 -0,17	13,45 -0,31	19,42 -0,65	23,03 -0,96
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,37 0,14	11,68 8,45	3,52 3,25	9,87 8,04	12,79 8,18	24,05 10,31	26,07 1,33
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,16 101,39	8,81 99,38	3,35 100,89	6,69 100,21	13,54 99,91	25,45 101,24	28,93 101,46
BB PREV RF FLUXO FIC	1,05	8,15	3,06	6,14	12,44	22,65	24,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	92,46	91,91	92,33	91,93	91,82	90,13	86,01
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,24	8,97	3,53	6,93	13,76	25,76	29,23
% do CDI	108,60	101,16	106,48	103,85	101,52	102,49	102,51
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,65	8,87	2,97	6,83	12,95	25,95	29,91
% do CDI	57,45	99,99	89,39	102,23	95,58	103,25	104,89
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	-5,67	4,61	4,89	8,96	-0,26	-17,73	-8,77
Var. IBOVESPA p.p.	-0,59	-0,87	-1,94	-1,34	-5,94	-15,17	-25,25
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	-5,14	5,41	6,37	9,72	2,29	-4,62	10,05
Var. IBOVESPA p.p.	-0,05	-0,06	-0,47	-0,58	-3,39	-2,06	-6,43
FIA BRASIL IBX-50	-5,86	2,74	5,34	5,93	1,74	-7,94	10,86
Var. IBOVESPA p.p.	-0,77	-2,74	-1,50	-4,37	-3,94	-5,38	-5,61
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	-4,30	3,94	7,69	8,76	1,10	-4,03	17,78
Var. IBOVESPA p.p.	0,79	-1,53	0,85	-1,55	-4,58	-1,47	1,30
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	-4,95	-3,99	2,67	0,58	-2,10	-13,16	5,30
Var. IBOVESPA p.p.	0,14	-9,47	-4,16	-9,72	-7,78	-10,60	-11,18
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	-3,45	9,23	7,22	12,59	9,27	6,96	26,09
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,62	0,01	-1,48	1,01	-1,37	-8,42	-11,67
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-5,81	1,76	5,78	6,27	-1,60	-6,69	17,95
Var. IBOVESPA p.p.	-0,73	-3,72	-1,05	-4,03	-7,28	-4,13	1,47
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	-4,22	9,08	7,44	12,22	1,72	-26,20	-12,89
Var. IBOVESPA p.p.	0,87	3,61	0,60	1,91	-3,96	-23,64	-29,36
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	-0,75	19,29	7,83	14,51	19,10	10,50	43,25
Var. IBOVESPA p.p.	4,34	13,82	1,00	4,21	13,42	13,06	26,77
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	-2,52	5,26	7,54	8,80	4,52	2,68	18,13
Var. IBOVESPA p.p.	2,56	-0,22	0,70	-1,50	-1,15	5,23	1,65
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	-6,24	6,99	6,37	10,14	0,90	-14,13	-2,96
Var. IBOVESPA p.p.	-1,15	1,51	-0,46	-0,16	-4,78	-11,58	-19,43
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	-5,15	5,19	5,98	9,32	4,45	-6,38	6,91
Var. IBOVESPA p.p.	-0,06	-0,28	-0,85	-0,98	-1,23	-3,82	-9,56
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	-4,34	18,77	8,76	20,36	10,95	-13,56	1,18
Var. SMALL CAP p.p.	3,08	10,65	5,49	2,96	12,89	10,19	11,99
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-8,99	-1,85	2,54	3,87	-13,35		
Var. IBOVESPA p.p.	-3,90	-7,32	-4,30	-6,43	-19,03		
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-4,18	5,62	6,22	9,96	3,77	0,49	9,45
Var. IBOVESPA p.p.	0,91	0,15	-0,61	-0,34	-1,91	3,05	-7,03
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-5,20	4,45	6,77	9,26	3,15	-6,61	11,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IGCT p.p.	-0,21	-1,29	-0,47	-1,26	-1,67	-2,46	-4,01
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	-4,72 0,37	6,08 0,61	6,90 0,06	10,12 -0,18	0,88 -4,80	-11,75 -9,19	-0,98 -17,46
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	2,90 -0,36	20,35 -1,08	5,57 -0,40	14,51 -0,51	14,97 -0,67	-4,08 -2,01	11,45 -4,96
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	3,77 8,85	13,23 7,75	5,31 -1,53	10,15 -0,15	9,59 3,91	-12,05 -9,49	4,24 -12,23
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-0,92 -2,88	23,40 12,66	9,88 5,72	17,91 10,60	23,70 15,38	17,13 21,75	52,40 36,56
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-0,96 4,12	22,95 17,47	9,70 2,86	17,61 7,31	23,14 17,46	16,57 19,13	51,68 35,20
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI Var. S&P 500 p.p.	-0,95 -2,91	23,26 12,51	9,83 5,67	17,85 10,55	23,63 15,31	17,05 21,67	53,06 37,21
COTIA Var. IPCA + 4,88% p.p.	-0,21 -0,87	10,50 3,94	4,20 2,69	8,50 4,17	11,94 2,25	13,00 -12,08	20,26 -23,61
CDI	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52
IBOVESPA	-5,09	5,47	6,84	10,30	5,68	-2,56	16,48
INPC + 6,00%	0,73	6,87	1,52	4,60	10,27	27,21	48,86
IPCA + 6,00%	0,76	7,32	1,79	4,89	10,86	27,77	48,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	-	2,00
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		
BB AÇÕES DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32		2,00
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 TÍTULOS PÚBLICOS FI	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-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA BRASIL IBX-50	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	D+1 du	D+0	D+21 du	D+23 du		1,72
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	D+1 du	D+0	D+23 du	D+25 du		1,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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 FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	D+1 du	D+0	D+2 du	D+4 du		1,50
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,00
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	D+0	D+0	D+21 du	D+24 du		
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	D+1 du	D+0	D+22 du	D+24 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE EQUIVALENTE A 10% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA B3.	0,80
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	O GESTOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE	0,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO CERTIFICADO DE DEPÓSITO INTERFINANCEIRO - CDI DE UM DIA, APURADO PELA CETIP.	
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32	Método Passivo.	0,00
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+0	D+0	D+3 du	D+4 du		0,30
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+2 du		1,00
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		3,50
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	Além da taxa de administração, será devida, pelo FUNDO à GESTORA, uma taxa de performance no valor equivalente a 20% (vinte por cento) aplicável sobre a valorização diária da cota do FUNDO que exceder a 100% (cem por cento) da variação diária do IBOVESPA no mesmo período.	2,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,15	9,05	3,44	6,81	13,74	24,03	26,80	33,22	43,08
IRF-M 1+	0,59	12,99	4,10	11,31	16,04	21,61	17,57	30,08	56,68
IRF-M TOTAL	0,76	11,43	3,81	9,56	14,96	22,06	20,53	31,03	52,86
IMA-B 5	0,61	8,75	2,66	5,76	11,97	23,03	28,90	40,81	61,13
IMA-B 5+	-1,27	14,28	2,80	14,40	15,00	16,66	18,76	24,36	71,86
IMA-B TOTAL	-0,38	11,84	2,83	10,43	13,76	20,07	23,99	32,22	68,62
IMA-GERAL TOTAL	0,63	10,39	3,38	8,50	13,72	22,67	24,97	33,10	54,16
IDKA 2	0,77	8,66	2,75	5,42	11,80	22,33	28,55	41,03	58,78
IDKA 20	-3,05	19,50	3,45	24,26	18,37	10,39	11,16	10,89	77,63
CDI	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52	33,50	41,88

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-5,09	5,47	6,84	10,30	5,68	-2,56	16,48	14,44	50,95
IBRX 100	-5,01	4,62	6,85	9,37	4,16	-4,36	15,60	14,31	54,15
IBRX 50	-4,76	3,66	7,43	8,45	4,56	-3,16	18,26	15,68	49,30
SMALL CAP	-7,43	8,13	3,26	17,40	-1,94	-23,76	-10,81	-5,44	42,85
Índice Consumo - ICON	-10,42	-0,75	0,30	6,83	-15,38	-41,83	-41,59	-38,22	-6,46
Índice Dividendos - IDIV	-2,83	9,22	8,71	11,58	10,64	15,38	37,76	32,74	99,45

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	1,97	10,75	4,16	7,31	8,32	-4,62	15,85	83,19	84,91

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,49	12,06	6,62	14,40	7,95	16,84	15,48	20,93	50,17

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,73	6,92	2,53	3,09	6,36	-11,42	5,54	59,73	56,19

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,23	3,23	0,27	1,83	4,61	13,74	24,75	27,79	32,17
INPC	0,20	2,80	0,01	1,55	4,06	13,24	25,04	28,72	32,95
IGPM	-0,14	-5,28	-2,77	-5,42	-7,20	0,77	32,13	49,34	56,73
SELIC	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52	33,50	41,88

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	5,97	1,29	3,88	8,78	23,00	40,28	49,45	60,68
IPCA + 5,00%	0,68	6,64	1,54	4,39	9,82	25,37	44,35	55,27	68,52
IPCA + 5,50%	0,72	6,98	1,66	4,64	10,34	26,57	46,42	58,24	72,56
IPCA + 5,89%	0,75	7,25	1,76	4,84	10,74	27,50	48,05	60,59	75,76
IPCA + 6,00%	0,76	7,32	1,79	4,89	10,86	27,77	48,51	61,26	76,67
INPC + 4,00%	0,56	5,52	1,03	3,59	8,20	22,46	40,61	50,54	61,62
INPC + 6,00%	0,73	6,87	1,52	4,60	10,27	27,21	48,86	62,43	77,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150826 (5,030000%)	42.530.101,69	5,030000	42.319.381,36	5,220000	-210.720,33
NTN-B 150830 (5,685000%)	42.241.024,62	5,685000	43.276.739,37	5,243400	1.035.714,75
NTN-B 150830 (6,080000%)	8.909.118,80	6,080000	9.326.137,33	5,243400	417.018,53
NTN-B 150830 (6,255000%)	40.951.054,39	6,255000	43.276.739,37	5,243400	2.325.684,98

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
142	02/08/2023	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12.062,20	0,00	1.570,85688600	7,6787389750
152	03/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.379,00	529,68273000	2,6034452730
147	04/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	26.582,18	10.205,64442400	2,6046547280
153	04/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.593,60	1.571,74642300	2,9226088460
163	04/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	19.465,71	6.660,38838100	2,9226088460
143	07/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.034,00	3.466,80655200	2,6058563880
154	07/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	40.873.254,39	13.978.010,99818400	2,9241109050
166	07/08/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	40.873.254,39	10.197.523,39667503	4,0081550000
168	07/08/2023	NTN-B 150826 (5,030000%)	43.513.378,31	0,00	9.999,73319829	4.351,4539285338
161	08/08/2023	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	40.874.818,04	0,00	5.290.195,95585400	7,7265224920
157	09/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	23.513,53	8.033,11644300	2,9270744630
148	11/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	44.366,14	16.994,58387000	2,6106046690
160	14/08/2023	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	14.794,91	0,00	1.913,73736800	7,7308988390
162	15/08/2023	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	8.950,93	0,00	1.156,93230000	7,7367794080
146	18/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	11.808,00	4.513,04677300	2,6164142750
144	21/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	27.309,91	10.433,50618000	2,6175198950
159	21/08/2023	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	428,85	0,00	55,84183100	7,6797265990
156	22/08/2023	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	1.794.279,57	0,00	233.934,26225473	7,6700161520
165	22/08/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.000.000,00	0,00	461.155,06431269	4,3369360000
167	22/08/2023	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3.387.080,96	0,00	1.840.772,85612400	1,8400320000
145	25/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	575,64	219,52472200	2,6222103530
149	28/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.274,87	1.248,33244500	2,6233957260
151	29/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.747.008,28	1.271.298,96007415	2,9473856250
158	29/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	87.903,63	33.492,21656500	2,6245987580
150	31/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	677.269,20	229.564,09929100	2,9502400510
155	31/08/2023	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12.062,20	0,00	1.580,71429600	7,6308539940
164	31/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	55.444,44	21.104,75604000	2,6271064160
Total			91.617.855,97	86.486.036,91		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 17.563.096,20

Value-At-Risk: 1,69%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
COTIA		1,69		1,69			1.041.804.041,54	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,59%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (5,030000%)		0,10	0,00	0,11			42.530.101,69	4,08
NTN-B 150830 (5,685000%)		0,10	0,00	0,11			42.241.024,62	4,05
NTN-B 150830 (6,080000%)		0,10	0,00	0,11			8.909.118,80	0,86
NTN-B 150830 (6,255000%)		0,10	0,00	0,11			40.951.054,39	3,93
Sub-total	0,19	0,10	0,00		-2,17	0,74	134.631.299,50	12,92

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,13	0,00	0,01			3.382.659,71	0,32
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA		1,87	0,01	0,14			10.070.259,65	0,97
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,86	0,06	0,06			82.047.126,12	7,88
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,86	0,01	0,05			18.073.839,10	1,73
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,14	0,00	0,01			29.087.751,80	2,79
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,70	0,03	0,03			141.537.373,35	13,59
BB PREV RF IDKA2		0,70	0,00	0,13			28.567.761,14	2,74
FI CAIXA BRASIL IDKA IPKA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,72	0,01	0,16			72.620.807,93	6,97
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		0,72	0,00	0,03			11.869.868,75	1,14
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,35	0,00	1,35			6.049.736,14	0,58
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,83	0,01	0,85			28.955.459,80	2,78
Sub-total	2,06	0,90	0,14		-0,36	0,40	432.262.643,49	41,49

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,02	-0,00	0,02			31.000.446,87	2,98
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			52.841.460,77	5,07
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	0,00	0,01			5.933.271,62	0,57
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI		0,48	0,00	0,48			18.186.548,46	1,75
Sub-total	0,25	0,09	0,00		-0,20	1,09	107.961.727,72	10,36

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,97%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI		7,86	0,03	0,85			6.052.784,53	0,58
BB AÇÕES DIVIDENDOS		7,10	0,10	1,64			18.161.713,09	1,74
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES		6,69	0,03	2,90			5.693.833,05	0,55
FIA BRASIL IBX-50		7,40	0,06	0,82			10.893.320,20	1,05
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		7,14	0,03	1,19			4.871.217,99	0,47
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		7,23	0,11	0,26			20.466.230,97	1,96
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,40	0,02	5,32			3.995.856,65	0,38
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS		7,40	0,08	1,12			14.884.182,90	1,43
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		6,41	0,07	1,48			16.293.957,31	1,56
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC		6,99	0,02	2,76			3.386.678,07	0,33
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		7,36	0,04	1,04			6.923.687,82	0,66
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA		5,19	0,13	8,13			36.664.365,35	3,52
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		7,06	0,05	2,54			9.276.263,77	0,89
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		8,21	0,03	3,35			5.755.263,99	0,55
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI		7,31	0,04	2,01			7.498.531,14	0,72
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		7,23	0,02	1,95			4.468.189,46	0,43
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA		8,99	0,02	2,46			3.228.531,88	0,31
Sub-total	11,06	5,97	0,86		-0,47	-4,10	178.514.608,17	17,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,50%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		5,42	0,08	7,41			18.238.827,51	1,75
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		5,53	0,32	5,30			72.676.230,92	6,98
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI		5,47	0,05	5,29			12.467.885,28	1,20
Sub-total	12,00	5,50	0,45		-0,17	-0,93	103.382.943,71	9,92

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,78%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		7,04	0,16	0,87			54.638.049,93	5,24
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		6,69	0,07	11,00			30.412.769,02	2,92
Sub-total	16,69	6,78	0,23		0,12	3,21	85.050.818,95	8,16

(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 (%)