



LDB
EMPRESAS

COTIA
OUTUBRO 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 31.10.2023.

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

66,27%

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%)	2,85	0,03	0,65	1,86	43.081.322,26	4,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,685000%)	1,07	0,03	0,70	8,95	42.831.721,47	4,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,080000%)	0,36	0,04	0,74	9,29	9.039.189,30	0,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,255000%)	0,36	0,04	0,75	9,44	41.560.070,64	4,02
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,57	0,03	0,70	9,12	136.512.303,67	13,20

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	0,06	0,92	10,82	3.444.787,86	0,33	7.179.042.508,92	0,05
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	5,08	-0,08	-0,79	9,80	9.885.884,23	0,96	339.818.003,61	2,91
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,16	-0,08	-0,67	9,82	103.329.005,73	9,99	5.052.854.726,15	2,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,19	-0,09	-0,66	9,92	17.781.915,33	1,72	5.036.600.197,80	0,35
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,37	0,06	0,94	10,95	29.627.994,45	2,86	7.795.296.699,71	0,38
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,31	-0,02	-0,32	8,44	141.239.936,76	13,66	7.787.487.970,57	1,81
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,36	-0,01	-0,33	8,23	28.533.840,93	2,76	5.824.441.376,72	0,49
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,41	-0,01	-0,29	8,48	72.666.622,21	7,03	5.184.421.071,28	1,40
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,33	-0,02	-0,32	8,40	11.844.563,06	1,15	5.252.934.178,04	0,23
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	4,05	-0,01	-0,21	11,12	6.019.087,93	0,58	2.180.749.467,31	0,28
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,50	0,01	0,26	10,64	31.340.606,68	3,03	5.136.324.306,86	0,61
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,54	-0,03	-0,29	8,59	455.714.245,17	44,06		

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	0,06	0,05	1,02	11,21	18.919.456,09	1,83	14.076.402.461,33	0,13
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	0,99	10,95	50.312.595,90	4,86	15.296.039.303,73	0,33
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,03	0,04	0,90	10,10	5.563.259,25	0,54	3.689.670.141,46	0,15
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,88	0,04	0,70	10,09	18.390.745,11	1,78	2.609.317.950,67	0,70
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,33	0,05	0,93	10,86	93.186.056,35	9,01		
Renda Fixa			1,79	-0,01	0,07	9,07	685.412.605,19	66,27		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

16,52%

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	18,61	0,31	-2,90	1,40	5.904.734,13	0,57	1.302.352.358,50	0,45
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	17,29	0,14	-3,41	3,18	17.742.827,95	1,72	544.339.620,40	3,26
SAFRA	SAFRA	SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	16,15	0,38	-2,15	4,57	5.656.871,46	0,55	59.271.980,84	9,54
CAIXA DTVM	CEF	FIA BRASIL IBX-50	18,55	0,56	-3,33	0,25	10.629.403,32	1,03	617.426.719,37	1,72
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	17,91	0,55	-3,69	1,38	4.694.948,39	0,45	324.738.504,65	1,45
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	18,92	0,41	-3,61	1,59	19.904.455,28	1,92	730.788.793,77	2,72
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	17,92	0,82	-6,30	-0,81	3.704.471,87	0,36	736.207.166,08	0,50
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	19,31	0,44	-3,93	1,34	14.309.551,00	1,38	636.425.761,76	2,25
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	16,51	0,12	-3,01	6,51	15.888.267,85	1,54	898.947.192,31	1,77
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	17,17	0,37	-4,29	-8,29	3.234.917,62	0,31	1.245.165.684,45	0,26
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	18,52	0,39	-3,79	-1,85	6.678.283,84	0,65	763.608.202,26	0,87
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	14,85	0,36	-1,76	11,72	34.337.023,21	3,32	1.089.375.893,71	3,15
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	18,46	0,50	-5,29	0,47	8.785.231,29	0,85	586.219.451,06	1,50
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	21,88	0,88	-7,30	-9,52	5.305.475,21	0,51	137.339.469,08	3,86
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	18,90	0,71	-5,21	-1,57	7.055.679,93	0,68	142.629.819,49	4,95
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	20,43	0,53	-5,10	2,27	4.189.226,20	0,41	297.740.547,67	1,41
SAFRA	SAFRA	SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	23,25	1,03	-7,53	5,32	2.862.767,79	0,28	59.833.281,67	4,78
Sub-total Artigo 8º I			15,10	0,41	-3,57	3,14	170.884.136,34	16,52		
Renda Variável			15,10	0,41	-3,57	3,14	170.884.136,34	16,52		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,82%

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	20,25	0,45	-1,40	14,42	51.947.662,03	5,02	1.935.277.303,73	2,68
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	18,88	0,43	-2,05	7,76	28.955.634,48	2,80	624.028.529,44	4,64
Sub-total Artigo 9º III			19,46	0,44	-1,63	11,89	80.903.296,51	7,82		
Investimentos no Exterior			19,46	0,44	-1,63	11,89	80.903.296,51	7,82		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,38%

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	15,57	0,69	-1,74	15,49	17.132.561,02	1,66	520.571.054,03	3,29
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	15,71	0,69	-1,77	15,81	68.205.719,29	6,59	1.452.300.441,47	4,70
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	15,67	0,68	-1,75	15,73	11.705.911,76	1,13	1.128.762.122,57	1,04
Sub-total Artigo 10º I			15,68	0,69	-1,76	15,75	97.044.192,07	9,38		
Investimentos Estruturados			15,68	0,69	-1,76	15,75	97.044.192,07	9,38		
Total			4,29	0,16	-0,86	8,79	1.034.244.230,11	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	136.512.303,67	13,20	0,00	35,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	455.714.245,17	44,06	0,00	30,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	93.186.056,35	9,01	0,00	11,50	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	685.412.605,19	66,27					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	170.884.136,34	16,52	0,00	3,50	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	170.884.136,34	16,52					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	80.903.296,51	7,82	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	80.903.296,51	7,82					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	97.044.192,07	9,38	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	97.044.192,07	9,38					15,00
Total		1.034.244.230,11	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	0,70 70,56	9,12 82,77	2,14 68,17	4,23 64,63	11,13 82,93	954.131,94	8.883.934,39
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,29 -29,31	8,59 77,89	0,04 1,18	3,21 49,04	9,12 67,96	-1.327.840,39	33.294.730,09
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,93 92,87	10,86 98,49	2,91 92,69	6,44 98,25	12,95 96,51	832.116,03	13.501.648,75
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-3,57 -0,63	3,14 0,03	-8,20 -0,98	5,27 -3,07	-3,67 -1,18	-6.324.229,49	5.199.920,49
Artigo 9º III % do CDI	-1,63 -163,82	11,89 107,89	-1,82 -57,98	4,66 71,16	13,80 102,82	-1.344.102,71	7.896.960,40
Artigo 10º I % do CDI	-1,76 -176,69	15,75 142,83	-7,00 -222,74	4,33 66,07	16,74 124,79	-1.741.247,12	13.201.559,08
COTIA (Total)						-8.951.171,74	81.978.753,20

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%)	42.802.079,78	0,00	0,00	0,00	43.081.322,26	279.242,48	788.783,02
NTN-B 150830 (5,685000%)	42.532.102,34	0,00	0,00	0,00	42.831.721,47	299.619,13	3.617.469,24
NTN-B 150830 (6,080000%)	8.973.160,76	0,00	0,00	0,00	9.039.189,30	66.028,54	790.200,44
NTN-B 150830 (6,255000%)	41.250.828,85	0,00	0,00	0,00	41.560.070,64	309.241,79	3.687.481,69
	135.558.171,73	0,00	0,00	0,00	136.512.303,67	954.131,94	

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	28.628.239,39	0,00	0,00	0,00	28.533.840,93	-94.398,46	2.170.699,44
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	104.030.074,91	0,00	0,00	0,00	103.329.005,73	-701.069,18	1.997.319,78
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	11.883.062,29	0,00	0,00	0,00	11.844.563,06	-38.499,23	918.035,34
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	3.413.243,57	0,00	0,00	0,00	3.444.787,86	31.544,29	336.331,37

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	72.879.238,71	0,00	0,00	0,00	72.666.622,21	-212.616,50	6.053.397,98
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	141.695.771,15	0,00	0,00	0,00	141.239.936,76	-455.834,39	14.869.876,67
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	17.900.860,11	0,00	0,00	0,00	17.781.915,33	-118.944,78	817.911,45
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.352.222,50	0,00	0,00	0,00	29.627.994,45	275.771,95	2.923.480,16
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	29.099.889,67	2.162.927,80	0,00	0,00	31.340.606,68	77.789,21	1.723.197,00
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	6.031.634,74	0,00	0,00	0,00	6.019.087,93	-12.546,81	602.107,06
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	9.964.920,72	0,00	0,00	0,00	9.885.884,23	-79.036,49	882.373,84
	454.879.157,76	2.162.927,80	0,00	0,00	455.714.245,17	-1.327.840,39	

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	5.750.792,43	48,85	-238.912,54	0,00	5.563.259,25	51.330,51	242.695,03
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	48.673.580,95	5.847.298,57	-4.696.108,60	0,00	50.312.595,90	487.824,98	8.157.108,01
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.095.615,74	8.659.054,31	0,00	0,00	18.919.456,09	164.786,04	3.330.082,82
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	18.262.570,61	0,00	0,00	0,00	18.390.745,11	128.174,50	1.484.682,28
	82.782.559,73	14.506.401,73	-4.935.021,14	0,00	93.186.056,35	832.116,03	

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	3.953.677,80	0,00	0,00	0,00	3.704.471,87	-249.205,93	-30.360,97
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	34.951.997,80	0,00	0,00	0,00	34.337.023,21	-614.974,59	3.602.456,59
BB AÇÕES DIVIDENDOS	18.368.924,04	0,00	0,00	0,00	17.742.827,95	-626.096,09	547.531,68
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20.650.877,14	0,00	0,00	0,00	19.904.455,28	-746.421,86	310.799,43
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	6.081.256,63	0,00	0,00	0,00	5.904.734,13	-176.522,50	81.446,65
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	6.941.625,29	0,00	0,00	0,00	6.678.283,84	-263.341,45	-125.786,70
FIA BRASIL IBX-50	10.995.358,53	0,00	0,00	0,00	10.629.403,32	-365.955,21	26.280,59
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	14.895.299,36	0,00	0,00	0,00	14.309.551,00	-585.748,36	189.236,53
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	16.381.789,22	0,00	0,00	0,00	15.888.267,85	-493.521,37	971.792,83
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	9.275.623,49	0,00	0,00	0,00	8.785.231,29	-490.392,20	40.851,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	3.379.809,69	0,00	0,00	0,00	3.234.917,62	-144.892,07	-292.602,36
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	4.874.611,46	0,00	0,00	0,00	4.694.948,39	-179.663,07	64.076,08
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	5.723.085,42	0,00	0,00	0,00	5.305.475,21	-417.610,21	-558.165,82
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	7.443.191,37	0,00	0,00	0,00	7.055.679,93	-387.511,44	-112.535,03
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	4.414.483,62	0,00	0,00	0,00	4.189.226,20	-225.257,42	92.990,96
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	5.780.888,02	0,00	0,00	0,00	5.656.871,46	-124.016,56	247.376,93
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	3.095.866,95	0,00	0,00	0,00	2.862.767,79	-233.099,16	144.531,82
	177.208.365,83	0,00	0,00	0,00	170.884.136,34	-6.324.229,49	

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	52.684.802,32	0,00	0,00	0,00	51.947.662,03	-737.140,29	5.920.219,89
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	29.562.596,90	0,00	0,00	0,00	28.955.634,48	-606.962,42	1.976.740,51
	82.247.399,22	0,00	0,00	0,00	80.903.296,51	-1.344.102,71	

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	69.435.883,14	0,00	0,00	0,00	68.205.719,29	-1.230.163,85	9.312.979,94
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	11.914.099,38	0,00	0,00	0,00	11.705.911,76	-208.187,62	1.590.762,80
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	17.435.456,67	0,00	0,00	0,00	17.132.561,02	-302.895,65	2.297.816,34
	98.785.439,19	0,00	0,00	0,00	97.044.192,07	-1.741.247,12	

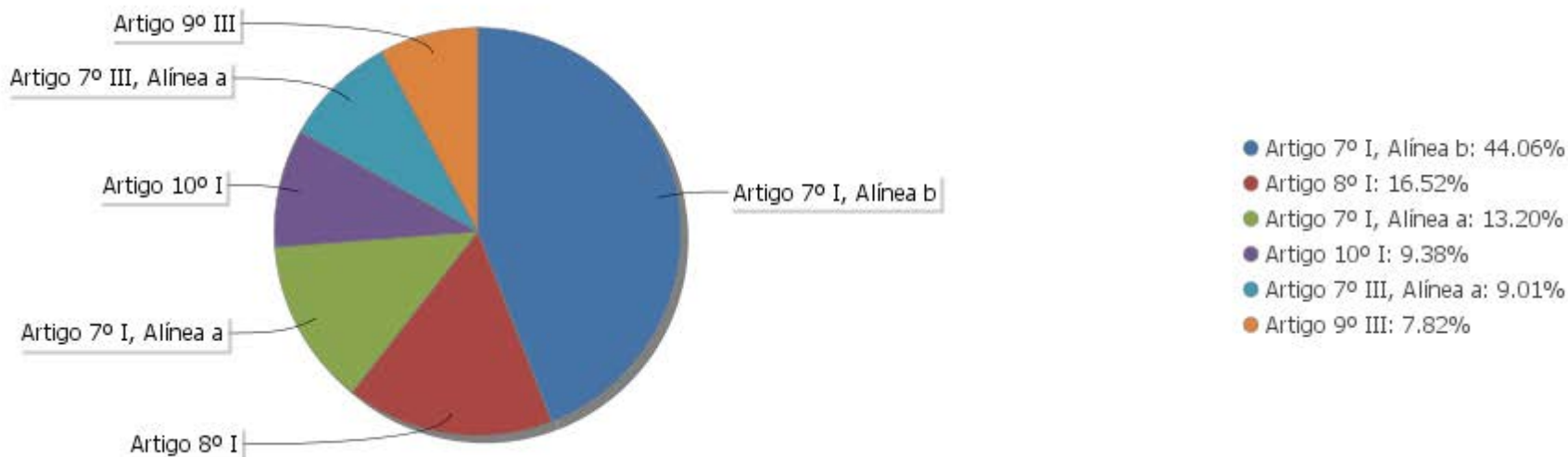
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

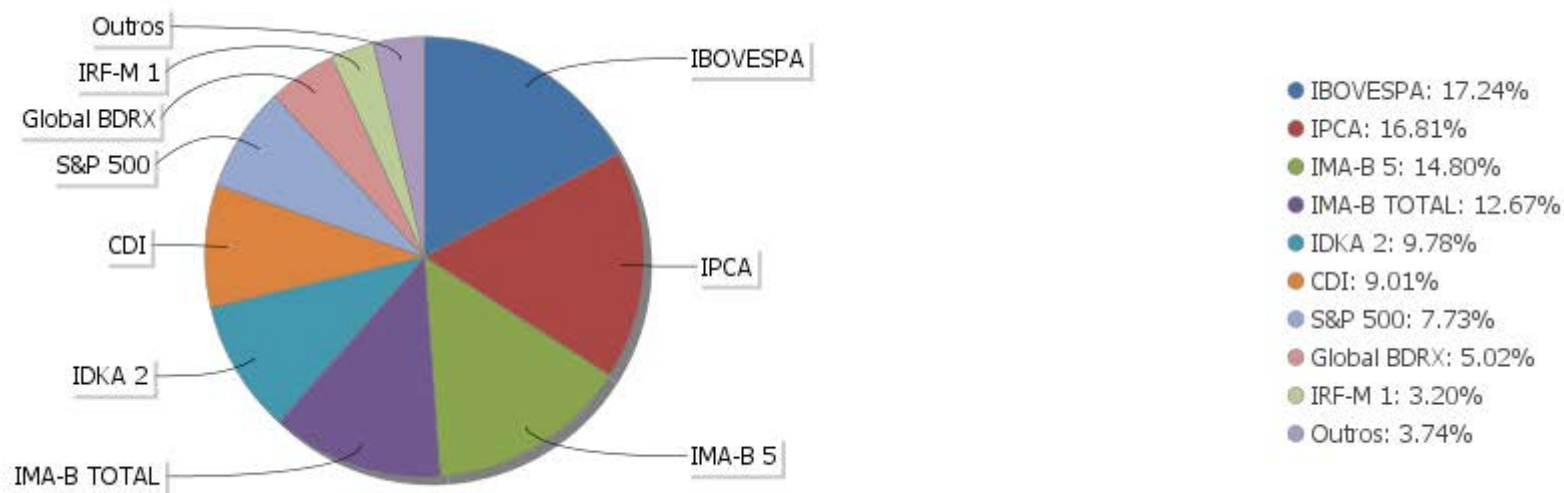
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	832.285.293,50	80,47	832.285.293,50	80,47	
de 31 dias a 365 dias	65.446.632,94	6,33	897.731.926,44	86,80	
acima de 365 dias	136.512.303,67	13,20	1.034.244.230,11	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

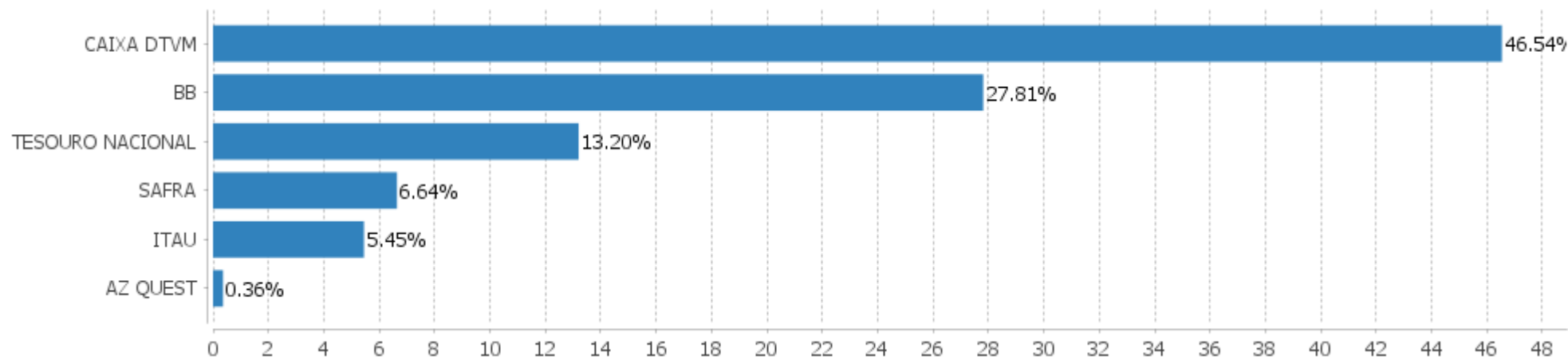


Alocação Por Estratégia



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	-0,70	-0,86			8,79
IPCA + 4,88%	0,95	1,18	1,15	0,95	0,65	0,32	0,52	0,67	0,64	0,64			7,93
p.p. indexador	1,39	-1,67	0,11	0,22	0,99	2,38	1,16	-0,87	-1,34	-1,50			0,86
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

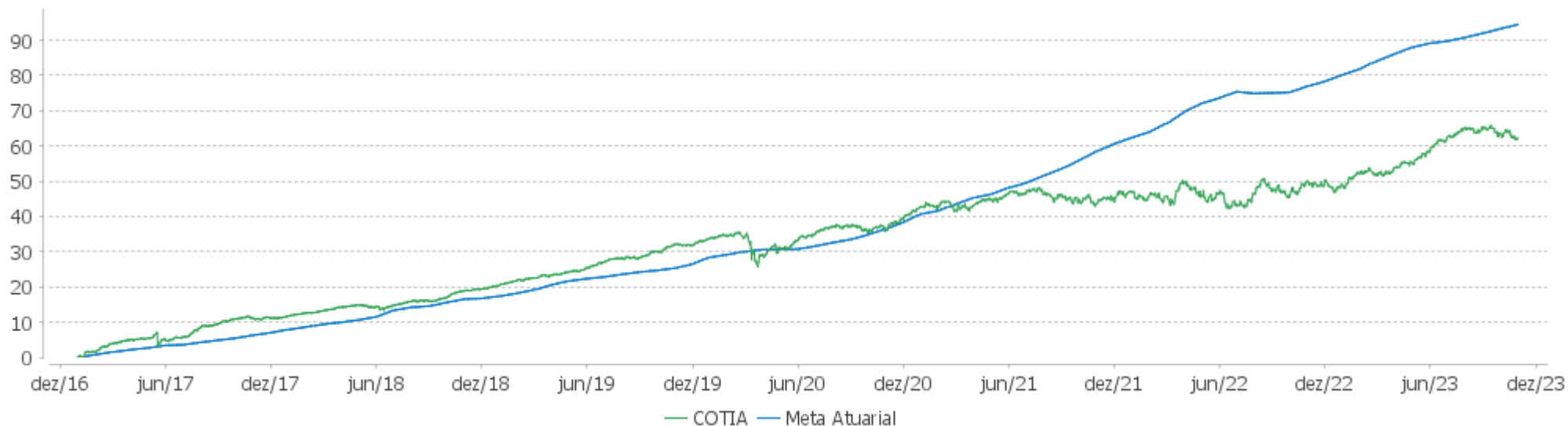
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	37	45,12
Meses abaixo - Meta Atuarial	45	54,88
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,05	2022-10
Menor rentabilidade da Carteira	-3,56	2020-03

Relatório

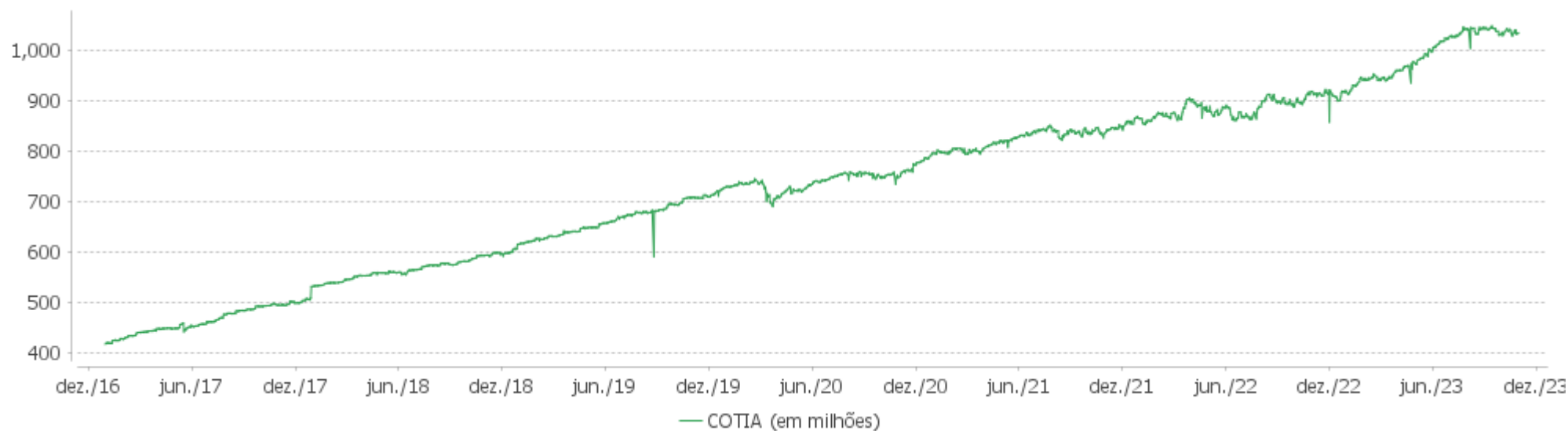
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	-1,76	1,96	-3,72	4,19
06 meses	4,26	3,48	0,79	3,94
12 meses	8,16	9,91	-1,75	4,29
24 meses	13,22	22,84	-9,62	5,69
36 meses	19,47	43,35	-23,88	5,31
48 meses	22,98	57,64	-34,66	5,52
60 meses	36,43	71,34	-34,91	4,98
Desde 30/12/2016	62,25	103,61	-41,36	4,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

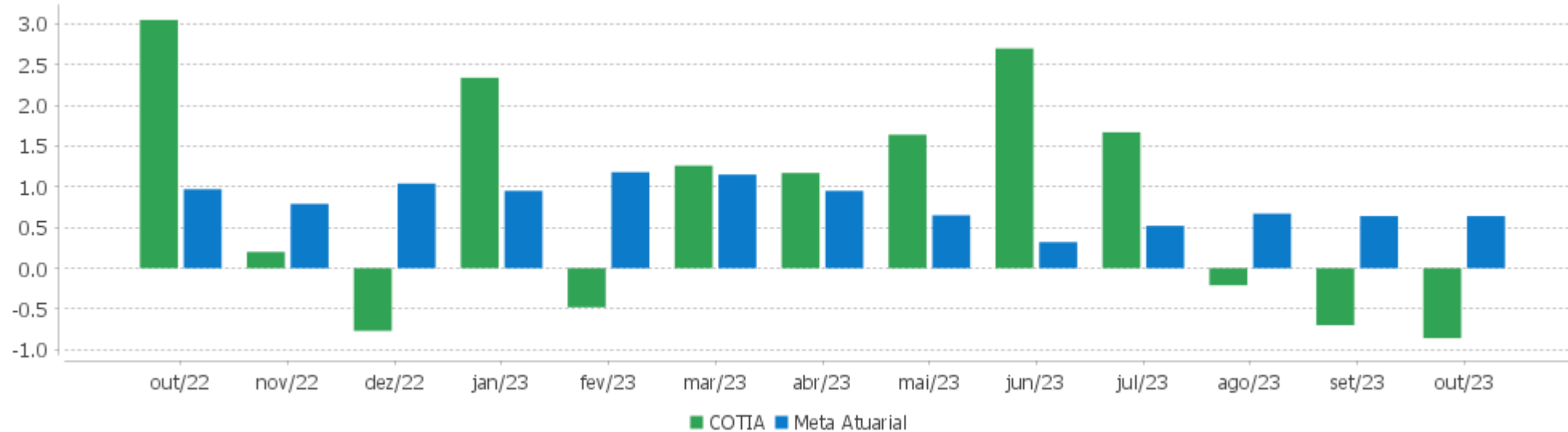


Patrimônio Líquido



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.	0,75 0,51	9,44 5,69	2,28 1,55	4,44 3,44	11,65 6,83	19,49 7,89	
NTN-B 150830 (5,685000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,46	8,95 5,20	2,14 1,41	4,16 3,15	11,05 6,23	18,46 6,86	
NTN-B 150826 (5,030000%) Var. IPCA p.p.	0,65 0,41	5,37 1,62	1,98 1,25	3,83 2,83	7,29 2,47		
NTN-B 150830 (6,080000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,50	9,29 5,54	2,24 1,50	4,35 3,35	11,47 6,65	22,71 11,11	35,41 11,90
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,66 -0,01	9,92 -0,14	-1,98 -0,01	3,69 -0,06	8,75 -0,23	20,99 -0,41	22,90 -0,72
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,32 -0,01	8,44 -0,11	0,39 -0,05	3,03 -0,03	9,06 -0,15	22,79 -0,32	27,94 -0,63
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	-0,33 0,08	8,23 -0,29	0,62 -0,02	3,00 0,09	8,84 -0,19	22,05 -0,60	27,39 -0,92
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,26 0,02	10,64 6,90	1,30 0,56	6,24 5,23	12,00 7,18	24,61 13,01	24,98 1,47
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,92 -0,03	10,82 -0,30	2,97 -0,09	6,45 -0,16	13,13 -0,36	25,83 -0,72	27,74 -1,06
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-0,32 -0,01	8,40 -0,15	0,37 -0,07	2,99 -0,07	8,99 -0,22	22,58 -0,53	27,67 -0,89
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,29 0,12	8,48 -0,05	0,84 0,20	3,19 0,28	9,04 0,01	22,01 -0,64	27,38 -0,94
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,94 -0,02	10,95 -0,17	2,99 -0,07	6,48 -0,13	13,26 -0,22	26,00 -0,55	27,96 -0,84
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,67 -0,02	9,82 -0,24	-2,03 -0,07	3,63 -0,12	8,70 -0,27	20,76 -0,64	22,69 -0,93
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,79 -0,14	9,80 -0,26	-2,34 -0,37	3,28 -0,48	8,81 -0,17	19,60 -1,80	18,60 -5,02
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	-0,21 -0,45	11,12 7,37	-0,14 -0,87	5,42 4,42	9,56 4,74	22,83 11,23	25,63 2,11
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,99 99,06	10,95 99,36	3,15 100,06	6,60 100,68	13,35 99,46	26,71 100,98	31,23 101,88
BB PREV RF FLUXO FIC	0,90	10,10	2,88	6,02	12,28	23,94	26,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	90,45	91,64	91,57	91,93	91,53	90,52	87,12
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,70	10,09	1,78	5,68	11,89	24,74	31,14
% do CDI	70,36	91,51	56,77	86,69	88,58	93,54	101,59
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,02	11,21	3,32	6,91	13,65	27,03	31,73
% do CDI	101,94	101,66	105,49	105,45	101,76	102,18	103,52
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	-5,21	-1,57	-11,24	4,08	-12,29	-6,68	-9,81
Var. IBOVESPA p.p.	-2,27	-4,68	-4,03	-4,27	-9,79	-16,00	-30,24
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	-3,93	1,34	-8,80	6,05	-8,21	6,92	10,93
Var. IBOVESPA p.p.	-1,00	-1,77	-1,59	-2,29	-5,72	-2,40	-9,49
FIA BRASIL IBX-50	-3,33	0,25	-8,14	6,16	-8,03	3,74	14,81
Var. IBOVESPA p.p.	-0,39	-2,86	-0,92	-2,18	-5,54	-5,57	-5,61
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	-2,90	1,40	-6,64	8,29	-5,16	2,67	21,68
Var. IBOVESPA p.p.	0,03	-1,71	0,58	-0,05	-2,66	-6,65	1,25
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	-4,29	-8,29	-9,21	-1,31	-14,59	-4,03	5,31
Var. IBOVESPA p.p.	-1,35	-11,40	-1,99	-9,65	-12,10	-13,35	-15,12
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	-3,01	6,51	-5,85	6,96	0,57	16,55	29,25
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,14	-0,67	-1,20	-0,60	-5,71	-7,23	-11,58
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-3,79	-1,85	-9,15	4,80	-7,15	-2,25	16,87
Var. IBOVESPA p.p.	-0,86	-4,96	-1,94	-3,54	-4,66	-11,56	-3,56
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	-5,10	2,27	-10,20	7,01	-9,66	-9,44	-13,61
Var. IBOVESPA p.p.	-2,17	-0,84	-2,98	-1,33	-7,16	-18,76	-34,04
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	-6,30	-0,81	-13,08	3,12	-12,18	-11,03	-2,37
Var. IBOVESPA p.p.	-3,37	-3,92	-5,86	-5,23	-9,68	-20,35	-22,79
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	-1,76	11,72	-7,05	2,34	12,61	1,39	43,21
Var. IBOVESPA p.p.	1,18	8,61	0,17	-6,01	15,10	-7,92	22,78
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	-2,15	4,57	-3,15	6,50	2,11	16,47	21,79
Var. IBOVESPA p.p.	0,79	1,47	4,06	-1,84	4,60	7,15	1,37
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	-7,53	5,32	-15,18	6,85	-9,56	-3,69	-2,54
Var. SMALL CAP p.p.	-0,13	8,03	1,53	1,36	6,68	12,50	10,62
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	-3,69	1,38	-8,58	6,96	-5,89	5,92	9,08
Var. IBOVESPA p.p.	-0,75	-1,72	-1,37	-1,38	-3,39	-3,40	-11,34
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-7,30	-9,52	-16,10	-0,75	-24,00	-21,02	
Var. IBOVESPA p.p.	-4,36	-12,63	-8,89	-9,10	-21,51	-30,33	
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-3,41	3,18	-6,39	6,19	-3,58	9,76	13,84
Var. IBOVESPA p.p.	-0,47	0,08	0,83	-2,15	-1,08	0,45	-6,58
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-3,61	1,59	-7,80	8,08	-4,91	5,72	15,45

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.	-0,11	-1,43	-0,36	-0,78	-1,56	-2,73	-4,13
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	-5,29 -2,35	0,47 -2,64	-9,76 -2,55	7,47 -0,87	-10,82 -8,32	-1,56 -10,88	1,03 -19,40
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-1,40 0,17	14,42 -0,97	-2,16 -0,29	6,20 -0,45	16,47 -1,90	-17,58 -1,45	10,07 -4,78
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	-2,05 0,88	7,80 4,70	-1,21 6,01	1,98 -6,36	9,50 11,99	-22,21 -31,52	3,31 -17,12
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-1,77 -0,55	15,81 9,94	-7,01 -4,49	4,37 2,65	16,80 12,60	7,09 25,47	54,56 42,18
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-1,74 1,20	15,49 12,38	-6,97 0,25	4,18 -4,16	16,47 18,96	6,69 -2,62	53,17 32,75
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI Var. S&P 500 p.p.	-1,75 -0,52	15,73 9,85	-7,00 -4,48	4,28 2,55	16,83 12,63	7,03 25,42	54,50 42,12
COTIA Var. IPCA + 4,88% p.p.	-0,86 -1,50	8,79 0,86	-1,76 -3,72	4,26 0,79	8,16 -1,75	13,22 -9,52	19,47 -22,94
CDI	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65
IBOVESPA	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32	20,43
INPC + 6,00%	0,61	8,14	1,93	3,62	10,36	24,54	46,58
IPCA + 6,00%	0,73	8,88	2,23	4,04	11,08	25,37	47,00

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 IBOVESA, APURADO PELA BM&FBOVESA	1,90
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESA 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 IBOVESA, 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 VARIÇÃO 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 IBOVSPA 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	0,96	11,12	3,06	6,61	13,48	26,55	28,80	34,03	43,59
IRF-M 1+	0,12	12,95	0,56	7,03	13,15	26,82	19,34	24,87	47,27
IRF-M TOTAL	0,37	12,04	1,31	6,68	12,95	26,45	22,28	27,70	46,46
IMA-B 5	-0,31	8,55	0,43	3,06	9,21	23,11	28,57	35,91	54,63
IMA-B 5+	-0,98	10,98	-4,11	3,97	8,37	19,37	18,16	11,25	52,40
IMA-B TOTAL	-0,66	10,06	-1,97	3,75	8,97	21,40	23,62	22,38	55,11
IMA-GERAL TOTAL	0,30	10,92	1,11	5,71	11,71	24,89	26,20	29,58	48,76
IDKA 2	-0,41	8,53	0,64	2,92	9,03	22,65	28,32	36,96	53,47
IDKA 20	-1,16	13,95	-7,55	5,69	7,85	15,86	10,01	-4,59	48,02
CDI	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65	34,86	43,24

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32	20,43	5,52	29,42
IBRX 100	-3,03	2,31	-7,11	8,24	-3,47	7,90	19,13	5,97	32,25
IBRX 50	-2,99	1,78	-6,48	8,57	-2,99	9,63	22,40	7,19	28,83
SMALL CAP	-7,40	-2,72	-16,71	5,49	-16,24	-16,19	-13,16	-18,52	16,44
Índice Consumo - ICON	-8,90	-13,22	-21,67	-1,55	-29,56	-40,09	-45,26	-46,32	-22,15
Índice Dividendos - IDIV	-3,15	7,18	-4,65	7,57	6,28	23,78	40,83	25,93	75,34

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	-1,22	5,87	-2,52	1,73	4,20	-18,39	12,38	74,39	110,39

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,97	10,06	-1,30	10,41	5,49	17,94	14,06	13,03	40,73

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,10	1,94	-3,96	-1,70	4,45	-23,43	1,25	50,47	78,73

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,24	3,75	0,73	1,00	4,82	11,60	23,51	28,35	31,61
INPC	0,12	3,04	0,43	0,60	4,14	10,87	23,15	29,03	32,32
IGPM	0,50	-4,46	0,73	-3,74	-4,57	1,65	23,73	49,63	54,34
SELIC	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65	34,86	43,24

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	7,18	1,74	3,04	9,00	20,69	38,87	50,04	59,99
IPCA + 5,00%	0,65	8,03	1,99	3,54	10,04	23,02	42,90	55,86	67,80
IPCA + 5,50%	0,69	8,46	2,11	3,79	10,56	24,19	44,94	58,84	71,82
IPCA + 5,89%	0,72	8,79	2,21	3,98	10,97	25,11	46,55	61,19	75,01
IPCA + 6,00%	0,73	8,88	2,23	4,04	11,08	25,37	47,00	61,85	75,91
INPC + 4,00%	0,45	6,44	1,44	2,62	8,29	19,90	38,47	50,83	60,87
INPC + 6,00%	0,61	8,14	1,93	3,62	10,36	24,54	46,58	62,71	76,88

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%)	43.081.322,26	5,030000	41.899.275,90	6,167000	-1.182.046,36
NTN-B 150830 (5,685000%)	42.831.721,47	5,685000	42.400.925,28	5,875600	-430.796,19
NTN-B 150830 (6,080000%)	9.039.189,30	6,080000	9.137.399,40	5,875600	98.210,10
NTN-B 150830 (6,255000%)	41.560.070,64	6,255000	42.400.925,28	5,875600	840.854,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
200	02/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.568,37	1.345,61125155	2,6518580280
214	02/10/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.414.662,62	0,00	1.115.591,00441700	4,8536270000
199	04/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	19.150,63	7.215,52220648	2,6540878750
209	06/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.640,00	0,00	884,14331800	2,9859412420
212	06/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.189,00	3.459,11200200	2,6564621190
198	09/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	48,85	0,00	18,38126300	2,6575974380
210	09/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	34.875,64	11.674,34728327	2,9873738680
197	10/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	19.007,14	7.148,90647804	2,6587478880
211	11/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.493,49	561,48584600	2,6598889540
195	13/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	361,00	135,66430500	2,6609799920
196	16/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.438,65	3.921,24634300	2,6620745260
191	18/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.527,00	2.825,12598091	2,6643059640
208	19/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.591,18	0,00	1.531,95201700	2,9969476510
189	23/10/2023	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2.162.927,80	0,00	1.169.057,90137600	1,8501460000
190	23/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.400,00	5.397,83772400	2,6677348850
207	23/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.843.440,23	0,00	614.506,19932520	2,9998724700
215	23/10/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.244.391,69	0,00	663.995,65999013	4,8861640000
213	25/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	349,90	131,05119100	2,6699490240
192	26/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	401,86	150,44807800	2,6710876220
205	26/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.925.712,75	0,00	1.306.794,35370000	3,0040784450
193	27/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	91.278,34	34.158,15015673	2,6722272600
204	27/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	29.304,21	0,00	9.750,32206000	3,0054607240
206	27/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.925.735,79	1.306.200,99562500	3,0054607240
202	30/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	29.548,00	0,00	9.826,85631900	3,0068619140
194	31/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	61.747,16	23.086,81405814	2,6745639240
201	31/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	12.062,20	0,00	4.009,64693355	3,0082947950
203	31/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	735.497,17	244.489,72594789	3,0082947950
Total			16.669.329,53	4.935.021,14		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 19.386.432,26

Value-At-Risk: 1,87%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
COTIA		1,87		1,87			1.034.244.230,11	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,83%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (5,030000%)		0,05	-0,00	0,06			43.081.322,26	4,17
NTN-B 150830 (5,685000%)		0,05	-0,00	0,06			42.831.721,47	4,14
NTN-B 150830 (6,080000%)		0,05	-0,00	0,06			9.039.189,30	0,87
NTN-B 150830 (6,255000%)		0,05	-0,00	0,06			41.560.070,64	4,02
Sub-total	0,19	0,05	-0,00		-1,55	0,70	136.512.303,67	13,20

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			3.444.787,86	0,33
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA		2,06	0,01	0,20			9.885.884,23	0,96
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,03	0,12	0,04			103.329.005,73	9,99
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,00	0,02	0,03			17.781.915,33	1,72
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,12	0,00	0,01			29.627.994,45	2,86
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,19	0,09	0,01			141.239.936,76	13,66
BB PREV RF IDKA2		1,10	0,02	0,16			28.533.840,93	2,76
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,94	0,04	0,31			72.666.622,21	7,03
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,21	0,01	0,02			11.844.563,06	1,15
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,77	0,01	1,78			6.019.087,93	0,58
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,84	0,01	0,85			31.340.606,68	3,03
Sub-total	3,55	1,23	0,33		-0,36	-0,29	455.714.245,17	44,06

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			18.919.456,09	1,83
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			50.312.595,90	4,86
BB PREV RF FLUXO FIC		0,02	0,00	0,02			5.563.259,25	0,54
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI		0,58	0,01	0,58			18.390.745,11	1,78
Sub-total	0,18	0,12	0,01		-0,40	0,93	93.186.056,35	9,01

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,12%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI		7,37	0,03	0,79			5.904.734,13	0,57
BB AÇÕES DIVIDENDOS		6,56	0,09	1,73			17.742.827,95	1,72
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES		5,66	0,02	2,57			5.656.871,46	0,55
FIA BRASIL IBX-50		7,45	0,06	0,94			10.629.403,32	1,03
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		7,11	0,03	1,13			4.694.948,39	0,45
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		7,81	0,12	0,38			19.904.455,28	1,92
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		9,09	0,02	4,47			3.704.471,87	0,36
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS		7,67	0,08	1,34			14.309.551,00	1,38
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		6,58	0,07	1,35			15.888.267,85	1,54
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC		6,46	0,01	2,71			3.234.917,62	0,31
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		7,41	0,04	1,11			6.678.283,84	0,65
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA		5,94	0,14	8,01			34.337.023,21	3,32
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		7,61	0,05	2,81			8.785.231,29	0,85
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		9,20	0,04	4,24			5.305.475,21	0,51
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI		7,42	0,04	2,69			7.055.679,93	0,68
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		7,54	0,02	1,98			4.189.226,20	0,41
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA		8,80	0,02	2,45			2.862.767,79	0,28
Sub-total	13,99	6,12	0,87		-0,33	-3,57	170.884.136,34	16,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 6,05%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		6,02	0,08	7,22			17.132.561,02	1,66
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,06	0,32	5,27			68.205.719,29	6,59
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI		6,04	0,06	5,27			11.705.911,76	1,13
Sub-total	15,18	6,05	0,46		-0,18	-1,76	97.044.192,07	9,38

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,69%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,90	0,15	0,71			51.947.662,03	5,02
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		6,69	0,06	10,50			28.955.634,48	2,80
Sub-total	15,65	6,69	0,21		-0,17	-1,63	80.903.296,51	7,82

(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 (%)