



LDB
EMPRESAS

TOLEDO
1º TRIMESTRE 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 28.03.2024.

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

RENDA FIXA 84,02%

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	Trim.				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,97	0,03	0,77	2,41	26.567.795,78	4,68	6.783.435.564,44	0,39
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,11	0,04	0,79	2,55	87.870.629,64	15,48	13.231.140.496,66	0,66
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,88	-0,00	0,06	0,13	38.468.858,57	6,78	5.029.824.301,86	0,76
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,24	0,04	0,80	2,47	30.104.254,20	5,30	8.612.056.482,37	0,35
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,68	0,08	0,75	2,01	40.035.989,65	7,05	7.792.392.111,13	0,51
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,00	-0,08	-0,56	-1,52	4.077.229,43	0,72	1.366.454.531,96	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,58	0,10	0,90	2,08	13.133.356,12	2,31	5.081.326.495,59	0,26
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,36	0,03	0,58	1,80	61.166.906,02	10,78	5.431.217.487,91	1,13
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,98	0,04	0,91	-0,09	10.017.721,86	1,76	192.912.939,03	5,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,72	0,04	1,01	2,64	42.549.134,45	7,50	652.954.009,62	6,52
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,08	0,04	0,69	1,94	353.991.875,72	62,36		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	5,96	-0,35	-0,62	-0,96	16.545.514,42	2,91	139.259.780,06	11,88
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	8,06	0,11	1,42	3,13	10.528.883,79	1,85	236.185.618,53	4,46
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,04	0,87	2,72	44.443.372,61	7,83	16.216.695.874,70	0,27
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,10	0,04	0,85	2,70	41.130.941,27	7,25	6.030.179.613,18	0,68
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,05	0,03	0,62	2,17	10.264.363,58	1,81	750.127.183,13	1,37
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,43	-0,01	0,68	2,14	122.913.075,67	21,65		
Renda Fixa			1,04	0,03	0,69	1,99	476.904.951,39	84,02		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

4,30%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	25,20	-0,04	0,91	-6,68	1.211.131,26	0,21	212.054.099,29	0,57
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	21,86	0,22	1,12	-7,43	833.009,58	0,15	111.593.641,09	0,75
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	12,81	0,12	-1,01	-2,33	5.073.136,11	0,89	1.020.718.638,42	0,50
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	20,62	0,29	2,09	-4,27	1.482.012,27	0,26	686.836.540,62	0,22
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	13,98	0,47	0,97	1,44	5.145.032,62	0,91	1.248.705.426,92	0,41
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	14,97	0,20	0,60	-2,88	8.317.162,27	1,47	627.026.185,29	1,33
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	18,04	-0,04	0,80	-5,56	2.333.898,14	0,41	147.570.225,77	1,58
Sub-total Artigo 8º I			14,93	0,21	0,48	-2,62	24.395.382,25	4,30		
Renda Variável			14,93	0,21	0,48	-2,62	24.395.382,25	4,30		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR **4,24%**

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,82	1,35	2,16	15,24	4.588.471,20	0,81	769.263.355,99	0,60
Sub-total Artigo 9º II			18,82	1,35	2,16	11,82	4.588.471,20	0,81		

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	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	14,00	0,35	3,48	14,98	19.496.898,97	3,43	2.280.222.056,45	0,86
Sub-total Artigo 9º III			14,00	0,35	3,48	14,98	19.496.898,97	3,43		

Investimentos no Exterior			12,87	0,54	3,22	13,86	24.085.370,17	4,24		
----------------------------------	--	--	--------------	-------------	-------------	--------------	----------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,44%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	8,20	0,17	-0,60	-4,34	4.496.288,47	0,79	133.890.315,46	3,36
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2,71	-0,04	-1,35	-1,12	11.380.234,00	2,00	234.008.087,33	4,86
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	7,00	0,25	-0,96	-3,24	7.951.767,48	1,40	178.044.107,12	4,47
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11,49	0,14	3,39	11,13	18.401.000,72	3,24	1.864.604.527,50	0,99
Sub-total Artigo 10º I			5,34	0,11	0,82	3,11	42.229.290,67	7,44		
Investimentos Estruturados			5,34	0,11	0,82	3,11	42.229.290,67	7,44		
Total			1,87	0,06	0,79	2,41	567.614.994,48	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	308.257,89
Sub-total Disponibilidades Financeiras	308.257,89
Total	567.923.252,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	353.991.875,72	62,36	20,00	23,64	90,00	29,51	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	122.913.075,67	21,65	5,00	16,63	50,00	12,23	70,00
	Total Renda Fixa	476.904.951,39	84,02					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	24.395.382,25	4,30	0,00	8,11	20,00	0,49	40,00
	Total Renda Variável	24.395.382,25	4,30					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	4.588.471,20	0,81	0,00	5,00	10,00	4,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	19.496.898,97	3,43	0,00	5,00	10,00	6,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	24.085.370,17	4,24					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	42.229.290,67	7,44	5,00	10,00	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	42.229.290,67	7,44					15,00
Total		567.614.994,48	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,69 82,69	1,94 73,89	1,94 73,89	5,18 93,46	11,67 94,39	2.455.807,31	6.718.598,07
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,68 81,70	2,14 81,68	2,14 81,68	5,01 90,40	11,29 91,31	801.262,10	2.402.411,26
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	0,48 1,19	-2,62 1,91	-2,62 1,91	9,80 -0,10	22,70 -3,04	116.290,65	-808.499,16
Artigo 9º II % do CDI	2,16 259,53	11,82 450,24	11,82 450,24	27,83 502,64	37,70 304,97	97.152,77	1.233.378,90
Artigo 9º III % do CDI	3,48 417,27	14,98 570,76	14,98 570,76	23,77 429,35	32,44 262,42	655.289,52	2.540.271,38
Artigo 10º I % do CDI	0,82 98,68	3,11 118,55	3,11 118,55	13,18 237,98	18,93 153,16	344.478,74	1.242.108,49
TOLEDO (Total)						4.470.281,09	13.328.268,94

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	26.365.669,39	0,00	0,00	0,00	26.567.795,78	202.126,39	624.790,85
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.926.900,58	0,00	0,00	0,00	10.017.721,86	90.821,28	-9.521,58
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	13.016.462,29	0,00	0,00	0,00	13.133.356,12	116.893,83	267.640,35
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	39.736.894,18	0,00	0,00	0,00	40.035.989,65	299.095,47	787.512,38
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.100.154,80	0,00	0,00	0,00	4.077.229,43	-22.925,37	-62.970,49
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	38.447.087,77	0,00	0,00	0,00	38.468.858,57	21.770,80	48.889,86
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.866.403,00	0,00	0,00	0,00	30.104.254,20	237.851,20	725.785,03
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	88.928.769,27	6.634.552,81	-8.427.985,54	0,00	87.870.629,64	735.293,10	2.161.088,66
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	60.815.500,62	0,00	0,00	0,00	61.166.906,02	351.405,40	1.080.530,55
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	42.125.659,24	0,00	0,00	0,00	42.549.134,45	423.475,21	1.094.852,46
	353.329.501,14	6.634.552,81	-8.427.985,54	0,00	353.991.875,72	2.455.807,31	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	40.784.729,91	0,00	0,00	0,00	41.130.941,27	346.211,36	1.080.724,15
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	39.706.039,03	4.390.857,38	0,00	0,00	44.443.372,61	346.476,20	944.684,53
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	10.201.207,56	0,00	0,00	0,00	10.264.363,58	63.156,02	218.068,90
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	16.647.922,31	0,00	0,00	0,00	16.545.514,42	-102.407,89	-160.249,21
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	10.381.057,38	0,00	0,00	0,00	10.528.883,79	147.826,41	319.182,89
	117.720.956,19	4.390.857,38	0,00	0,00	122.913.075,67	801.262,10	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	1.200.229,53	0,00	0,00	0,00	1.211.131,26	10.901,73	-86.717,71
FIA CAIXA CONSUMO	823.758,14	0,00	0,00	0,00	833.009,58	9.251,44	-66.897,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.451.611,16	0,00	0,00	0,00	1.482.012,27	30.401,11	-66.086,77
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.124.849,09	0,00	0,00	0,00	5.073.136,11	-51.712,98	-120.814,50
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	8.267.762,99	0,00	0,00	0,00	8.317.162,27	49.399,28	-246.355,39
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	5.095.445,06	0,00	0,00	0,00	5.145.032,62	49.587,56	72.990,21
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	2.315.435,63	0,00	0,00	0,00	2.333.898,14	18.462,51	-137.466,77
	24.279.091,60	0,00	0,00	0,00	24.395.382,25	116.290,65	

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	4.491.318,43	0,00	0,00	0,00	4.588.471,20	97.152,77	606.820,91
	4.491.318,43	0,00	0,00	0,00	4.588.471,20	97.152,77	

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18.841.609,45	0,00	0,00	0,00	19.496.898,97	655.289,52	2.540.271,38
	18.841.609,45	0,00	0,00	0,00	19.496.898,97	655.289,52	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	17.796.882,36	0,00	0,00	0,00	18.401.000,72	604.118,36	1.842.557,78
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	11.535.680,00	0,00	0,00	0,00	11.380.234,00	-155.446,00	-129.239,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	4.523.519,84	0,00	0,00	0,00	4.496.288,47	-27.231,37	-205.352,65
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	8.028.729,73	0,00	0,00	0,00	7.951.767,48	-76.962,25	-265.857,64
	41.884.811,93	0,00	0,00	0,00	42.229.290,67	344.478,74	

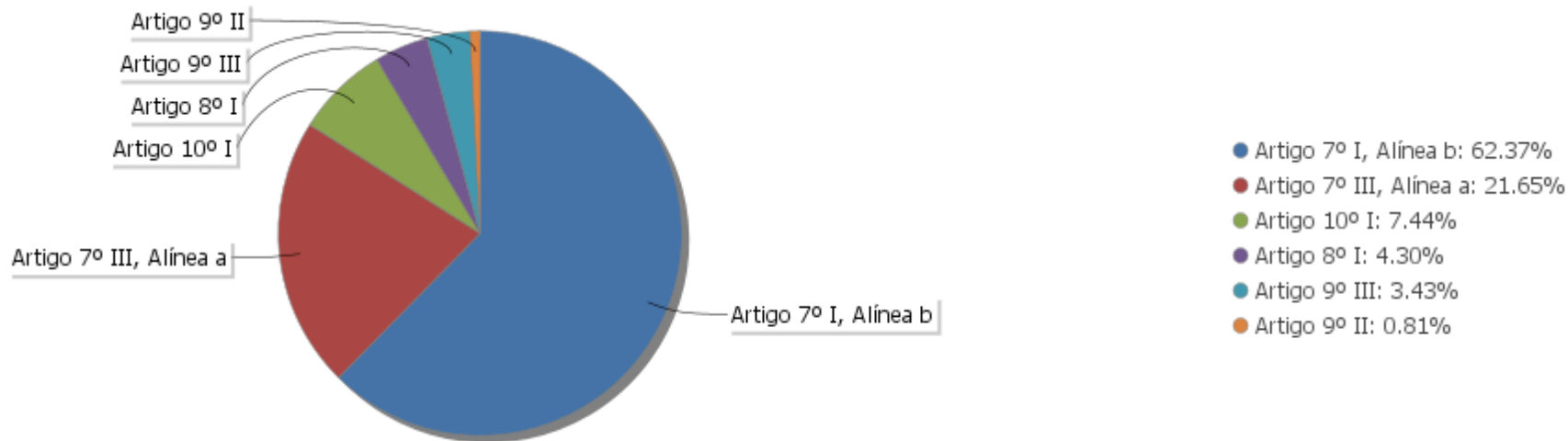
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

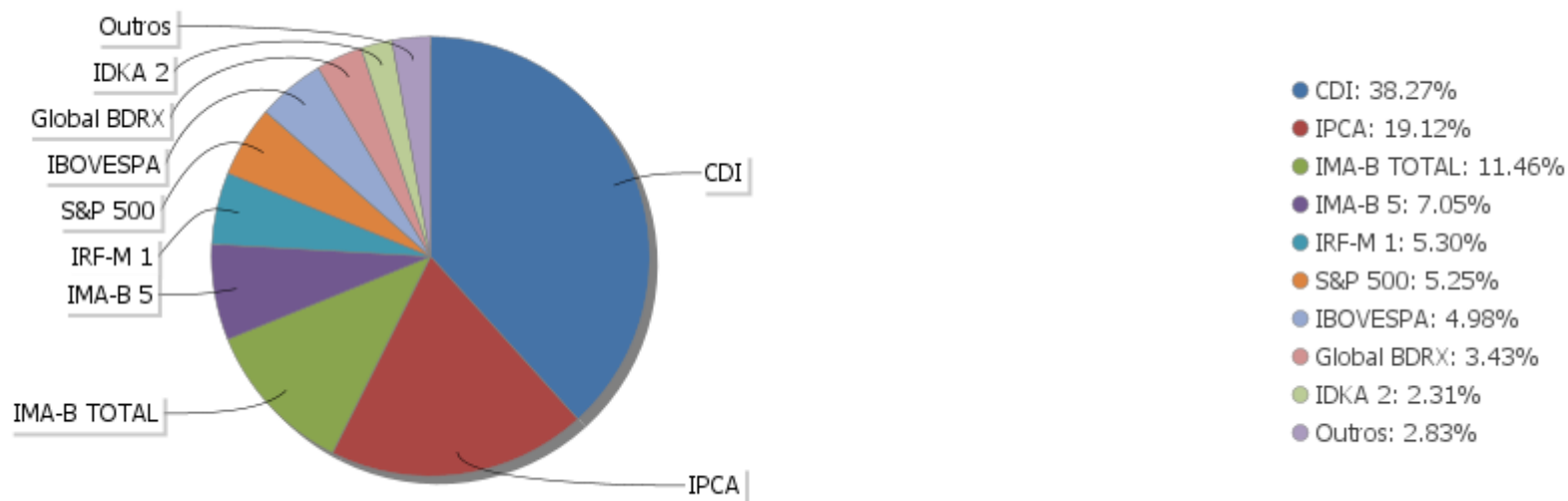
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	485.825.355,32	85,59	50,00	485.825.355,32	85,59	50,00
de 31 dias a 365 dias	66.764.466,90	11,76	10,00	552.589.822,22	97,35	60,00
acima de 365 dias	15.025.172,26	2,65	5,00	567.614.994,48	100,00	65,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

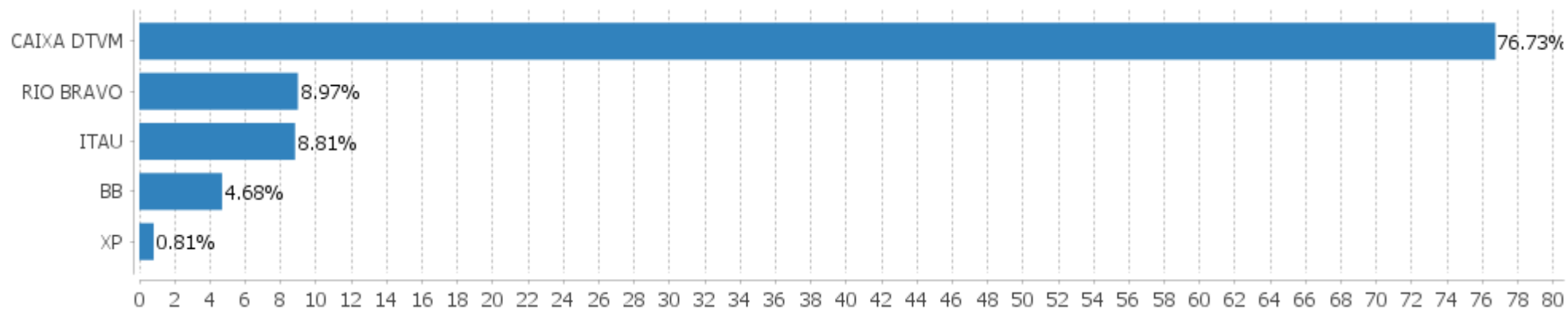


Alocação Por Estratégia



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	0,50	1,10	0,79										2,41
INPC + 4,90%	0,99	1,17	0,57										2,76
p.p. indexador	-0,49	-0,07	0,22										-0,35
2023	1,53	0,31	1,34	0,93	1,82	1,89	1,31	0,27	-0,00	0,06	2,52	1,84	14,69
INPC + 4,89%	0,88	1,11	1,08	0,87	0,78	0,30	0,31	0,64	0,49	0,52	0,48	0,93	8,72
p.p. indexador	0,65	-0,80	0,26	0,06	1,04	1,59	1,00	-0,37	-0,49	-0,46	2,04	0,91	5,98
2022	-0,80	-0,15	1,83	-0,96	0,47	-0,80	1,51	0,85	0,07	1,78	0,07	0,29	4,18
INPC + 4,90%	1,07	1,36	2,14	1,41	0,87	1,02	-0,20	0,13	0,08	0,85	0,76	1,11	11,10
p.p. indexador	-1,87	-1,51	-0,30	-2,36	-0,40	-1,82	1,71	0,73	-0,01	0,93	-0,69	-0,83	-6,92
2021	-0,35	-0,77	0,32	0,99	0,81	0,33	-0,23	-0,33	-0,71	-0,46	0,91	1,12	1,62
INPC + 5,42%	0,69	1,20	1,35	0,80	1,41	1,04	1,49	1,35	1,65	1,58	1,26	1,22	16,11
p.p. indexador	-1,04	-1,97	-1,02	0,19	-0,60	-0,72	-1,71	-1,67	-2,36	-2,04	-0,35	-0,10	-14,48
2020	0,52	-0,14	-3,86	1,35	1,57	1,44	1,98	-0,63	-0,87	-0,13	1,81	2,48	5,48
INPC + 5,87%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,96	0,84	1,35	1,37	1,41	1,97	11,61
p.p. indexador	-0,17	-0,72	-4,54	1,12	1,37	0,66	1,02	-1,47	-2,22	-1,50	0,40	0,51	-6,13

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	19	37,25
Meses abaixo - Meta Atuarial	32	62,75

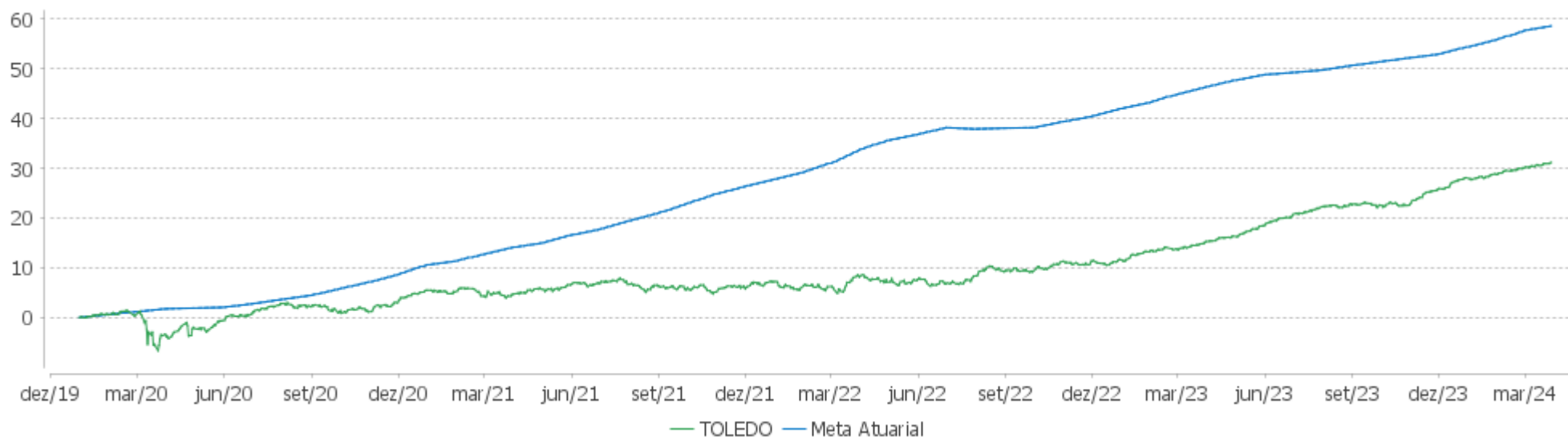
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,52	2023-11
Menor rentabilidade da Carteira	-3,86	2020-03

Relatório

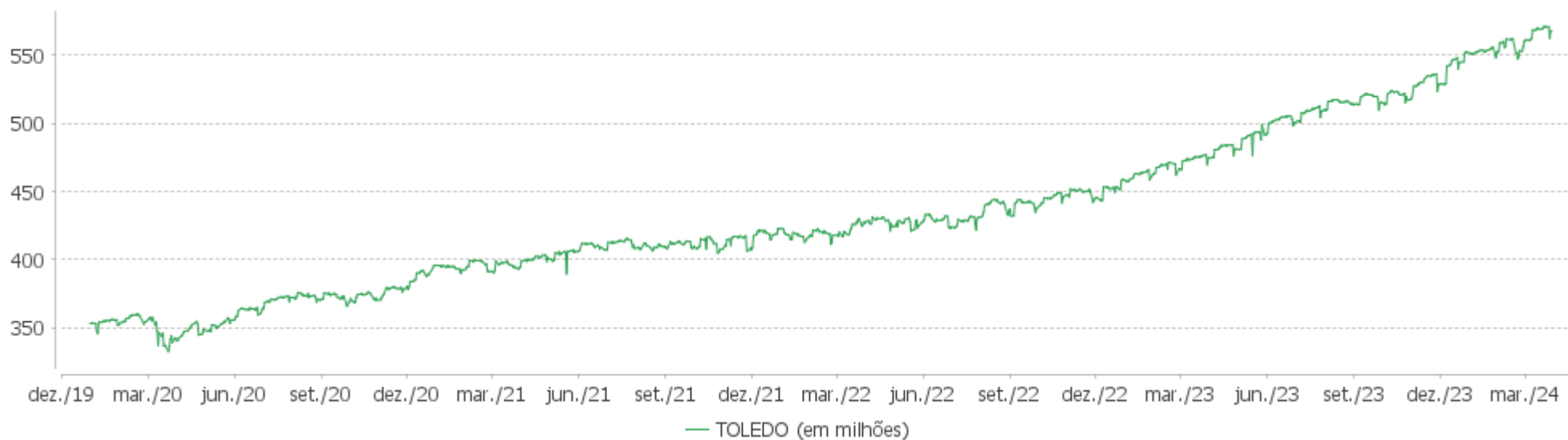
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,41	2,76	-0,35	1,43
06 meses	6,99	4,76	2,23	1,94
12 meses	13,80	8,35	5,45	1,87
24 meses	21,32	18,62	2,70	2,65
36 meses	25,36	39,54	-14,19	3,05
48 meses	35,92	57,75	-21,83	3,48
Desde 31/12/2019	31,17	60,85	-29,68	4,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

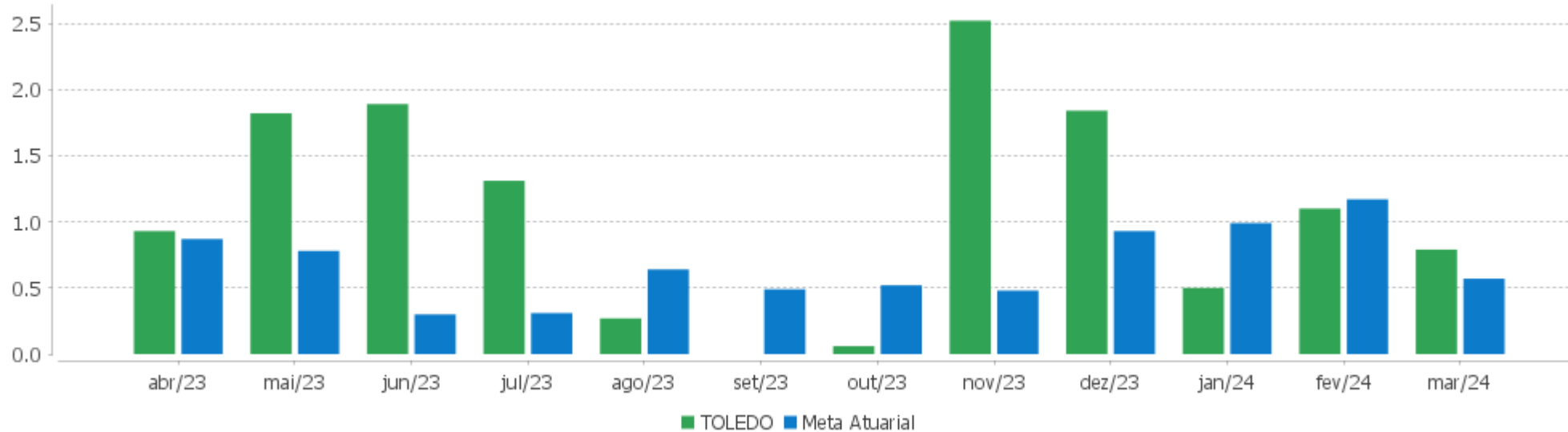


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,91 0,84	-0,09 -0,27	-0,09 -0,27	2,06 -2,88	6,71 -5,10	16,71 -3,50	26,52 0,89
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,06 -0,02	0,13 -0,05	0,13 -0,05	4,84 -0,10	11,64 -0,17	19,81 -0,40	24,88 -0,74
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,75 -0,02	2,01 -0,05	2,01 -0,05	4,98 -0,10	9,48 -0,15	20,72 -0,29	30,95 -0,60
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,58 0,42	1,80 0,38	1,80 0,38	4,77 2,26	11,99 8,07	25,10 16,35	28,10 7,05
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,90 -0,10	2,08 -0,16	2,08 -0,16	5,00 -0,20	9,45 -0,03	19,97 -0,69	30,39 -1,24
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,77 0,61	2,41 0,99	2,41 0,99	5,40 2,88	13,73 9,81	25,89 17,14	31,67 10,63
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,80 -0,04	2,47 0,01	2,47 0,01	5,37 -0,06	12,08 -0,20	26,60 -0,48	32,83 -0,78
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,79 95,28	2,55 97,24	2,55 97,24	5,41 97,75	12,25 99,11	26,99 98,93	35,33 99,67
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,56 -0,01	-1,52 -0,01	-1,52 -0,01	4,78 -0,03	13,13 -0,25	18,45 -0,63	18,32 -1,18
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI	1,01 120,61	2,64 100,62	2,64 100,62	6,36 114,88	11,94 96,56	23,28 85,32	34,24 96,60
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,62 -0,69	-0,96 -1,13	-0,96 -1,13	3,30 -1,64	7,62 -4,18		
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,85 101,85	2,70 102,81	2,70 102,81	5,72 103,26	12,96 104,85	27,89 102,21	36,73 103,63
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,87 104,20	2,72 103,65	2,72 103,65	5,74 103,60	12,93 104,59	27,88 102,20	36,71 103,58
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF Var. IPCA p.p.	1,42 1,26	3,13 1,71	3,13 1,71	3,12 0,60			
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,62 0,46	2,17 0,76	2,17 0,76	4,77 2,25	11,55 7,63	24,47 15,71	28,70 7,66
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	1,12 -0,13	-7,43 -0,33	-7,43 -0,33	3,63 -0,70	12,30 -1,45	-31,34 -1,71	-44,86 -2,16
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	2,09	-4,27	-4,27	6,32	22,85	-11,79	-21,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. SMALL CAP p.p.	-0,06	-0,18	-0,18	-0,61	-1,28	-1,22	-1,71
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL % do CDI	0,91 108,98	-6,68 -254,56	-6,68 -254,56	8,72 157,48	38,31 309,90	14,48 53,06	-8,15 -23,01
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	0,97 1,68	1,44 5,97	1,44 5,97	17,99 8,09	23,28 -2,46	12,52 5,76	7,59 -2,24
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,01 0,19	-2,33 1,48	-2,33 1,48	10,04 -0,20	26,45 -0,75	13,34 -5,68	20,66 -12,24
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	0,80 1,51	-5,56 -1,03	-5,56 -1,03	2,93 -6,98	12,24 -13,50	-17,70 -24,46	
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	0,60 1,31	-2,88 1,65	-2,88 1,65	7,26 -2,64	23,33 -2,41	1,91 -4,85	-3,35 -13,18
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	3,48 -0,57	14,98 -0,90	14,98 -0,90	23,77 -1,11	32,44 -2,21	27,69 -2,86	18,24 -5,60
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	2,16 1,54	15,24 12,38	15,24 12,38	29,37 23,92	37,99 27,96	27,89 5,83	-12,39 -56,39
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	3,39 0,03	11,13 -2,55	11,13 -2,55	25,56 3,31	36,04 10,29	34,42 12,11	62,08 46,10
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-0,60 0,11	-4,14 0,39	-4,14 0,39	5,50 -4,40	12,08 -13,66	12,73 5,98	
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	-1,35 -4,72	-1,12 -14,81	-1,12 -14,81	3,09 -19,16	9,58 -16,17		
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-0,96 -0,25	-3,24 1,30	-3,24 1,30	7,80 -2,10	7,70 -18,04		
TOLEDO Var. INPC + 4,90% p.p.	0,79 0,22	2,41 -0,35	2,41 -0,35	6,99 2,23	13,80 5,44	21,32 2,69	25,36 -13,68
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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 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 MATRIZ RENDA FI	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
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
FIA CAIXA CONSUMO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,60
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
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		
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
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du		1,90

O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO CDI, DE UM DIA, APURADO PELA CETIP	0,50
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	D+0	D+0	D+21 du	D+24 du		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1	D+2		0,90
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	D+0	D+0	D+1	D+2		0,90
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+3 du		
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+2		1,20
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+3 d.u		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,84	2,46	2,46	5,42	12,28	27,08	33,61	36,96	46,08
IRF-M 1+	0,43	1,37	1,37	6,49	15,26	28,03	28,76	31,09	48,08
IRF-M TOTAL	0,54	1,68	1,68	6,13	14,03	27,20	29,99	32,91	47,66
IMA-B 5	0,77	2,06	2,06	5,09	9,62	21,01	31,56	42,74	56,07
IMA-B 5+	-0,55	-1,51	-1,51	4,82	13,38	19,08	19,49	33,85	44,87
IMA-B TOTAL	0,08	0,18	0,18	4,94	11,81	20,21	25,62	38,67	51,35
IMA-GERAL TOTAL	0,52	1,64	1,64	5,51	12,59	24,78	30,91	37,43	49,07
IDKA 2	0,99	2,24	2,24	5,19	9,48	20,66	31,64	42,92	55,95
IDKA 20	-1,51	-4,59	-4,59	5,22	18,67	18,54	9,63	26,29	33,79
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84	75,44	34,26
IBRX 100	-0,73	-4,29	-4,29	10,02	25,18	5,09	8,02	75,18	36,28
IBRX 50	-0,81	-4,06	-4,06	9,78	24,88	5,45	9,81	80,89	34,52
SMALL CAP	2,15	-4,09	-4,09	6,93	24,13	-10,57	-19,33	32,77	16,87
Índice Consumo - ICON	1,26	-7,10	-7,10	4,34	13,75	-29,62	-42,70	-13,51	-19,55
Índice Dividendos - IDIV	-1,20	-3,81	-3,81	10,25	27,20	19,02	32,90	85,19	70,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,37	13,68	13,68	22,26	25,75	22,31	15,98	95,38	137,68

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,43	2,92	2,92	5,87	23,44	22,60	19,72	36,65	37,26

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,14	11,17	11,17	18,97	19,08	16,07	2,01	70,15	97,45

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,16	1,42	1,42	2,51	3,93	8,76	21,05	28,43	32,67
INPC	0,19	1,58	1,58	2,36	3,40	7,91	20,56	28,93	33,20
IGPM	-0,47	-0,91	-0,91	0,91	-4,26	-4,10	10,07	44,30	54,12
SELIC	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,47	2,38	2,38	4,48	8,00	17,54	36,06	50,08	61,29
IPCA + 5,00%	0,55	2,62	2,62	4,96	9,02	19,79	39,99	55,90	69,16
IPCA + 5,50%	0,59	2,74	2,74	5,21	9,53	20,92	41,99	58,87	73,21
IPCA + 5,89%	0,62	2,83	2,83	5,39	9,92	21,81	43,56	61,21	76,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00	61,88	77,34
INPC + 4,00%	0,50	2,55	2,55	4,32	7,45	16,62	35,51	50,66	61,93
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43	62,51	78,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	08/01/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	443.436,69	0,00	82.438,39243900	5,3790070000
2	19/01/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	28.511,99	0,00	5.280,32279022	5,3996680000
3	26/01/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	45.992,12	0,00	9.130,87017000	5,0369920000
4	29/01/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	7.950.875,61	1.468.637,98623900	5,4137750000
5	30/01/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.344.865,26	0,00	861.809,68985790	5,0415600000
6	02/02/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.798.630,21	0,00	1.069.303,59168000	5,4228100000
7	07/02/2024	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	0,00	5.051.563,67	1.691.525,79524942	2,9863947000
8	08/02/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	416.210,96	0,00	76.627,76035400	5,4315950000
9	09/02/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.051.563,67	0,00	929.617,81715200	5,4340220000
10	19/02/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	284.569,38	0,00	56.154,64276700	5,0676020000
11	19/02/2024	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	0,00	10.637.186,66	67.148,93961755	158,4118338000
12	21/02/2024	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	0,00	4.527.796,49	3.994.451,70657950	1,1335214000
13	21/02/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	37.516,96	0,00	6.887,09228200	5,4474310000
14	23/02/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.527.796,49	0,00	891.888,78348200	5,0766380000
15	27/02/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.408.799,59	0,00	441.471,41340100	5,4562980000
16	28/02/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	4.500.000,00	885.258,84677000	5,0832590000
17	28/02/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.390.857,38	0,00	863.787,85342200	5,0832590000
18	28/02/2024	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	4.500.000,00	0,00	3.961.502,99423600	1,1359325000
19	06/03/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	6.037,13	1.103,50718361	5,4708570000
20	07/03/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	651.006,79	0,00	118.946,58458768	5,4731020000
21	08/03/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.831.888,94	0,00	1.065.207,17961850	5,4748870000
22	13/03/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	23.917,99	0,00	4.362,49666675	5,4826380000
23	19/03/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	59.883,79	0,00	10.908,49358647	5,4896480000
24	26/03/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	8.421.948,41	1.531.184,00410161	5,5002850000
25	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.390.857,38	0,00	856.299,02987978	5,1277150000
26	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	67.855,30	0,00	12.332,03794954	5,5023590000
Total			43.304.160,89	41.095.407,97		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.986.654,30

Value-At-Risk: 0,70%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,67	0,27	5,00	0,15	-0,22	0,69	476.904.951,39	84,02
Artigo 8º	9,32	6,27	20,00	0,23	-0,04	0,48	24.395.382,25	4,30
Artigo 9º	13,56	5,77	20,00	0,12	0,18	3,23	24.085.370,17	4,24
Artigo 10º	4,03	2,96	20,00	0,20	-0,00	0,82	42.229.290,67	7,44
TOLEDO	1,87	0,70		0,70	0,77	13,80	567.614.994,48	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,27%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,17	0,08	0,00	0,13	-0,40	0,77	26.567.795,78	4,68
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,15	0,05	0,00	0,04	-0,26	0,79	87.870.629,64	15,48
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,28	1,22	0,06	0,01	-0,34	0,06	38.468.858,57	6,78
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,18	0,09	0,00	0,05	-0,21	0,80	30.104.254,20	5,30
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,93	0,53	0,03	0,01	-0,09	0,75	40.035.989,65	7,05
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,53	2,22	0,01	0,03	-0,39	-0,56	4.077.229,43	0,72
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,10	0,53	0,01	0,12	0,06	0,90	13.133.356,12	2,31
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,17	0,40	0,03	0,41	-0,22	0,58	61.166.906,02	10,78
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,42	0,46	0,00	1,29	0,19	0,91	10.017.721,86	1,76
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	0,62	0,43	-0,01	0,43	0,28	1,01	42.549.134,45	7,50
Sub-total	0,58	0,29	0,12		-0,25	0,69	353.991.875,72	62,36

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	6,20	2,20	0,02	2,04	-0,23	-0,62	16.545.514,42	2,91
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	1,20	1,52	0,00	1,52	0,49	1,42	10.528.883,79	1,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,03	0,02	0,00	0,01	1,21	0,87	44.443.372,61	7,83
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,11	0,05	0,00	0,04	0,14	0,85	41.130.941,27	7,25
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,96	0,33	0,00	0,34	-0,22	0,62	10.264.363,58	1,81
Sub-total	0,91	0,36	0,03		-0,17	0,68	122.913.075,67	21,65

Investimentos Estruturados Value-At-Risk: 2,96%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	5,81	4,49	0,02	2,58	-0,25	-0,60	4.496.288,47	0,79
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	6,15	2,46	-0,01	6,79	-0,35	-1,35	11.380.234,00	2,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	8,78	4,84	0,05	1,10	-0,20	-0,96	7.951.767,48	1,40
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	9,64	5,09	0,13	4,20	0,27	3,39	18.401.000,72	3,24
Sub-total	4,03	2,96	0,20		-0,00	0,82	42.229.290,67	7,44

Renda Variável Value-At-Risk: 6,27%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	17,24	11,18	0,02	11,18	0,00	0,91	1.211.131,26	0,21
FIA CAIXA CONSUMO	16,44	12,29	0,01	0,16	0,02	1,12	833.009,58	0,15
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	8,55	5,14	0,04	1,87	-0,22	-1,01	5.073.136,11	0,89
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	13,23	9,03	0,02	0,17	0,10	2,09	1.482.012,27	0,26
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	11,14	6,88	0,05	3,88	0,01	0,97	5.145.032,62	0,91
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	8,61	5,75	0,07	2,17	-0,03	0,60	8.317.162,27	1,47
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	11,72	7,22	0,02	3,12	-0,00	0,80	2.333.898,14	0,41
Sub-total	9,32	6,27	0,23		-0,04	0,48	24.395.382,25	4,30

Investimentos no Exterior Value-At-Risk: 5,77%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,55	10,03	0,03	10,02	0,07	2,16	4.588.471,20	0,81
Sub-total	18,55	10,03	0,03		0,07	2,16	4.588.471,20	0,81

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	12,38	5,51	0,09	0,56	0,21	3,48	19.496.898,97	3,43
Sub-total	12,38	5,51	0,09		0,21	3,48	19.496.898,97	3,43

(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 (%)