



LDB
EMPRESAS

TOLEDO
4º TRIMESTRE 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 29.12.2023.

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 81,48%

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	1,58	0,04	0,95	2,92	25.943.004,93	4,70	6.297.472.287,75	0,41
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,08	0,04	0,90	2,79	81.269.179,25	14,72	11.756.324.476,80	0,69
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,45	0,10	2,73	4,71	38.419.968,71	6,96	5.157.397.073,53	0,74
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	0,04	0,89	2,83	29.378.469,17	5,32	8.470.280.308,74	0,35
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,96	0,10	1,44	2,92	39.248.477,27	7,11	7.603.591.100,02	0,52
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,91	0,10	3,93	6,40	4.140.199,92	0,75	1.451.468.758,30	0,29
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,98	0,09	1,40	2,86	12.865.715,77	2,33	5.218.373.540,00	0,25
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,30	0,08	1,21	2,92	60.086.375,47	10,88	5.290.529.627,75	1,14
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,38	0,10	0,92	2,15	10.027.243,44	1,82	193.096.297,69	5,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,91	0,04	1,33	3,62	41.454.281,99	7,51	658.613.058,60	6,29
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,29	0,06	1,32	3,17	342.832.915,92	62,10		

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	7,07	0,03	2,54	4,30	16.705.763,63	3,03	140.608.554,32	11,88
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	9,46	-0,01	0,89	-0,01	10.209.700,90	1,85	229.025.651,82	4,46
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,04	0,92	2,94	30.013.750,07	5,44	13.988.008.512,08	0,21
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,09	0,04	0,93	2,94	40.050.217,12	7,25	5.463.046.966,63	0,73
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,07	0,05	0,98	2,54	10.046.294,68	1,82	745.486.745,62	1,35
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,47	0,04	1,19	2,80	107.025.726,40	19,39		
Renda Fixa			1,16	0,06	1,29	3,09	449.858.642,32	81,48		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

5,48%

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	27,19	-0,01	8,41	16,50	1.297.848,97	0,24	233.700.687,62	0,56
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	17,46	-0,01	5,45	15,02	5.208.714,20	0,94	207.597.477,00	2,51
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	24,23	-0,01	5,96	11,96	899.907,28	0,16	125.761.055,79	0,72
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	14,51	-0,01	5,91	12,66	5.193.950,61	0,94	1.019.487.668,90	0,51
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	22,12	-0,01	6,93	11,06	1.548.099,04	0,28	702.099.612,74	0,22
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	15,75	-0,01	7,35	16,32	5.072.042,41	0,92	1.403.792.198,31	0,36
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	16,57	-0,02	5,40	10,44	8.563.517,66	1,55	662.205.543,66	1,29
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	19,60	-0,01	5,35	8,99	2.471.364,91	0,45	161.464.884,10	1,53
Sub-total Artigo 8º I			16,60	-0,01	6,04	12,76	30.255.445,08	5,48		
Renda Variável			16,60	-0,01	6,04	12,76	30.255.445,08	5,48		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 5,61%

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	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	17,58	-0,59	5,22	15,17	10.010.628,67	1,81	243.950.699,07	4,10
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	22,09	0,13	4,02	12,26	3.981.650,29	0,72	687.792.180,37	0,58
Sub-total Artigo 9º II			15,67	-0,38	4,87	14,32	13.992.278,96	2,53		

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	15,18	-0,00	2,59	7,65	16.956.627,59	3,07	1.995.875.754,00	0,85
Sub-total Artigo 9º III			15,18	-0,00	2,59	7,65	16.956.627,59	3,07		
Investimentos no Exterior			14,11	-0,17	3,61	10,57	30.948.906,55	5,61		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,43%

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 BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,89	0,03	1,00	4,26	11.509.473,00	2,08	236.665.583,39	4,86
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	7,43	0,03	4,49	10,05	4.729.437,61	0,86	149.233.568,01	3,17
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	5,93	0,03	3,53	11,41	8.217.625,12	1,49	183.996.792,33	4,47
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,23	0,04	5,19	12,99	16.558.442,94	3,00	1.635.814.462,49	1,01
Sub-total Artigo 10º I			5,51	0,03	3,57	9,76	41.014.978,67	7,43		
Investimentos Estruturados			5,51	0,03	3,57	9,76	41.014.978,67	7,43		
Total			1,98	0,04	1,84	4,47	552.077.972,62	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	297.206,95
Sub-total Disponibilidades Financeiras	297.206,95
Total	552.375.179,57

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	342.832.915,92	62,10	20,00	29,51	90,00	29,51	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	107.025.726,40	19,39	5,00	12,23	50,00	12,23	70,00
	Total Renda Fixa	449.858.642,32	81,48					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	30.255.445,08	5,48	0,00	0,49	20,00	0,49	40,00
	Total Renda Variável	30.255.445,08	5,48					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	13.992.278,96	2,53	0,00	4,00	10,00	4,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	16.956.627,59	3,07	0,00	6,00	10,00	6,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	30.948.906,55	5,61					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	41.014.978,67	7,43	2,00	10,00	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	41.014.978,67	7,43					15,00
Total		552.077.972,62	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	1,32 147,60	3,17 111,85	3,17 111,85	5,27 85,73	13,36 102,43	4.457.522,46	10.540.201,56
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,19 132,34	2,80 98,71	2,80 98,71	5,20 84,56	12,51 95,86	1.222.112,18	2.739.865,58
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	1,12 18,29	5,39 41,31	0,00	0,00
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	6,04 0,66	12,76 -2,36	12,76 -2,36	9,29 -4,35	16,30 -5,98	1.722.810,97	3.422.869,26
Artigo 9º II % do CDI	4,87 543,74	14,32 504,65	14,32 504,65	14,34 233,24	41,06 314,71	650.247,10	1.752.957,51
Artigo 9º III % do CDI	2,59 288,79	7,65 269,47	7,65 269,47	9,07 147,55	24,92 191,01	427.844,14	1.204.659,15
Artigo 10º I % do CDI	3,57 398,48	9,76 343,97	9,76 343,97	9,66 157,11	20,23 155,07	1.414.378,64	3.647.842,96
TOLEDO (Total)						9.894.915,49	23.308.396,02

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	25.699.310,21	0,00	0,00	0,00	25.943.004,93	243.694,72	736.098,29
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.935.757,18	0,00	0,00	0,00	10.027.243,44	91.486,26	211.497,00
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12.687.853,42	0,00	0,00	0,00	12.865.715,77	177.862,35	357.229,23
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	38.691.882,23	0,00	0,00	0,00	39.248.477,27	556.595,04	1.113.256,51
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.983.571,60	0,00	0,00	0,00	4.140.199,92	156.628,32	249.041,79
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	37.400.218,12	0,00	0,00	0,00	38.419.968,71	1.019.750,59	1.726.631,85
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.120.376,60	0,00	0,00	0,00	29.378.469,17	258.092,57	807.244,61
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	70.314.871,50	18.042.440,98	-7.779.559,18	0,00	81.269.179,25	691.425,95	2.182.702,78
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	59.369.538,76	0,00	0,00	0,00	60.086.375,47	716.836,71	1.706.483,28
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	40.909.132,04	0,00	0,00	0,00	41.454.281,99	545.149,95	1.450.016,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
	328.112.511,66	18.042.440,98	-7.779.559,18	0,00	342.832.915,92	4.457.522,46	

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	39.679.308,79	0,00	0,00	0,00	40.050.217,12	370.908,33	1.143.879,85
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	26.115.175,58	3.649.205,37	0,00	0,00	30.013.750,07	249.369,12	658.737,72
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	9.948.725,33	0,00	0,00	0,00	10.046.294,68	97.569,35	248.971,80
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	16.291.581,71	0,00	0,00	0,00	16.705.763,63	414.181,92	689.083,77
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	10.119.617,44	0,00	0,00	0,00	10.209.700,90	90.083,46	-807,56
	102.154.408,85	3.649.205,37	0,00	0,00	107.025.726,40	1.222.112,18	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	4.939.421,94	0,00	0,00	0,00	5.208.714,20	269.292,26	680.357,90
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	1.197.169,16	0,00	0,00	0,00	1.297.848,97	100.679,81	183.861,06
FIA CAIXA CONSUMO	849.265,75	0,00	0,00	0,00	899.907,28	50.641,53	96.104,99
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.447.795,56	0,00	0,00	0,00	1.548.099,04	100.303,48	154.127,15
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.904.071,89	0,00	0,00	0,00	5.193.950,61	289.878,72	583.865,86
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	8.124.523,45	0,00	0,00	0,00	8.563.517,66	438.994,21	809.185,83
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	4.724.574,36	0,00	0,00	0,00	5.072.042,41	347.468,05	711.568,37
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	2.345.812,00	0,00	0,00	0,00	2.471.364,91	125.552,91	203.798,10
	28.532.634,11	0,00	0,00	0,00	30.255.445,08	1.722.810,97	

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	9.514.264,25	0,00	0,00	0,00	10.010.628,67	496.364,42	1.318.209,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3.827.767,61	0,00	0,00	0,00	3.981.650,29	153.882,68	434.748,30
	13.342.031,86	0,00	0,00	0,00	13.992.278,96	650.247,10	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	16.528.783,45	0,00	0,00	0,00	16.956.627,59	427.844,14	1.204.659,15
	16.528.783,45	0,00	0,00	0,00	16.956.627,59	427.844,14	

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	15.741.381,41	0,00	0,00	0,00	16.558.442,94	817.061,53	1.903.681,39
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	11.395.845,00	0,00	0,00	0,00	11.509.473,00	113.628,00	470.783,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	4.526.269,81	0,00	0,00	0,00	4.729.437,61	203.167,80	432.000,75
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	7.937.103,81	0,00	0,00	0,00	8.217.625,12	280.521,31	841.377,82
	39.600.600,03	0,00	0,00	0,00	41.014.978,67	1.414.378,64	

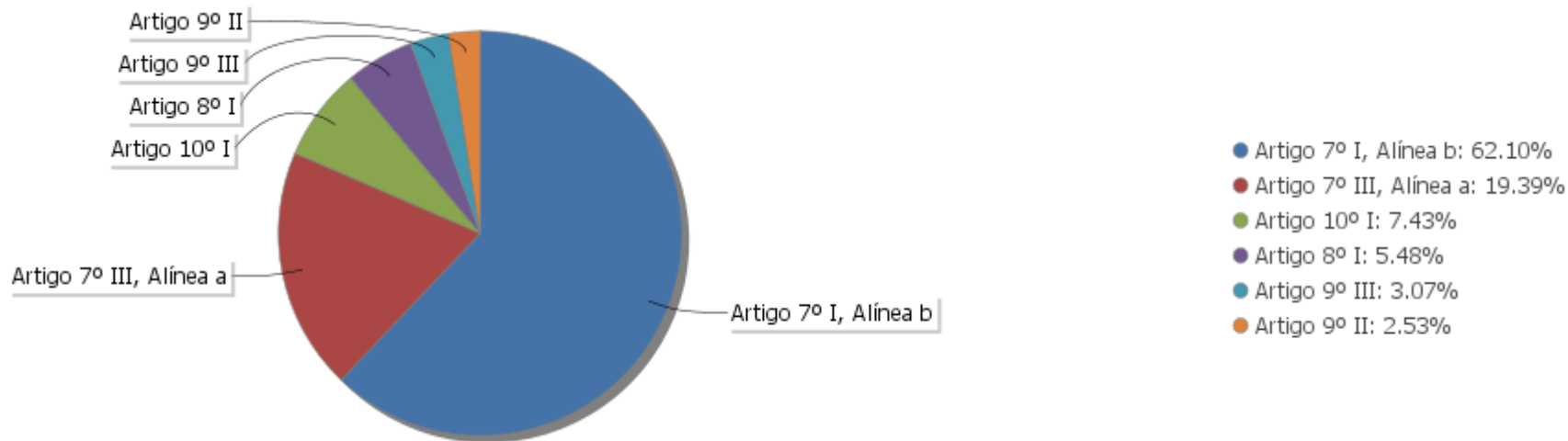
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

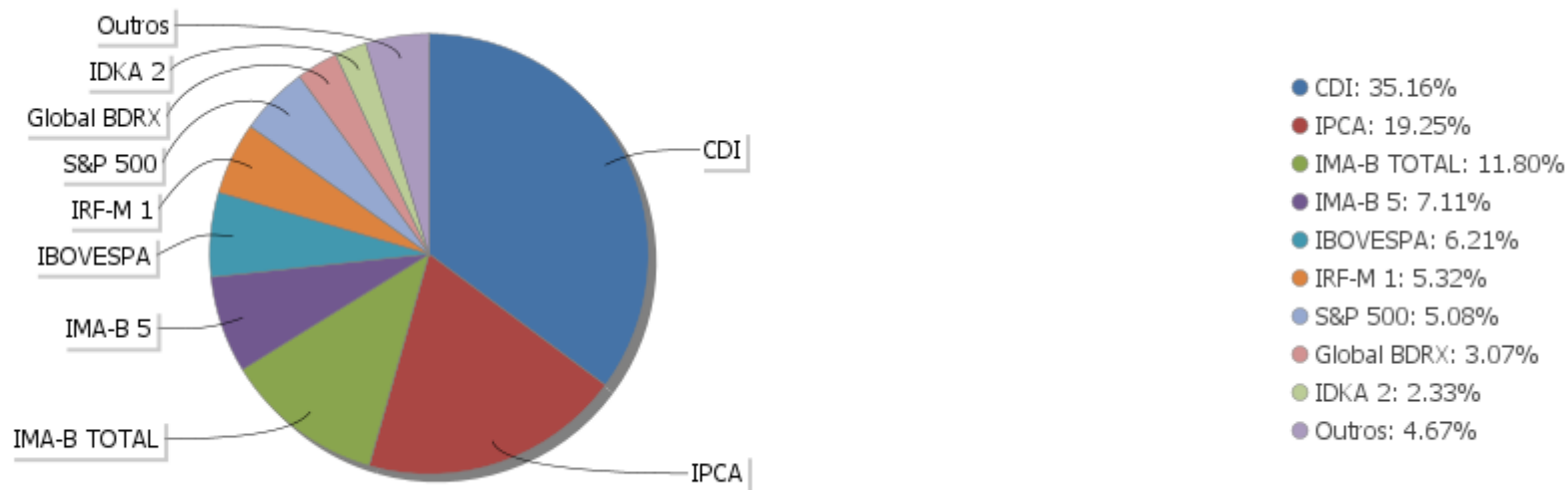
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	464.169.139,13	84,08	464.169.139,13	84,08	
de 31 dias a 365 dias	60.993.368,96	11,05	525.162.508,09	95,12	
acima de 365 dias	26.915.464,53	4,88	552.077.972,62	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

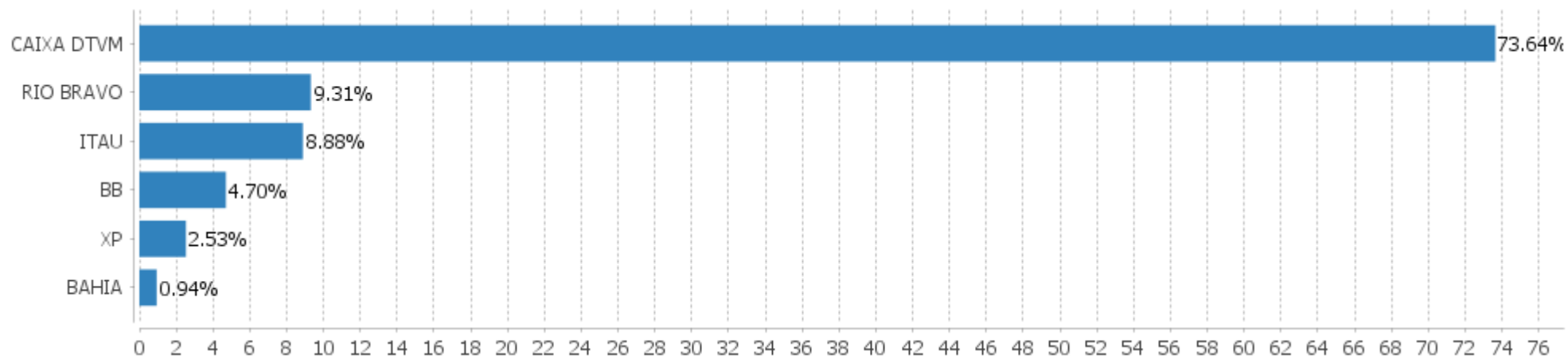


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2023	1,53	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

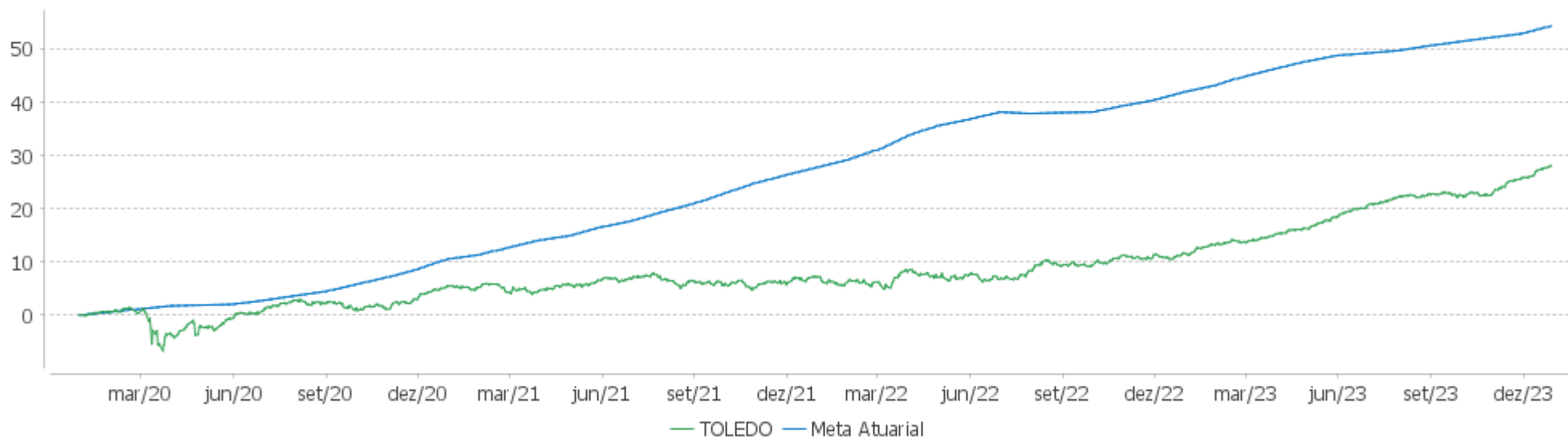
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

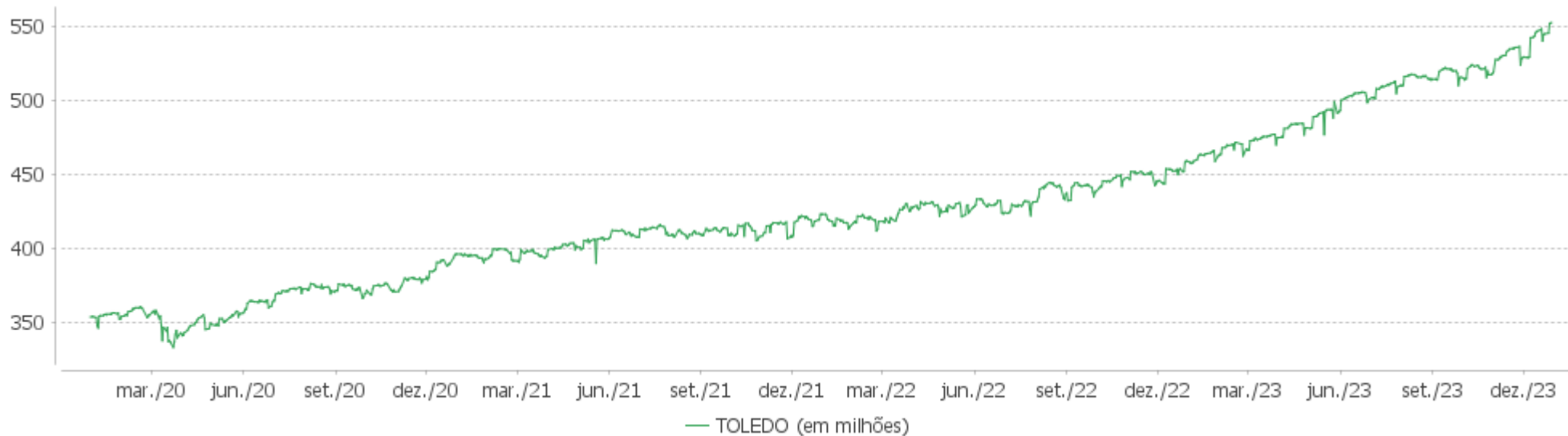
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	18	37,50	03 meses	4,47	1,94	2,52	2,32
Meses abaixo - Meta Atuarial	30	62,50	06 meses	6,12	3,41	2,71	2,16
			12 meses	14,69	8,72	5,98	1,98
			24 meses	19,49	20,79	-1,30	3,06
Maior rentabilidade da Carteira	2,52	2023-11	36 meses	21,42	40,24	-18,82	3,20
Menor rentabilidade da Carteira	-3,86	2020-03	48 meses	28,08	56,53	-28,45	4,65
			Desde 31/12/2019	28,08	56,53	-28,45	4,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

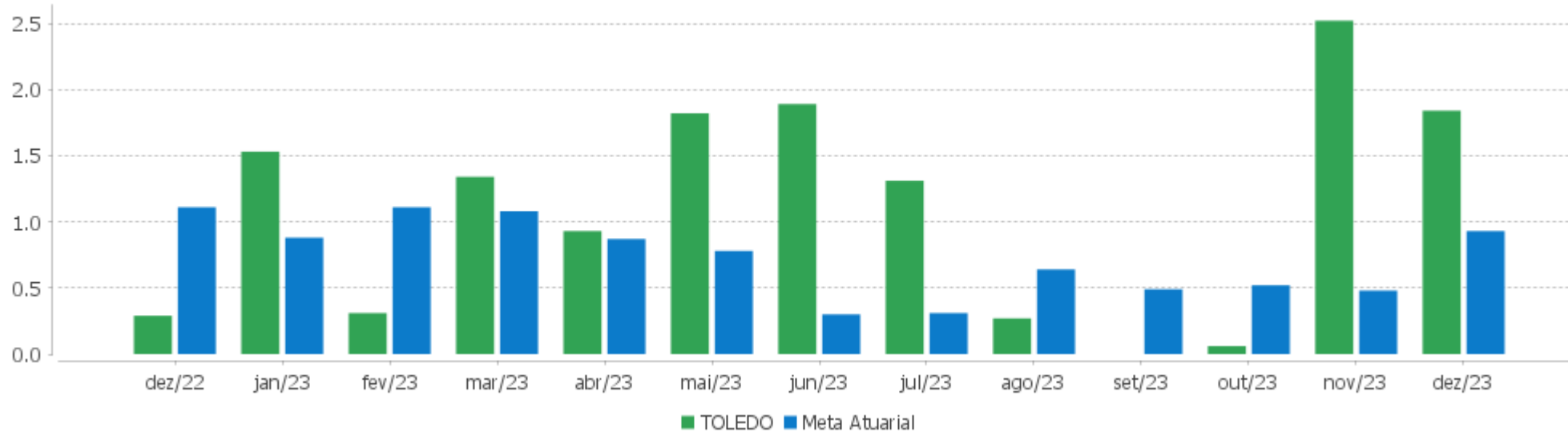


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No 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.	0,92 -1,83	2,15 -2,60	2,15 -2,60	5,30 1,09	11,13 -4,92	21,15 -2,30	24,71 2,82
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,73 -0,02	4,71 -0,05	4,71 -0,05	4,15 -0,06	15,86 -0,20	23,03 -0,41	21,15 -0,73
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,44 -0,02	2,92 -0,05	2,92 -0,05	4,64 -0,11	11,96 -0,16	22,79 -0,30	28,09 -0,63
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,21 0,65	2,92 1,84	2,92 1,84	4,92 3,22	13,59 8,97	25,74 15,07	25,60 3,79
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,40 -0,05	2,86 -0,04	2,86 -0,04	4,97 -0,03	11,90 -0,23	22,02 -0,59	27,70 -0,99
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,95 0,39	2,92 1,84	2,92 1,84	5,73 4,03	14,99 10,37	25,68 15,01	26,35 4,54
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,89 -0,03	2,83 -0,07	2,83 -0,07	6,04 -0,12	13,02 -0,23	26,29 -0,57	29,70 -0,87
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,90 100,08	2,79 98,28	2,79 98,28	6,04 98,18	12,98 99,48	27,02 99,94	32,53 99,73
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	3,93 -0,01	6,40 -0,02	6,40 -0,02	3,86 0,06	18,90 -0,38	22,53 -0,68	13,95 -1,19
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI	1,33 148,67	3,62 127,72	3,62 127,72	5,30 86,27	11,53 88,37	23,08 85,38	31,41 96,31
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,54 -0,21	4,30 -0,45	4,30 -0,45	3,07 -1,14			
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,92 103,12	2,94 103,46	2,94 103,46	6,48 105,39	13,32 102,09	27,68 102,38	33,54 102,84
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,93 104,29	2,94 103,59	2,94 103,59	6,46 105,08	13,39 102,59	27,85 103,01	33,62 103,08
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF Var. IPCA p.p.	0,89 0,33	-0,01 -1,09	-0,01 -1,09	2,54 0,84			
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,98 0,42	2,54 1,46	2,54 1,46	4,68 2,98	12,80 8,18	24,96 14,28	25,83 4,02
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	5,96 -0,02	11,96 -0,36	11,96 -0,36	-1,72 -0,43	5,54 -1,45	-22,24 -2,09	-43,22 -2,22
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6,93	11,06	11,06	3,02	16,46	-1,39	-18,28

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.	-0,12	-0,43	-0,43	-0,38	-0,66	-0,87	-1,65
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,45 0,07	15,02 -0,09	15,02 -0,09	11,33 -2,30	13,87 -8,42	16,70 -11,31	-7,18 -19,93
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL % do CDI	8,41 938,26	16,50 581,55	16,50 581,55	9,19 149,49	48,14 368,94	32,58 120,52	-9,97 -30,57
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	7,35 1,97	16,32 1,20	16,32 1,20	13,22 -0,41	11,45 -10,83	17,20 -10,81	7,23 -5,51
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	5,91 -0,99	12,66 -1,95	12,66 -1,95	12,37 -3,68	23,73 -3,11	34,24 -8,64	20,15 -13,58
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	5,35 -0,03	8,99 -6,13	8,99 -6,13	3,06 -10,57	6,38 -15,91	-2,24 -30,25	
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	5,40 0,02	10,44 -4,68	10,44 -4,68	8,41 -5,22	17,14 -5,14	15,05 -12,97	-2,75 -15,50
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	2,59 -0,25	7,65 -0,12	7,65 -0,12	9,07 -0,65	24,92 -1,41	-10,73 -1,62	16,51 -4,97
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	5,22 2,52	15,17 8,16	15,17 8,16	14,73 7,77	42,31 30,88	-8,64 7,81	4,81 0,01
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	4,02 2,99	12,26 9,74	12,26 9,74	13,39 8,70	38,02 27,20	-24,45 -48,69	-18,98 -63,88
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	5,19 2,76	12,99 5,45	12,99 5,45	10,86 3,19	33,22 17,95	17,27 30,45	55,76 37,46
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	1,00 -1,43	4,26 -3,28	4,26 -3,28	6,64 -1,03	14,50 -0,77		
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	4,49 -0,89	10,05 -5,06	10,05 -5,06	9,63 -4,00	15,69 -6,60		
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	3,53 -1,85	11,41 -3,71	11,41 -3,71	12,64 -1,00	14,06 -8,22		
TOLEDO Var. INPC + 4,90% p.p.	1,84 0,91	4,47 2,52	4,47 2,52	6,12 2,71	14,69 5,98	19,49 -1,29	21,42 -18,10
CDI	0,90	2,84	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62
IBOVESPA	5,38	15,12	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74
INPC + 6,00%	1,02	2,20	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97
IPCA + 6,00%	1,03	2,52	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		0,80
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)	-	1,90
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	O ADMINISTRADOR	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	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	0,91	2,89	2,89	6,16	13,25	26,86	30,57	35,59	44,75
IRF-M 1+	1,73	5,05	5,05	6,37	18,52	27,30	20,95	31,18	49,86
IRF-M TOTAL	1,48	4,38	4,38	6,28	16,51	26,79	24,26	32,58	48,53
IMA-B 5	1,46	2,97	2,97	4,75	12,13	23,09	28,71	39,06	57,35
IMA-B 5+	3,94	6,42	6,42	3,80	19,28	23,21	15,14	21,47	58,36
IMA-B TOTAL	2,75	4,76	4,76	4,21	16,05	23,45	21,89	29,69	59,46
IMA-GERAL TOTAL	1,63	3,81	3,81	5,67	14,80	25,89	27,10	33,88	51,04
IDKA 2	1,45	2,89	2,89	5,00	12,13	22,60	28,70	39,79	56,32
IDKA 20	6,58	10,28	10,28	3,92	27,13	24,70	6,62	8,97	57,20
CDI	0,90	2,84	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,38	15,12	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74	16,03	52,68
IBRX 100	5,48	14,95	14,95	13,77	21,27	26,15	12,05	15,97	54,69
IBRX 50	5,31	14,43	14,43	14,39	20,06	26,93	13,55	17,66	51,96
SMALL CAP	7,05	11,48	11,48	3,40	17,12	-0,52	-16,63	-17,18	31,02
Índice Consumo - ICON	5,98	12,32	12,32	-1,29	6,98	-20,15	-40,99	-40,51	-7,65
Índice Dividendos - IDIV	6,90	14,61	14,61	16,04	26,84	42,88	33,72	32,38	92,17

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	2,43	7,54	7,54	7,67	15,27	-13,18	18,31	77,33	137,73

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,25	2,86	2,86	4,95	15,50	18,06	15,37	3,56	40,82

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,70	7,01	7,01	6,95	11,43	-16,44	4,80	54,48	99,34

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	1,08	1,08	1,70	4,62	10,67	21,81	27,31	32,79
INPC	0,55	0,77	0,77	0,99	3,71	9,86	21,02	27,61	33,33
IGPM	0,74	1,84	1,84	1,34	-3,18	2,10	20,25	48,08	58,89
SELIC	0,90	2,84	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	2,05	2,05	3,70	8,75	19,63	36,91	48,80	61,44
IPCA + 5,00%	0,95	2,28	2,28	4,19	9,79	21,92	40,87	54,57	69,32
IPCA + 5,50%	0,99	2,40	2,40	4,44	10,30	23,08	42,88	57,51	73,37
IPCA + 5,89%	1,02	2,49	2,49	4,63	10,71	23,98	44,46	59,84	76,59
IPCA + 6,00%	1,03	2,52	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91	60,50	77,50
INPC + 4,00%	0,86	1,73	1,73	2,98	7,80	18,75	36,03	49,15	62,09
INPC + 6,00%	1,02	2,20	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97	60,89	78,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
62	06/10/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.738.251,21	0,00	1.096.339,99534200	5,2340070000
63	06/10/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	34.580,96	6.606,97626121	5,2340070000
64	09/10/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	388.681,97	0,00	74.224,29341859	5,2365870000
65	19/10/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	28.258,08	0,00	5.380,08832245	5,2523450000
66	25/10/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.729.061,86	1.088.721,14178991	5,2621940000
67	26/10/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.721,25	0,00	1.846,54803551	5,2645530000
68	26/10/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.649.205,37	0,00	745.713,43532828	4,8935760000
69	27/10/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	2.024.090,98	384.306,81874710	5,2668620000
70	03/11/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.748.573,08	0,00	1.089.367,36767900	5,2769830000
71	08/11/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	385.023,04	0,00	72.868,82144800	5,2837830000
72	14/11/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	28.220,12	0,00	5.331,37107400	5,2932200000
73	17/11/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	901,11	170,09028300	5,2978330000
74	28/11/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	12.450.707,32	2.342.710,47843700	5,3146590000
75	29/11/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	80.166,41	0,00	15.077,12963800	5,3170870000
76	29/11/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	53.366,79	0,00	10.036,84724300	5,3170870000
77	29/11/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.649.205,37	0,00	737.867,44853100	4,9456110000
78	06/12/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	8.486,53	1.592,37606099	5,3294760000
79	08/12/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	807.010,82	0,00	151.283,36437694	5,3344320000
80	08/12/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11.445.527,41	0,00	2.145.594,39692923	5,3344320000
81	20/12/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	7.767.005,79	1.450.813,00945129	5,3535540000
82	21/12/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.649.205,37	0,00	732.348,78270173	4,9828790000
83	21/12/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.769,37	0,00	1.824,06956184	5,3558100000
84	21/12/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	4.066,86	759,33612283	5,3558100000
85	27/12/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.780.133,38	0,00	1.077.835,32771778	5,3627240000
Total			41.450.319,04	28.018.901,41		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 6.228.698,91 Value-At-Risk: 1,13%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO		1,13		1,13			552.077.972,62	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,58%

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		0,20	0,01	0,21			25.943.004,93	4,70
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,03	0,00	0,03			81.269.179,25	14,72
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,20	0,12	0,03			38.419.968,71	6,96
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,09	0,00	0,02			29.378.469,17	5,32
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,24	0,07	0,01			39.248.477,27	7,11
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		3,32	0,02	0,04			4.140.199,92	0,75
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,98	0,02	0,31			12.865.715,77	2,33
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,72	0,06	0,71			60.086.375,47	10,88
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,36	0,00	2,14			10.027.243,44	1,82
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI		1,23	0,01	1,23			41.454.281,99	7,51
Sub-total	0,70	0,63	0,29		0,61	1,32	342.832.915,92	62,10

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		3,17	0,04	2,78			16.705.763,63	3,03
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF		2,37	0,01	2,37			10.209.700,90	1,85
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,03	-0,00	0,02			30.013.750,07	5,44
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,03	0,00	0,03			40.050.217,12	7,25
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,63	0,01	0,62			10.046.294,68	1,82
Sub-total	0,60	0,63	0,05		0,48	1,19	107.025.726,40	19,39

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,33%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO		0,82	0,01	6,99			11.509.473,00	2,08
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO		3,86	0,03	3,87			4.729.437,61	0,86
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO		3,12	0,02	6,41			8.217.625,12	1,49
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,36	0,16	5,46			16.558.442,94	3,00
Sub-total	6,27	3,33	0,21		0,43	3,57	41.014.978,67	7,43

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,14%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		8,34	0,11	6,94			10.010.628,67	1,81
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,36	0,01	9,35			3.981.650,29	0,72
Sub-total	7,70	7,31	0,13		0,52	4,87	13.992.278,96	2,53

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,24	0,07	0,59			16.956.627,59	3,07
Sub-total	8,58	6,24	0,07		0,20	2,59	16.956.627,59	3,07

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,72%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL		12,67	0,02	12,67			1.297.848,97	0,24
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA		7,71	0,06	1,77			5.208.714,20	0,94
FIA CAIXA CONSUMO		12,28	0,02	0,22			899.907,28	0,16

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		6,32	0,05	1,41			5.193.950,61	0,94
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		10,77	0,03	0,41			1.548.099,04	0,28
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		7,33	0,06	2,89			5.072.042,41	0,92
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		7,55	0,10	2,50			8.563.517,66	1,55
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		9,44	0,04	3,64			2.471.364,91	0,45
Sub-total	13,34	7,72	0,37		0,39	6,04	30.255.445,08	5,48

(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 (%)