



LDB
EMPRESAS

LINHARES - PLANO PREVIDENCIÁRIO
AGOSTO 2023



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.08.2023.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

INTRODUÇÃO

Este relatório apresenta a posição da carteira de investimentos do IPASLI por segmentos e ativos, com as informações de riscos, rentabilidades, instituição financeira e limites da Resolução CMN nº 4.963/2021 e da Política de Investimentos, e o acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos.

Tem por objetivo demonstrar o resultado da gestão dos investimentos do IPASLI pelo Conselho Deliberativo, Comitê de Investimentos, Diretoria Executiva e Conselho Fiscal.

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos do IPASLI analisou e atestou a conformidade deste relatório de investimentos quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos, conforme reunião realizada em 31.08.2023.

APROVAÇÃO DO CONSELHO FISCAL

O Conselho Fiscal, considerando os dados constantes neste relatório mensal de investimentos e as explicações dos gestores, aprovou o relatório de investimentos, conforme registro em reunião realizada no dia 31.08.2023.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

83,96%

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 150535 (3,200000%)	0,41	0,02	0,51	5,75	1.147.580,47	0,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,410000%)	0,41	0,03	0,62	6,58	1.146.497,89	0,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,640000%)	0,41	0,03	0,73	7,42	2.555.277,15	0,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,440500%)	3,85	0,03	0,71	0,71	2.103.342,21	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,470000%)	3,86	0,03	0,14	0,14	1.548.407,81	0,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,550000%)	3,90	0,09	0,72	1,19	2.028.432,59	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,800000%)	4,02	0,03	0,74	1,97	9.216.229,92	2,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,825000%)	0,65	0,03	0,74	7,54	1.885.216,21	0,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,847000%)	0,46	0,03	0,74	7,56	2.069.278,42	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,920000%)	0,41	0,03	0,75	7,61	5.214.572,92	1,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,150000%)	0,41	0,04	0,77	7,76	2.259.187,94	0,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,281000%)	0,41	0,04	0,78	7,85	2.009.196,43	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,305500%)	0,41	0,04	0,78	7,87	4.109.019,33	0,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,380000%)	3,06	0,04	0,79	7,92	4.005.804,00	0,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,418000%)	3,07	0,04	0,79	6,73	1.829.462,78	0,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,800000%)	0,41	0,03	0,74	7,52	1.487.625,10	0,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,200000%)	0,41	0,03	0,69	7,12	4.309.881,88	1,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,270000%)	0,41	0,03	0,69	7,16	2.120.914,39	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,500000%)	0,41	0,03	0,71	7,32	5.497.813,35	1,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,800000%)	0,41	0,03	0,65	6,85	5.539.294,98	1,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,350000%)	0,41	0,03	0,70	7,22	1.903.227,54	0,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,800000%)	0,41	0,03	0,74	7,52	15.924.009,38	3,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,910000%)	2,91	0,03	0,75	2,80	2.993.715,48	0,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,050500%)	2,95	0,04	0,76	3,34	1.326.635,84	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,132000%)	0,41	0,04	0,77	7,75	10.234.049,31	2,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,190000%)	2,99	0,04	0,77	3,95	2.171.643,42	0,51
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,41	0,04	0,74	7,49	96.636.316,74	22,53

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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,37	0,02	1,04	10,75	7.839.873,33	1,83	5.967.981.074,09	0,13
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,07	0,04	1,13	8,88	1.458.079,35	0,34	13.564.358.007,28	0,01
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	4,90	-0,66	-0,46	11,68	17.297.122,23	4,03	248.419.584,41	6,96
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,37	0,03	1,12	8,82	3.724.062,39	0,87	6.785.029.538,03	0,05
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,89	-0,64	-0,40	11,65	16.301.249,35	3,80	5.260.991.740,78	0,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,94	-0,63	-0,37	11,72	21.246.517,42	4,95	5.279.029.725,18	0,40
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,36	0,03	1,11	8,92	605.309,88	0,14	7.477.458.112,25	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,24	-0,24	0,60	8,67	25.060.919,70	5,84	8.195.443.440,71	0,31
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,38	-0,19	0,74	8,36	17.667.804,64	4,12	6.160.923.946,07	0,29
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,48	-0,17	0,77	8,41	32.305.660,93	7,53	5.504.316.744,32	0,59
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,26	-0,24	0,58	8,63	13.175.788,45	3,07	5.437.581.646,17	0,24
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,32	0,03	1,11	9,08	1.211.470,55	0,28	164.530.270,84	0,74
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,04	-0,01	0,90	7,61	1.488.040,34	0,35	208.416.569,80	0,71
BANCO DO NORDESTE	SANTANDER	BNB IMA-B FI RF	4,67	-0,64	-0,36	11,29	1.238.462,90	0,29	158.410.791,12	0,78
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,00	-0,34	0,34	9,67	160.620.361,46	37,45		

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				
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	7,05	-1,05	-1,49	7,78	2.586.799,81	0,60	136.142.028,21	1,90
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,05	1,24	8,97	13.500.729,57	3,15	14.797.589.893,96	0,09
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	4,95	-0,70	-0,58	11,50	18.469.642,03	4,31	161.482.927,48	11,44
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,04	1,16	8,81	29.575.886,78	6,90	14.734.335.445,36	0,20
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,71	0,06	1,24	6,64	10.566.337,27	2,46	2.786.888.227,17	0,38
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,99	0,06	1,18	6,91	17.595.253,61	4,10	272.374.654,72	6,46
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	0,85	-0,06	0,92	6,56	9.752.460,06	2,27	147.812.604,45	6,60
BANCO DO NORDESTE	SANTANDER	BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,05	0,05	1,15	8,75	790.192,38	0,18	1.195.162.134,99	0,07
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LONGO PRAZO	0,57	0,00	0,27	6,66	0,00	0,00	609.710.083,68	0,00
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,04	-0,12	0,77	8,51	102.837.301,51	23,98		
Renda Fixa			1,65	-0,18	0,57	8,75	360.093.979,71	83,96		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

11,14%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	20,60	-1,40	-4,30	3,94	3.981.841,51	0,93	1.338.682.696,87	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	18,32	-1,52	-2,83	8,19	1.995.591,71	0,47	231.629.258,56	0,86
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	18,94	-1,94	-6,24	6,99	749.325,26	0,17	811.429.533,50	0,09
SOMMA	BEM	SOMMA BRASIL FIA	20,15	-1,69	-5,50	-1,19	7.282.346,17	1,70	313.620.314,76	2,32
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,51	-1,62	-3,45	9,23	18.873.686,02	4,40	936.636.791,99	2,02
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	20,24	-1,33	-7,14	2,04	5.706.346,48	1,33	145.926.703,62	3,91
BANESTES	BANESTES	BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	18,20	-1,50	-4,66	-3,25	1.676.791,31	0,39	11.316.086,21	14,82
PLURAL	BEM	BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	17,03	-1,70	-3,11	5,41	3.188.949,01	0,74	148.607.541,02	2,15
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	21,57	-2,20	-2,13	29,38	4.313.213,04	1,01	786.608.043,15	0,55
Sub-total Artigo 8º I			18,54	-1,63	-4,22	6,89	47.768.090,51	11,14		
Renda Variável			18,54	-1,63	-4,22	6,89	47.768.090,51	11,14		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,92%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	22,56	1,40	4,43	5,15	2.326.395,01	0,54	126.664.775,11	1,84
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	41,29	3,47	-4,99	21,14	1.081.776,74	0,25	161.950.670,21	0,67
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	30,05	2,56	1,35	27,77	667.257,07	0,16	665.927.943,70	0,10
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	22,56	1,94	1,30	6,09	4.140.414,49	0,97	297.474.925,12	1,39
Sub-total Artigo 9º II			23,47	2,03	1,28	9,10	8.215.843,31	1,92		
Investimentos no Exterior			23,47	2,03	1,28	9,10	8.215.843,31	1,92		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,99%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V MULTIMERCADO LP	6,15	-0,91	-2,24	13,26	2.326.276,41	0,54	182.063.758,36	1,28
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	3,02	-0,00	1,07	9,48	2.195.964,30	0,51	226.291.720,75	0,97
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	7,29	-0,78	-2,69	4,72	4.818.065,33	1,12	135.091.004,95	3,57
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	6,13	-0,38	-0,61	7,09	3.474.063,18	0,81	559.505.399,14	0,62
Sub-total Artigo 10º I			5,55	-0,56	-1,42	7,64	12.814.369,22	2,99		
Investimentos Estruturados			5,55	-0,56	-1,42	7,64	12.814.369,22	2,99		
Total			2,98	-0,31	-0,03	8,52	428.892.282,75	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	96.636.316,74	22,53	0,00	30,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	160.620.361,46	37,45	0,00	18,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	102.837.301,51	23,98	0,00	28,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	360.093.979,71	83,96					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	47.768.090,51	11,14	0,00	11,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	47.768.090,51	11,14					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	8.215.843,31	1,92	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	8.215.843,31	1,92					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	12.814.369,22	2,99	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	12.814.369,22	2,99					15,00
Total		428.892.282,75	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,74 64,66	7,49 84,46	1,67 50,35	5,24 78,45	10,28 75,83	701.992,90	6.103.915,30
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,34 30,18	9,67 109,09	2,78 83,65	7,28 109,04	12,38 91,34	539.572,88	13.961.531,19
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,77 67,79	8,51 96,01	3,22 96,91	7,42 111,11	12,56 92,67	791.191,33	8.204.409,06
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,22 0,86	6,89 1,42	7,11 0,27	10,68 0,38	5,67 -0,01	-2.076.708,22	2.995.101,15
Artigo 9º II % do CDI	1,28 112,46	9,10 102,65	2,38 71,79	5,69 85,22	6,89 50,84	103.935,30	685.396,25
Artigo 10º I % do CDI	-1,42 -124,77	7,64 86,21	4,08 123,06	7,36 110,17	10,70 78,95	-184.787,05	909.923,25
LINHARES - PLANO PREVIDENCIÁRIO (Total)						-124.802,86	32.860.276,20

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 150535 (3,200000%)	1.141.731,95	0,00	0,00	0,00	1.147.580,47	5.848,52	63.534,89
NTN-B 150535 (4,410000%)	1.139.441,80	0,00	0,00	0,00	1.146.497,89	7.056,09	72.101,44
NTN-B 150535 (5,640000%)	2.536.838,28	0,00	0,00	0,00	2.555.277,15	18.438,87	179.943,18
NTN-B 150545 (5,440500%)	2.088.524,91	0,00	0,00	0,00	2.103.342,21	14.817,30	14.817,30
NTN-B 150545 (5,470000%)	0,00	1.546.183,85	0,00	0,00	1.548.407,81	2.223,96	2.223,96
NTN-B 150545 (5,550000%)	2.013.960,71	0,00	0,00	0,00	2.028.432,59	14.471,88	23.810,46
NTN-B 150545 (5,800000%)	9.148.465,10	0,00	0,00	0,00	9.216.229,92	67.764,82	178.475,11
NTN-B 150545 (5,825000%)	1.871.311,96	0,00	0,00	0,00	1.885.216,21	13.904,25	134.855,91
NTN-B 150545 (5,847000%)	2.053.979,32	0,00	0,00	0,00	2.069.278,42	15.299,10	148.301,18
NTN-B 150545 (5,920000%)	5.175.693,60	0,00	0,00	0,00	5.214.572,92	38.879,32	376.043,74
NTN-B 150545 (6,150000%)	2.241.900,30	0,00	0,00	0,00	2.259.187,94	17.287,64	166.088,73
NTN-B 150545 (6,281000%)	1.993.596,68	0,00	0,00	0,00	2.009.196,43	15.599,75	149.314,98

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150545 (6,305500%)	4.077.031,94	0,00	0,00	0,00	4.109.019,33	31.987,39	305.976,34
NTN-B 150545 (6,380000%)	3.974.361,81	0,00	0,00	0,00	4.005.804,00	31.442,19	300.109,31
NTN-B 150545 (6,418000%)	1.815.045,65	0,00	0,00	0,00	1.829.462,78	14.417,13	117.702,11
NTN-B 150824 (5,800000%)	1.520.250,18	0,00	0,00	43.707,20	1.487.625,10	11.082,12	107.690,58
NTN-B 150828 (5,200000%)	4.402.738,12	0,00	0,00	122.697,60	4.309.881,88	29.841,36	295.956,55
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.166.653,34	0,00	0,00	60.555,23	2.120.914,39	14.816,28	146.561,93
NTN-B 150828 (5,500000%)	5.616.769,43	0,00	0,00	158.469,14	5.497.813,35	39.513,06	387.737,74
NTN-B 150830 (4,800000%)	5.655.379,50	0,00	0,00	152.486,87	5.539.294,98	36.402,35	366.411,63
NTN-B 150832 (5,350000%)	1.943.398,46	0,00	0,00	53.596,26	1.903.227,54	13.425,34	132.388,06
NTN-B 150840 (5,800000%)	16.263.850,29	0,00	0,00	458.437,30	15.924.009,38	118.596,39	1.151.986,25
NTN-B 150840 (5,910000%)	3.058.299,36	0,00	0,00	87.170,24	2.993.715,48	22.586,36	83.454,60
NTN-B 150840 (6,050500%)	1.355.654,87	0,00	0,00	39.189,98	1.326.635,84	10.170,95	44.036,78
NTN-B 150840 (6,132000%)	10.459.695,93	0,00	0,00	304.851,65	10.234.049,31	79.205,03	761.737,73
NTN-B 150840 (6,190000%)	2.219.800,43	0,00	0,00	65.072,46	2.171.643,42	16.915,45	84.739,99
					96.636.316,74	701.992,90	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	15.088.958,26	2.293.581,72	0,00	0,00	17.297.122,23	-85.417,75	1.555.441,36
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1.198.118,45	0,00	0,00	0,00	1.211.470,55	13.352,10	100.866,83
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	7.759.250,46	0,00	0,00	0,00	7.839.873,33	80.622,87	761.013,26
BB PREV RF IDKA2	17.538.156,90	0,00	0,00	0,00	17.667.804,64	129.647,74	1.363.452,63
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	16.366.925,54	0,00	0,00	0,00	16.301.249,35	-65.676,19	1.696.680,91
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	13.099.694,83	0,00	0,00	0,00	13.175.788,45	76.093,62	1.047.127,16
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	3.682.968,40	0,00	0,00	0,00	3.724.062,39	41.093,99	300.575,80
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	1.518.493,14	0,00	-43.975,79	0,00	1.488.040,34	13.522,99	109.230,15
BNB IMA-B FI RF	1.242.980,51	0,00	0,00	0,00	1.238.462,90	-4.517,61	125.636,75
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	32.057.400,19	0,00	0,00	0,00	32.305.660,93	248.260,74	2.505.439,05
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	24.912.172,12	0,00	0,00	0,00	25.060.919,70	148.747,58	1.998.776,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.325.589,21	0,00	0,00	0,00	21.246.517,42	-79.071,79	2.228.829,52
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	598.660,82	0,00	0,00	0,00	605.309,88	6.649,06	49.594,66
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.441.813,82	0,00	0,00	0,00	1.458.079,35	16.265,53	118.866,28
					160.620.361,46	539.572,88	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	9.663.539,68	0,00	0,00	0,00	9.752.460,06	88.920,38	600.271,96
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	18.577.337,28	0,00	0,00	0,00	18.469.642,03	-107.695,25	1.891.123,75
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	10.437.143,60	0,00	0,00	0,00	10.566.337,27	129.193,67	658.294,47
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	17.390.129,77	0,00	0,00	0,00	17.595.253,61	205.123,84	1.136.823,69
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	29.238.161,79	0,00	0,00	0,00	29.575.886,78	337.724,99	2.488.598,37
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	781.204,61	0,00	0,00	0,00	790.192,38	8.987,77	63.566,86
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	13.335.736,90	0,00	0,00	0,00	13.500.729,57	164.992,67	1.110.794,91
ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LONGO PRAZO	1.088.021,98	0,00	-1.091.011,34	0,00	0,00	2.989,36	68.135,24
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	2.625.845,91	0,00	0,00	0,00	2.586.799,81	-39.046,10	186.799,81
					102.837.301,51	791.191,33	

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	799.187,88	0,00	0,00	0,00	749.325,26	-49.862,62	48.948,64
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	1.758.785,95	0,00	0,00	0,00	1.676.791,31	-81.994,64	-56.264,23
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	6.145.392,28	0,00	0,00	0,00	5.706.346,48	-439.045,80	114.052,73
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	4.160.712,10	0,00	0,00	0,00	3.981.841,51	-178.870,59	150.975,28
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	2.175.842,12	1.090.000,00	0,00	0,00	3.188.949,01	-76.893,11	98.949,01
FIA CAIXA DIVIDENDOS	2.053.707,69	0,00	0,00	0,00	1.995.591,71	-58.115,98	151.119,32
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	19.547.781,27	0,00	0,00	0,00	18.873.686,02	-674.095,25	1.595.571,13
SOMMA BRASIL FIA	7.706.100,23	0,00	0,00	0,00	7.282.346,17	-423.754,06	-87.825,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
TARPON GT 30 FIC FIA	4.407.289,21	0,00	0,00	0,00	4.313.213,04	-94.076,17	979.574,95
					47.768.090,51	-2.076.708,22	

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	2.227.811,80	0,00	0,00	0,00	2.326.395,01	98.583,21	113.951,54
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.138.564,56	0,00	0,00	0,00	1.081.776,74	-56.787,82	188.782,96
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	658.396,11	0,00	0,00	0,00	667.257,07	8.860,96	145.008,01
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	4.087.135,54	0,00	0,00	0,00	4.140.414,49	53.278,95	237.653,74
					8.215.843,31	103.935,30	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	3.495.418,14	0,00	0,00	0,00	3.474.063,18	-21.354,96	230.066,61
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V MULTIMERCADO LP	2.379.635,18	0,00	0,00	0,00	2.326.276,41	-53.358,77	272.338,42
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2.172.666,47	0,00	0,00	0,00	2.195.964,30	23.297,83	190.231,63
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	4.951.436,48	0,00	0,00	0,00	4.818.065,33	-133.371,15	217.286,59
					12.814.369,22	-184.787,05	

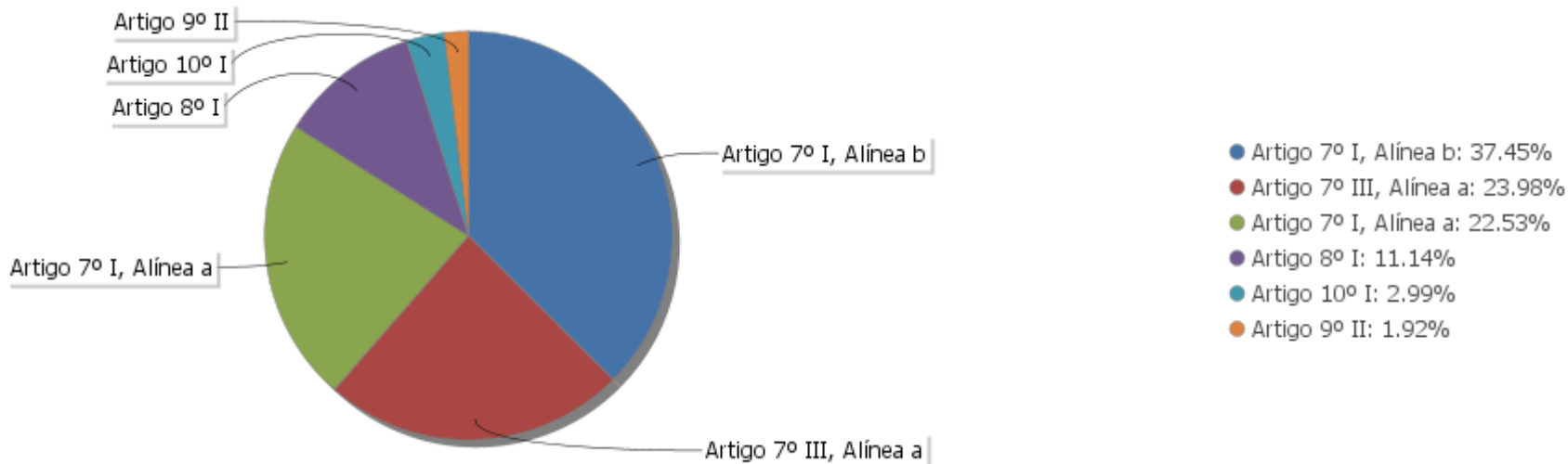
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

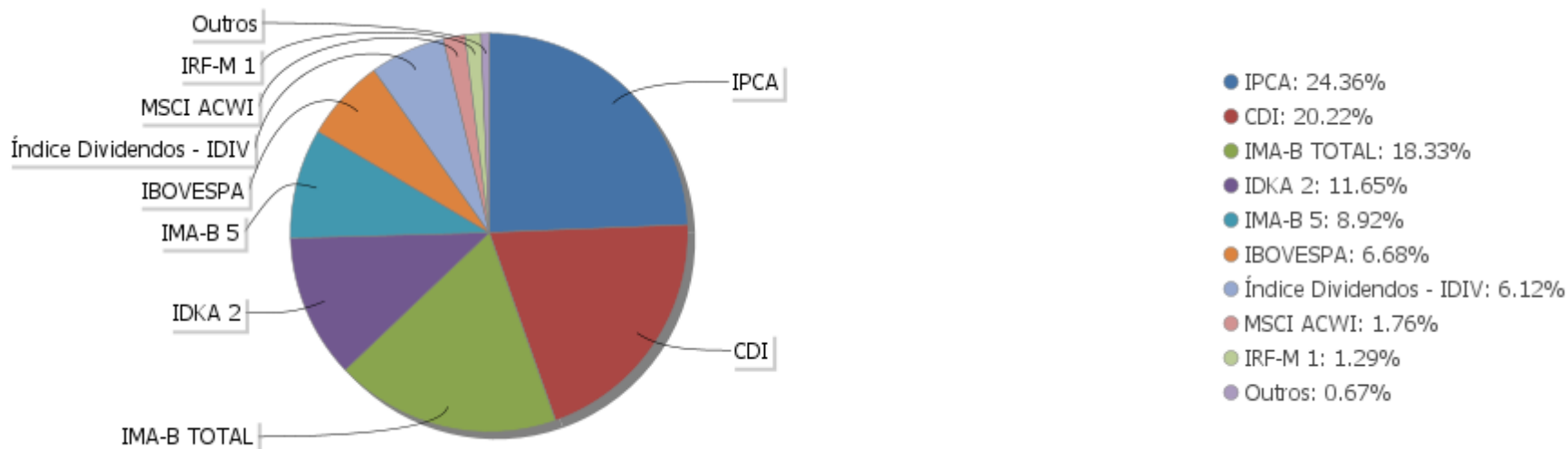
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	292.273.850,69	68,15	292.273.850,69	68,15	
de 31 dias a 365 dias	36.686.976,31	8,55	328.960.827,00	76,70	
acima de 365 dias	99.931.455,75	23,30	428.892.282,75	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

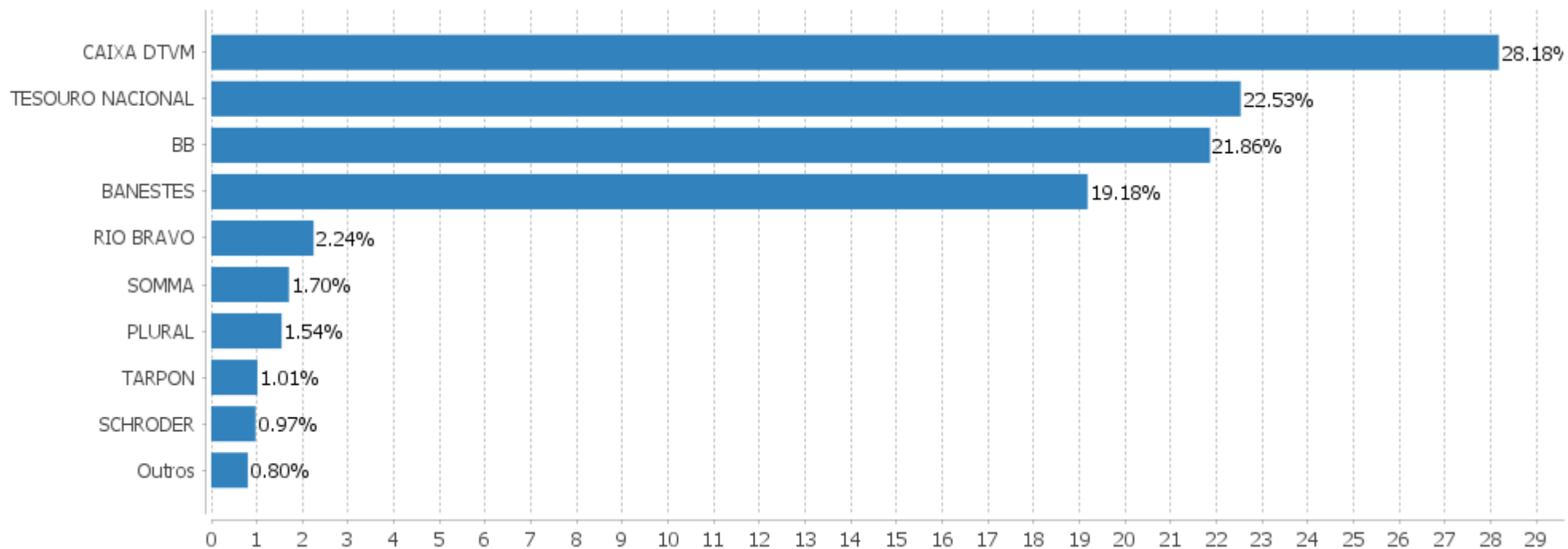


Alocação Por Estratégia



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	1,22	0,03	1,05	1,20	1,64	2,00	1,13	-0,03					8,52
INPC + 5,10%	0,90	1,13	1,10	0,89	0,80	0,31	0,33	0,66					6,27
p.p. indexador	0,32	-1,10	-0,05	0,32	0,85	1,69	0,80	-0,69					2,26
2022	0,23	0,39	2,25	-0,02	0,88	-0,66	0,71	1,00	0,55	1,72	-0,26	0,41	7,40
INPC + 4,93%	1,07	1,37	2,14	1,41	0,87	1,02	-0,20	0,13	0,08	0,85	0,76	1,11	11,13
p.p. indexador	-0,85	-0,97	0,11	-1,43	0,00	-1,68	0,91	0,88	0,47	0,86	-1,03	-0,70	-3,73
2021	-0,93	-1,16	0,23	0,72	1,07	0,17	-0,44	-0,62	-0,56	-1,41	1,62	0,55	-0,80
INPC + 5,45%	0,69	1,20	1,35	0,80	1,41	1,05	1,49	1,35	1,65	1,59	1,27	1,22	16,14
p.p. indexador	-1,63	-2,36	-1,12	-0,08	-0,34	-0,87	-1,93	-1,97	-2,21	-3,00	0,35	-0,67	-16,94
2020	0,49	-0,30	-6,00	1,19	1,40	1,41	2,77	-1,09	-1,53	0,16	1,96	3,27	3,46
INPC + 6,00%	0,70	0,59	0,69	0,23	0,21	0,79	0,98	0,85	1,36	1,38	1,42	1,98	11,75
p.p. indexador	-0,21	-0,89	-6,69	0,96	1,19	0,63	1,79	-1,94	-2,89	-1,22	0,55	1,29	-8,29
2019	2,03	0,57	0,45	0,98	2,17	2,28	1,23	-0,12	1,94	2,06	-1,14	1,47	14,79
INPC + 6,00%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,44	0,57	1,01	1,71	10,78
p.p. indexador	1,15	-0,43	-0,77	-0,11	1,51	1,83	0,60	-0,75	1,50	1,49	-2,14	-0,25	4,02
2018	3,06	0,59	0,52	0,09	-2,34	-0,08	1,29	0,01	0,40	3,08	0,67	1,06	8,56
INPC + 6,00%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	0,74	0,91	0,21	0,60	9,59
p.p. indexador	2,32	-0,01	-0,04	-0,60	-3,25	-2,00	0,53	-0,53	-0,34	2,17	0,46	0,46	-1,03

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	29	42,65
Meses abaixo - Meta Atuarial	39	57,35

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,27	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-6,00	2020-03

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,13	1,30	1,82	2,36
06 meses	7,19	4,15	3,04	2,22
12 meses	11,15	9,28	1,87	2,98
24 meses	16,75	25,00	-8,24	3,12
36 meses	20,08	45,77	-25,69	3,30
48 meses	24,84	59,06	-34,22	4,28
60 meses	44,58	74,02	-29,44	3,94
Desde 29/12/2017	49,06	86,07	-37,01	3,82

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

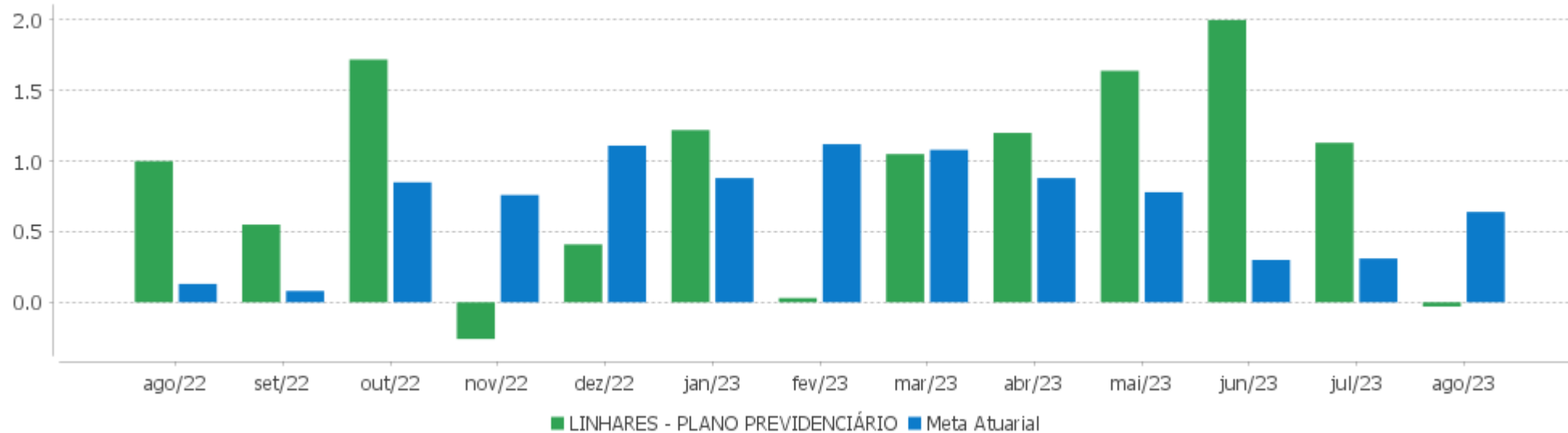


Patrimônio Líquido



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 150545 (5,800000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,51	4,51 1,28	1,68 1,41	2,31 0,48	4,26 -0,35		
NTN-B 150545 (5,920000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,61 4,37	1,71 1,44	5,32 3,49	10,48 5,87	20,96 7,22	32,12 7,37
NTN-B 150828 (5,500000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,48	7,32 4,09	1,61 1,34	5,11 3,28	10,04 5,43	27,12 13,38	38,43 13,68
NTN-B 150840 (6,050500%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,53	4,59 1,36	1,75 1,48	5,39 3,56	7,43 2,82		
NTN-B 150545 (5,470000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,48	4,41 1,18	1,60 1,33	2,26 0,43	4,17 -0,44		
NTN-B 150545 (6,305500%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,55	7,87 4,64	1,81 1,54	5,52 3,69	10,88 6,27	21,51 7,77	32,83 8,09
NTN-B 150535 (4,410000%) Var. IPCA p.p.	0,62 0,39	6,58 3,35	1,34 1,07	4,56 2,73	8,91 4,30	24,51 10,77	42,01 17,26
NTN-B 150840 (6,190000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,54	4,64 1,41	1,78 1,51	5,46 3,63	7,52 2,92		
NTN-B 150545 (6,150000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,54	7,76 4,53	1,77 1,50	5,44 3,61	10,72 6,11	21,29 7,55	
NTN-B 150830 (4,800000%) Var. IPCA p.p.	0,65 0,42	6,85 3,61	1,43 1,16	4,76 2,92	9,32 4,71	25,44 11,70	36,10 11,36
NTN-B 150535 (5,640000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,50	7,42 4,18	1,64 1,37	5,18 3,35	10,19 5,58	23,91 10,17	35,16 10,42
NTN-B 150840 (6,132000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,54	7,75 4,52	1,77 1,50	5,43 3,60	10,70 6,09	24,90 11,17	36,50 11,76
NTN-B 150828 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,46	7,16 3,93	1,55 1,28	4,99 3,16	9,80 5,20	26,56 12,83	37,63 12,88
NTN-B 150545 (5,825000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,51	7,54 4,31	1,69 1,42	5,28 3,44	10,38 5,77	20,82 7,08	31,94 7,19
NTN-B 150545 (6,418000%) Var. IPCA p.p.	0,79 0,56	7,94 4,71	1,84 1,57	5,57 3,74	7,66 3,05	18,01 4,27	
NTN-B 150545 (5,440500%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,48	4,40 1,17	1,59 1,32	2,26 0,43	4,16 -0,45		
NTN-B 150828 (5,200000%)	0,69	7,12	1,53	4,96	9,73	26,40	37,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,46	3,89	1,26	3,13	5,12	12,66	12,64
NTN-B 150545 (6,380000%) Var. IPCA p.p.	0,79 0,56	7,92 4,69	1,83 1,56	5,56 3,72	7,64 3,03	17,98 4,24	
NTN-B 150545 (6,281000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,55	7,85 4,62	1,80 1,53	5,51 3,67	10,85 6,25	21,47 7,74	32,79 8,04
NTN-B 150840 (5,910000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	4,54 1,31	1,71 1,44	5,32 3,49	7,33 2,72		
NTN-B 150545 (5,847000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,51	7,56 4,32	1,70 1,43	5,29 3,45	10,40 5,79	20,85 7,12	
NTN-B 150824 (5,800000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,51	7,52 4,29	1,68 1,41	5,26 3,43	10,35 5,75	24,19 10,45	35,44 10,70
NTN-B 150545 (5,550000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,49	4,50 1,27	1,68 1,41	2,34 0,51	4,25 -0,36		
NTN-B 150832 (5,350000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,47	7,22 3,99	1,57 1,30	5,03 3,20	9,89 5,28	23,29 9,55	34,25 9,50
NTN-B 150535 (3,200000%) Var. IPCA p.p.	0,51 0,28	5,75 2,52	1,03 0,76	3,94 2,11	7,65 3,04	21,64 7,91	37,14 12,39
NTN-B 150840 (5,800000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,51	7,52 4,29	1,68 1,41	5,26 3,43	10,35 5,75	24,25 10,51	35,65 10,91
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,37 0,01	11,72 -0,12	2,79 -0,04	10,37 -0,06	13,51 -0,26	19,64 -0,43	23,24 -0,75
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,60 -0,01	8,67 -0,08	2,60 -0,06	5,72 -0,04	11,81 -0,16	22,71 -0,31	28,23 -0,66
BNB IMA-B FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,36 0,01	11,29 -0,55	2,77 -0,07	9,89 -0,54	13,46 -0,31	19,88 -0,19	23,25 -0,74
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,12 -0,03	8,82 -0,23	3,37 -0,07	6,66 -0,16	13,40 -0,34	23,37 -0,66	25,63 -1,17
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,58 -0,03	8,63 -0,11	2,58 -0,08	5,68 -0,08	11,73 -0,24	22,46 -0,57	27,99 -0,91
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	1,13 99,02	8,88 100,11	3,34 100,57	6,68 100,06	13,50 99,58	25,27 100,54	28,08 98,45
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,90 1,28	7,61 -4,23	2,91 0,08	4,74 -5,69	11,04 -2,72	22,28 2,21	28,30 4,31
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,46 -0,09	11,68 -0,16	2,71 -0,12	10,32 -0,11	13,56 -0,20	17,06 -3,01	15,33 -8,66
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1,11	9,08	3,49	6,81	13,71	24,41	25,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	0,03	0,04	-0,00	-0,03	0,38	-1,39
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,74 -0,03	8,36 -0,30	2,73 -0,02	5,26 -0,16	11,57 -0,23	21,91 -0,42	28,11 -0,44
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,77 0,01	8,41 -0,26	2,76 0,01	5,32 -0,10	11,53 -0,27	21,66 -0,68	27,54 -1,01
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	1,04 0,81	10,75 7,52	3,67 3,40	8,97 7,14	14,02 9,41	22,87 9,14	25,04 0,29
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,40 -0,02	11,65 -0,20	2,71 -0,12	10,26 -0,17	13,45 -0,31	19,42 -0,65	23,03 -0,96
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,11 -0,03	8,92 -0,13	3,38 -0,06	6,69 -0,13	13,51 -0,23	23,50 -0,53	25,97 -0,83
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	1,18 103,53	6,91 77,90	3,38 101,76	6,69 100,20	11,42 84,28	22,82 90,77	26,69 93,59
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,58 -0,20	11,50 -0,35	2,66 -0,17	11,27 0,84	13,38 -0,39	19,04 -1,03	17,60 -6,39
ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LONGO PRAZO % do CDI	1,22 106,88	7,66 86,44	3,54 106,51	6,72 100,63	12,33 91,00	24,07 95,75	28,66 100,50
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,49 -1,11	7,88 -2,26	1,40 -1,43	7,27 -3,16			
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	1,24 108,65	6,64 74,94	3,55 106,96	6,32 94,58	11,39 84,03	23,59 93,84	28,04 98,31
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	0,92 80,77	6,56 73,97	3,28 98,80	6,30 94,28	10,76 79,36	21,06 83,78	22,08 77,42
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,16 101,39	8,81 99,38	3,35 100,89	6,69 100,21	13,54 99,91	25,45 101,24	28,93 101,46
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,24 108,60	8,97 101,16	3,53 106,48	6,93 103,85	13,76 101,52	25,76 102,49	29,23 102,51
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO % do CDI	1,15 100,99	8,75 98,67	3,31 99,76	6,57 98,34	13,33 98,38	24,88 98,99	27,69 97,11
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-7,14 -4,31	2,04 -7,18	4,62 -4,08	4,03 -7,54	-2,23 -12,88	-28,38 -43,76	-27,47 -65,23
TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,13 2,95	29,38 23,91	14,14 7,30	29,69 19,39	27,48 21,80	48,69 51,25	105,39 88,92
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-4,30 0,79	3,94 -1,53	7,69 0,85	8,76 -1,55	1,10 -4,58	-4,03 -1,47	17,78 1,30
FIA CAIXA DIVIDENDOS	-2,83	8,19	8,28	10,70	9,25	12,71	31,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	2,26	2,72	1,44	0,40	3,57	15,26	14,75
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,24 -1,15	6,99 1,51	6,37 -0,46	10,14 -0,16	0,90 -4,78	-14,13 -11,58	-2,96 -19,43
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-3,45 -0,62	9,23 0,01	7,22 -1,48	12,59 1,01	9,27 -1,37	6,96 -8,42	26,09 -11,67
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-3,11 1,97	8,40 2,92	6,09 -0,75	10,49 0,18	9,21 3,53	20,73 23,29	37,32 20,85
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-4,66 -1,83	-3,25 -12,47	6,49 -2,22	2,15 -9,43	-2,58 -13,22	-11,62 -27,00	-5,96 -43,72
SOMMA BRASIL FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,50 -0,41	-1,19 -6,67	4,72 -2,12	5,59 -4,71	-2,41 -8,09	-13,62 -11,06	0,33 -16,15
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	4,43 3,70	5,15 -1,77	4,11 1,58	5,78 2,69	5,53 -0,83	-5,66 5,77	
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	1,30 0,58	6,09 -0,83	0,49 -2,04	3,91 0,82	9,30 2,95	-10,65 0,77	13,48 7,94
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-4,99 -5,72	21,14 14,22	4,25 1,72	7,99 4,90	-4,03 -10,38	-56,90 -45,48	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,35 0,58	27,77 20,45	5,56 3,77	13,52 8,63	17,77 6,91	-28,49 -56,26	-20,65 -69,16
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V MULTIMERCADO LP Var. IBOVESPA p.p.	-2,24 2,84	13,26 7,79	6,88 0,04	11,13 0,83	19,68 14,00		
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	1,07 -0,89	9,48 -1,26	3,85 -0,31	7,63 0,33			
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-2,69 2,39	4,72 -0,75	3,18 -3,66	5,54 -4,77	6,91 1,24		
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO % do CDI	-0,61 -53,63	7,09 79,99	3,68 110,96	7,31 109,51	10,35 76,38	17,96 71,46	23,86 83,66
LINHARES - PLANO PREVIDENCIÁRIO Var. INPC + 4,93% p.p.	-0,03 -0,69	8,52 2,26	3,13 1,82	7,19 3,04	11,15 1,81	16,75 -8,31	20,08 -25,03
CDI	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52
IBOVESPA	-5,09	5,47	6,84	10,30	5,68	-2,56	16,48
INPC + 6,00%	0,73	6,87	1,52	4,60	10,27	27,21	48,86
IPCA + 6,00%	0,76	7,32	1,79	4,89	10,86	27,77	48,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	-	2,00
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du		0,50
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	D+1 du	D+0	D+30	D+34		0,00
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,15
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
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
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BNB IMA-B FI RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES			D+5 du	D+7 du	-	2,00
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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
FIA CAIXA DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+2		
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	D+1	D+1	D+1	D+5		
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		
ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LONGO PRAZO			D+0	D+1 du	-	0,30
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 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
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	-	
SOMMA BRASIL FIA	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du	-	2,00
TARPON GT 30 FIC FIA	D+1 du	D+1 du	D+30	D+32	O fundo cobrará 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice IBOV_FEC. A taxa de performance será paga no(s) mes(es) de Janeiro	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

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

Renda Variável

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	1,97	10,75	4,16	7,31	8,32	-4,62	15,85	83,19	84,91

Investimentos Imobiliários

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

Investimentos no Exterior

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

Indicadores Econômicos

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

Meta Atuarial

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (3,200000%)	1.147.580,47	3,200000	955.065,87	5,404200	-192.514,60
NTN-B 150535 (4,410000%)	1.146.497,89	4,410000	1.056.762,70	5,404200	-89.735,19
NTN-B 150535 (5,640000%)	2.555.277,15	5,640000	2.604.323,13	5,404200	49.045,98
NTN-B 150545 (5,440500%)	2.103.342,21	5,440500	2.064.489,93	5,597500	-38.852,28
NTN-B 150545 (5,470000%)	1.548.407,81	5,470000	1.525.159,30	5,597500	-23.248,51
NTN-B 150545 (5,550000%)	2.028.432,59	5,550000	2.015.861,68	5,597500	-12.570,91
NTN-B 150545 (5,800000%)	9.216.229,92	5,800000	9.438.299,77	5,597500	222.069,85
NTN-B 150545 (5,825000%)	1.885.216,21	5,825000	1.936.288,20	5,597500	51.071,99
NTN-B 150545 (5,847000%)	2.069.278,42	5,847000	2.130.801,17	5,597500	61.522,75
NTN-B 150545 (5,920000%)	5.214.572,92	5,920000	5.415.417,90	5,597500	200.844,98
NTN-B 150545 (6,150000%)	2.259.187,94	6,150000	2.409.308,37	5,597500	150.120,43
NTN-B 150545 (6,281000%)	2.009.196,43	6,281000	2.175.008,66	5,597500	165.812,23
NTN-B 150545 (6,305500%)	4.109.019,33	6,305500	4.460.536,05	5,597500	351.516,72
NTN-B 150545 (6,380000%)	4.005.804,00	6,380000	4.385.383,31	5,597500	379.579,31
NTN-B 150545 (6,418000%)	1.829.462,78	6,418000	2.011.440,94	5,597500	181.978,16
NTN-B 150824 (5,800000%)	1.487.625,10	5,800000	1.474.970,95	6,772200	-12.654,15
NTN-B 150828 (5,200000%)	4.309.881,88	5,200000	4.296.349,11	5,276000	-13.532,77
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.120.914,39	5,270000	2.120.387,22	5,276000	-527,17
NTN-B 150828 (5,500000%)	5.497.813,35	5,500000	5.548.916,56	5,276000	51.103,21
NTN-B 150830 (4,800000%)	5.539.294,98	4,800000	5.405.264,75	5,243400	-134.030,23
NTN-B 150832 (5,350000%)	1.903.227,54	5,350000	1.904.830,64	5,337500	1.603,10
NTN-B 150840 (5,800000%)	15.924.009,38	5,800000	16.442.712,53	5,492000	518.703,15
NTN-B 150840 (5,910000%)	2.993.715,48	5,910000	3.126.523,77	5,492000	132.808,29
NTN-B 150840 (6,050500%)	1.326.635,84	6,050500	1.405.622,03	5,492000	78.986,19
NTN-B 150840 (6,132000%)	10.234.049,31	6,132000	10.934.075,42	5,492000	700.026,11
NTN-B 150840 (6,190000%)	2.171.643,42	6,190000	2.333.945,61	5,492000	162.302,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
145	07/08/2023	ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LONGO PRAZO	0,00	1.091.011,34	146.962,83577510	7,4237227000
146	14/08/2023	BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	1.090.000,00	0,00	423.531,53650791	2,5735982000
144	15/08/2023	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	0,00	43.975,79	18.062,09904578	2,4346998590
147	21/08/2023	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	2.293.581,72	0,00	501.664,59110474	4,5719426100
142	28/08/2023	NTN-B 150545 (5,470000%)	1.546.183,85	0,00	345,00017850	4.481,6900000000
Total			4.929.765,57	1.134.987,13		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.578.771,76

Value-At-Risk: 1,07%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LINHARES - PLANO PREVIDENCIÁRIO		1,07		1,07			428.892.282,75	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,58%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (3,200000%)		0,10	0,00	0,11			1.147.580,47	0,27
NTN-B 150535 (4,410000%)		0,10	0,00	0,11			1.146.497,89	0,27
NTN-B 150535 (5,640000%)		0,10	0,00	0,11			2.555.277,15	0,60
NTN-B 150545 (5,440500%)		0,22	-0,00	0,24			2.103.342,21	0,49
NTN-B 150545 (5,470000%)		0,22	-0,00	0,24			1.548.407,81	0,36
NTN-B 150545 (5,550000%)		0,26	-0,00	0,28			2.028.432,59	0,47
NTN-B 150545 (5,800000%)		0,23	-0,00	0,25			9.216.229,92	2,15
NTN-B 150545 (5,825000%)		0,10	0,00	0,11			1.885.216,21	0,44
NTN-B 150545 (5,847000%)		0,10	0,00	0,11			2.069.278,42	0,48
NTN-B 150545 (5,920000%)		0,10	0,00	0,11			5.214.572,92	1,22
NTN-B 150545 (6,150000%)		0,10	0,00	0,11			2.259.187,94	0,53
NTN-B 150545 (6,281000%)		0,10	0,00	0,11			2.009.196,43	0,47
NTN-B 150545 (6,305500%)		0,10	0,00	0,11			4.109.019,33	0,96
NTN-B 150545 (6,380000%)		0,10	0,00	0,11			4.005.804,00	0,93
NTN-B 150545 (6,418000%)		0,10	0,00	0,11			1.829.462,78	0,43
NTN-B 150824 (5,800000%)		0,10	0,00	0,11			1.487.625,10	0,35
NTN-B 150828 (5,200000%)		0,10	0,00	0,11			4.309.881,88	1,00
NTN-B 150828 (5,270000%)		0,10	0,00	0,11			2.120.914,39	0,49
NTN-B 150828 (5,500000%)		0,10	0,00	0,11			5.497.813,35	1,28
NTN-B 150830 (4,800000%)		0,10	0,00	0,11			5.539.294,98	1,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150832 (5,350000%)		0,10	0,00	0,11			1.903.227,54	0,44
NTN-B 150840 (5,800000%)		0,10	0,00	0,11			15.924.009,38	3,71
NTN-B 150840 (5,910000%)		0,10	0,00	0,11			2.993.715,48	0,70
NTN-B 150840 (6,050500%)		0,10	0,00	0,11			1.326.635,84	0,31
NTN-B 150840 (6,132000%)		0,10	0,00	0,11			10.234.049,31	2,39
NTN-B 150840 (6,190000%)		0,10	0,00	0,11			2.171.643,42	0,51
Sub-total	0,19	0,09	0,00		-2,14	0,74	96.636.316,74	22,53

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		0,66	0,01	0,67			7.839.873,33	1,83
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,05	0,00	0,05			1.458.079,35	0,34
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B		2,00	0,06	0,16			17.297.122,23	4,03
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,13	0,00	0,01			3.724.062,39	0,87
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,86	0,05	0,06			16.301.249,35	3,80
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,86	0,07	0,05			21.246.517,42	4,95
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,14	0,00	0,01			605.309,88	0,14
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,70	0,03	0,03			25.060.919,70	5,84
BB PREV RF IDKA2		0,70	0,02	0,13			17.667.804,64	4,12
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,72	0,03	0,16			32.305.660,93	7,53
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		0,72	0,01	0,03			13.175.788,45	3,07
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1		0,18	0,00	0,06			1.211.470,55	0,28
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI		0,48	0,00	1,78			1.488.040,34	0,35
BNB IMA-B FI RF		1,82	0,00	0,09			1.238.462,90	0,29
Sub-total	2,17	1,01	0,28		-0,37	0,34	160.620.361,46	37,45

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		2,70	0,01	2,08			2.586.799,81	0,60
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,02	-0,00	0,02			13.500.729,57	3,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF		2,04	0,07	0,30			18.469.642,03	4,31
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			29.575.886,78	6,90
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI		0,03	-0,00	0,03			10.566.337,27	2,46
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI		0,06	0,00	0,06			17.595.253,61	4,10
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF		0,22	0,00	0,22			9.752.460,06	2,27
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO		0,03	0,00	0,03			790.192,38	0,18
ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LONGO PRAZO		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
Sub-total	0,89	0,43	0,08		-0,41	0,77	102.837.301,51	23,98

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,59%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI		7,86	0,06	0,85			3.981.841,51	0,93
FIA CAIXA DIVIDENDOS		6,77	0,03	2,31			1.995.591,71	0,47
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,40	0,01	5,32			749.325,26	0,17
SOMMA BRASIL FIA		7,29	0,11	1,28			7.282.346,17	1,70
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		6,41	0,25	1,48			18.873.686,02	4,40
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL		7,54	0,09	4,64			5.706.346,48	1,33
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA		7,19	0,02	3,96			1.676.791,31	0,39
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES		5,92	0,04	2,73			3.188.949,01	0,74
TARPON GT 30 FIC FIA		7,91	0,06	6,45			4.313.213,04	1,01
Sub-total	12,50	6,59	0,68		-0,43	-4,22	47.768.090,51	11,14

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,51%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V		3,84	0,02	4,33			2.326.276,41	0,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MULTIMERCADO LP								
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO		0,66	0,00	6,93			2.195.964,30	0,51
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO		3,35	0,03	4,49			4.818.065,33	1,12
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO		2,07	0,02	2,07			3.474.063,18	0,81
Sub-total	5,02	2,51	0,07		-0,51	-1,42	12.814.369,22	2,99

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,21%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE		6,32	-0,01	6,61			2.326.395,01	0,54
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		12,01	0,00	10,89			1.081.776,74	0,25
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,25	-0,00	9,25			667.257,07	0,16
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		7,90	-0,02	7,78			4.140.414,49	0,97
Sub-total	15,86	7,21	-0,04		0,01	1,28	8.215.843,31	1,92