



**LDB**  
EMPRESAS

**LINHARES - PLANO PREVIDENCIÁRIO**  
MAIO 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 31.05.2023.

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

84,40%

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 150523 (5,850000%)	0,48	0,00	0,59	5,27	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (6,050000%)	0,48	0,00	0,60	5,34	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (3,200000%)	0,47	0,03	0,84	4,67	1.135.847,08	0,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,410000%)	0,47	0,03	0,94	5,17	1.131.368,65	0,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,640000%)	0,47	0,04	1,04	5,68	2.513.952,29	0,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,800000%)	4,02	0,04	0,29	0,29	9.063.645,32	2,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,825000%)	0,69	0,04	1,06	5,75	1.853.890,66	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,847000%)	0,51	0,04	1,06	5,76	2.034.787,60	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,920000%)	0,47	0,04	1,07	5,79	5.126.737,36	1,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,150000%)	0,47	0,04	1,09	5,89	2.219.894,34	0,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,281000%)	0,47	0,04	1,10	5,94	1.973.622,67	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,305500%)	0,47	0,04	1,10	5,95	4.036.026,38	0,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,380000%)	3,07	0,04	1,11	5,98	3.933.931,24	0,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,418000%)	3,08	0,04	1,11	4,81	1.796.473,75	0,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,800000%)	0,47	0,04	1,06	5,74	1.506.156,35	0,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,200000%)	0,47	0,04	1,01	5,50	4.366.058,28	1,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,270000%)	0,47	0,04	1,01	5,53	2.148.363,88	0,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,500000%)	0,47	0,04	1,03	5,62	5.567.333,24	1,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,800000%)	0,47	0,03	0,97	5,33	5.611.824,79	1,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,350000%)	0,47	0,04	1,02	5,56	1.926.749,16	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,800000%)	0,47	0,04	1,06	5,74	16.113.073,58	3,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,910000%)	4,13	0,04	1,07	1,07	3.029.423,57	0,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,050500%)	4,19	0,04	1,08	1,57	1.342.557,38	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,132000%)	0,47	0,04	1,09	5,88	10.357.321,57	2,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,190000%)	4,25	0,04	1,09	2,13	2.197.872,15	0,54
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,47</b>	<b>0,04</b>	<b>1,05</b>	<b>5,72</b>	<b>90.986.911,29</b>	<b>22,21</b>

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	2,46	0,02	1,88	6,83	7.562.260,96	1,85	5.928.019.904,28	0,13
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,07	0,06	1,22	5,36	1.410.976,65	0,34	15.093.190.243,42	0,01
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	5,33	-0,01	2,62	8,73	14.621.903,86	3,57	221.370.635,33	6,61
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,39	0,04	1,12	5,27	3.602.651,86	0,88	6.724.495.811,47	0,05
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,26	-0,01	2,58	8,70	15.871.301,53	3,87	5.943.377.738,68	0,27
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,34	-0,01	2,53	8,69	20.669.575,30	5,04	3.621.007.048,62	0,57
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,38	0,04	1,12	5,37	585.534,85	0,14	7.491.213.170,65	0,01

## 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 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,45	0,00	0,63	5,91	24.425.383,45	5,96	8.623.099.025,61	0,28
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,69	0,01	0,39	5,49	17.198.921,61	4,20	7.232.116.284,73	0,24
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,79	0,01	0,36	5,50	31.438.376,81	7,67	6.636.813.957,94	0,47
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,47	0,00	0,61	5,90	12.843.990,04	3,13	5.869.025.714,56	0,22
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,30	0,04	1,16	5,41	1.170.663,51	0,29	205.555.147,29	0,57
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,26	0,01	-0,01	4,57	1.488.847,47	0,36	208.529.617,32	0,71
BANCO DO NORDESTE	SANTANDER	BNB IMA-B FI RF	4,91	-0,01	2,38	8,30	1.205.140,33	0,29	127.285.502,08	0,95
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>3,31</b>	<b>0,00</b>	<b>1,27</b>	<b>6,71</b>	<b>154.095.528,23</b>	<b>37,61</b>		

## 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	7,77	0,09	1,91	6,30	2.551.114,86	0,62	134.263.957,29	1,90
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,05	1,18	5,25	13.039.831,97	3,18	15.982.419.153,18	0,08
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	5,36	0,00	3,12	8,60	17.990.510,34	4,39	175.405.159,25	10,26
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	1,15	5,29	28.617.534,85	6,98	15.420.425.695,62	0,19
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,71	0,05	1,16	2,99	10.204.061,76	2,49	2.636.601.796,07	0,39
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,99	0,05	1,79	3,41	17.020.355,94	4,15	275.126.057,47	6,19
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	0,89	0,04	1,25	3,18	9.442.780,22	2,30	152.023.010,41	6,21
BANCO DO NORDESTE	SANTANDER	BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,05	0,05	1,15	5,26	764.865,24	0,19	1.160.343.594,70	0,07
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LONGO PRAZO	0,58	0,04	1,18	3,99	1.063.667,64	0,26	665.763.792,89	0,16
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>1,10</b>	<b>0,04</b>	<b>1,63</b>	<b>5,13</b>	<b>100.694.722,82</b>	<b>24,58</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,86</b>	<b>0,02</b>	<b>1,32</b>	<b>5,98</b>	<b>345.777.162,34</b>	<b>84,40</b>		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**REND A VARIÁVEL**

**10,64%**

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	21,44	-0,51	3,08	-3,48	3.697.463,55	0,90	1.275.029.732,58	0,29
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	18,46	-0,84	0,68	-0,08	1.843.022,40	0,45	219.320.739,31	0,84
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	18,39	-0,03	4,56	0,58	704.431,38	0,17	786.555.266,23	0,09
SOMMA	BEM	SOMMA BRASIL FIA	21,04	-0,52	3,52	-5,64	6.954.323,07	1,70	298.138.590,82	2,33
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,66	-0,83	2,30	1,88	17.602.491,74	4,30	889.314.500,47	1,98
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	21,28	-0,32	7,39	-2,47	5.454.332,75	1,33	137.903.670,58	3,96
BANESTES	BANESTES	BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	18,59	-0,52	2,11	-9,14	1.574.627,64	0,38	10.656.643,33	14,78
PLURAL	BEM	BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	17,44	-0,74	-0,64	-0,64	1.987.142,59	0,49	106.013.144,08	1,87
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	22,28	0,09	13,28	13,36	3.778.871,63	0,92	680.339.527,08	0,56
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>18,89</b>	<b>-0,58</b>	<b>4,07</b>	<b>-0,20</b>	<b>43.596.706,75</b>	<b>10,64</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>18,89</b>	<b>-0,58</b>	<b>4,07</b>	<b>-0,20</b>	<b>43.596.706,75</b>	<b>10,64</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,96%

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	25,09	-0,68	-1,42	1,00	2.234.520,64	0,55	121.219.144,58	1,84
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	48,18	1,17	12,68	16,20	1.037.671,93	0,25	180.506.038,86	0,57
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	35,10	-0,36	6,84	21,04	632.140,56	0,15	658.978.226,88	0,10
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	24,21	-0,97	2,61	5,57	4.120.285,66	1,01	296.355.367,98	1,39
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>26,21</b>	<b>-0,57</b>	<b>2,95</b>	<b>6,56</b>	<b>8.024.618,79</b>	<b>1,96</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>26,21</b>	<b>-0,57</b>	<b>2,95</b>	<b>6,56</b>	<b>8.024.618,79</b>	<b>1,96</b>		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,00%

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	8,16	-0,13	2,12	5,97	2.176.539,28	0,53	170.344.747,77	1,28
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	3,43	-0,04	1,40	5,43	2.114.550,00	0,52	217.902.051,17	0,97
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	6,79	-0,24	1,79	1,50	4.669.730,18	1,14	130.931.918,99	3,57
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	6,33	-0,04	1,97	3,29	3.350.654,88	0,82	568.217.214,92	0,59
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>5,31</b>	<b>-0,13</b>	<b>1,83</b>	<b>3,42</b>	<b>12.311.474,34</b>	<b>3,00</b>		
Investimentos Estruturados			5,31	-0,13	1,83	3,42	12.311.474,34	3,00		
Total			3,09	-0,06	1,64	5,24	409.709.962,22	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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	90.986.911,29	22,21	0,00	30,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	154.095.528,23	37,61	0,00	18,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	100.694.722,82	24,58	0,00	28,00	60,00	0,00	60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>345.777.162,34</b>	<b>84,40</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	43.596.706,75	10,64	0,00	11,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>43.596.706,75</b>	<b>10,64</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	8.024.618,79	1,96	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>8.024.618,79</b>	<b>1,96</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	12.311.474,34	3,00	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>12.311.474,34</b>	<b>3,00</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>409.709.962,22</b>	<b>100,00</b>					

## 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	1,05 93,90	5,72 106,57	3,51 107,94	6,62 101,04	9,97 73,97	921.359,11	4.547.606,81
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,27 113,32	6,71 124,97	4,38 134,84	7,35 112,13	9,45 70,12	1.936.397,33	9.686.303,89
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,63 145,32	5,13 95,56	4,07 125,28	5,98 91,31	11,89 88,21	1.639.459,36	4.970.819,03
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	4,07 0,33	-0,20 1,07	3,33 0,09	-2,68 1,01	-2,63 0,08	1.624.694,06	-86.282,61
Artigo 9º II % do CDI	2,95 262,60	6,56 122,23	3,23 99,40	5,69 86,83	11,26 83,57	229.931,06	494.171,73
Artigo 10º I % do CDI	1,83 163,18	3,42 63,68	3,14 96,72	4,12 62,93	7,99 59,29	221.604,57	407.028,37
<b>LINHARES - PLANO PREVIDENCIÁRIO (Total)</b>						<b>6.573.445,49</b>	<b>20.019.647,22</b>

## 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 150523 (5,850000%)	2.773.746,77	0,00	-2.790.162,84	0,00	0,00	16.416,07	139.719,83
NTN-B 150523 (6,050000%)	3.296.211,83	0,00	-3.315.968,13	0,00	0,00	19.756,30	168.194,99
NTN-B 150535 (3,200000%)	1.152.569,52	0,00	0,00	26.299,84	1.135.847,08	9.577,40	51.801,50
NTN-B 150535 (4,410000%)	1.149.760,56	0,00	0,00	29.100,28	1.131.368,65	10.708,37	56.972,20
NTN-B 150535 (5,640000%)	2.559.258,73	0,00	0,00	71.715,76	2.513.952,29	26.409,32	138.618,32
NTN-B 150545 (5,800000%)	0,00	9.037.754,81	0,00	0,00	9.063.645,32	25.890,51	25.890,51
NTN-B 150545 (5,825000%)	1.887.458,74	0,00	0,00	53.330,23	1.853.890,66	19.762,15	103.530,36
NTN-B 150545 (5,847000%)	2.071.745,78	0,00	0,00	58.687,60	2.034.787,60	21.729,42	113.810,36
NTN-B 150545 (5,920000%)	5.220.830,49	0,00	0,00	149.154,17	5.126.737,36	55.061,04	288.208,18
NTN-B 150545 (6,150000%)	2.261.976,19	0,00	0,00	66.358,39	2.219.894,34	24.276,54	126.795,13
NTN-B 150545 (6,281000%)	2.011.725,46	0,00	0,00	59.905,19	1.973.622,67	21.802,40	113.741,22
NTN-B 150545 (6,305500%)	4.114.215,82	0,00	0,00	122.854,33	4.036.026,38	44.664,89	232.983,39

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150545 (6,380000%)	4.010.931,25	0,00	0,00	120.784,44	3.933.931,24	43.784,43	228.236,55
NTN-B 150545 (6,418000%)	1.831.821,20	0,00	0,00	55.400,12	1.796.473,75	20.052,67	84.713,08
NTN-B 150824 (5,800000%)	1.490.386,63	0,00	0,00	0,00	1.506.156,35	15.769,72	82.514,63
NTN-B 150828 (5,200000%)	4.322.486,21	0,00	0,00	0,00	4.366.058,28	43.572,07	229.435,35
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.126.801,94	0,00	0,00	0,00	2.148.363,88	21.561,94	113.456,19
NTN-B 150828 (5,500000%)	5.510.403,63	0,00	0,00	0,00	5.567.333,24	56.929,61	298.788,49
NTN-B 150830 (4,800000%)	5.557.671,35	0,00	0,00	0,00	5.611.824,79	54.153,44	286.454,57
NTN-B 150832 (5,350000%)	1.907.284,27	0,00	0,00	0,00	1.926.749,16	19.464,89	102.313,42
NTN-B 150840 (5,800000%)	15.944.349,67	0,00	0,00	0,00	16.113.073,58	168.723,91	882.613,15
NTN-B 150840 (5,910000%)	2.997.431,12	0,00	0,00	0,00	3.029.423,57	31.992,45	31.992,45
NTN-B 150840 (6,050500%)	1.328.226,05	0,00	0,00	0,00	1.342.557,38	14.331,33	20.768,34
NTN-B 150840 (6,132000%)	10.246.066,22	0,00	0,00	0,00	10.357.321,57	111.255,35	580.158,34
NTN-B 150840 (6,190000%)	2.174.159,26	0,00	0,00	0,00	2.197.872,15	23.712,89	45.896,26
					90.986.911,29	0,00	

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	14.249.028,77	0,00	0,00	0,00	14.621.903,86	372.875,09	1.173.804,71
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1.157.262,45	0,00	0,00	0,00	1.170.663,51	13.401,06	60.059,79
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	7.422.408,99	0,00	0,00	0,00	7.562.260,96	139.851,97	483.400,89
BB PREV RF IDKA2	17.132.310,14	0,00	0,00	0,00	17.198.921,61	66.611,47	894.569,60
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	15.426.937,57	46.942,05	0,00	0,00	15.871.301,53	397.421,91	1.266.733,09
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	12.765.997,99	0,00	0,00	0,00	12.843.990,04	77.992,05	715.328,75
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	3.562.694,67	0,00	0,00	0,00	3.602.651,86	39.957,19	179.165,27
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	1.488.985,87	0,00	0,00	0,00	1.488.847,47	-138,40	66.061,49
BNB IMA-B FI RF	1.177.145,86	0,00	0,00	0,00	1.205.140,33	27.994,47	92.314,18
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	31.325.471,60	0,00	0,00	0,00	31.438.376,81	112.905,21	1.638.154,93
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	24.272.334,03	0,00	0,00	0,00	24.425.383,45	153.049,42	1.363.240,58
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	20.158.668,35	0,00	0,00	0,00	20.669.575,30	510.906,95	1.651.887,40

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	579.029,77	0,00	0,00	0,00	585.534,85	6.505,08	29.819,63
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.393.912,79	0,00	0,00	0,00	1.410.976,65	17.063,86	71.763,58
					154.095.528,23	0,00	

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	9.326.191,10	0,00	0,00	0,00	9.442.780,22	116.589,12	290.592,12
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	17.446.555,15	0,00	0,00	0,00	17.990.510,34	543.955,19	1.411.992,06
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	10.087.177,38	0,00	0,00	0,00	10.204.061,76	116.884,38	296.018,96
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	16.720.299,37	0,00	0,00	0,00	17.020.355,94	300.056,57	561.926,02
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	30.275.466,75	0,00	-1.998.995,39	0,00	28.617.534,85	341.063,49	1.530.246,44
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	756.175,16	0,00	0,00	0,00	764.865,24	8.690,08	38.239,72
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	12.887.752,28	0,00	0,00	0,00	13.039.831,97	152.079,69	649.897,31
ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LONGO PRAZO	1.051.305,97	0,00	0,00	0,00	1.063.667,64	12.361,67	40.791,54
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	2.503.335,69	0,00	0,00	0,00	2.551.114,86	47.779,17	151.114,86
					100.694.722,82	0,00	

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	673.693,95	0,00	0,00	0,00	704.431,38	30.737,43	4.054,76
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	1.542.146,62	0,00	0,00	0,00	1.574.627,64	32.481,02	-158.427,90
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	5.078.936,23	0,00	0,00	0,00	5.454.332,75	375.396,52	-137.961,00
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	3.587.048,11	0,00	0,00	0,00	3.697.463,55	110.415,44	-133.402,68
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	0,00	1.987.142,59	-12.857,41	-12.857,41
FIA CAIXA DIVIDENDOS	1.830.498,52	0,00	0,00	0,00	1.843.022,40	12.523,88	-1.449,99
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17.205.898,41	0,00	0,00	0,00	17.602.491,74	396.593,33	324.376,85
SOMMA BRASIL FIA	6.717.891,26	0,00	0,00	0,00	6.954.323,07	236.431,81	-415.848,78
TARPON GT 30 FIC FIA	3.335.899,59	0,00	0,00	0,00	3.778.871,63	442.972,04	445.233,54

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					43.596.706,75	0,00	

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	2.266.645,19	0,00	0,00	0,00	2.234.520,64	-32.124,55	22.077,17
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	920.870,93	0,00	0,00	0,00	1.037.671,93	116.801,00	144.678,15
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	591.686,76	0,00	0,00	0,00	632.140,56	40.453,80	109.891,50
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	4.015.484,85	0,00	0,00	0,00	4.120.285,66	104.800,81	217.524,91
					8.024.618,79	0,00	

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	3.285.896,10	0,00	0,00	0,00	3.350.654,88	64.758,78	106.658,31
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V MULTIMERCADO LP	2.131.270,11	0,00	0,00	0,00	2.176.539,28	45.269,17	122.601,29
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2.085.277,26	0,00	0,00	0,00	2.114.550,00	29.272,74	108.817,33
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	4.587.426,30	0,00	0,00	0,00	4.669.730,18	82.303,88	68.951,44
					12.311.474,34	0,00	

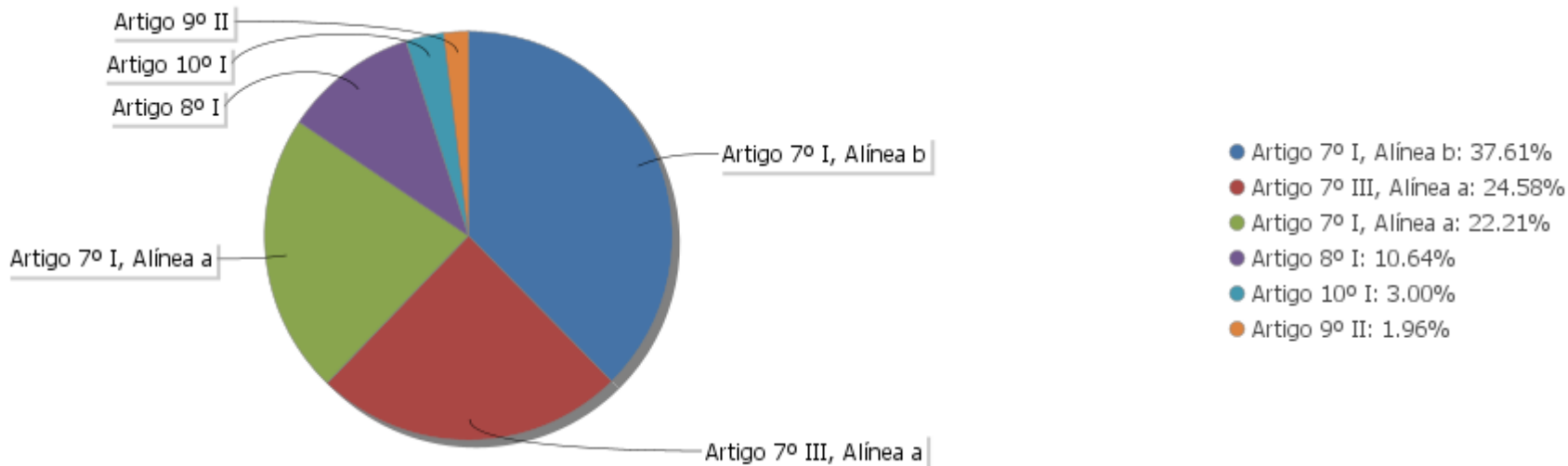
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

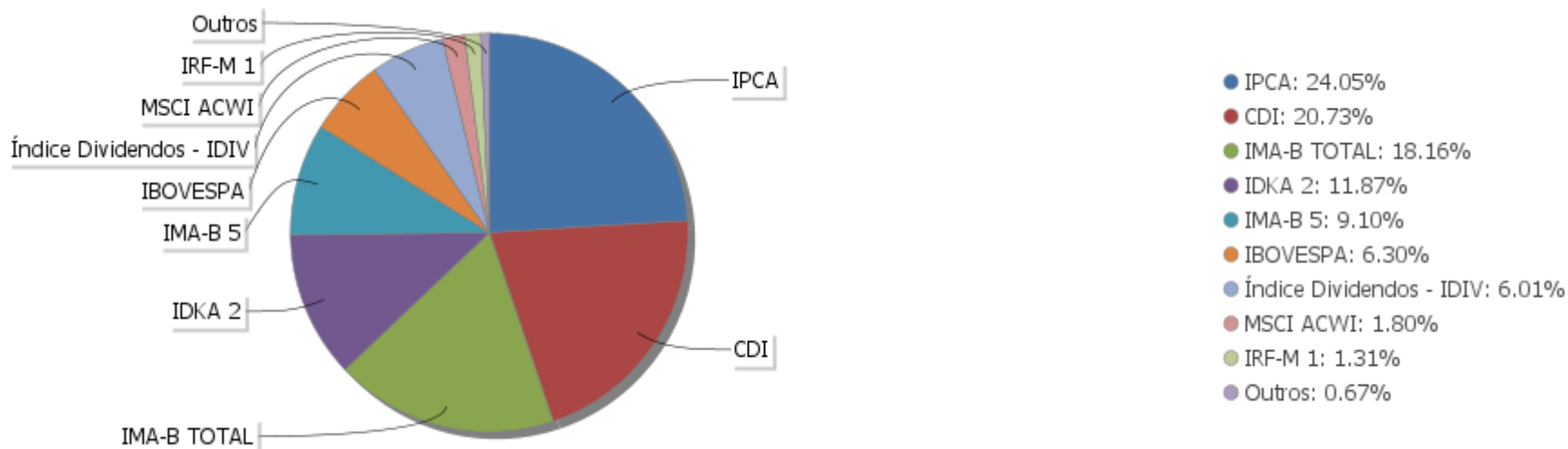
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	281.063.112,30	68,60	281.063.112,30	68,60	
de 31 dias a 365 dias	31.505.426,30	7,69	312.568.538,60	76,29	
acima de 365 dias	97.141.423,62	23,71	409.709.962,22	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



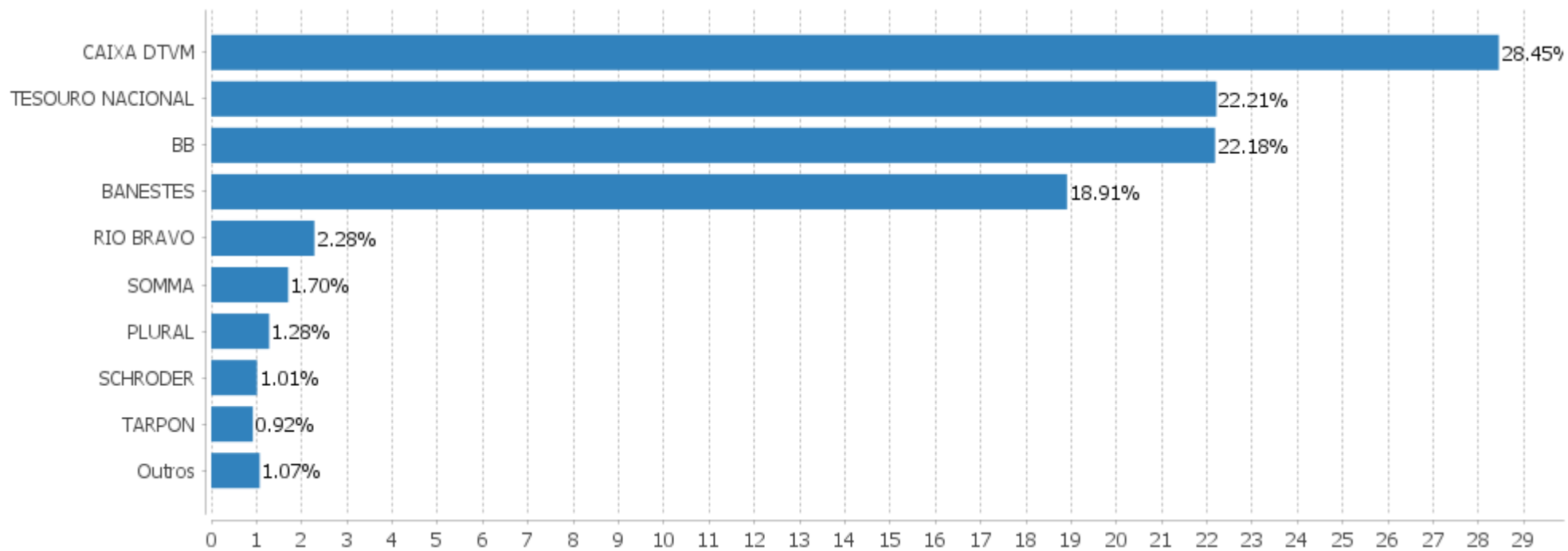
Alocação Por Estratégia





## 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								5,24
INPC + 5,10%	0,90	1,13	1,10	0,89	0,80								4,90
p.p. indexador	0,32	-1,10	-0,05	0,32	0,85								0,33
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	27	41,54
Meses abaixo - Meta Atuarial	38	58,46

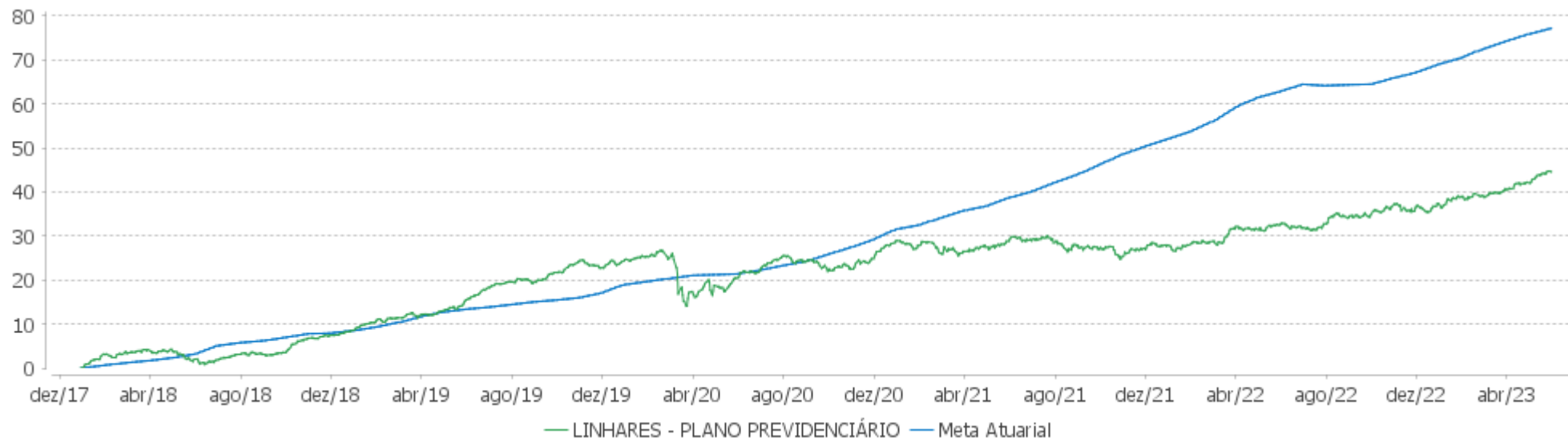
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,27	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-6,00	2020-03

**Relatório**

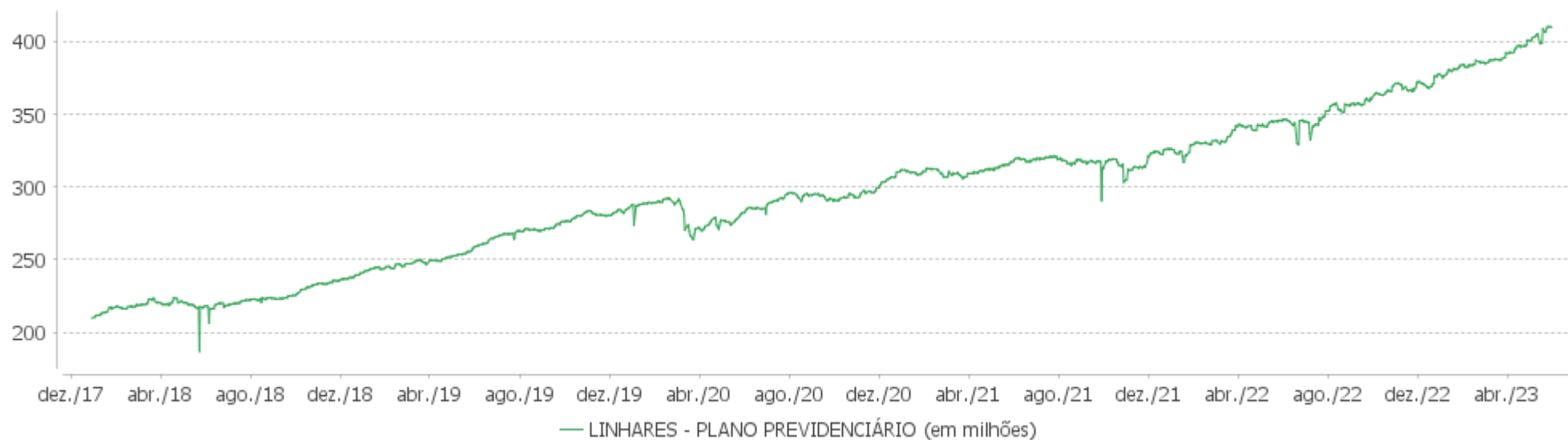
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,94	2,81	1,13	2,08
06 meses	5,67	6,07	-0,40	2,69
12 meses	8,92	8,91	0,01	3,09
24 meses	12,21	28,25	-16,04	3,27
36 meses	20,03	47,69	-27,66	3,33
48 meses	25,20	59,72	-34,52	4,27
60 meses	41,90	77,36	-35,46	3,94
Desde 29/12/2017	44,55	83,68	-39,13	3,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

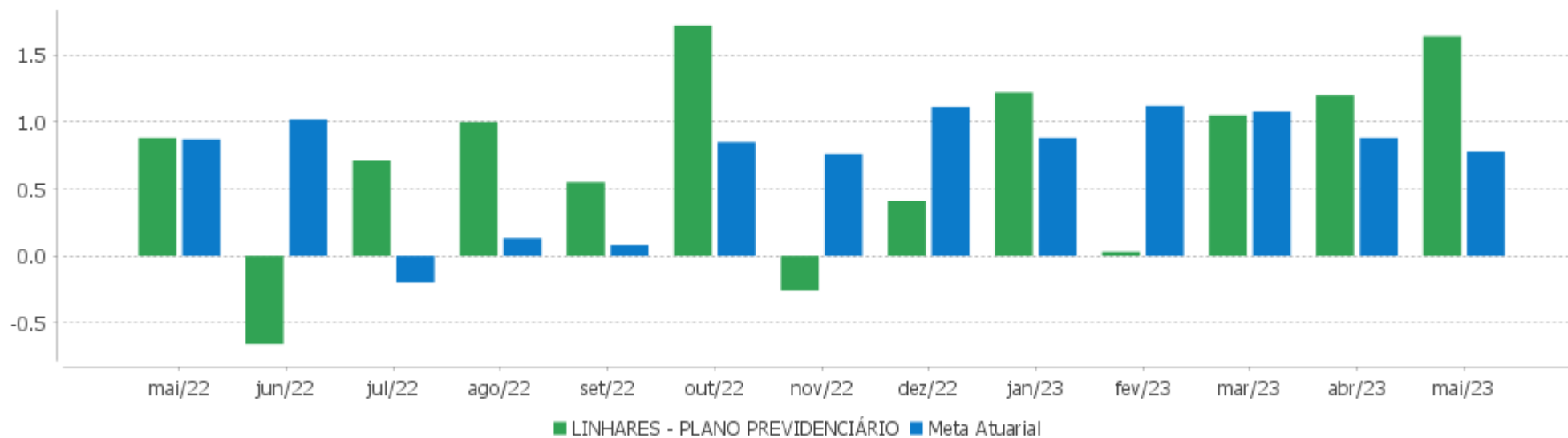


Patrimônio Líquido



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.	-1,77 -2,00	2,78 -0,17	0,62 -0,94	3,66 0,07	4,02 0,08		
NTN-B 150545 (5,920000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,79 2,84	3,55 1,99	6,71 3,12	10,22 6,28	23,51 7,38	32,59 7,10
NTN-B 150828 (5,500000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,80	5,62 2,67	3,45 1,89	6,50 2,91	9,78 5,85	26,17 10,04	35,05 9,57
NTN-B 150523 (5,850000%) Var. IPCA p.p.	0,59 0,36	5,27 2,32	3,05 1,49	6,18 2,59	9,63 5,70	26,32 10,20	35,45 9,97
NTN-B 150840 (6,050500%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,85	2,80 -0,15	3,58 2,02	3,70 0,11	4,09 0,15		
NTN-B 150545 (6,305500%) Var. IPCA p.p.	1,10 0,87	5,95 3,00	3,64 2,09	6,90 3,31	10,62 6,68	24,07 7,94	33,30 7,82
NTN-B 150535 (4,410000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,71	5,17 2,22	3,18 1,62	5,95 2,36	8,65 4,72	27,00 10,87	29,48 4,00
NTN-B 150840 (6,190000%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,86	2,81 -0,14	3,62 2,06	3,73 0,13	4,14 0,20		
NTN-B 150523 (6,050000%) Var. IPCA p.p.	0,60 0,37	5,34 2,39	3,09 1,53	6,27 2,68	9,83 5,89	26,78 10,65	36,17 10,68
NTN-B 150545 (6,150000%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,86	5,89 2,93	3,61 2,05	6,83 3,23	10,46 6,52		
NTN-B 150830 (4,800000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,74	5,33 2,38	3,27 1,72	6,15 2,56	9,06 5,12	24,69 8,56	32,99 7,51
NTN-B 150535 (5,640000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,81	5,68 2,73	3,48 1,92	6,57 2,98	9,93 5,99	26,52 10,40	35,64 10,16
NTN-B 150840 (6,132000%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,86	5,88 2,93	3,60 2,04	6,82 3,23	10,44 6,50	23,83 7,70	33,01 7,52
NTN-B 150828 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,78	5,53 2,57	3,39 1,83	6,39 2,79	9,55 5,61	25,67 9,54	34,32 8,84
NTN-B 150545 (5,825000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,83	5,75 2,80	3,53 1,97	6,66 3,07	10,12 6,18	23,37 7,24	32,41 6,92
NTN-B 150545 (6,418000%) Var. IPCA p.p.	1,11 0,88	6,00 3,04	3,67 2,11	6,96 3,37	7,41 3,47		
NTN-B 150828 (5,200000%)	1,01	5,50	3,37	6,35	9,47	25,51	34,10

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.	0,78	2,55	1,82	2,76	5,54	9,38	8,62
NTN-B 150840 (5,910000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	2,79 -0,17	3,55 1,99	3,68 0,09	4,04 0,10		
NTN-B 150545 (6,281000%) Var. IPCA p.p.	1,10 0,87	5,94 2,99	3,64 2,08	6,89 3,30	10,59 6,66	24,04 7,91	33,26 7,78
NTN-B 150545 (6,380000%) Var. IPCA p.p.	1,11 0,88	5,98 3,03	3,66 2,10	6,94 3,35	7,38 3,45		
NTN-B 150545 (5,847000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,83	5,76 2,81	3,53 1,97	6,67 3,08	10,14 6,21	23,40 7,27	
NTN-B 150824 (5,800000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,83	5,74 2,79	3,52 1,96	6,65 3,06	10,09 6,16	23,18 7,06	32,05 6,57
NTN-B 150832 (5,350000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,79	5,56 2,61	3,41 1,85	6,43 2,83	9,63 5,69	22,45 6,32	31,06 5,57
NTN-B 150535 (3,200000%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,61	4,67 1,72	2,88 1,32	5,34 1,75	7,40 3,46	24,09 7,96	36,77 11,29
NTN-B 150840 (5,800000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,83	5,74 2,79	3,52 1,96	6,65 3,06	10,09 6,16	23,31 7,18	32,32 6,83
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,53 0,00	8,69 -0,08	7,37 -0,02	8,43 -0,12	10,29 -0,18	15,07 -0,47	25,33 -0,80
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,63 0,06	5,91 -0,02	3,04 0,02	6,89 -0,04	9,41 -0,03	19,60 -0,30	28,08 -0,68
BNB IMA-B FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,38 -0,15	8,30 -0,47	6,93 -0,46	8,16 -0,39	10,32 -0,15	15,58 0,04	24,62 -1,51
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,12 -0,02	5,27 -0,15	3,18 -0,08	6,49 -0,17	13,21 -0,32	20,16 -0,66	22,24 -1,13
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,61 0,04	5,90 -0,03	3,02 0,00	6,87 -0,06	9,27 -0,18	19,30 -0,59	27,79 -0,97
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	1,22 108,98	5,36 99,81	3,24 99,53	6,51 99,37	13,40 99,46	22,55 100,53	24,62 98,09
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01 -2,54	4,57 -4,20	1,78 -5,61	5,94 -2,61	8,30 -2,17	19,47 3,93	27,72 1,58
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,62 0,09	8,73 -0,04	7,41 0,02	8,58 0,03	10,54 0,07	11,75 -3,79	19,09 -7,05
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	1,16 0,01	5,41 -0,01	3,21 -0,05	6,65 -0,01	13,42 -0,10	20,73 -0,10	22,37 -1,00
BB PREV RF IDKA2	0,39	5,49	2,47	6,77	8,61	18,88	28,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IDKA 2 p.p.	0,10	-0,27	-0,13	-0,30	-0,13	0,09	-0,73
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,36	5,50	2,49	6,80	8,34	18,22	27,61
Var. IDKA 2 p.p.	0,07	-0,26	-0,11	-0,27	-0,40	-0,57	-1,23
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,58	8,70	7,35	8,46	10,27	14,95	25,18
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,04	-0,06	-0,04	-0,09	-0,20	-0,60	-0,96
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1,88	6,83	5,11	7,65	12,47	17,91	22,80
Var. IPCA p.p.	1,65	3,88	3,56	4,06	8,53	1,78	-2,68
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,12	5,37	3,20	6,58	13,30	20,31	22,58
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,06	-0,06	-0,08	-0,22	-0,52	-0,79
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	3,12	8,60	8,39	8,34	10,39	14,10	20,24
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,59	-0,16	1,00	-0,21	-0,08	-1,45	-5,89
ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LONGO PRAZO	1,18	3,99	3,08	5,17	12,00	21,19	26,14
% do CDI	104,68	74,28	94,63	78,95	89,00	94,48	104,16
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	1,79	3,41	3,21	4,50	11,21	20,16	24,14
% do CDI	159,76	63,59	98,61	68,70	83,16	89,85	96,18
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	1,91	6,40	5,79				
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,62	-0,72	-1,60				
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	1,16	2,99	2,67	4,13	11,18	20,91	25,46
% do CDI	103,15	55,65	82,16	63,02	82,94	93,22	101,45
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	1,25	3,18	2,92	4,11	10,24	17,32	20,35
% do CDI	111,29	59,14	89,85	62,71	75,99	77,20	81,09
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1,15	5,29	3,23	6,47	13,47	22,81	25,60
% do CDI	102,46	98,46	99,51	98,71	99,91	101,66	102,01
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,18	5,25	3,28	6,46	13,49	22,99	25,62
% do CDI	105,05	97,76	101,03	98,57	100,10	102,48	102,07
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	1,15	5,26	3,15	6,40	13,19	22,23	24,31
% do CDI	102,31	98,02	96,93	97,62	97,90	99,10	96,85
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	7,39	-2,47	-0,56	-5,42	-4,27	-38,32	-17,55
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	6,56	-2,94	-3,20	-4,28	-3,43	-39,86	-57,53
TARPON GT 30 FIC FIA	13,28	13,36	13,63	7,95	20,91	24,32	138,12
Var. IBOVESPA p.p.	9,54	14,63	10,38	11,64	23,62	38,49	114,17
FIA CAIXA DIVIDENDOS	0,68	-0,08	2,23	-1,65	-1,88	-2,84	21,92
Var. IBOVESPA p.p.	-3,05	1,20	-1,01	2,04	0,83	11,33	-2,03
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	3,08	-3,48	0,99	-5,96	-9,91	-15,82	29,47
Var. IBOVESPA p.p.	-0,66	-2,21	-2,25	-2,27	-7,20	-1,65	5,52
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	4,56	0,58	3,54	-1,23	-7,32	-25,59	9,45



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.	0,82	1,85	0,30	2,46	-4,61	-11,42	-14,50
<b>BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES</b>	<b>2,85</b>	<b>2,18</b>	<b>4,15</b>	<b>0,29</b>	<b>5,87</b>	<b>5,71</b>	<b>39,44</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-0,88	3,45	0,90	3,98	8,58	19,88	15,49
<b>FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS</b>	<b>2,30</b>	<b>1,88</b>	<b>5,00</b>	<b>-0,59</b>	<b>-0,78</b>	<b>-6,36</b>	<b>28,12</b>
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,47	1,40	2,36	0,55	0,07	-7,90	-11,86
<b>SOMMA BRASIL FIA</b>	<b>3,52</b>	<b>-5,64</b>	<b>0,84</b>	<b>-7,60</b>	<b>-10,25</b>	<b>-22,93</b>	<b>6,18</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-0,22	-4,37	-2,41	-3,91	-7,54	-8,77	-17,77
<b>BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA</b>	<b>2,11</b>	<b>-9,14</b>	<b>-4,08</b>	<b>-9,89</b>	<b>-9,62</b>	<b>-22,84</b>	
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,27	-9,62	-6,72	-8,74	-8,77	-24,38	
<b>GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE</b>	<b>-1,42</b>	<b>1,00</b>	<b>1,60</b>	<b>1,64</b>	<b>6,47</b>	<b>-4,78</b>	
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,98	-3,28	1,05	3,03	-0,23	6,73	
<b>SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE</b>	<b>2,61</b>	<b>5,57</b>	<b>3,40</b>	<b>5,78</b>	<b>13,30</b>	<b>-7,12</b>	
Var. MSCI ACWI p.p.	2,05	1,29	2,85	7,17	6,60	4,39	
<b>GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE</b>	<b>12,68</b>	<b>16,20</b>	<b>3,59</b>	<b>8,14</b>	<b>8,38</b>	<b>-53,28</b>	
Var. MSCI ACWI p.p.	12,12	11,92	3,04	9,52	1,68	-41,77	
<b>MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>	<b>6,84</b>	<b>21,04</b>	<b>7,55</b>	<b>17,16</b>	<b>21,65</b>	<b>-31,28</b>	<b>-3,62</b>
Var. IPCA + 6,00% p.p.	6,10	15,61	4,50	10,53	11,50	-61,73	-53,00
<b>FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V MULTIMERCADO LP</b>	<b>2,12</b>	<b>5,97</b>	<b>3,98</b>	<b>8,73</b>			
Var. IBOVESPA p.p.	-1,61	7,24	0,73	12,42			
<b>RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO</b>	<b>1,40</b>	<b>5,43</b>	<b>3,64</b>	<b>6,98</b>			
Var. S&P 500 p.p.	-0,75	-0,90	0,62	8,37			
<b>RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO</b>	<b>1,79</b>	<b>1,50</b>	<b>2,29</b>	<b>1,38</b>	<b>6,19</b>		
Var. IBOVESPA p.p.	-1,94	2,77	-0,96	5,07	8,90		
<b>FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO</b>	<b>1,97</b>	<b>3,29</b>	<b>3,50</b>	<b>3,43</b>	<b>9,35</b>	<b>12,63</b>	<b>24,58</b>
% do CDI	175,45	61,24	107,71	52,35	69,40	56,29	97,91
<b>LINHARES - PLANO PREVIDENCIÁRIO</b>	<b>1,64</b>	<b>5,24</b>	<b>3,94</b>	<b>5,67</b>	<b>8,92</b>	<b>12,21</b>	<b>20,03</b>
Var. INPC + 4,93% p.p.	0,85	0,33	1,13	-0,42	-0,09	-15,99	-26,67
<b>CDI</b>	<b>1,12</b>	<b>5,37</b>	<b>3,25</b>	<b>6,55</b>	<b>13,48</b>	<b>22,43</b>	<b>25,10</b>
<b>IBOVESPA</b>	<b>3,74</b>	<b>-1,28</b>	<b>3,24</b>	<b>-3,69</b>	<b>-2,71</b>	<b>-14,17</b>	<b>23,95</b>
<b>INPC + 6,00%</b>	<b>0,87</b>	<b>5,27</b>	<b>3,03</b>	<b>6,53</b>	<b>9,94</b>	<b>30,40</b>	<b>50,49</b>
<b>IPCA + 6,00%</b>	<b>0,74</b>	<b>5,43</b>	<b>3,05</b>	<b>6,63</b>	<b>10,15</b>	<b>30,45</b>	<b>49,38</b>

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	1,14	5,42	3,26	6,67	13,53	20,82	23,37	31,17	40,60
IRF-M 1+	2,85	8,54	6,92	10,30	15,84	14,80	14,48	30,11	50,74
IRF-M TOTAL	2,20	7,34	5,54	8,93	14,73	16,57	17,40	30,67	48,09
IMA-B 5	0,57	5,93	3,02	6,92	9,45	19,90	28,76	40,94	59,58
IMA-B 5+	4,13	11,16	11,29	9,84	11,30	11,03	22,89	28,01	69,69
IMA-B TOTAL	2,53	8,76	7,39	8,55	10,47	15,54	26,13	34,56	66,49
IMA-GERAL TOTAL	1,77	6,78	4,95	7,60	12,55	18,47	23,45	32,82	51,09
IDKA 2	0,29	5,76	2,60	7,07	8,74	18,79	28,85	40,48	57,41
IDKA 20	7,14	15,51	20,12	11,68	12,90	1,60	17,65	14,97	73,96
CDI	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10	31,21	39,57

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,74	-1,28	3,24	-3,69	-2,71	-14,17	23,95	11,65	41,15
IBRX 100	3,59	-2,09	2,36	-4,66	-4,47	-16,34	23,50	12,48	44,21
IBRX 50	2,92	-3,51	0,95	-5,97	-4,44	-15,81	25,71	11,41	38,93
SMALL CAP	13,54	4,71	13,69	1,56	-7,34	-32,24	6,89	5,09	34,10
Índice Consumo - ICON	12,26		6,51	-6,28	-15,80	-46,84	-32,02	-26,79	-9,87
Índice Dividendos - IDIV	0,84	0,48	2,64	-1,14	-0,85	1,55	39,98	32,28	81,33

**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	2,16	6,32	3,02	-1,39	9,00	-3,17	28,94	96,40	109,24

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	5,43	5,10	7,30	5,10	6,84	6,99	13,39	18,05	36,10

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,56	4,28	0,55	-1,39	6,70	-11,51	19,15	69,85	72,84

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,23	2,95	1,56	3,59	3,94	16,13	25,48	27,84	33,80
INPC	0,36	2,79	1,54	3,50	3,74	16,08	26,41	29,00	35,17
IGPM	-1,84	-2,58	-2,73	-2,14	-4,47	5,78	44,96	54,39	66,19
SELIC	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10	31,21	39,57

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	4,62	2,56	5,63	8,08	25,59	41,11	49,48	62,68
IPCA + 5,00%	0,66	5,03	2,80	6,13	9,11	28,01	45,21	55,30	70,63
IPCA + 5,50%	0,70	5,23	2,93	6,38	9,63	29,23	47,29	58,27	74,72
IPCA + 5,89%	0,73	5,39	3,02	6,57	10,03	30,18	48,92	60,62	77,96
IPCA + 6,00%	0,74	5,43	3,05	6,63	10,15	30,45	49,38	61,28	78,88
INPC + 4,00%	0,70	4,45	2,54	5,53	7,87	25,54	42,15	50,84	64,35
INPC + 6,00%	0,87	5,27	3,03	6,53	9,94	30,40	50,49	62,75	80,72

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%)	1.135.847,08	3,200000	928.621,60	5,552700	-207.225,48
NTN-B 150535 (4,410000%)	1.131.368,65	4,410000	1.027.502,61	5,552700	-103.866,04
NTN-B 150535 (5,640000%)	2.513.952,29	5,640000	2.532.213,54	5,552700	18.261,25
NTN-B 150545 (5,800000%)	9.063.645,32	5,800000	9.139.618,13	5,730200	75.972,81
NTN-B 150545 (5,825000%)	1.853.890,66	5,825000	1.875.012,99	5,730200	21.122,33
NTN-B 150545 (5,847000%)	2.034.787,60	5,847000	2.063.370,46	5,730200	28.582,86
NTN-B 150545 (5,920000%)	5.126.737,36	5,920000	5.244.043,19	5,730200	117.305,83
NTN-B 150545 (6,150000%)	2.219.894,34	6,150000	2.333.064,11	5,730200	113.169,77
NTN-B 150545 (6,281000%)	1.973.622,67	6,281000	2.106.178,98	5,730200	132.556,31
NTN-B 150545 (6,305500%)	4.036.026,38	6,305500	4.319.379,25	5,730200	283.352,87
NTN-B 150545 (6,380000%)	3.933.931,24	6,380000	4.246.604,77	5,730200	312.673,53
NTN-B 150545 (6,418000%)	1.796.473,75	6,418000	1.947.787,47	5,730200	151.313,72
NTN-B 150824 (5,800000%)	1.506.156,35	5,800000	1.474.922,10	7,722900	-31.234,25
NTN-B 150828 (5,200000%)	4.366.058,28	5,200000	4.310.940,34	5,498200	-55.117,94
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.148.363,88	5,270000	2.127.588,47	5,498200	-20.775,41
NTN-B 150828 (5,500000%)	5.567.333,24	5,500000	5.567.761,75	5,498200	428,51
NTN-B 150830 (4,800000%)	5.611.824,79	4,800000	5.410.938,41	5,450000	-200.886,38
NTN-B 150832 (5,350000%)	1.926.749,16	5,350000	1.906.352,16	5,507000	-20.397,00
NTN-B 150840 (5,800000%)	16.113.073,58	5,800000	16.322.994,15	5,674600	209.920,57
NTN-B 150840 (5,910000%)	3.029.423,57	5,910000	3.103.759,74	5,674600	74.336,17
NTN-B 150840 (6,050500%)	1.342.557,38	6,050500	1.395.387,78	5,674600	52.830,40
NTN-B 150840 (6,132000%)	10.357.321,57	6,132000	10.854.465,09	5,674600	497.143,52
NTN-B 150840 (6,190000%)	2.197.872,15	6,190000	2.316.952,30	5,674600	119.080,15

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
128	15/05/2023	NTN-B 150523 (5,850000%)	0,00	2.790.162,84	658,00000000	4.240,3690577510
129	15/05/2023	NTN-B 150523 (6,050000%)	0,00	3.315.968,13	782,00000000	4.240,3684526850
127	19/05/2023	NTN-B 150545 (5,800000%)	9.037.754,81	0,00	2.135,00000000	4.233,1404270000
115	22/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.998.995,39	702.850,08695130	2,8441276840
114	24/05/2023	BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	2.000.000,00	0,00	826.067,21171958	2,4211105000
116	29/05/2023	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	46.942,05	0,00	6.320,93231103	7,4264440260
<b>Total</b>			<b>11.084.696,86</b>	<b>8.105.126,36</b>		



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Análise de Risco**

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

Value-At-Risk (R\$): 4.716.875,65

Value-At-Risk: 1,15%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LINHARES - PLANO PREVIDENCIÁRIO		1,15	1,15			409.709.962,22	100,00

**Renda Fixa**

Value-At-Risk: 0,62%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150523 (5,850000%)		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
NTN-B 150523 (6,050000%)		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
NTN-B 150535 (3,200000%)		0,07	0,00	0,10			1.135.847,08	0,28
NTN-B 150535 (4,410000%)		0,07	0,00	0,10			1.131.368,65	0,28
NTN-B 150535 (5,640000%)		0,07	0,00	0,10			2.513.952,29	0,61
NTN-B 150545 (5,800000%)		0,20	-0,00	0,20			9.063.645,32	2,21
NTN-B 150545 (5,825000%)		0,07	0,00	0,10			1.853.890,66	0,45
NTN-B 150545 (5,847000%)		0,07	0,00	0,10			2.034.787,60	0,50
NTN-B 150545 (5,920000%)		0,07	0,00	0,10			5.126.737,36	1,25
NTN-B 150545 (6,150000%)		0,07	0,00	0,10			2.219.894,34	0,54
NTN-B 150545 (6,281000%)		0,07	0,00	0,10			1.973.622,67	0,48
NTN-B 150545 (6,305500%)		0,07	0,00	0,10			4.036.026,38	0,99
NTN-B 150545 (6,380000%)		0,07	0,00	0,10			3.933.931,24	0,96
NTN-B 150545 (6,418000%)		0,07	0,00	0,10			1.796.473,75	0,44
NTN-B 150824 (5,800000%)		0,07	0,00	0,10			1.506.156,35	0,37
NTN-B 150828 (5,200000%)		0,07	0,00	0,10			4.366.058,28	1,07
NTN-B 150828 (5,270000%)		0,07	0,00	0,10			2.148.363,88	0,52
NTN-B 150828 (5,500000%)		0,07	0,00	0,10			5.567.333,24	1,36
NTN-B 150830 (4,800000%)		0,07	0,00	0,10			5.611.824,79	1,37
NTN-B 150832 (5,350000%)		0,07	0,00	0,10			1.926.749,16	0,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (5,800000%)		0,07	0,00	0,10			16.113.073,58	3,93
NTN-B 150840 (5,910000%)		0,20	-0,00	0,22			3.029.423,57	0,74
NTN-B 150840 (6,050500%)		0,20	-0,00	0,23			1.342.557,38	0,33
NTN-B 150840 (6,132000%)		0,07	0,00	0,10			10.357.321,57	2,53
NTN-B 150840 (6,190000%)		0,20	-0,00	0,23			2.197.872,15	0,54
<b>Sub-total</b>	0,30	0,07	-0,00		-0,23	1,05	90.986.911,29	22,21

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		0,89	0,01	0,90			7.562.260,96	1,85
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,05	0,00	0,05			1.410.976,65	0,34
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B		1,98	0,05	0,08			14.621.903,86	3,57
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,22	0,00	0,01			3.602.651,86	0,88
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,94	0,06	0,03			15.871.301,53	3,87
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,96	0,07	0,04			20.669.575,30	5,04
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,22	0,00	0,01			585.534,85	0,14
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,86	0,04	0,03			24.425.383,45	5,96
BB PREV RF IDKA2		0,99	0,03	0,16			17.198.921,61	4,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,01	0,05	0,16			31.438.376,81	7,67
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		0,86	0,02	0,02			12.843.990,04	3,13
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1		0,16	0,00	0,07			1.170.663,51	0,29
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI		0,86	0,00	1,68			1.488.847,47	0,36
BNB IMA-B FI RF		1,88	0,00	0,11			1.205.140,33	0,29
<b>Sub-total</b>	1,71	1,15	0,33		0,09	1,27	154.095.528,23	37,61

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA		2,63	-0,00	2,90			2.551.114,86	0,62
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,04	-0,00	0,04			13.039.831,97	3,18
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF		2,04	0,07	0,35			17.990.510,34	4,39

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			28.617.534,85	6,98
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI		0,23	0,00	0,23			10.204.061,76	2,49
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI		0,26	0,00	0,26			17.020.355,94	4,15
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF		0,21	0,00	0,21			9.442.780,22	2,30
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO		0,03	0,00	0,03			764.865,24	0,19
ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LONGO PRAZO		0,25	0,00	0,25			1.063.667,64	0,26
<b>Sub-total</b>	<b>0,63</b>	<b>0,40</b>	<b>0,07</b>		<b>0,80</b>	<b>1,63</b>	<b>100.694.722,82</b>	<b>24,58</b>

**Renda Variável**

**Value-At-Risk: 7,38%**

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI		8,44	0,07	1,02			3.697.463,55	0,90
FIA CAIXA DIVIDENDOS		7,21	0,03	2,92			1.843.022,40	0,45
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		5,13	0,01	5,74			704.431,38	0,17
SOMMA BRASIL FIA		8,17	0,12	1,89			6.954.323,07	1,70
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		7,27	0,28	1,89			17.602.491,74	4,30
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL		8,76	0,10	5,01			5.454.332,75	1,33
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA		7,71	0,02	4,25			1.574.627,64	0,38
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES		7,26	0,03	3,10			1.987.142,59	0,49
TARPON GT 30 FIC FIA		8,93	0,06	7,12			3.778.871,63	0,92
<b>Sub-total</b>	<b>13,85</b>	<b>7,38</b>	<b>0,71</b>		<b>0,21</b>	<b>4,07</b>	<b>43.596.706,75</b>	<b>10,64</b>

**Investimentos Estruturados**

**Value-At-Risk: 2,29%**

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V MULTIMERCADO LP		2,25	0,01	6,88			2.176.539,28	0,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO		0,96	0,00	7,93			2.114.550,00	0,52
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO		3,16	0,03	5,86			4.669.730,18	1,14
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO		2,55	0,02	2,55			3.350.654,88	0,82
<b>Sub-total</b>	<b>4,16</b>	<b>2,29</b>	<b>0,06</b>		<b>0,17</b>	<b>1,83</b>	<b>12.311.474,34</b>	<b>3,00</b>

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,17%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE		10,25	-0,01	9,56			2.234.520,64	0,55
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		21,45	0,01	19,70			1.037.671,93	0,25
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		13,53	-0,00	13,53			632.140,56	0,15
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		8,84	-0,02	8,90			4.120.285,66	1,01
<b>Sub-total</b>	<b>18,30</b>	<b>10,17</b>	<b>-0,02</b>		<b>0,10</b>	<b>2,95</b>	<b>8.024.618,79</b>	<b>1,96</b>