



IPAJM - CONSOLIDADO
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.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA

82,76%

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 150830	5,48	-0,66	-0,26	12,43	121.174.870,24	1,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,640000%)	0,41	0,03	0,73	7,42	130.149.939,81	1,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,645000%)	0,41	0,03	0,73	7,42	130.097.583,39	1,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,681000%)	0,41	0,03	0,73	7,44	129.722.031,33	1,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,706000%)	0,41	0,03	0,73	7,46	43.153.995,34	0,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,475000%)	0,41	0,03	0,71	7,30	44.854.670,06	0,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,511000%)	0,41	0,03	0,72	7,33	44.663.068,62	0,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,531000%)	0,41	0,03	0,72	7,34	89.114.230,10	1,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,576000%)	0,41	0,03	0,72	7,37	132.960.314,82	1,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,662500%)	0,41	0,03	0,73	7,43	131.608.972,59	1,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,700000%)	0,41	0,03	0,73	7,46	131.029.329,63	1,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,752000%)	0,41	0,03	0,74	7,49	86.821.216,22	1,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,761000%)	0,41	0,03	0,74	7,50	86.729.737,18	1,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,790000%)	0,41	0,03	0,74	7,52	86.435.780,12	1,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,945000%)	0,41	0,03	0,75	7,62	84.889.155,78	1,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,616100%)	0,41	0,03	0,72	7,40	86.449.758,38	1,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,621700%)	0,41	0,03	0,73	7,40	86.399.304,30	1,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,642300%)	0,41	0,03	0,73	7,42	86.214.195,72	1,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,661100%)	0,41	0,03	0,73	7,43	129.068.568,27	1,89
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,726000%)	0,41	0,03	0,73	7,47	128.201.337,06	1,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,385000%)	0,41	0,03	0,70	7,24	45.090.480,85	0,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,797000%)	0,41	0,03	0,74	7,52	128.053.200,57	1,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,841000%)	0,41	0,03	0,74	7,55	127.316.116,08	1,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,887200%)	0,41	0,03	0,75	7,58	84.366.170,28	1,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,931000%)	0,41	0,03	0,75	7,61	125.828.795,97	1,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,961600%)	0,41	0,03	0,75	7,63	125.329.176,51	1,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,041000%)	0,41	0,04	0,76	7,69	124.046.815,74	1,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,071500%)	0,41	0,04	0,76	7,71	123.559.603,02	1,81
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,46	0,00	0,69	7,69	2.873.328.417,98	41,99

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				
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,01	0,04	0,86	6,67	66.202.806,93	0,97	1.549.207.595,27	4,27
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	4,90	-0,66	-0,46	11,68	5.588.689,51	0,08	248.419.584,41	2,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,37	0,03	1,12	8,82	199.467.913,54	2,92	6.785.029.538,03	2,94
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,89	-0,64	-0,40	2,00	71.200.819,33	1,04	5.260.991.740,78	1,35
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,94	-0,63	-0,37	2,07	69.219.720,27	1,01	5.279.029.725,18	1,31
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,36	0,03	1,11	8,92	50.823.240,40	0,74	7.477.458.112,25	0,68
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,24	-0,24	0,60	8,67	107.189.151,07	1,57	8.195.443.440,71	1,31
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,32	0,03	1,11	9,08	1.770.662,86	0,03	164.530.270,84	1,08
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,45	-0,19	0,63	9,92	105.336.920,17	1,54	5.643.739.686,42	1,87
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,17	-0,19	0,60	8,42	676.799.924,08	9,89		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,05	1,24	8,97	999.266.881,70	14,60	14.797.589.893,96	6,75
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	4,95	-0,70	-0,58	11,50	371.762,38	0,01	161.482.927,48	0,23
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,04	1,16	8,81	902.252.085,71	13,19	14.734.335.445,36	6,12
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	1,05	8,15	470.571,64	0,01	3.554.344.878,79	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,02	0,05	1,05	7,80	16.058,59	0,00	875.310.436,12	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,71	0,06	1,24	6,64	200.011.174,35	2,92	2.786.888.227,17	7,18
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,99	0,06	1,18	6,91	1.431.831,86	0,02	272.374.654,72	0,53
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	0,85	-0,06	0,92	6,56	8.811.514,79	0,13	147.812.604,45	5,96
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,18	0,05	1,20	8,39	2.112.631.881,02	30,88		
Renda Fixa			0,33	-0,00	0,87	8,06	5.662.760.223,08	82,76		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

10,56%

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	129.510.436,53	1,89	1.338.682.696,87	9,67
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	18,87	-1,60	-4,18	5,62	41.329.321,15	0,60	562.805.403,27	7,34
CAIXA DTVM	CEF	FIA BRASIL IBX-50	20,42	-1,55	-5,86	2,74	94.014.980,74	1,37	634.558.685,41	14,82
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,73	-1,60	-5,20	4,45	115.987.779,96	1,70	758.125.877,46	15,30
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,51	-1,62	-3,45	9,23	90.984.108,95	1,33	936.636.791,99	9,71
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	25,28	-2,49	-7,25	7,96	87.731.273,92	1,28	684.787.474,06	12,81
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	20,24	-1,33	-7,14	2,04	13.024.718,02	0,19	145.926.703,62	8,93
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	17,24	-0,02	-0,75	19,29	107.615.612,64	1,57	1.236.273.116,90	8,70
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	21,40	-1,56	-4,61	2,46	42.558.237,38	0,62	834.870.515,70	5,10
Sub-total Artigo 8º I			17,95	-1,43	-4,47	7,10	722.756.469,29	10,56		
Renda Variável			17,95	-1,43	-4,47	7,10	722.756.469,29	10,56		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,63%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	22,55	1,65	2,90	20,35	88.791.724,84	1,30	2.114.296.555,90	4,20
BB	BB	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	20,59	1,36	2,83	13,17	97.743.561,19	1,43	1.329.667.917,72	7,35
BB	BB	BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NÍVEL I FI	18,76	0,30	2,09	34,32	61.512.964,62	0,90	468.217.504,61	13,14
Sub-total Artigo 9º III			19,22	1,20	2,67	20,45	248.048.250,65	3,63		
Investimentos no Exterior			19,22	1,20	2,67	20,45	248.048.250,65	3,63		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,80%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	0,42	-0,02	0,96	8,48	83.209.258,42	1,22	16.607.871.823,22	0,50
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	18,24	-0,08	-0,92	23,40	108.648.930,46	1,59	1.616.038.532,30	6,72
Sub-total Artigo 10º I			9,49	-0,05	-0,11	16,22	191.858.188,88	2,80		
Investimentos Estruturados			9,49	-0,05	-0,11	16,22	191.858.188,88	2,80		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,25%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	22,70	0,86	5,63	41,31	16.800.000,00	0,25	138.610.263,98	12,12
Sub-total Artigo 11º			22,70	0,86	5,63	41,31	16.800.000,00	0,25		
Fundos Imobiliários			22,70	0,86	5,63	41,31	16.800.000,00	0,25		
Total			2,46	-0,11	0,32	8,75	6.842.223.131,90	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	2.873.328.417,98	41,99	46,00	58,00	80,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	676.799.924,08	9,89	2,00	5,00	25,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	2.112.631.881,02	30,88	5,00	22,00	30,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	5.662.760.223,08	82,76					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	722.756.469,29	10,56	2,00	5,50	20,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	722.756.469,29	10,56					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	248.048.250,65	3,63	2,00	4,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	248.048.250,65	3,63					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	191.858.188,88	2,80	2,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	191.858.188,88	2,80					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	16.800.000,00	0,25	0,00	0,50	3,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	16.800.000,00	0,25					5,00
Total		6.842.223.131,90	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	0,69 60,91	7,69 86,69	1,71 51,64	5,44 81,49	10,50 77,44	19.953.058,65	215.041.762,61
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,60 52,71	8,42 94,94	2,98 89,89	6,24 93,47	11,87 87,58	4.377.050,94	49.244.312,93
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,20 105,40	8,39 94,61	3,46 104,17	6,71 100,45	13,14 96,98	24.296.109,10	148.906.038,85
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,47 0,62	7,10 1,63	6,40 -0,44	10,37 0,06	4,22 -1,46	-33.803.347,09	48.726.308,21
Artigo 9º III % do CDI	2,67 234,36	20,45 230,59	6,81 205,28	15,71 235,25	14,19 104,74	6.450.793,51	43.083.386,77
Artigo 10º I % do CDI	-0,11 -9,77	16,22 182,98	6,80 204,85	12,54 187,84	18,59 137,17	-213.896,30	35.208.161,83
Artigo 11º % do CDI	5,63 493,79	41,31 465,86	26,26 791,09	41,88 627,16	33,45 246,83	898.000,00	4.994.000,00
IPAJM - CONSOLIDADO (Total)						21.957.768,81	545.203.971,20

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 (5,640000%)	129.210.778,29	0,00	0,00	0,00	130.149.939,81	939.161,52	9.165.187,80
NTN-B 150535 (5,645000%)	129.158.291,13	0,00	0,00	0,00	130.097.583,39	939.292,26	9.165.426,03
NTN-B 150535 (5,681000%)	128.781.349,08	0,00	0,00	0,00	129.722.031,33	940.682,25	9.167.381,52
NTN-B 150535 (5,706000%)	42.840.132,91	0,00	0,00	0,00	43.153.995,34	313.862,43	3.056.210,76
NTN-B 150545 (5,475000%)	44.537.383,03	0,00	0,00	0,00	44.854.670,06	317.287,03	3.112.433,45
NTN-B 150545 (5,511000%)	44.345.714,09	0,00	0,00	0,00	44.663.068,62	317.354,53	3.109.006,71
NTN-B 150545 (5,531000%)	88.479.498,86	0,00	0,00	0,00	89.114.230,10	634.731,24	6.214.168,72
NTN-B 150545 (5,576000%)	132.008.071,95	0,00	0,00	0,00	132.960.314,82	952.242,87	9.308.449,95
NTN-B 150545 (5,662500%)	130.656.651,18	0,00	0,00	0,00	131.608.972,59	952.321,41	9.283.595,61
NTN-B 150545 (5,700000%)	130.077.064,14	0,00	0,00	0,00	131.029.329,63	952.265,49	9.272.789,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150545 (5,752000%)	86.186.403,86	0,00	0,00	0,00	86.821.216,22	634.812,36	6.171.823,34
NTN-B 150545 (5,761000%)	86.094.881,44	0,00	0,00	0,00	86.729.737,18	634.855,74	6.170.118,66
NTN-B 150545 (5,790000%)	85.800.920,28	0,00	0,00	0,00	86.435.780,12	634.859,84	6.164.573,66
NTN-B 150545 (5,945000%)	84.254.446,98	0,00	0,00	0,00	84.889.155,78	634.708,80	6.134.608,70
NTN-B 150830	124.883.178,36	0,00	0,00	3.418.440,59	121.174.870,24	-289.867,53	13.869.860,26
NTN-B 150840 (5,616100%)	88.261.627,62	0,00	0,00	2.441.743,28	86.449.758,38	629.874,04	6.153.883,56
NTN-B 150840 (5,621700%)	88.211.121,10	0,00	0,00	2.441.743,28	86.399.304,30	629.926,48	6.153.268,62
NTN-B 150840 (5,642300%)	88.025.765,46	0,00	0,00	2.441.743,28	86.214.195,72	630.173,54	6.151.302,90
NTN-B 150840 (5,661100%)	131.785.620,45	0,00	0,00	3.662.614,92	129.068.568,27	945.562,74	9.224.263,38
NTN-B 150840 (5,726000%)	130.917.477,75	0,00	0,00	3.662.614,92	128.201.337,06	946.474,23	9.214.600,86
NTN-B 150850 (5,385000%)	45.992.045,06	0,00	0,00	1.220.871,64	45.090.480,85	319.307,43	3.142.344,09
NTN-B 150850 (5,797000%)	130.762.492,05	0,00	0,00	3.662.614,92	128.053.200,57	953.323,44	9.259.471,23
NTN-B 150850 (5,841000%)	130.026.062,46	0,00	0,00	3.662.614,92	127.316.116,08	952.668,54	9.241.699,71
NTN-B 150850 (5,887200%)	86.173.199,56	0,00	0,00	2.441.743,28	84.366.170,28	634.714,00	6.148.763,34
NTN-B 150850 (5,931000%)	128.539.833,84	0,00	0,00	3.662.614,92	125.828.795,97	951.577,05	9.205.824,78
NTN-B 150850 (5,961600%)	128.040.586,80	0,00	0,00	3.662.614,92	125.329.176,51	951.204,63	9.193.574,61
NTN-B 150850 (6,041000%)	126.759.355,26	0,00	0,00	3.662.614,92	124.046.815,74	950.075,40	9.162.104,37
NTN-B 150850 (6,071500%)	126.272.611,05	0,00	0,00	3.662.614,92	123.559.603,02	949.606,89	9.150.040,77
					2.873.328.417,98	19.953.058,65	

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 INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	82.768.659,21	326.104.481,94	-343.542.674,25	0,00	66.202.806,93	872.340,03	7.706.417,71
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	5.614.772,63	0,00	0,00	0,00	5.588.689,51	-26.083,12	584.499,17
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1.751.147,68	0,00	0,00	0,00	1.770.662,86	19.515,18	147.425,08
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	71.487.680,72	0,00	0,00	0,00	71.200.819,33	-286.861,39	1.200.819,33
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	197.266.840,98	0,00	0,00	0,00	199.467.913,54	2.201.072,56	16.169.153,90
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	106.552.936,32	0,00	0,00	0,00	107.189.151,07	636.214,75	8.549.055,41
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	69.477.330,88	0,00	0,00	0,00	69.219.720,27	-257.610,61	1.219.720,27

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	50.264.968,94	0,00	0,00	0,00	50.823.240,40	558.271,46	4.164.084,39
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	104.676.728,09	0,00	0,00	0,00	105.336.920,17	660.192,08	9.503.137,67
					676.799.924,08	4.377.050,94	

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	8.731.173,70	0,00	0,00	0,00	8.811.514,79	80.341,09	542.356,00
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	373.930,10	0,00	0,00	0,00	371.762,38	-2.167,72	38.333,95
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	227.385.725,22	0,00	-30.000.000,00	0,00	200.011.174,35	2.625.449,13	17.030.456,56
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	1.415.139,69	0,00	0,00	0,00	1.431.831,86	16.692,17	97.618,81
BB PREV RF FLUXO FIC	393.699,02	165.376,94	-93.614,23	0,00	470.571,64	5.109,91	33.841,80
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	820.566.604,02	75.000.000,00	-3.234.366,31	0,00	902.252.085,71	9.919.848,00	63.242.446,06
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	15.840,48	114.000,00	-114.000,00	0,00	16.058,59	218,11	692.116,86
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	893.795.058,58	93.821.204,71	0,00	0,00	999.266.881,70	11.650.618,41	67.228.868,81
					2.112.631.881,02	24.296.109,10	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	14.026.838,66	0,00	0,00	0,00	13.024.718,02	-1.002.120,64	260.324,99
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	108.423.500,69	0,00	0,00	0,00	107.615.612,64	-807.888,05	18.726.754,60
BB AÇÕES DIVIDENDOS	43.130.732,47	0,00	0,00	0,00	41.329.321,15	-1.801.411,32	2.199.206,16
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	122.349.003,68	0,00	0,00	0,00	115.987.779,96	-6.361.223,72	4.945.124,04
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	44.613.722,27	0,00	0,00	0,00	42.558.237,38	-2.055.484,89	1.020.448,06
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	135.328.249,20	0,00	0,00	0,00	129.510.436,53	-5.817.812,67	4.910.510,67
FIA BRASIL IBX-50	99.862.896,17	0,00	0,00	0,00	94.014.980,74	-5.847.915,43	2.504.554,19
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	94.591.162,97	0,00	0,00	0,00	87.731.273,92	-6.859.889,05	6.467.638,48
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	94.233.710,27	0,00	0,00	0,00	90.984.108,95	-3.249.601,32	7.691.747,02
					722.756.469,29	-33.803.347,09	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	95.056.794,14	0,00	0,00	0,00	97.743.561,19	2.686.767,05	11.372.410,64
BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NÍVEL I FI	60.254.439,92	0,00	0,00	0,00	61.512.964,62	1.258.524,70	15.718.304,45
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	86.286.223,08	0,00	0,00	0,00	88.791.724,84	2.505.501,76	15.992.671,68
					248.048.250,65	6.450.793,51	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	82.417.852,12	0,00	0,00	0,00	83.209.258,42	791.406,30	8.642.805,40
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	109.654.233,06	0,00	0,00	0,00	108.648.930,46	-1.005.302,60	26.565.356,43
					191.858.188,88	-213.896,30	

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	16.016.000,00	0,00	0,00	0,00	114.000,00	16.800.000,00	898.000,00	4.994.000,00
						16.800.000,00	898.000,00	

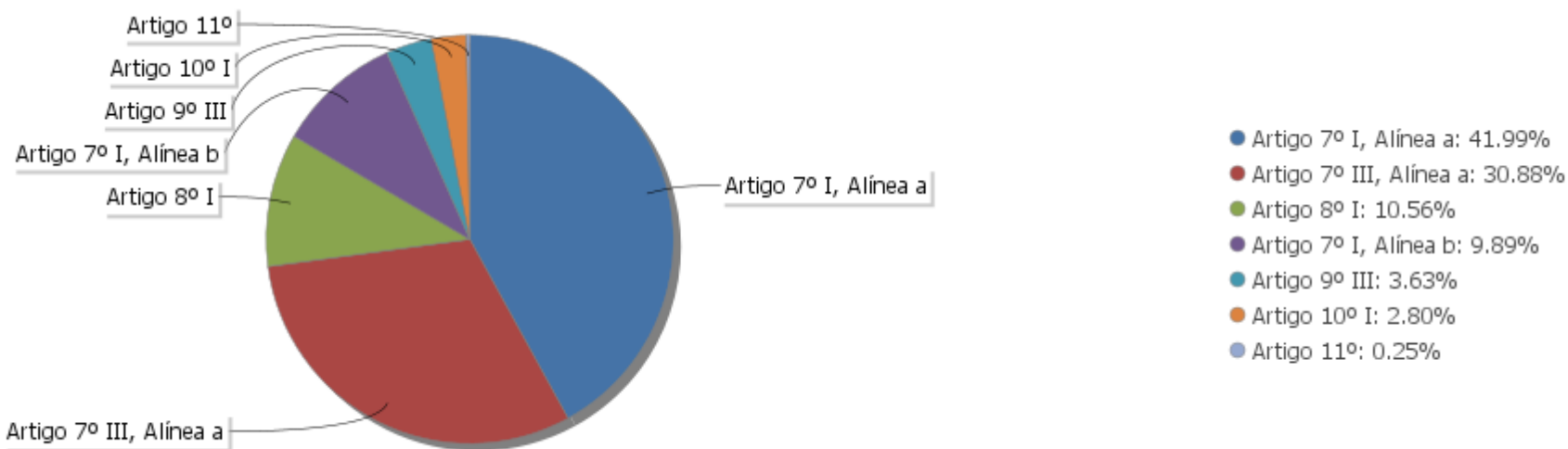
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

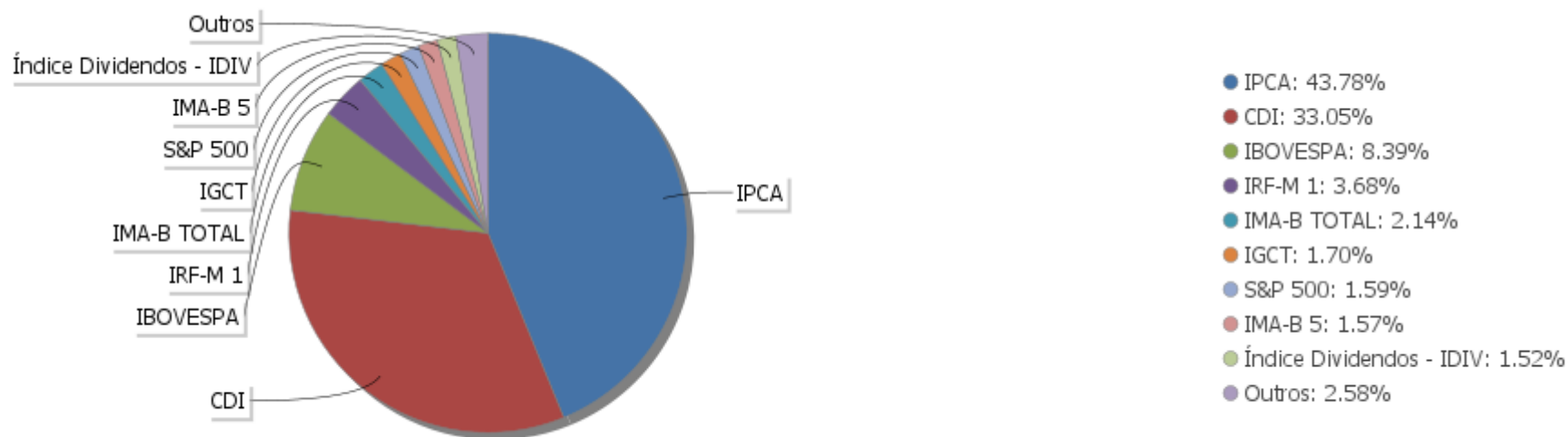
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	3.864.885.886,95	56,49	3.864.885.886,95	56,49	
de 31 dias a 365 dias	104.008.826,97	1,52	3.968.894.713,92	58,01	
acima de 365 dias	2.873.328.417,98	41,99	6.842.223.131,90	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

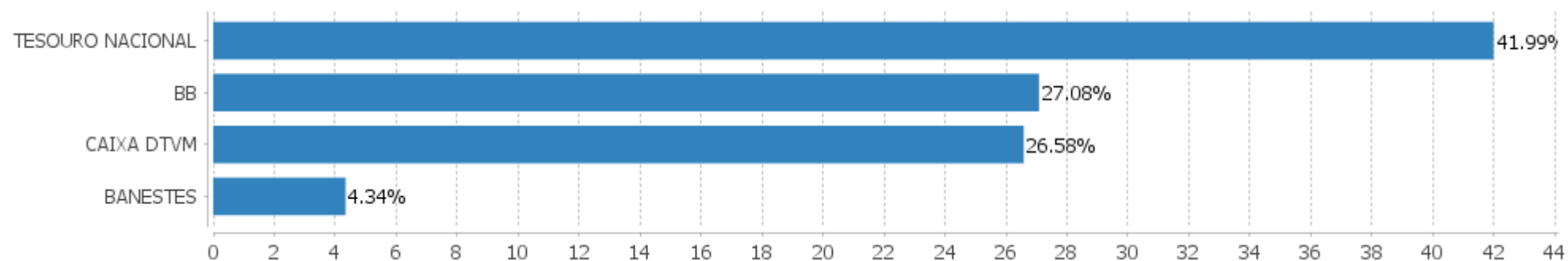


Alocação Por Estratégia



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	1,66	-0,12	1,08	0,97	1,62	1,77	1,14	0,32					8,75
IPCA + 5,00%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,66	0,33	0,53	0,68					6,64
p.p. indexador	0,70	-1,31	-0,08	0,01	0,96	1,45	0,61	-0,36					2,10
2022	0,30	0,01	1,89	-1,01	0,89	-1,15	1,69	0,77	-0,29	1,71	0,52	0,11	5,52
IPCA + 5,00%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,90	1,08	-0,28	0,08	0,12	0,98	0,80	1,05	11,05
p.p. indexador	-0,65	-1,38	-0,16	-2,45	-0,01	-2,23	1,97	0,69	-0,40	0,73	-0,28	-0,94	-5,53
2021	-0,45	-0,70	1,06	0,83	1,07	0,14	-0,44	-0,37	-0,81	-0,58	0,54	1,28	1,55
IPCA + 5,00%	0,64	1,21	1,38	0,70	1,24	0,94	1,39	1,30	1,57	1,64	1,34	1,18	15,54
p.p. indexador	-1,09	-1,91	-0,32	0,13	-0,17	-0,80	-1,83	-1,67	-2,38	-2,22	-0,80	0,10	-13,99
2020	0,42	-0,92	-5,48	1,82	1,70	1,96	2,00	-0,26	-0,83	-0,22	2,51	2,29	4,80
IPCA + 5,00%	0,64	0,60	0,50	0,08	0,01	0,67	0,81	0,65	1,05	1,27	1,28	1,78	9,72
p.p. indexador	-0,22	-1,52	-5,98	1,74	1,70	1,29	1,19	-0,91	-1,88	-1,49	1,23	0,51	-4,92
2019	1,69	0,49	0,60	0,91	1,51	1,74	1,03	0,23	1,43	1,33	-0,10	1,02	12,53
IPCA + 5,50%	0,79	0,86	1,16	1,02	0,60	0,41	0,68	0,58	0,41	0,59	0,94	1,60	10,07
p.p. indexador	0,90	-0,37	-0,55	-0,11	0,91	1,32	0,35	-0,35	1,03	0,74	-1,04	-0,58	2,46
2018	1,29	0,58	1,11	0,44	-1,02	-0,00	1,12	0,18	0,62	1,87	0,53	0,84	7,80
IPCA + 5,75%	0,78	0,72	0,56	0,69	0,87	1,73	0,82	0,42	0,90	0,94	0,23	0,60	9,66
p.p. indexador	0,51	-0,14	0,56	-0,25	-1,89	-1,73	0,30	-0,24	-0,29	0,92	0,29	0,25	-1,86
2017	1,30	1,89	1,24	0,45	0,35	0,70	2,20	1,13	1,07	0,43	0,19	0,82	12,40
IPCA + 6,00%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	0,41	1,15	0,45	-0,11	-0,47	0,45	1,48	0,40	0,44	-0,48	-0,55	-0,09	3,35
2016	1,92	1,40	1,66	1,65	0,93	1,19	1,45	1,23	1,28	0,82	0,38	1,47	16,48
IPCA + 6,00%	1,74	1,34	0,94	1,08	1,27	0,86	1,01	0,98	0,57	0,72	0,64	0,81	12,64
p.p. indexador	0,18	0,05	0,72	0,57	-0,34	0,33	0,44	0,26	0,71	0,10	-0,26	0,66	3,84
2015	1,51	0,80	0,65	1,24	1,39	0,73	1,09	-0,17	0,72	1,96	0,91	1,67	13,20
IPCA + 6,00%	1,73	1,64	1,84	1,18	1,21	1,28	1,16	0,71	1,03	1,31	1,48	1,47	17,26
p.p. indexador	-0,22	-0,85	-1,19	0,06	0,19	-0,55	-0,07	-0,88	-0,31	0,64	-0,56	0,19	-4,06
2014	-1,15	2,71	0,90	1,75	2,50	0,76	1,06	2,33	-0,76	1,18	0,88	0,18	12,97
IPCA + 6,00%	1,06	1,16	1,36	1,14	0,95	0,87	0,54	0,74	1,08	0,96	0,98	1,29	12,82
p.p. indexador	-2,21	1,56	-0,46	0,61	1,55	-0,11	0,52	1,59	-1,84	0,22	-0,09	-1,12	0,15
2013	0,58	-0,48	-0,65	1,00	-1,62	-1,42	0,81	-0,81	0,75	0,72	-1,14	0,87	-1,43
IPCA + 6,00%	1,37	1,02	0,94	1,06	0,86	0,72	0,56	0,75	0,84	1,11	1,01	1,41	12,29
p.p. indexador	-0,80	-1,50	-1,58	-0,07	-2,48	-2,15	0,25	-1,56	-0,08	-0,38	-2,14	-0,54	-13,72
2012	1,48	1,67	1,59	3,31	1,29	-0,23	2,31	1,35	1,11	2,72	0,68	1,57	20,51
IPCA + 6,00%	1,07	0,89	0,72	1,11	0,87	0,54	0,94	0,95	1,01	1,10	1,07	1,26	12,16
p.p. indexador	0,41	0,78	0,87	2,20	0,42	-0,77	1,37	0,41	0,10	1,61	-0,38	0,31	8,35
2011	0,11	0,67	1,40	0,53	1,40	0,17	0,81	4,20	1,08	1,30	1,60	0,51	14,62

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
IPCA + 6,00%	1,32	1,27	1,28	1,21	0,98	0,64	0,65	0,91	1,02	0,90	0,99	1,01	12,87
p.p. indexador	-1,21	-0,60	0,12	-0,68	0,42	-0,47	0,17	3,30	0,06	0,40	0,61	-0,51	1,76

Performance Sobre a Meta Atuarial

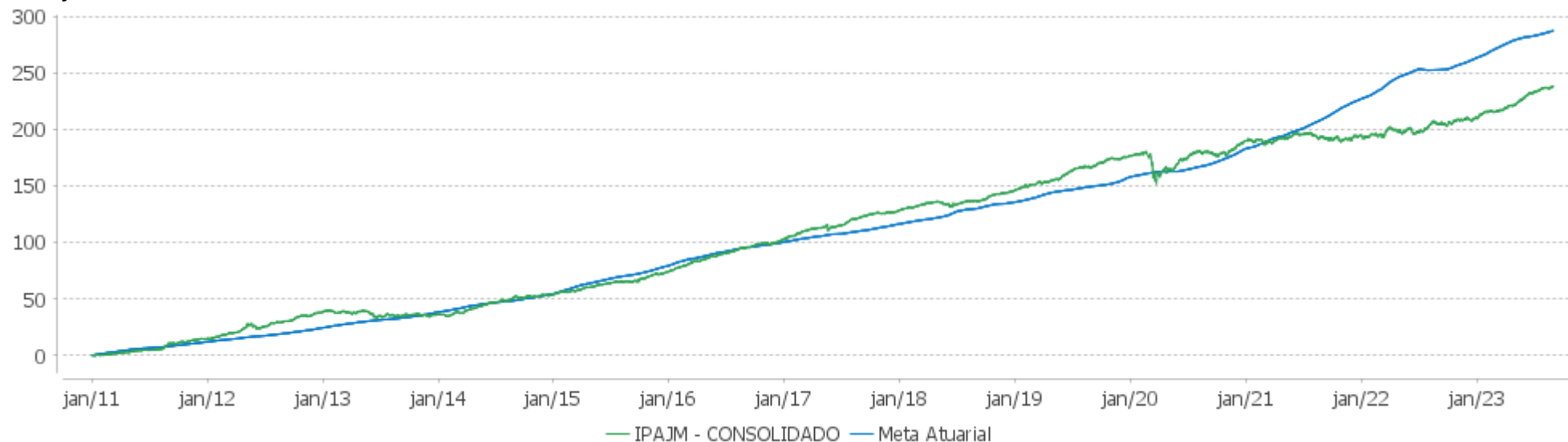
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	73	48,03	03 meses	3,26	1,54	1,72	1,73
Meses abaixo - Meta Atuarial	79	51,97	06 meses	7,10	4,39	2,71	1,85
			12 meses	10,99	9,82	1,18	2,46
			24 meses	15,23	25,37	-10,14	3,26
			36 meses	20,91	44,35	-23,45	3,38
			48 meses	26,67	55,52	-28,84	4,76
			60 meses	42,79	69,72	-26,93	4,35
			Desde 31/12/2010	237,75	318,61	-80,86	3,60

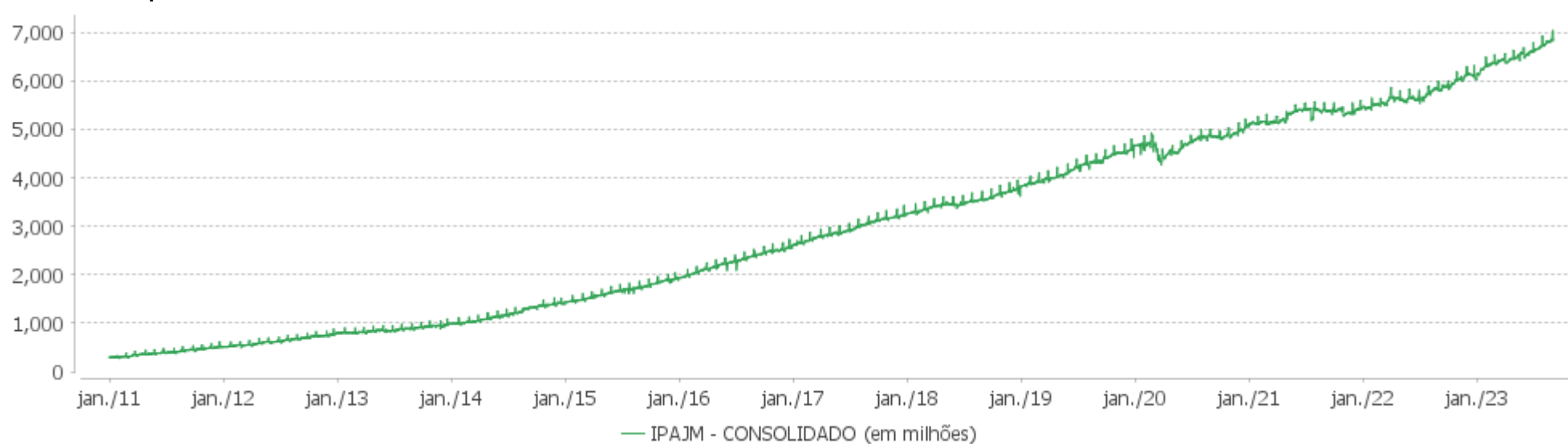
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,20	2011-08
Menor rentabilidade da Carteira	-5,48	2020-03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

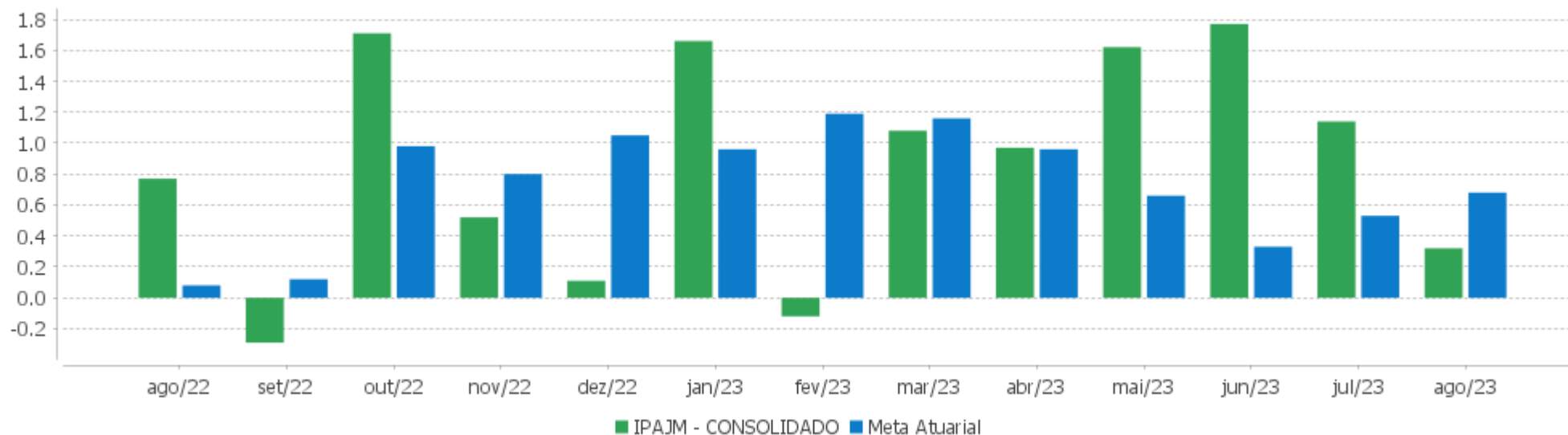


Patrimônio Líquido



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 (5,511000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,49	7,33 4,10	1,61 1,34	5,12 3,28	10,05 5,45	23,71 9,97	34,99 10,24
NTN-B 150840 (5,661100%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,50	7,43 4,20	1,65 1,38	5,19 3,36	10,21 5,60	23,98 10,24	35,30 10,55
NTN-B 150840 (5,621700%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,50	7,40 4,17	1,64 1,37	5,17 3,34	10,17 5,56	23,90 10,16	35,19 10,45
NTN-B 150850 (5,797000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,51	7,52 4,29	1,68 1,41	5,26 3,43	10,35 5,74	24,27 10,53	35,71 10,96
NTN-B 150850 (6,071500%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,53	7,71 4,48	1,75 1,48	5,40 3,57	10,64 6,03	24,78 11,04	36,34 11,59
NTN-B 150850 (5,931000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,61 4,38	1,72 1,45	5,33 3,50	10,49 5,88	24,52 10,78	36,02 11,27
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 150545 (5,576000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,49	7,37 4,14	1,63 1,36	5,15 3,32	10,12 5,51	23,83 10,10	35,15 10,40
NTN-B 150535 (5,681000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,50	7,44 4,21	1,65 1,38	5,20 3,37	10,23 5,62	24,00 10,26	35,28 10,53
NTN-B 150850 (5,887200%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,58 4,35	1,71 1,44	5,31 3,48	10,44 5,84	24,44 10,70	35,92 11,17
NTN-B 150840 (5,726000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,50	7,47 4,24	1,67 1,40	5,23 3,39	10,28 5,67	24,11 10,37	35,46 10,72
NTN-B 150545 (5,700000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,50	7,46 4,23	1,66 1,39	5,21 3,38	10,25 5,64	24,07 10,33	35,45 10,70
NTN-B 150545 (5,531000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,49	7,34 4,11	1,62 1,35	5,13 3,29	10,07 5,47	23,75 10,01	35,04 10,29
NTN-B 150850 (5,961600%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,63 4,40	1,72 1,45	5,34 3,51	10,52 5,91	24,57 10,84	36,09 11,34
NTN-B 150850 (5,841000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,51	7,55 4,32	1,69 1,42	5,28 3,45	10,40 5,79	24,35 10,61	35,81 11,06
NTN-B 150850 (5,385000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,47	7,24 4,01	1,58 1,31	5,05 3,22	9,92 5,31	26,83 13,09	38,40 13,65
NTN-B 150840 (5,642300%)	0,73	7,42	1,64	5,18	10,19	23,94	35,25

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.	0,50	4,19	1,37	3,35	5,58	10,20	10,50
NTN-B 150545 (5,475000%)	0,71	7,30	1,60	5,10	10,02	23,64	34,90
Var. IPCA p.p.	0,48	4,07	1,33	3,27	5,41	9,90	10,15
NTN-B 150545 (5,662500%)	0,73	7,43	1,65	5,19	10,21	24,00	35,36
Var. IPCA p.p.	0,50	4,20	1,38	3,36	5,60	10,26	10,61
NTN-B 150545 (5,945000%)	0,75	7,62	1,72	5,34	10,50	24,54	36,04
Var. IPCA p.p.	0,52	4,39	1,45	3,50	5,90	10,80	11,29
NTN-B 150535 (5,706000%)	0,73	7,46	1,66	5,22	10,26	24,05	35,35
Var. IPCA p.p.	0,50	4,23	1,39	3,38	5,65	10,31	10,60
NTN-B 150545 (5,761000%)	0,74	7,50	1,67	5,24	10,31	24,19	35,59
Var. IPCA p.p.	0,51	4,27	1,40	3,41	5,71	10,45	10,85
NTN-B 150545 (5,752000%)	0,74	7,49	1,67	5,24	10,30	24,17	35,57
Var. IPCA p.p.	0,51	4,26	1,40	3,41	5,70	10,43	10,83
NTN-B 150830	-0,26	12,43	2,68	10,64	14,00	21,27	23,34
Var. IPCA p.p.	-0,49	9,20	2,41	8,81	9,39	7,53	-1,41
NTN-B 150840 (5,616100%)	0,72	7,40	1,64	5,17	10,16	23,89	35,18
Var. IPCA p.p.	0,49	4,17	1,37	3,34	5,55	10,15	10,43
NTN-B 150535 (5,645000%)	0,73	7,42	1,64	5,18	10,19	23,92	35,18
Var. IPCA p.p.	0,50	4,19	1,37	3,35	5,58	10,18	10,43
NTN-B 150545 (5,790000%)	0,74	7,52	1,68	5,26	10,34	24,24	35,66
Var. IPCA p.p.	0,51	4,29	1,41	3,43	5,74	10,51	10,92
NTN-B 150850 (6,041000%)	0,76	7,69	1,74	5,38	10,60	24,72	36,27
Var. IPCA p.p.	0,53	4,46	1,47	3,55	6,00	10,99	11,52
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,86	6,67	2,51	5,03	10,17	18,19	19,25
% do CDI	75,62	75,27	75,59	75,39	75,05	72,35	67,51
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	-0,46	11,68	2,71	10,32	13,56	17,06	15,33
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,09	-0,16	-0,12	-0,11	-0,20	-3,01	-8,66
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-0,37	11,72	2,79	10,37	13,51	19,64	23,24
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,01	-0,12	-0,04	-0,06	-0,26	-0,43	-0,75
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1,11	9,08	3,49	6,81	13,71	24,41	25,42
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	0,03	0,04	-0,00	-0,03	0,38	-1,39
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,60	8,67	2,60	5,72	11,81	22,71	28,23
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,01	-0,08	-0,06	-0,04	-0,16	-0,31	-0,66
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1,12	8,82	3,37	6,66	13,40	23,37	25,63
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,23	-0,07	-0,16	-0,34	-0,66	-1,17
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,63	9,92	3,67	7,75	13,76	23,41	23,40

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.	0,40	6,69	3,40	5,92	9,15	9,67	-1,35
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
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
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
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
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	1,05 92,46	8,15 91,91	3,06 92,33	6,14 91,93	12,44 91,82	22,65 90,13	24,53 86,01
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
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	1,05 92,12	7,80 87,96	3,05 92,02	5,94 88,89	11,81 87,12	21,38 85,06	23,55 82,57
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
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	-7,25 0,17	7,96 -0,17	3,17 -0,09	16,79 -0,62	-2,31 -0,37	-24,48 -0,72	-13,39 -2,58
FIA BRASIL IBX-50 Var. IBOVESPA p.p.	-5,86 -0,77	2,74 -2,74	5,34 -1,50	5,93 -4,37	1,74 -3,94	-7,94 -5,38	10,86 -5,61
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
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,75 4,34	19,29 13,82	7,83 1,00	14,51 4,21	19,10 13,42	10,50 13,06	43,25 26,77
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
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-4,61 0,48	2,46 -3,02	7,09 0,25	4,48 -5,82	-6,72 -12,40	-23,66 -21,10	-8,84 -25,32
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-5,20	4,45	6,77	9,26	3,15	-6,61	11,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IGCT p.p.	-0,21	-1,29	-0,47	-1,26	-1,67	-2,46	-4,01
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	-4,18 0,91	5,62 0,15	6,22 -0,61	9,96 -0,34	3,77 -1,91	0,49 3,05	9,45 -7,03
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	2,90 -0,36	20,35 -1,08	5,57 -0,40	14,51 -0,51	14,97 -0,67	-4,08 -2,01	11,45 -4,96
BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NÍVEL I FI Var. IBOVESPA p.p.	2,09 7,17	34,32 28,85	9,12 2,28	27,21 16,91	17,54 11,87	-19,97 -17,41	-6,28 -22,76
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	2,83 7,91	13,17 7,69	6,63 -0,20	10,56 0,26	12,14 6,46	-4,03 -1,47	11,56 -4,91
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI % do CDI	0,96 84,28	8,48 95,61	3,20 96,34	6,57 98,40	12,84 94,76	23,65 94,10	27,68 97,08
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-0,92 -2,88	23,40 12,66	9,88 5,72	17,91 10,60	23,70 15,38	17,13 21,75	52,40 36,56
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII Var. IPCA p.p.	5,63 5,40	41,31 38,07	26,26 25,99	41,88 40,05	33,45 28,84	37,37 23,63	-30,43 -55,18
IPAJM - CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,32 -0,36	8,75 2,10	3,26 1,72	7,10 2,71	10,99 1,18	15,23 -10,14	20,91 -23,45
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
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 INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA			D+0	D+0		3,50
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 BOLSA AMERICANA FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		
BB AÇÕES DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,00
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NÍVEL I FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI			D+1 du	D+1 du		0,50
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	Não se aplica	Não se aplica				
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
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
FIA BRASIL IBX-50	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72

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 (5,640000%)	130.149.939,81	5,640000	132.648.037,14	5,404200	2.498.097,33
NTN-B 150535 (5,645000%)	130.097.583,39	5,645000	132.648.037,14	5,404200	2.550.453,75
NTN-B 150535 (5,681000%)	129.722.031,33	5,681000	132.648.037,14	5,404200	2.926.005,81
NTN-B 150535 (5,706000%)	43.153.995,34	5,706000	44.216.012,38	5,404200	1.062.017,04
NTN-B 150545 (5,475000%)	44.854.670,06	5,475000	44.207.493,09	5,597500	-647.176,97
NTN-B 150545 (5,511000%)	44.663.068,62	5,511000	44.207.493,09	5,597500	-455.575,53
NTN-B 150545 (5,531000%)	89.114.230,10	5,531000	88.414.986,18	5,597500	-699.243,92
NTN-B 150545 (5,576000%)	132.960.314,82	5,576000	132.622.479,27	5,597500	-337.835,55
NTN-B 150545 (5,662500%)	131.608.972,59	5,662500	132.622.479,27	5,597500	1.013.506,68
NTN-B 150545 (5,700000%)	131.029.329,63	5,700000	132.622.479,27	5,597500	1.593.149,64
NTN-B 150545 (5,752000%)	86.821.216,22	5,752000	88.414.986,18	5,597500	1.593.769,96
NTN-B 150545 (5,761000%)	86.729.737,18	5,761000	88.414.986,18	5,597500	1.685.249,00
NTN-B 150545 (5,790000%)	86.435.780,12	5,790000	88.414.986,18	5,597500	1.979.206,06
NTN-B 150545 (5,945000%)	84.889.155,78	5,945000	88.414.986,18	5,597500	3.525.830,40
NTN-B 150840 (5,616100%)	86.449.758,38	5,616100	87.577.696,58	5,492000	1.127.938,20
NTN-B 150840 (5,621700%)	86.399.304,30	5,621700	87.577.696,58	5,492000	1.178.392,28
NTN-B 150840 (5,642300%)	86.214.195,72	5,642300	87.577.696,58	5,492000	1.363.500,86
NTN-B 150840 (5,661100%)	129.068.568,27	5,661100	131.366.544,87	5,492000	2.297.976,60
NTN-B 150840 (5,726000%)	128.201.337,06	5,726000	131.366.544,87	5,492000	3.165.207,81
NTN-B 150850 (5,385000%)	45.090.480,85	5,385000	43.597.370,91	5,636800	-1.493.109,94
NTN-B 150850 (5,797000%)	128.053.200,57	5,797000	130.792.112,73	5,636800	2.738.912,16
NTN-B 150850 (5,841000%)	127.316.116,08	5,841000	130.792.112,73	5,636800	3.475.996,65
NTN-B 150850 (5,887200%)	84.366.170,28	5,887200	87.194.741,82	5,636800	2.828.571,54
NTN-B 150850 (5,931000%)	125.828.795,97	5,931000	130.792.112,73	5,636800	4.963.316,76
NTN-B 150850 (5,961600%)	125.329.176,51	5,961600	130.792.112,73	5,636800	5.462.936,22
NTN-B 150850 (6,041000%)	124.046.815,74	6,041000	130.792.112,73	5,636800	6.745.296,99
NTN-B 150850 (6,071500%)	123.559.603,02	6,071500	130.792.112,73	5,636800	7.232.509,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
5601	01/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	662,82	0,00	254,83749782	2,6009516090
5629	01/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	919,20	0,00	353,40911258	2,6009516090
5588	01/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	280.617,29	29.648,75855692	9,4647231000
5602	01/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	237.545,36	0,00	25.097,97249113	9,4647231000
5630	01/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	202.752,80	0,00	21.421,94735734	9,4647231000
5603	02/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	9.257,21	0,00	3.557,47075773	2,6021886420
5631	02/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.010,61	0,00	1.156,95301694	2,6021886420
5590	02/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	27.011,87	0,00	2.852,85934707	9,4683497200
5589	02/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	99.851,59	10.545,82825443	9,4683497200
5605	02/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	6.704,54	0,00	708,10016510	9,4683497200
5604	02/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	19.428.247,67	2.051.914,87899541	9,4683497200
5633	02/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	43.827,86	0,00	4.628,88056484	9,4683497200
5632	02/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	385.937,72	40.760,82225657	9,4683497200
5634	03/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.476,28	0,00	567,04860106	2,6034452730
5591	03/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	28.536,00	3.012,65291102	9,4720503300
5607	03/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	5.425.545,04	0,00	572.795,20810992	9,4720503300
5606	03/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	45.616,65	4.815,92141202	9,4720503300
5636	03/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	11.859.358,33	0,00	1.252.037,08984093	9,4720503300
5635	03/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	4.189,31	442,28122255	9,4720503300
5608	04/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.454,93	0,00	558,58843184	2,6046547280
5637	04/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	15.110,29	0,00	5.801,26411288	2,6046547280
5610	04/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	4.579.621,08	0,00	483.306,60792504	9,4756020400
5609	04/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	139.296,30	14.700,52239551	9,4756020400
5638	04/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	11.579.616,71	0,00	1.222.045,48704327	9,4756020400
5611	07/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	32.733,35	0,00	12.561,45586178	2,6058563880
5639	07/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.025,70	0,00	1.161,11540679	2,6058563880
5592	07/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	8.182,59	863,22551602	9,4790872700
5612	07/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	27.475,32	0,00	2.898,51957445	9,4790872700

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
5640	07/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	77.608,32	0,00	8.187,31991693	9,4790872700
5613	08/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	841,70	0,00	322,85264555	2,6070717140
5641	08/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.398,48	0,00	536,41792533	2,6070717140
5593	08/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	8.121,22	856,43262953	9,4826139500
5614	08/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	49.574.791,46	0,00	5.227.966,85823111	9,4826139500
5642	08/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	625.974,02	0,00	66.012,81284893	9,4826139500
5615	09/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.085,68	0,00	416,24698923	2,6082591060
5643	09/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.703,13	0,00	1.419,77075494	2,6082591060
5594	09/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	149.059,88	15.713,44091775	9,4861387000
5617	09/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	37.834,47	0,00	3.988,39519393	9,4861387000
5616	09/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	257,28	27,12167808	9,4861387000
5647	10/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	114.000,00	0,00	49.543,43981841	2,3010110000
5644	10/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.765,80	0,00	1.826,37545944	2,6094305940
5596	10/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	89,20	0,00	9,39979269	9,4895709900
5595	10/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	20.252,30	2.134,16391756	9,4895709900
5619	10/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	88.014,33	0,00	9.274,84815623	9,4895709900
5618	10/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	1.491.760,25	157.199,96737176	9,4895709900
5646	10/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	14.485,96	0,00	1.526,51368700	9,4895709900
5645	10/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	76.306,99	8.041,14222660	9,4895709900
5651	11/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	114.000,00	49.521,05752653	2,3020510000
5652	11/08/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	114.000,00	0,00	23.914,80790221	4,7669210000
5620	11/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.523,64	0,00	1.349,74094004	2,6106046690
5648	11/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	14.511,96	0,00	5.558,85009030	2,6106046690
5597	11/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	61.088,35	6.435,03134643	9,4930928400
5598	11/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	6.412.579,87	0,00	675.499,54246524	9,4930928400
5622	11/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	3.879,35	0,00	408,64974834	9,4930928400
5621	11/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	4.359.062,98	459.182,59238261	9,4930928400
5650	11/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	30.551,20	0,00	3.218,25568494	9,4930928400
5649	11/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	2.053.516,89	216.316,95008262	9,4930928400
5623	14/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.357,24	0,00	902,54350689	2,6117743710

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
5653	14/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.243,24	0,00	476,01355378	2,6117743710
5599	14/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	45.068,41	4.745,69529428	9,4966927300
5624	14/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	36.349,34	0,00	3.827,57882491	9,4966927300
5654	14/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	13.943,24	0,00	1.468,22061073	9,4966927300
5656	15/08/2023	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	30.000.000,00	13.767.343,32470740	2,1790696500
5660	15/08/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	50.000.000,00	0,00	10.477.938,59550777	4,7719310000
5661	15/08/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	43.707.204,71	0,00	9.159.228,14265336	4,7719310000
5626	15/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	45.000.000,00	0,00	15.343.477,35014746	2,9328423390
5658	15/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	30.000.000,00	0,00	10.228.984,90009831	2,9328423390
5625	15/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.030,28	0,00	777,00942917	2,6129412640
5659	15/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	18.676,34	0,00	7.147,63100775	2,6129412640
5600	15/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	153.866,17	16.196,14934317	9,5001698700
5628	15/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	1.771.896,54	0,00	186.512,09023066	9,5001698700
5627	15/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	45.000.000,00	4.736.757,40705466	9,5001698700
5655	15/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	50.015.713,62	5.264.717,82130355	9,5001698700
5657	15/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	1,46	0,00	0,15368146	9,5001698700
5677	16/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	7.758,86	0,00	2.968,05548905	2,6141222860
5684	16/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	6.960,66	0,00	2.662,71399669	2,6141222860
5662	16/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	19.548,50	2.056,96367709	9,5035708300
5670	16/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	7.415,23	780,25724569	9,5035708300
5678	17/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.421,35	0,00	925,85788874	2,6152501690
5663	17/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	56.078,14	5.898,58339433	9,5070521600
5680	18/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	144.251,15	49.113,53235638	2,9370958080
5665	18/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	138,62	0,00	14,57541308	9,5105366300
5664	18/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	20.868,86	2.194,28837845	9,5105366300
5672	18/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	407.309,02	0,00	42.827,13329921	9,5105366300
5671	18/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	2.028.542,82	213.294,25445891	9,5105366300
5682	18/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	2.056.340,52	0,00	216.217,08637486	9,5105366300
5681	18/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	17.121,90	1.800,30850688	9,5105366300
5685	21/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	741,02	0,00	283,10004498	2,6175198950

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
5666	21/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	5.100,23	536,06841351	9,5141401200
5673	21/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	22.305,29	2.344,43572605	9,5141401200
5674	21/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	18.397.374,49	0,00	1.933.687,57007543	9,5141401200
5686	22/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.932,42	0,00	737,92320805	2,6187277740
5667	22/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	561,40	58,98532682	9,5176212500
5675	22/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	6.077.029,61	0,00	638.502,98833860	9,5176212500
5687	23/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.639,07	0,00	625,62638047	2,6198863270
5669	23/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	1.340,95	0,00	140,83947027	9,5211235700
5668	23/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	3.479.834,64	365.485,71336313	9,5211235700
5676	23/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	1.058,56	111,18015560	9,5211235700
5683	23/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	1.058,56	0,00	111,18015560	9,5211235700
5692	24/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	624.716,14	212.283,33353495	2,9428412000
5702	24/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	13.159,24	5.020,65357111	2,6210213100
5689	24/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	7.879,37	0,00	827,25737614	9,5246899300
5688	24/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	2.222,92	233,38502527	9,5246899300
5695	24/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	9.095.524,94	0,00	954.941,84134559	9,5246899300
5694	24/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	26.888.999,15	2.823.083,93738966	9,5246899300
5699	24/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	5.654.286,43	0,00	593.645,19701483	9,5246899300
5698	24/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	247.039,34	25.936,73303967	9,5246899300
5693	25/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	5.899,83	0,00	2.249,94535364	2,6222103530
5703	25/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.356,01	0,00	898,48245672	2,6222103530
5691	25/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	7.328,75	0,00	769,17150975	9,5281090200
5690	25/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	3.357,46	352,37422168	9,5281090200
5697	25/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	13.104,24	0,00	1.375,32431383	9,5281090200
5696	25/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	3.793.662,69	398.154,83660366	9,5281090200
5701	25/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	19.795,44	0,00	2.077,58328105	9,5281090200
5700	25/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	48.419,63	5.081,76700102	9,5281090200
5704	28/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	554.391,45	58.162,75336490	9,5317263700
5707	28/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	190.034.576,48	0,00	19.937.057,47555991	9,5317263700
5709	28/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	425.234,46	0,00	44.612,53329076	9,5317263700

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
5708	29/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.722,37	0,00	656,24126155	2,6245987580
5710	29/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.476,28	0,00	562,47835807	2,6245987580
5706	29/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	15.345,38	0,00	1.609,32406668	9,5352951700
5705	29/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	7.027,87	737,03748806	9,5352951700
5711	29/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	2.267,28	0,00	237,77764186	9,5352951700
5715	30/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.465.399,02	836.020,45512346	2,9489697350
5716	30/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	9.486,24	0,00	3.612,70414230	2,6258004050
5717	30/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	80.454,99	30.640,17731386	2,6258004050
5712	30/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	1.029.462,98	107.923,31246532	9,5388378700
5714	30/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	236.377,44	0,00	24.780,52811270	9,5388378700
5713	30/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	175.648.667,43	18.414.053,13978777	9,5388378700
5718	30/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	5.806.438,30	608.715,48286416	9,5388378700
5720	31/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	311,45	0,00	118,55248729	2,6271064160
5723	31/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	883,50	0,00	336,30156533	2,6271064160
5719	31/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	182,34	0,00	19,10834788	9,5424262300
5721	31/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	117.857,42	0,00	12.350,88615403	9,5424262300
5722	31/08/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	856.672,53	0,00	89.775,12734725	9,5424262300
Total			495.205.063,59	376.984.654,79		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rendimentos Realizados

Artigo	Ativo	Quantidade	Valor Aplicação	Valor Resgate	Rendimento
Artigo 7º I, Alínea b	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	36.082.024,604967	342.651.298,23	343.542.674,24	891.376,01
Artigo 7º III, Alínea a	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	13.767.343,324707	26.285.414,89	30.000.000,00	3.714.585,11
Artigo 7º III, Alínea a	BB PREV RF FLUXO FIC	35.660,830885	90.717,12	93.614,23	2.897,11
Artigo 7º III, Alínea a	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.097.417,321015	2.754.257,32	3.234.366,31	480.108,99
Artigo 7º III, Alínea a	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	49.521,057527	113.662,34	114.000,00	337,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 57.978.373,75

Value-At-Risk: 0,85%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
IPAJM - CONSOLIDADO		0,85		0,85			6.842.223.131,90	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,13%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150830		1,77	0,01	1,77			121.174.870,24	1,77
NTN-B 150535 (5,640000%)		0,10	0,00	0,11			130.149.939,81	1,90
NTN-B 150535 (5,645000%)		0,10	0,00	0,11			130.097.583,39	1,90
NTN-B 150535 (5,681000%)		0,10	0,00	0,11			129.722.031,33	1,90
NTN-B 150535 (5,706000%)		0,10	0,00	0,11			43.153.995,34	0,63
NTN-B 150545 (5,475000%)		0,10	0,00	0,11			44.854.670,06	0,66
NTN-B 150545 (5,511000%)		0,10	0,00	0,11			44.663.068,62	0,65
NTN-B 150545 (5,531000%)		0,10	0,00	0,11			89.114.230,10	1,30
NTN-B 150545 (5,576000%)		0,10	0,00	0,11			132.960.314,82	1,94
NTN-B 150545 (5,662500%)		0,10	0,00	0,11			131.608.972,59	1,92
NTN-B 150545 (5,700000%)		0,10	0,00	0,11			131.029.329,63	1,92
NTN-B 150545 (5,752000%)		0,10	0,00	0,11			86.821.216,22	1,27
NTN-B 150545 (5,761000%)		0,10	0,00	0,11			86.729.737,18	1,27
NTN-B 150545 (5,790000%)		0,10	0,00	0,11			86.435.780,12	1,26
NTN-B 150545 (5,945000%)		0,10	0,00	0,11			84.889.155,78	1,24
NTN-B 150840 (5,616100%)		0,10	0,00	0,11			86.449.758,38	1,26
NTN-B 150840 (5,621700%)		0,10	0,00	0,11			86.399.304,30	1,26
NTN-B 150840 (5,642300%)		0,10	0,00	0,11			86.214.195,72	1,26
NTN-B 150840 (5,661100%)		0,10	0,00	0,11			129.068.568,27	1,89
NTN-B 150840 (5,726000%)		0,10	0,00	0,11			128.201.337,06	1,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150850 (5,385000%)		0,10	0,00	0,11			45.090.480,85	0,66
NTN-B 150850 (5,797000%)		0,10	0,00	0,11			128.053.200,57	1,87
NTN-B 150850 (5,841000%)		0,10	0,00	0,11			127.316.116,08	1,86
NTN-B 150850 (5,887200%)		0,10	0,00	0,11			84.366.170,28	1,23
NTN-B 150850 (5,931000%)		0,10	0,00	0,11			125.828.795,97	1,84
NTN-B 150850 (5,961600%)		0,10	0,00	0,11			125.329.176,51	1,83
NTN-B 150850 (6,041000%)		0,10	0,00	0,11			124.046.815,74	1,81
NTN-B 150850 (6,071500%)		0,10	0,00	0,11			123.559.603,02	1,81
Sub-total	0,23	0,13	0,02		-1,92	0,69	2.873.328.417,98	41,99

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA		0,01	0,00	0,01			66.202.806,93	0,97
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B		2,00	0,00	0,16			5.588.689,51	0,08
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,13	0,00	0,01			199.467.913,54	2,92
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,86	0,01	0,06			71.200.819,33	1,04
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,86	0,01	0,05			69.219.720,27	1,01
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,14	0,00	0,01			50.823.240,40	0,74
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,70	0,00	0,03			107.189.151,07	1,57
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1		0,18	0,00	0,06			1.770.662,86	0,03
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,83	0,00	0,85			105.336.920,17	1,54
Sub-total	1,27	0,63	0,03		-0,43	0,60	676.799.924,08	9,89

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,02	-0,00	0,02			999.266.881,70	14,60
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF		2,04	0,00	0,30			371.762,38	0,01
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			902.252.085,71	13,19
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	0,00	0,01			470.571,64	0,01
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,01	-0,00	0,01			16.058,59	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI		0,03	-0,00	0,03			200.011.174,35	2,92
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI		0,06	0,00	0,06			1.431.831,86	0,02
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF		0,22	0,00	0,22			8.811.514,79	0,13
Sub-total	0,04	0,01	0,00		1,64	1,20	2.112.631.881,02	30,88

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,61%

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	0,13	0,85			129.510.436,53	1,89
BB AÇÕES DIVIDENDOS		7,10	0,04	1,64			41.329.321,15	0,60
FIA BRASIL IBX-50		7,40	0,09	0,82			94.014.980,74	1,37
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		7,23	0,11	0,26			115.987.779,96	1,70
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		6,41	0,07	1,48			90.984.108,95	1,33
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		9,96	0,11	0,41			87.731.273,92	1,28
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL		7,54	0,01	4,64			13.024.718,02	0,19
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA		5,19	0,04	8,13			107.615.612,64	1,57
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI		8,25	0,05	1,76			42.558.237,38	0,62
Sub-total	11,95	6,61	0,66		-0,47	-4,47	722.756.469,29	10,56

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,36%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		7,04	0,02	0,87			88.791.724,84	1,30
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I		6,02	0,02	10,30			97.743.561,19	1,43
BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NÍVEL I FI		7,63	0,04	8,93			61.512.964,62	0,90
Sub-total	16,05	6,36	0,09		0,10	2,67	248.048.250,65	3,63

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,14%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI		0,22	0,00	0,22			83.209.258,42	1,22
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		5,53	0,06	5,30			108.648.930,46	1,59
Sub-total	6,80	3,14	0,06		-0,18	-0,11	191.858.188,88	2,80

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 12,65%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII		12,65	-0,00	12,65			16.800.000,00	0,25
Sub-total	11,26	12,65	-0,00		0,40	5,63	16.800.000,00	0,25