



LDB
EMPRESAS

CAMPO MOURÃO
JUNHO 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 30.06.2023.

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 85,73%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,750000%)	0,68	0,02	0,46	6,20	565.089,73	0,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,680000%)	0,57	0,02	0,45	6,17	10.382.631,30	4,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,760000%)	0,57	0,02	0,46	6,21	41.625.633,97	18,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,790000%)	0,58	0,02	0,46	6,22	10.399.243,03	4,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,790000%)	1,16	0,02	0,46	6,22	9.812.822,15	4,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,820000%)	1,16	0,02	0,46	6,24	516.242,72	0,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,820000%)	1,16	0,02	0,46	6,24	5.181.734,09	2,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,930000%)	1,18	0,02	0,47	6,29	6.209.191,94	2,74
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,61	0,02	0,46	6,22	84.692.588,93	37,43

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 IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,38	0,07	1,16	6,49	1.224.871,78	0,54	6.781.214.720,11	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,37	0,07	1,16	6,59	31.030.058,02	13,71	7.342.301.496,88	0,42
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,39	0,22	1,03	7,00	11.763.634,47	5,20	8.254.253.931,25	0,14
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,60	0,17	1,02	6,56	3.596.554,33	1,59	6.483.473.627,64	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,70	0,17	1,04	6,60	5.391.288,84	2,38	5.947.143.642,03	0,09
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,41	0,23	1,03	6,99	17.052.451,45	7,54	5.638.426.224,35	0,30

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,91	0,44	2,22	10,28	5.364.824,05	2,37	2.099.537.000,43	0,26
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,87	0,17	1,18	6,96	75.423.682,94	33,33		

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				
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	5,31	0,74	1,90	1,90	10.149.735,42	4,49	746.954.336,58	1,36
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	0,99	0,99	5.048.820,76	2,23	14.982.085.274,92	0,03
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	1,00	5,98	36.213,29	0,02	4.278.810.513,26	0,00
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	3,09	0,42	2,01	9,45	17.269.003,71	7,63	725.460.751,19	2,38
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			3,10	0,46	1,93	9,36	32.503.773,18	14,36		

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GRAPHEN	CM CAPITAL	GBX PRIME I FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS	5,22	-0,05	-0,05	0,41	1.393.940,95	0,62	155.844.626,83	0,89
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			5,22	-0,05	-0,05	0,41	1.393.940,95	0,62		
Renda Fixa			1,10	0,15	0,96	6,83	194.013.986,00	85,73		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

2,03%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	19,56	0,89	9,77	13,72	4.588.957,53	2,03	611.430.231,25	0,75
Sub-total Artigo 8º I			19,56	0,89	9,77	13,72	4.588.957,53	2,03		
Renda Variável			19,61	0,89	9,77	13,72	4.588.957,53	2,03		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,07%

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	23,77	0,25	0,47	14,53	9.214.559,76	4,07	2.036.420.590,68	0,45
Sub-total Artigo 9º III			23,77	0,25	0,47	14,53	9.214.559,76	4,07		
Investimentos no Exterior			23,77	0,25	0,47	14,53	9.214.559,76	4,07		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,76%

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	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	19,46	1,31	7,00	20,17	13.180.734,34	5,82	1.596.861.875,61	0,83
Sub-total Artigo 10º I			19,46	1,31	7,00	20,17	13.180.734,34	5,82		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
A5	PLANNER	W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	7,23	-0,15	-0,15	-0,87	2.867.847,13	1,27	123.688.251,61	2,32
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	68,50	-0,05	-0,05	103,75	1.501.789,86	0,66	315.113.130,83	0,48
Sub-total Artigo 10º II			19,04	-0,11	-0,11	20,38	4.369.636,99	1,93		

Investimentos Estruturados			15,62	0,95	5,14	20,22	17.550.371,33	7,76		
-----------------------------------	--	--	--------------	-------------	-------------	--------------	----------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,41%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PLANNER	PLANNER	CARE11	36,13	-2,37	7,29	-26,95	930.320,72	0,41	298.211.981,52	0,31
Sub-total Artigo 11º			36,13	-2,37	7,29	-26,95	930.320,72	0,41		
Fundos Imobiliários			36,13	-2,37	7,29	-26,95	930.320,72	0,41		
Total			2,14	0,22	1,45	8,01	226.298.195,34	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	84.692.588,93	37,43	0,00	55,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	75.423.682,94	33,33	0,00	9,51	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	32.503.773,18	14,36	0,00	14,23	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.393.940,95	0,62	0,00	0,77	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	194.013.986,00	85,73					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	4.588.957,53	2,03	0,00	0,49	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	4.588.957,53	2,03					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	9.214.559,76	4,07	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	9.214.559,76	4,07					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	13.180.734,34	5,82	0,00	7,92	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	4.369.636,99	1,93	0,00	2,08	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	17.550.371,33	7,76					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	930.320,72	0,41	0,00	0,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	930.320,72	0,41					5,00
Total		226.298.195,34	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	0,46 42,67	6,22 95,66	2,48 78,72	6,22 95,66	9,48 70,03	385.655,62	5.055.354,71
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,18 109,77	6,96 107,11	2,93 93,17	6,96 107,11	10,90 80,51	903.901,19	5.525.365,98
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,93 179,78	9,36 144,04	5,59 177,77	9,36 144,04	14,27 105,39	538.927,40	1.690.150,23
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,05 -4,43	0,41 6,23	0,27 8,45	0,41 6,23	-3,72 -27,48	-661,58	6.880,23
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	9,77 0,77	13,72 6,11	19,95 4,04	13,72 6,11	20,73 0,89	408.597,43	553.608,11
Artigo 9º III % do CDI	0,47 43,67	14,53 223,59	5,60 178,11	14,53 223,59	13,40 98,98	42.931,54	1.169.015,77
Artigo 10º I % do CDI	7,00 653,40	20,17 310,40	10,43 331,51	20,17 310,40	28,33 209,21	862.794,00	2.212.482,07
Artigo 10º II % do CDI	-0,11 -10,42	20,38 313,56	-0,39 -12,50	20,38 313,56	13,35 98,57	-4.887,37	739.676,73
Artigo 11º % do CDI	7,29 680,20	-26,95 -414,71	-8,44 -268,44	-26,95 -414,71	-50,48 -372,75	63.225,68	-343.225,12
CAMPO MOURÃO (Total)						3.200.483,91	16.609.308,71

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 (5,750000%)	562.527,07	0,00	0,00	0,00	565.089,73	2.562,66	33.819,80
NTN-B 150545 (5,680000%)	10.336.116,92	0,00	0,00	0,00	10.382.631,30	46.514,38	617.868,65
NTN-B 150555 (5,760000%)	41.436.537,29	0,00	0,00	0,00	41.625.633,97	189.096,68	2.492.277,19
NTN-B 150555 (5,790000%)	10.351.756,74	0,00	0,00	0,00	10.399.243,03	47.486,29	624.096,97
NTN-B 150840 (5,790000%)	9.768.013,66	0,00	0,00	0,00	9.812.822,15	44.808,49	579.497,50
NTN-B 150840 (5,820000%)	513.873,25	0,00	0,00	0,00	516.242,72	2.369,47	30.555,83
NTN-B 150850 (5,820000%)	5.157.950,75	0,00	0,00	0,00	5.181.734,09	23.783,34	306.688,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150850 (5,930000%)	6.180.157,63	0,00	0,00	0,00	6.209.191,94	29.034,31	370.550,56
					84.692.588,93	385.655,62	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IDKA2	13.521.393,17	0,00	-10.000.000,00	0,00	3.596.554,33	75.161,16	778.451,03
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	16.878.449,17	0,00	0,00	0,00	17.052.451,45	174.002,28	1.114.024,80
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	6.205.823,37	0,00	-5.000.000,00	0,00	1.224.871,78	19.048,41	329.916,11
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.335.624,06	0,00	0,00	0,00	5.391.288,84	55.664,78	334.687,95
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8.750.875,63	5.759.243,55	-2.852.428,83	0,00	11.763.634,47	105.944,12	620.770,27
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.494.395,40	3.532.834,04	-4.354.529,34	0,00	31.030.058,02	357.357,92	1.847.485,93
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	5.248.101,53	0,00	0,00	0,00	5.364.824,05	116.722,52	500.029,89
					75.423.682,94	903.901,19	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	35.855,71	0,00	0,00	0,00	36.213,29	357,58	2.043,22
BB PREV RF IMA-B	0,00	10.000.000,00	0,00	0,00	10.149.735,42	149.735,42	149.735,42
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000.000,00	0,00	0,00	5.048.820,76	48.820,76	48.820,76
BRANCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	16.928.990,07	0,00	0,00	0,00	17.269.003,71	340.013,64	1.489.550,83
					32.503.773,18	538.927,40	

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
GBX PRIME I FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS	1.394.602,53	0,00	0,00	0,00	1.393.940,95	-661,58	6.880,23
					1.393.940,95	-661,58	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	4.180.360,10	0,00	0,00	0,00	4.588.957,53	408.597,43	553.608,11
					4.588.957,53	408.597,43	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	9.171.628,22	0,00	0,00	0,00	9.214.559,76	42.931,54	1.169.015,77
					9.214.559,76	42.931,54	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12.317.940,34	0,00	0,00	0,00	13.180.734,34	862.794,00	2.212.482,07
					13.180.734,34	862.794,00	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	1.502.475,90	0,00	0,00	0,00	1.501.789,86	-686,04	764.723,10
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	2.872.048,46	0,00	0,00	0,00	2.867.847,13	-4.201,33	-25.046,37
					4.369.636,99	-4.887,37	

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CARE11	867.095,04	0,00	0,00	0,00	0,00	930.320,72	63.225,68	-343.225,12
						930.320,72	63.225,68	

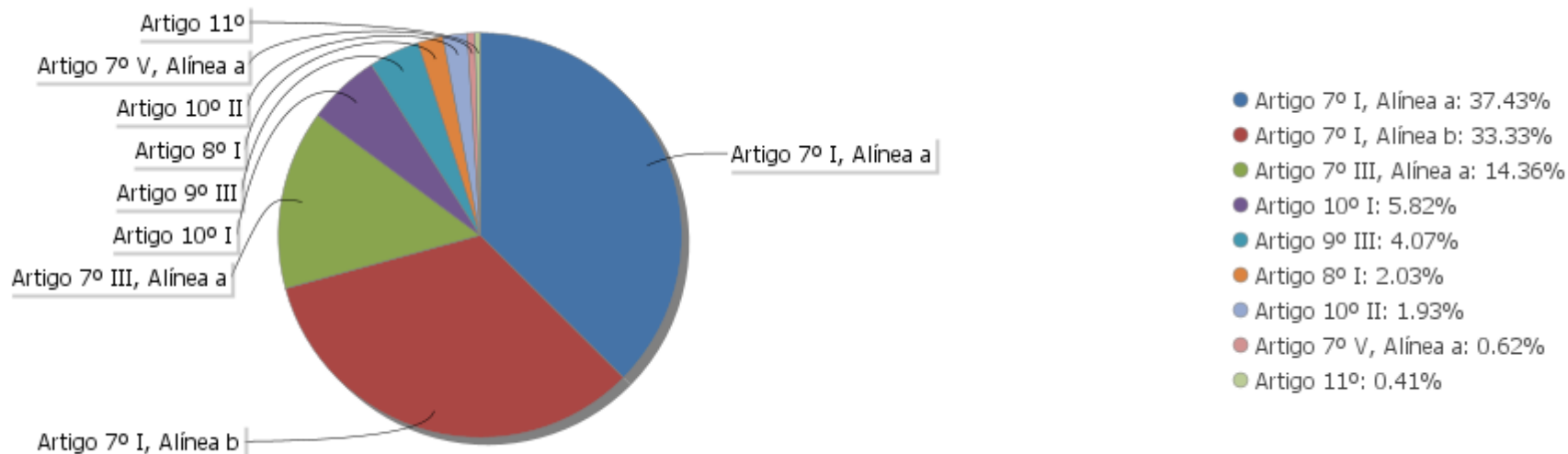
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

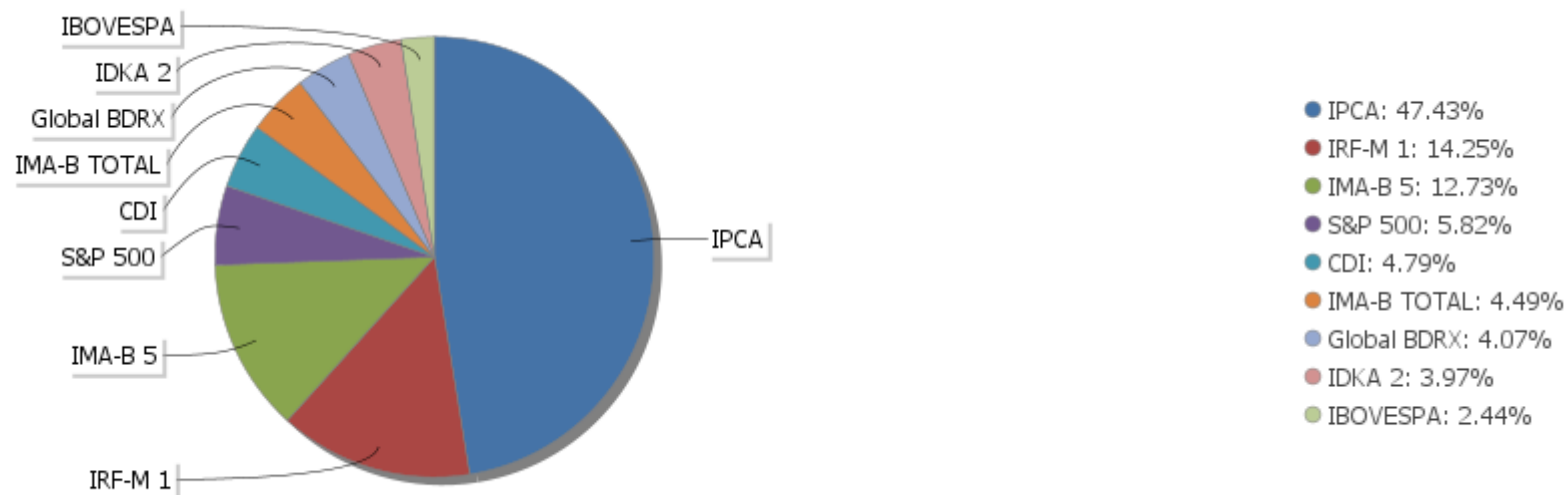
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	138.709.875,60	61,30	138.709.875,60	61,30	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	138.709.875,60	61,30	
acima de 365 dias	87.588.319,74	38,70	226.298.195,34	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

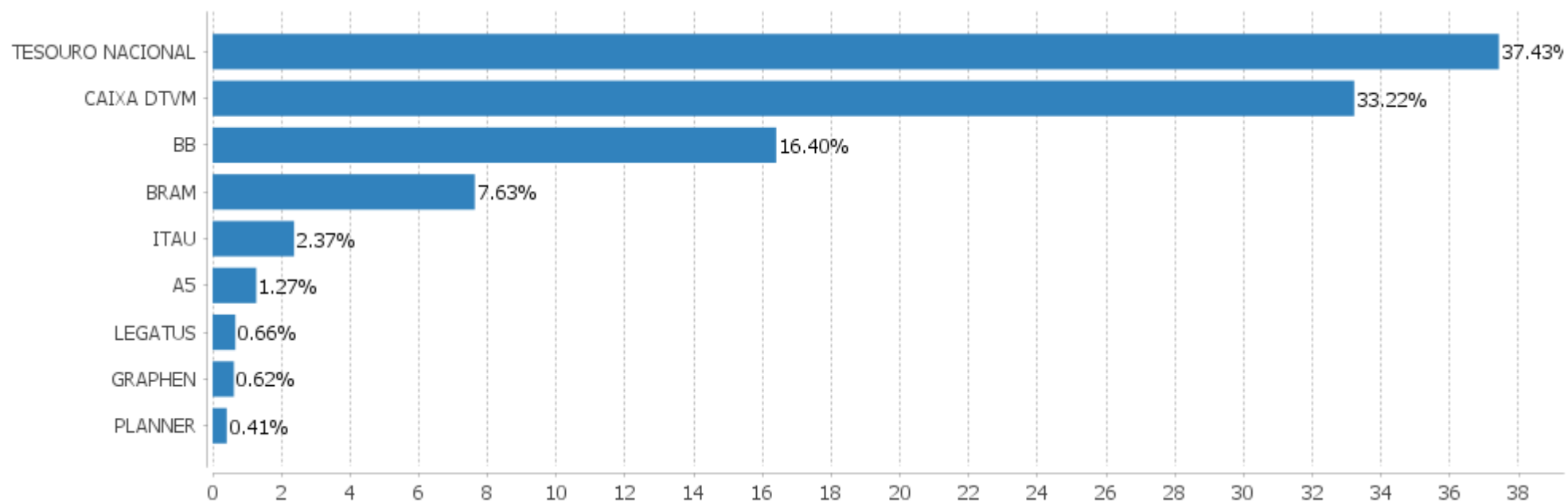


Alocação Por Estratégia



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	1,86	0,69	1,57	0,86	1,33	1,45							8,01
IPCA + 5,13%	0,97	1,20	1,17	0,97	0,67	0,34							5,43
p.p. indexador	0,89	-0,52	0,40	-0,11	0,66	1,11							2,57
2022	-1,33	-0,06	2,37	-1,00	0,82	-1,40	1,40	-0,18	-0,61	1,46	0,74	0,14	2,31
IPCA + 4,95%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,89	1,08	-0,28	0,08	0,11	0,98	0,80	1,05	11,00
p.p. indexador	-2,27	-1,43	0,32	-2,43	-0,07	-2,47	1,68	-0,26	-0,73	0,48	-0,05	-0,90	-8,69
2021	-0,51	-0,51	1,29	2,00	1,14	0,28	-0,25	-0,09	-0,91	0,03	-0,18	1,93	4,23
IPCA + 5,45%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,98	1,43	1,34	1,61	1,68	1,38	1,22	16,03
p.p. indexador	-1,19	-1,75	-0,13	1,27	-0,14	-0,70	-1,68	-1,43	-2,52	-1,65	-1,56	0,71	-11,81
2020	0,13	-0,88	-5,49	1,11	1,81	1,72	2,31	-0,61	-1,04	0,13	2,62	2,64	4,25
IPCA + 5,88%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,64
p.p. indexador	-0,58	-1,54	-6,06	0,97	1,74	0,98	1,43	-1,33	-2,16	-1,21	1,27	0,79	-6,39

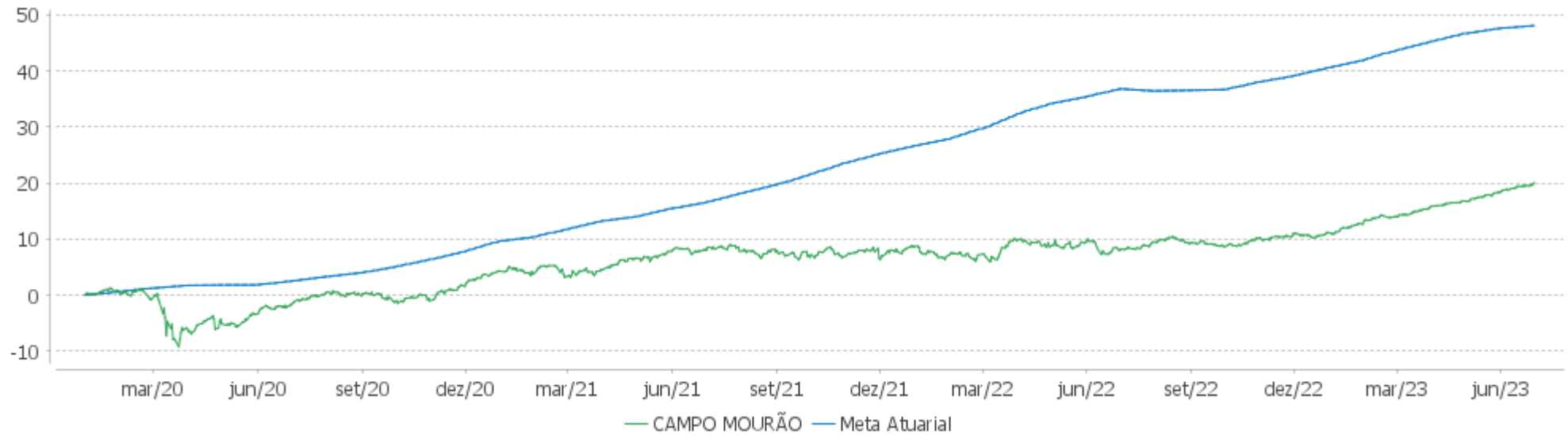
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

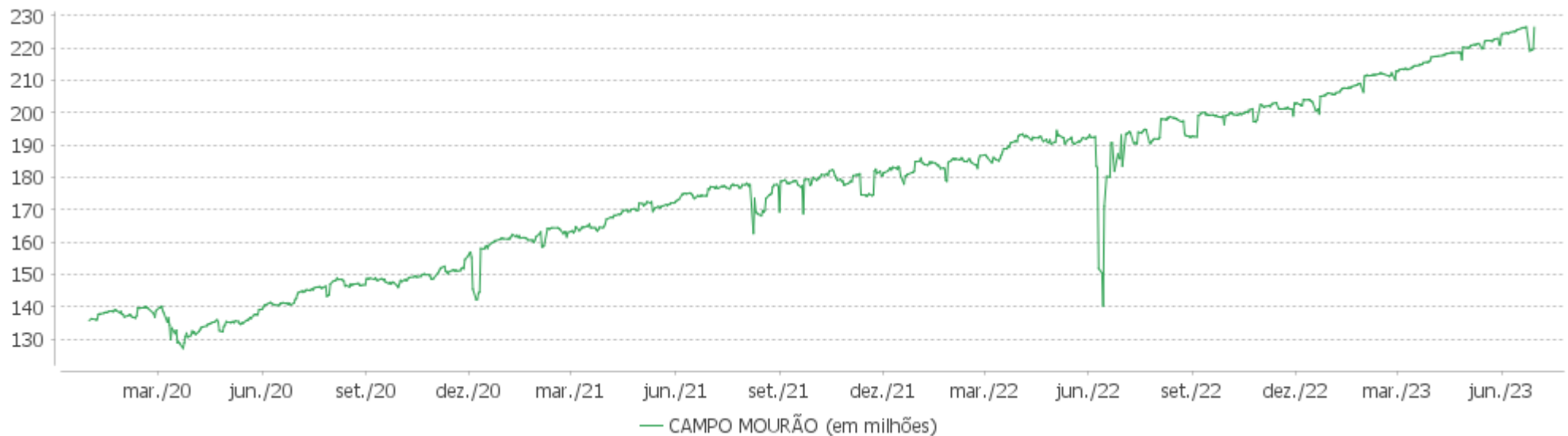
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	15	35,71	03 meses	3,68	1,99	1,69	1,33
Meses abaixo - Meta Atuarial	27	64,29	06 meses	8,01	5,43	2,57	1,68
			12 meses	11,21	8,34	2,88	2,14
			24 meses	11,06	27,52	-16,47	3,99
			36 meses	22,24	45,97	-23,73	4,07
Maior rentabilidade da Carteira	2,64	2020-12	Desde 31/12/2019	20,07	50,24	-30,17	5,64
Menor rentabilidade da Carteira	-5,49	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

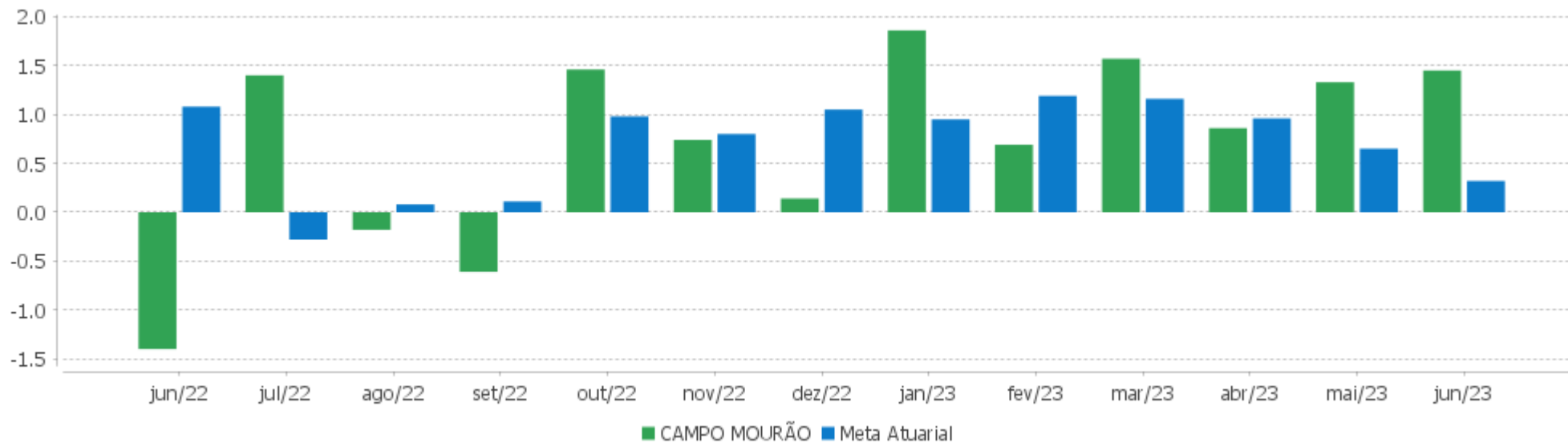


Patrimônio Líquido



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 150840 (5,790000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,22 3,35	2,48 1,72	6,22 3,35	9,50 6,34	22,35 6,92	32,31 7,25
NTN-B 150535 (5,750000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,20 3,33	2,47 1,71	6,20 3,33	9,46 6,30	22,25 6,82	32,15 7,09
NTN-B 150840 (5,820000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,24 3,37	2,49 1,73	6,24 3,37	9,53 6,37	22,39 6,97	32,37 7,31
NTN-B 150850 (5,820000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,24 3,37	2,49 1,73	6,24 3,37	9,53 6,37	22,43 7,00	32,44 7,39
NTN-B 150555 (5,790000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,22 3,35	2,48 1,72	6,22 3,35	9,50 6,34	22,40 6,97	32,41 7,36
NTN-B 150555 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,21 3,34	2,47 1,71	6,21 3,34	9,47 6,31	22,36 6,93	32,37 7,31
NTN-B 150545 (5,680000%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,53	6,17 3,30	2,45 1,69	6,17 3,30	9,39 6,22	22,20 6,78	32,14 7,08
NTN-B 150850 (5,930000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,29 3,42	2,51 1,75	6,29 3,42	9,64 6,48	22,58 7,16	32,63 7,58
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	7,00 -0,04	2,57 0,02	7,00 -0,04	10,18 -0,05	21,01 -0,30	28,00 -0,68
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,02 0,05	6,56 -0,22	2,10 0,11	6,56 -0,22	9,43 0,15	20,20 -0,12	27,87 -0,96
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,16 -0,03	6,49 -0,18	3,14 -0,08	6,49 -0,18	13,48 -0,34	21,33 -0,67	23,34 -1,15
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	6,99 -0,05	2,56 0,01	6,99 -0,05	10,05 -0,18	20,76 -0,56	27,74 -0,94
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,04 0,07	6,60 -0,19	2,14 0,15	6,60 -0,19	9,23 -0,05	19,78 -0,54	27,45 -1,38
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,16 -0,03	6,59 -0,09	3,15 -0,07	6,59 -0,09	13,58 -0,24	21,47 -0,53	23,68 -0,80
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	2,22 2,30	10,28 7,41	5,91 5,15	10,28 7,41	12,95 9,79	23,06 7,64	25,02 -0,04
GBX PRIME I FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS % do CDI	-0,05 -4,43	0,41 6,23	0,27 8,45	0,41 6,23	-3,72 -27,48	-8,86 -37,92	-5,38 -20,56
BB PREV RF IMA-B	2,39	11,31	7,20	11,31	13,23	17,29	25,63

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,05	0,10	-0,05	-0,29	-0,52	-0,93
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,09 101,92	6,44 99,04	3,16 100,55	6,44 99,04	13,54 99,98	23,74 101,59	26,65 101,82
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	1,00 93,03	5,98 92,01	2,90 92,23	5,98 92,01	12,44 91,84	20,85 89,21	22,25 85,01
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA Var. IPCA p.p.	2,01 2,09	9,45 6,58	5,68 4,92	9,45 6,58	14,37 11,20	19,80 4,38	22,21 -2,85
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p.	9,77 0,77	13,72 6,11	19,95 4,04	13,72 6,11	20,91 1,08	2,63 9,50	46,63 22,40
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	0,47 -0,02	14,53 -0,61	5,60 -0,29	14,53 -0,61	13,40 -1,04	-1,43 -2,02	24,43 -4,32
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	7,00 6,31	20,17 13,11	10,43 7,70	20,17 13,11	28,33 20,17	20,97 21,20	67,67 41,34
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA % do CDI	-0,15 -13,65	-0,87 -13,32	-0,43 -13,56	-0,87 -13,32	-8,46 -62,49	-9,80 -41,92	-8,96 -34,22
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING % do CDI	-0,05 -4,26	103,75 1.596,54	-0,33 -10,46	103,75 1.596,54	107,99 797,39	-40,11 -171,64	-41,19 -157,40
CARE11 Var. IBOVESPA p.p.	7,29 -1,71	-26,95 -34,56	-8,44 -24,35	-26,95 -34,56	-50,48 -70,32	-48,80 -41,93	-41,18 -65,41
CAMPO MOURÃO Var. IPCA + 4,95% p.p.	1,45 1,11	8,01 2,57	3,68 1,69	8,01 2,57	11,21 2,78	11,06 -16,49	22,24 -23,01
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,30
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
BRDESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	D+0	D+0	D+3 du	D+4 du		0,40
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
CARE11	Não se aplica	Não se aplica				
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 IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	Não se aplica	Não se aplica				
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	D+1 du	D+0	D+13 du	D+15 du		2,00
GBX PRIME I FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS	D+0	D+0		D+1600		
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se aplica	Não se aplica				

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	1,19	6,68	3,22	6,68	13,82	22,00	24,49	31,97	41,51
IRF-M 1+	2,65	11,41	6,89	11,41	18,80	17,59	16,30	30,02	54,96
IRF-M TOTAL	2,12	9,62	5,52	9,62	16,74	18,79	18,96	30,63	51,17
IMA-B 5	1,05	7,04	2,55	7,04	10,23	21,32	28,68	40,02	60,53
IMA-B 5+	3,37	14,91	10,90	14,91	16,34	13,82	23,52	25,96	77,32
IMA-B TOTAL	2,39	11,37	7,10	11,37	13,52	17,81	26,56	32,82	71,02
IMA-GERAL TOTAL	1,74	8,64	4,83	8,64	14,01	20,10	24,37	32,47	53,53
IDKA 2	0,97	6,79	1,99	6,79	9,28	20,32	28,82	40,12	58,67
IDKA 20	5,91	22,33	19,68	22,33	23,20	6,46	19,60	13,99	89,13
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23	16,96	62,29
IBRX 100	8,87	6,59	14,96	6,59	17,60	-9,50	23,38	17,63	65,59
IBRX 50	8,77	4,96	13,79	4,96	17,68	-9,03	25,07	16,40	59,58
SMALL CAP	8,17	13,26	25,16	13,26	19,79	-27,64	1,04	6,25	50,57
Índice Consumo - ICON	9,53	8,38	24,04	8,38	7,60	-42,14	-32,37	-22,91	3,43
Índice Dividendos - IDIV	8,78	9,30	13,95	9,30	17,73	12,91	39,77	39,55	106,18

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	0,69	7,06	2,73	7,06	8,17	-0,23	26,33	90,25	104,62

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,71	10,05	14,28	10,05	12,87	14,54	12,44	20,15	48,47

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,09	4,18	0,15	4,18	5,27	-8,63	14,48	64,05	68,93

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,08	2,87	0,76	2,87	3,16	15,42	25,06	27,72	32,02
INPC	-0,10	2,69	0,79	2,69	3,00	15,28	25,91	28,86	33,13
IGPM	-1,93	-4,46	-4,65	-4,46	-6,86	3,11	39,98	50,22	60,00
SELIC	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,25	4,88	1,72	4,88	7,27	24,82	40,63	49,40	60,53
IPCA + 5,00%	0,33	5,37	1,96	5,37	8,30	27,23	44,71	55,22	68,37
IPCA + 5,50%	0,37	5,62	2,08	5,62	8,81	28,44	46,79	58,20	72,40
IPCA + 5,89%	0,40	5,81	2,17	5,81	9,21	29,39	48,42	60,54	75,60
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88	61,21	76,52
INPC + 4,00%	0,23	4,69	1,75	4,69	7,10	24,66	41,58	50,73	61,88
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89	62,65	78,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (5,750000%)	565.089,73	5,750000	589.838,97	5,229500	24.749,24
NTN-B 150545 (5,680000%)	10.382.631,30	5,680000	10.660.941,90	5,459700	278.310,60
NTN-B 150555 (5,760000%)	41.625.633,97	5,760000	43.483.420,72	5,452600	1.857.786,75
NTN-B 150555 (5,790000%)	10.399.243,03	5,790000	10.909.109,07	5,452600	509.866,04
NTN-B 150840 (5,790000%)	9.812.822,15	5,790000	10.245.140,56	5,371900	432.318,41
NTN-B 150840 (5,820000%)	516.242,72	5,820000	540.640,66	5,371900	24.397,94
NTN-B 150850 (5,820000%)	5.181.734,09	5,820000	5.432.329,64	5,459000	250.595,55
NTN-B 150850 (5,930000%)	6.209.191,94	5,930000	6.602.230,35	5,459000	393.038,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
355	01/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	51.525,22	0,00	16.298,90401600	3,1612690000
354	01/06/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.570.461,54	0,00	656.354,35852100	3,9162710000
361	01/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	44.997,97	0,00	14.234,14774200	3,1612690000
350	02/06/2023	BB PREV RF IMA-B	1.000.000,00	0,00	151.000,60977600	6,6224898130
348	02/06/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	5.000.000,00	1.518.222,06499000	3,2933258680
346	02/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.000.000,00	0,00	1.399.760,07692300	2,8576325800
347	05/06/2023	BB PREV RF IDKA2	0,00	10.000.000,00	2.854.925,16677200	3,5027187810
349	05/06/2023	BB PREV RF IMA-B	9.000.000,00	0,00	1.353.049,02094200	6,6516437030
345	05/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.000.000,00	0,00	349.760,59908200	2,8590984880
359	19/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	443.055,37	0,00	139.313,19005200	3,1802830000
357	26/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.916.000,00	914.583,65502000	3,1883360000
360	26/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.000,00	313,64323400	3,1883360000
358	26/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.397.529,34	438.325,61277500	3,1883360000
352	26/06/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	2.851.428,83	723.475,29319100	3,9412940000
351	26/06/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.000,00	253,72375700	3,9412940000
363	26/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	40.000,00	12.545,73024500	3,1883360000
356	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.798.590,15	0,00	875.626,86575100	3,1960990000
353	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.188.782,01	0,00	806.792,09274500	3,9524210000
362	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	194.665,33	0,00	60.907,16526600	3,1960990000
Total			24.292.077,59	22.206.958,17		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.745.881,42

Value-At-Risk: 0,77%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAMPO MOURÃO	1,42	0,77	0,77	0,26	1,45	226.298.195,34	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,42%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,750000%)	0,37	0,13	-0,00	0,12	-1,68	0,46	565.089,73	0,25
NTN-B 150545 (5,680000%)	0,37	0,13	-0,00	0,12	-1,70	0,45	10.382.631,30	4,59
NTN-B 150555 (5,760000%)	0,37	0,13	-0,00	0,12	-1,68	0,46	41.625.633,97	18,39
NTN-B 150555 (5,790000%)	0,37	0,13	-0,00	0,12	-1,68	0,46	10.399.243,03	4,60
NTN-B 150840 (5,790000%)	0,37	0,13	-0,00	0,12	-1,68	0,46	9.812.822,15	4,34
NTN-B 150840 (5,820000%)	0,37	0,13	-0,00	0,12	-1,67	0,46	516.242,72	0,23
NTN-B 150850 (5,820000%)	0,37	0,13	-0,00	0,12	-1,67	0,46	5.181.734,09	2,29
NTN-B 150850 (5,930000%)	0,37	0,13	-0,00	0,12	-1,65	0,47	6.209.191,94	2,74
Sub-total	0,37	0,13	-0,00		-1,68	0,46	84.692.588,93	37,43

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,22	0,21	0,00	0,01	0,39	1,16	1.224.871,78	0,54
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,22	0,22	0,01	0,01	0,39	1,16	31.030.058,02	13,71
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,86	0,91	0,02	0,03	-0,02	1,03	11.763.634,47	5,20
BB PREV RF IDKA2	1,64	0,99	0,01	0,15	-0,03	1,02	3.596.554,33	1,59
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,74	0,98	0,01	0,15	-0,02	1,04	5.391.288,84	2,38
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,89	0,92	0,03	0,03	-0,02	1,03	17.052.451,45	7,54
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,79	1,45	0,02	1,47	0,41	2,22	5.364.824,05	2,37
Sub-total	1,14	0,62	0,08		0,09	1,18	75.423.682,94	33,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA-B	4,57	1,85	0,04	0,04	0,29	2,39	10.149.735,42	4,49
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,01	0,02	0,00	0,02	1,37	1,09	5.048.820,76	2,23
BB PREV RF FLUXO FIC	0,01	0,01	0,00	0,01	-5,74	1,00	36.213,29	0,02
BRDESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	2,51	1,07	0,04	1,09	0,37	2,01	17.269.003,71	7,63
Sub-total	2,70	1,14	0,07		0,32	1,93	32.503.773,18	14,36

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GBX PRIME I FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS	0,16	0,03	0,00	0,03	-6,81	-0,05	1.393.940,95	0,62
Sub-total	0,16	0,03	0,00		-6,81	-0,05	1.393.940,95	0,62

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,15%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	10,58	6,86	0,32	5,46	0,56	7,00	13.180.734,34	5,82
Sub-total	10,58	6,86	0,32		0,56	7,00	13.180.734,34	5,82

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	0,51	0,03	-0,00	0,03	-2,40	-0,15	2.867.847,13	1,27
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	0,16	0,13	-0,00	0,13	-7,06	-0,05	1.501.789,86	0,66
Sub-total	0,39	0,04	-0,00		-3,06	-0,11	4.369.636,99	1,93

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,63%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	13,88	7,63	0,19	0,62	-0,04	0,47	9.214.559,76	4,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	13,88	7,63	0,19		-0,04	0,47	9.214.559,76	4,07

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,41%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	16,88	8,41	0,09	4,16	0,52	9,77	4.588.957,53	2,03
Sub-total	16,88	8,41	0,09		0,52	9,77	4.588.957,53	2,03

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 18,39%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARE11	31,23	18,39	0,02	19,51	0,20	7,29	930.320,72	0,41
Sub-total	31,23	18,39	0,02		0,20	7,29	930.320,72	0,41