



LDB
EMPRESAS

CAMPO MOURÃO
MARÇO 2024



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 28.03.2024.

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

85,31%

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%)	1,53	0,03	1,00	3,07	590.561,17	0,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,680000%)	0,82	0,03	0,99	3,05	10.857.534,67	4,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,760000%)	0,66	0,03	1,00	3,07	43.567.838,19	16,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,790000%)	1,01	0,03	1,00	3,08	10.885.538,52	4,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,790000%)	1,37	0,03	1,00	3,08	9.974.079,49	3,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,820000%)	1,79	0,03	1,00	3,09	524.748,74	0,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,630000%)	3,96	0,03	0,99	1,48	2.016.238,84	0,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,640000%)	2,88	0,03	0,99	3,04	18.789.110,64	7,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,660000%)	2,88	0,03	0,99	3,05	8.163.666,81	3,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,670000%)	2,89	0,03	0,99	3,05	22.053.960,76	8,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730000%)	4,01	0,03	0,36	0,36	5.734.339,21	2,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,770000%)	4,03	-0,03	0,21	0,21	7.414.122,25	2,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,820000%)	1,32	0,03	1,00	3,09	5.271.774,66	2,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,930000%)	3,25	0,03	1,01	3,11	6.316.983,72	2,44
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,84	0,03	0,99	3,06	152.160.497,67	58,75

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,24	0,04	0,80	2,47	19.584.504,08	7,56	8.612.056.482,37	0,23
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,68	0,08	0,75	2,01	10.777.099,82	4,16	7.792.392.111,13	0,14
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,70	0,08	0,75	2,00	10.767.263,19	4,16	5.297.621.800,71	0,20
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,68	0,00	0,45	1,49	0,00	0,00	2.398.945.450,00	0,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,08	0,06	0,77	2,13	41.128.867,09	15,88		

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	3,93	-0,01	0,04	0,07	10.562.949,51	4,08	914.490.517,61	1,16
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,04	0,85	2,65	5.500.898,36	2,12	16.860.564.075,44	0,03
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	0,04	0,75	2,38	38.423,32	0,01	4.354.660.093,34	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	1,95	0,03	0,49	1,53	10.228.254,27	3,95	768.035.082,69	1,33
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			2,23	0,02	0,39	1,17	26.330.525,46	10,17		

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	3,56	-3,38	-3,38	-3,89	1.334.175,80	0,52	120.150.177,01	1,11
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			3,56	-3,38	-3,38	-3,89	1.334.175,80	0,52		
Renda Fixa			0,86	0,01	0,84	2,56	220.954.066,02	85,31		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

2,01%

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	15,75	1,04	1,36	0,85	5.205.128,43	2,01	716.419.031,98	0,73
Sub-total Artigo 8º I			15,75	1,04	1,36	0,85	5.205.128,43	2,01		
Renda Variável			15,53	1,04	1,36	0,85	5.205.128,43	2,01		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,46%

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	14,00	0,35	3,48	14,98	11.556.314,23	4,46	2.280.222.056,45	0,51
Sub-total Artigo 9º III			14,00	0,35	3,48	14,98	11.556.314,23	4,46		
Investimentos no Exterior			14,00	0,35	3,48	14,98	11.556.314,23	4,46		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

6,88%

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	11,49	0,14	3,39	11,13	16.237.618,18	6,27	1.864.604.527,50	0,87
Sub-total Artigo 10º I			11,49	0,14	3,39	11,13	16.237.618,18	6,27		

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 MULTISTRATÉGIA	58,19	-0,13	-0,13	-43,95	1.593.366,98	0,62	68.720.809,22	2,32
Sub-total Artigo 10º II			58,19	-0,13	-0,13	-43,95	1.593.366,98	0,62		

Investimentos Estruturados			11,42	0,11	3,07	2,16	17.830.985,16	6,88		
-----------------------------------	--	--	--------------	-------------	-------------	-------------	----------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,33%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	62,90	-0,10	-0,10	-10,10	2.483.284,08	0,96	654.137.410,24	0,38
PLANNER	PLANNER	CARE11	42,90	4,90	15,68	56,20	966.449,68	0,37	0,00	
Sub-total Artigo 11º			51,46	1,25	3,87	2,03	3.449.733,76	1,33		
Fundos Imobiliários			51,46	1,25	3,87	2,03	3.449.733,76	1,33		
Total			1,74	0,07	1,16	2,99	258.996.227,60	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	152.160.497,67	58,75	0,00	60,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	41.128.867,09	15,88	0,00	8,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	26.330.525,46	10,17	0,00	10,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.334.175,80	0,52	0,00	0,65	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	220.954.066,02	85,31					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	5.205.128,43	2,01	0,00	2,50	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	5.205.128,43	2,01					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	11.556.314,23	4,46	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	11.556.314,23	4,46					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	16.237.618,18	6,27	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	1.593.366,98	0,62	0,00	1,35	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	17.830.985,16	6,88					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	3.449.733,76	1,33	0,00	1,50	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	3.449.733,76	1,33					5,00
Total		258.996.227,60	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	0,99 119,34	3,06 116,71	3,06 116,71	5,56 100,39	10,29 83,24	1.409.506,33	4.169.768,35
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,77 92,85	2,13 81,31	2,13 81,31	5,24 94,68	10,78 87,19	356.272,73	1.026.172,01
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,39 46,43	1,17 44,47	1,17 44,47	5,15 92,94	12,29 99,39	101.504,89	303.763,60
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-3,38 -405,04	-3,89 -148,22	-3,89 -148,22	-4,48 -80,98	-4,03 -32,62	-46.614,82	-54.006,09
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,36 2,07	0,85 5,38	0,85 5,38	15,38 5,47	36,06 10,32	69.681,96	43.754,73
Artigo 9º III % do CDI	3,48 417,27	14,98 570,76	14,98 570,76	23,77 429,35	32,44 262,42	388.406,95	1.505.684,27
Artigo 10º I % do CDI	3,39 407,27	11,13 423,95	11,13 423,95	25,56 461,66	36,04 291,53	533.092,91	1.625.930,58
Artigo 10º II % do CDI	-0,13 -15,62	-43,95 -1.674,59	-43,95 -1.674,59	-44,19 -798,08	-44,66 -361,25	-2.076,53	-1.249.577,98
Artigo 11º % do CDI	3,87 464,38	2,03 77,49	2,03 77,49	50,21 906,73	29,86 241,57	128.545,85	68.768,43
CAMPO MOURÃO (Total)						2.938.320,27	7.440.257,90

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%)	584.719,09	0,00	0,00	0,00	590.561,17	5.842,08	17.594,49
NTN-B 150545 (5,680000%)	10.750.692,26	0,00	0,00	0,00	10.857.534,67	106.842,41	321.788,18
NTN-B 150555 (5,760000%)	43.136.522,78	0,00	0,00	0,00	43.567.838,19	431.315,41	1.298.977,02
NTN-B 150555 (5,790000%)	10.777.530,63	0,00	0,00	0,00	10.885.538,52	108.007,89	325.277,85
NTN-B 150840 (5,790000%)	9.875.115,24	0,00	0,00	0,00	9.974.079,49	98.964,25	302.073,32
NTN-B 150840 (5,820000%)	519.530,42	0,00	0,00	0,00	524.748,74	5.218,32	15.928,54
NTN-B 150850 (5,630000%)	1.996.473,24	0,00	0,00	0,00	2.016.238,84	19.765,60	29.370,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150850 (5,640000%)	18.604.777,37	0,00	0,00	0,00	18.789.110,64	184.333,27	562.492,99
NTN-B 150850 (5,660000%)	8.083.454,54	0,00	0,00	0,00	8.163.666,81	80.212,27	244.773,69
NTN-B 150850 (5,670000%)	21.837.105,10	0,00	0,00	0,00	22.053.960,76	216.855,66	661.759,13
NTN-B 150850 (5,730000%)	0,00	5.713.511,82	0,00	0,00	5.734.339,21	20.827,39	20.827,39
NTN-B 150850 (5,770000%)	0,00	7.398.559,68	0,00	0,00	7.414.122,25	15.562,57	15.562,57
NTN-B 150850 (5,820000%)	5.219.349,89	0,00	0,00	0,00	5.271.774,66	52.424,77	160.009,29
NTN-B 150850 (5,930000%)	6.253.649,28	0,00	0,00	0,00	6.316.983,72	63.334,44	193.333,70
	137.638.919,84	13.112.071,50	0,00	0,00	152.160.497,67	1.409.506,33	

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 IMA-B 5 LP FIC FI	18.061.501,74	0,00	-7.400.000,00	0,00	10.767.263,19	105.761,45	326.922,92
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.696.587,72	0,00	0,00	0,00	10.777.099,82	80.512,10	211.986,77
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.155.301,99	1.704.771,10	-420.000,00	0,00	19.584.504,08	144.430,99	403.324,59
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	5.693.731,74	0,00	-5.719.299,93	0,00	0,00	25.568,19	83.937,73
	52.607.123,19	1.704.771,10	-13.539.299,93	0,00	41.128.867,09	356.272,73	

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	38.135,63	0,00	0,00	0,00	38.423,32	287,69	893,46
BB PREV RF IMA-B	10.558.374,00	0,00	0,00	0,00	10.562.949,51	4.575,51	7.003,34
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.454.383,13	0,00	0,00	0,00	5.500.898,36	46.515,23	141.779,99
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	10.178.127,81	0,00	0,00	0,00	10.228.254,27	50.126,46	154.086,81
	26.229.020,57	0,00	0,00	0,00	26.330.525,46	101.504,89	

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	1.380.790,62	0,00	0,00	0,00	1.334.175,80	-46.614,82	-54.006,09
	1.380.790,62	0,00	0,00	0,00	1.334.175,80	-46.614,82	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	5.135.446,47	0,00	0,00	0,00	5.205.128,43	69.681,96	43.754,73
	5.135.446,47	0,00	0,00	0,00	5.205.128,43	69.681,96	

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	11.167.907,28	0,00	0,00	0,00	11.556.314,23	388.406,95	1.505.684,27
	11.167.907,28	0,00	0,00	0,00	11.556.314,23	388.406,95	

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	15.704.525,27	0,00	0,00	0,00	16.237.618,18	533.092,91	1.625.930,58
	15.704.525,27	0,00	0,00	0,00	16.237.618,18	533.092,91	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	1.595.443,51	0,00	0,00	0,00	1.593.366,98	-2.076,53	-1.249.577,98
	1.595.443,51	0,00	0,00	0,00	1.593.366,98	-2.076,53	

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CARE11	835.482,20	0,00	0,00	0,00	0,00	966.449,68	130.967,48	347.741,24
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	2.485.705,71	0,00	0,00	0,00	0,00	2.483.284,08	-2.421,63	-278.972,81
	3.321.187,91	0,00	0,00	0,00	0,00	3.449.733,76	128.545,85	

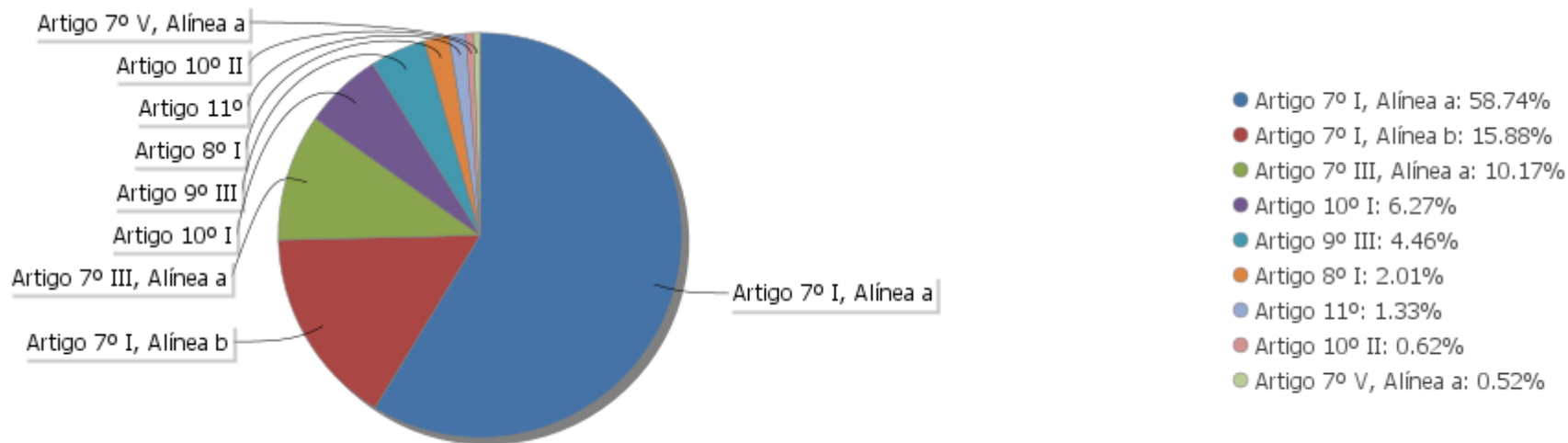
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

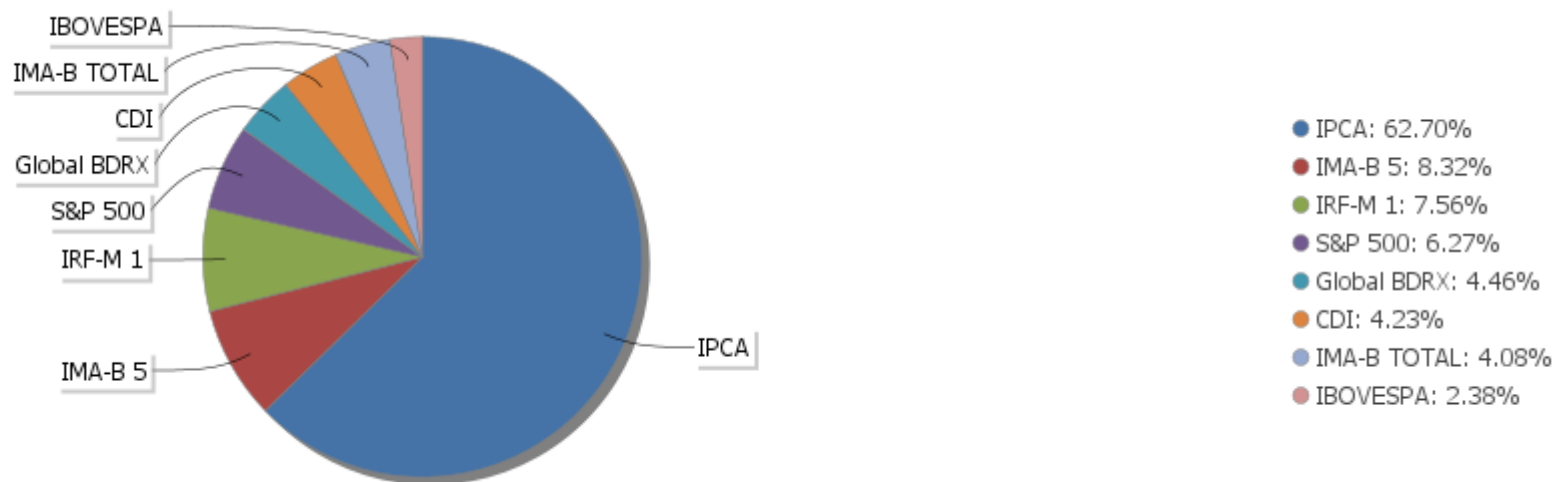
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	103.018.270,05	39,78		103.018.270,05	39,78	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00		103.018.270,05	39,78	
acima de 365 dias	155.977.957,55	60,22		258.996.227,60	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

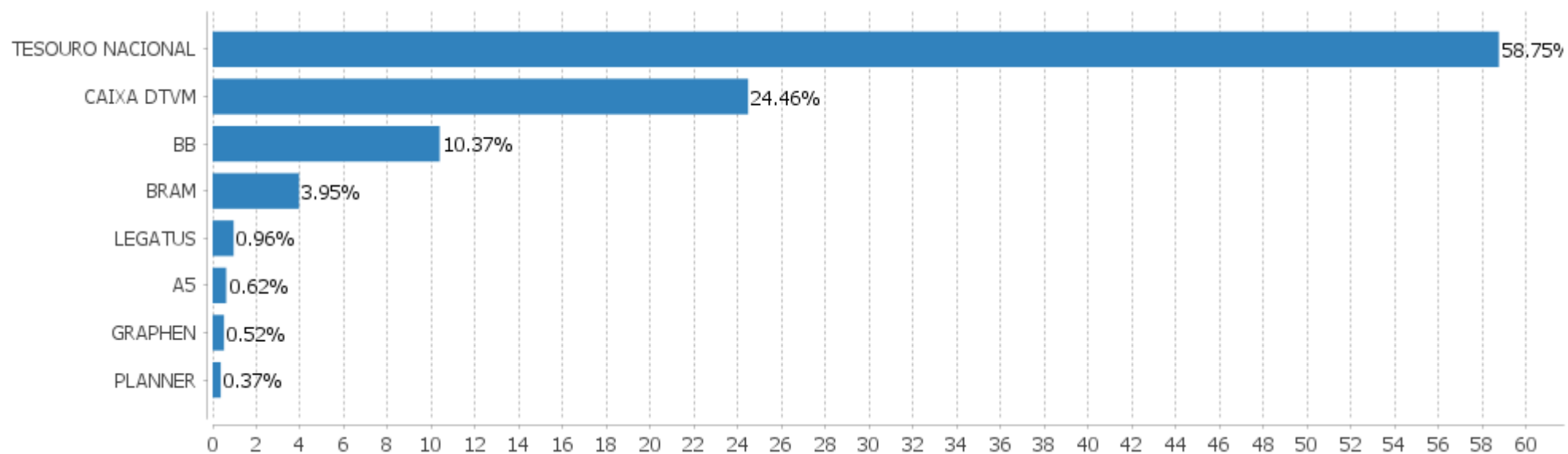


Alocação Por Estratégia



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
2024	0,89	0,91	1,16										2,99
IPCA + 5,04%	0,85	1,20	0,55										2,63
p.p. indexador	0,04	-0,29	0,61										0,36
2023	1,86	0,69	1,57	0,86	1,33	1,45	0,95	0,57	-0,03	-0,02	2,77	1,41	14,22
IPCA + 5,13%	0,97	1,20	1,17	0,97	0,67	0,34	0,54	0,69	0,66	0,66	0,68	0,96	9,92
p.p. indexador	0,89	-0,52	0,40	-0,11	0,66	1,11	0,42	-0,12	-0,69	-0,67	2,09	0,45	4,30
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

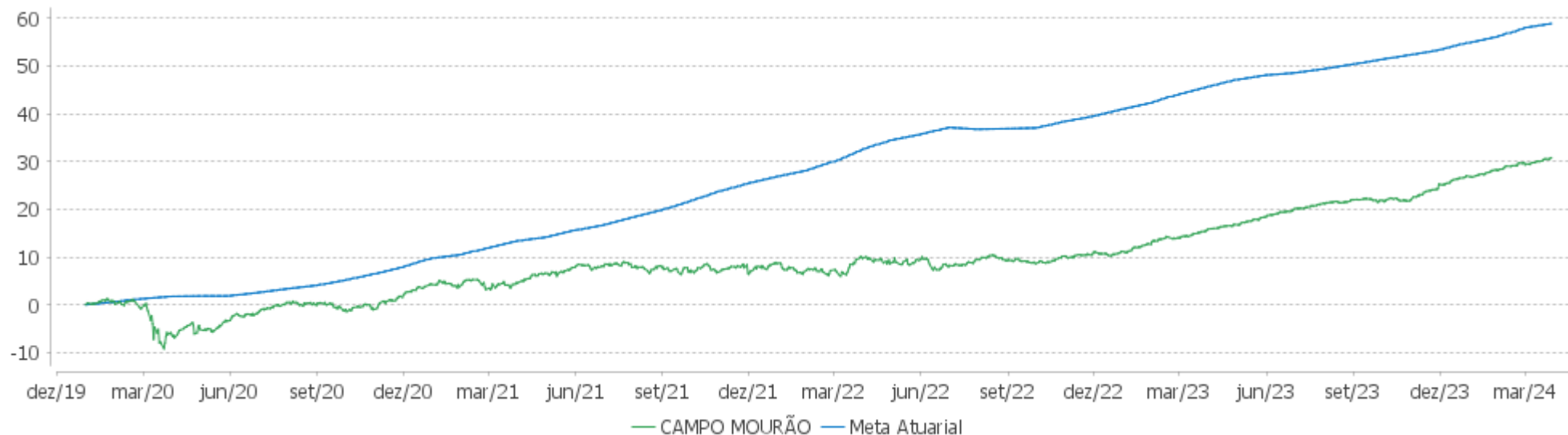
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	20	39,22
Meses abaixo - Meta Atuarial	31	60,78

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,77	2023-11
Menor rentabilidade da Carteira	-5,49	2020-03

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,99	2,63	0,36	1,59
06 meses	7,31	5,01	2,31	2,00
12 meses	12,93	9,13	3,80	1,74
24 meses	19,22	19,91	-0,68	2,75
36 meses	25,14	40,56	-15,43	3,54
48 meses	39,42	57,68	-18,26	4,01
Desde 31/12/2019	30,78	60,76	-29,97	5,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

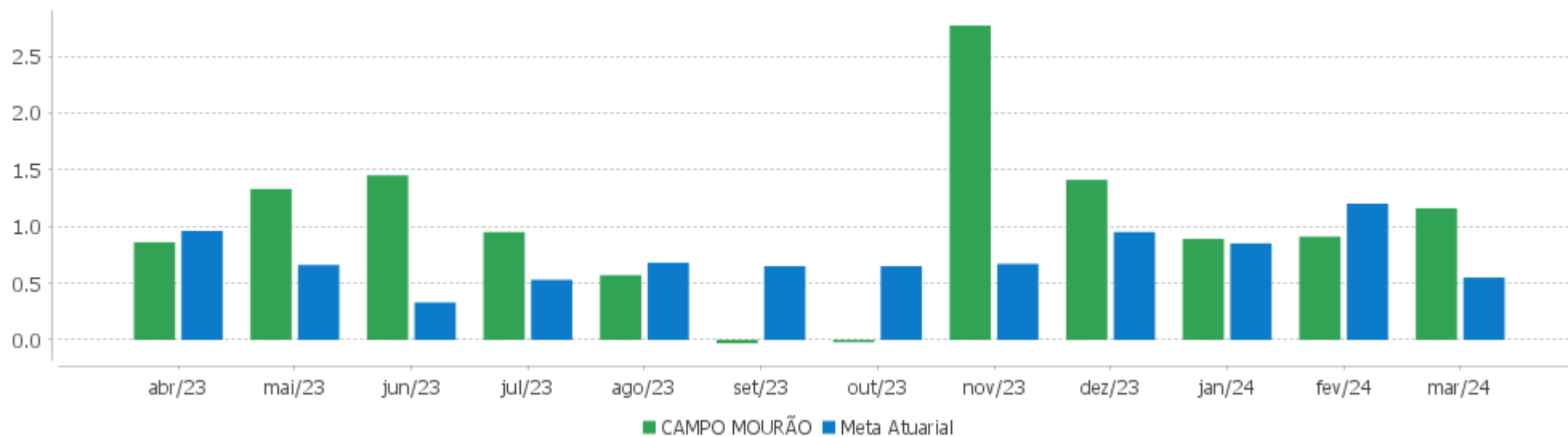


Patrimônio Líquido



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.	1,00 0,84	3,08 1,66	3,08 1,66	5,53 3,01	10,26 6,34	22,87 14,11	35,88 14,83
NTN-B 150535 (5,750000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,07 1,66	3,07 1,66	5,47 2,96	10,19 6,26	19,29 10,53	31,87 10,82
NTN-B 150850 (5,820000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,09 1,67	3,09 1,67	5,60 3,09	10,36 6,43	23,01 14,25	36,09 15,04
NTN-B 150840 (5,820000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,09 1,67	3,09 1,67	5,54 3,03	10,30 6,37	22,94 14,18	35,97 14,92
NTN-B 150555 (5,790000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,08 1,66	3,08 1,66	5,60 3,09	10,34 6,42	19,54 10,78	32,25 11,20
NTN-B 150850 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	0,22 -1,20	0,22 -1,20	2,45 -0,06	4,03 0,10		
NTN-B 150545 (5,680000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,05 1,64	3,05 1,64	5,50 2,99	10,18 6,26	19,27 10,51	31,89 10,84
NTN-B 150850 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,05 1,64	3,05 1,64	5,56 3,05	7,17 3,25		
NTN-B 150850 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,78	0,15 -1,26	0,15 -1,26	2,39 -0,12	3,97 0,04		
NTN-B 150850 (5,660000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,05 1,63	3,05 1,63	5,56 3,04	7,17 3,24		
NTN-B 150850 (5,640000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,04 1,63	3,04 1,63	5,55 3,03	7,15 3,23		
NTN-B 150850 (5,630000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	0,23 -1,18	0,23 -1,18	2,44 -0,07	4,00 0,08		
NTN-B 150555 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,07 1,66	3,07 1,66	5,59 3,07	10,31 6,39	19,48 10,72	32,19 11,14
NTN-B 150850 (5,930000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,11 1,70	3,11 1,70	5,65 3,14	10,47 6,55	23,26 14,50	36,40 15,35
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,75 -0,02	2,01 -0,05	2,01 -0,05	4,98 -0,10	9,48 -0,15	20,72 -0,29	30,95 -0,60
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,75 -0,02	2,00 -0,06	2,00 -0,06	4,98 -0,11	9,44 -0,18	20,53 -0,48	30,63 -0,93
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,80	2,47	2,47	5,37	12,08	26,60	32,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,04	0,01	0,01	-0,06	-0,20	-0,48	-0,78
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,55 0,39	1,59 0,18	1,59 0,18	5,69 3,18	13,03 9,10	23,64 14,88	32,20 11,15
GBX PRIME I FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS % do CDI	-3,38 -405,04	-3,89 -148,22	-3,89 -148,22	-4,48 -80,98	-4,03 -32,62	-6,05 -22,16	-13,14 -37,07
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,04 -0,03	0,07 -0,11	0,07 -0,11	4,77 -0,17	11,57 -0,24	19,45 -0,76	24,65 -0,97
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,85 102,32	2,65 100,79	2,65 100,79	5,55 100,26	12,40 100,31	27,30 100,05	35,92 101,34
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,75 90,51	2,38 90,70	2,38 90,70	5,02 90,65	11,27 91,14	24,78 90,83	31,36 88,48
BRANCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA Var. IPCA p.p.	0,49 0,33	1,53 0,11	1,53 0,11	5,23 2,71	12,96 9,03	24,31 15,55	29,71 8,66
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p.	1,36 2,07	0,85 5,38	0,85 5,38	15,38 5,47	36,06 10,32	22,66 15,91	34,78 24,94
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	3,48 -0,57	14,98 -0,90	14,98 -0,90	23,77 -1,11	32,44 -2,21	27,69 -2,86	18,24 -5,60
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	3,39 0,03	11,13 -2,55	11,13 -2,55	25,56 3,31	36,04 10,29	34,42 12,11	62,08 46,10
W7 FIP MULTISTRATÉGIA % do CDI	-0,13 -15,62	-43,95 -1.674,59	-43,95 -1.674,59	-44,19 -798,08	-44,68 -361,40	-49,33 -180,82	-50,08 -141,28
CARE11 Var. IBOVESPA p.p.	15,68 16,38	56,20 60,73	56,20 60,73	20,90 11,00	-4,89 -30,63	-44,85 -51,60	-19,67 -29,50
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING % do CDI	-0,10 -11,69	-9,48 -361,26	-9,48 -361,26	65,85 1.189,27	64,81 524,26	242,24 887,89	-1,38 -3,91
CAMPO MOURÃO Var. IPCA + 5,04% p.p.	1,16 0,61	2,99 0,36	2,99 0,36	7,31 2,33	12,93 3,87	19,22 -0,66	25,14 -15,02
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00

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 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 REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO 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 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	0,84	2,46	2,46	5,42	12,28	27,08	33,61	36,96	46,08
IRF-M 1+	0,43	1,37	1,37	6,49	15,26	28,03	28,76	31,09	48,08
IRF-M TOTAL	0,54	1,68	1,68	6,13	14,03	27,20	29,99	32,91	47,66
IMA-B 5	0,77	2,06	2,06	5,09	9,62	21,01	31,56	42,74	56,07
IMA-B 5+	-0,55	-1,51	-1,51	4,82	13,38	19,08	19,49	33,85	44,87
IMA-B TOTAL	0,08	0,18	0,18	4,94	11,81	20,21	25,62	38,67	51,35
IMA-GERAL TOTAL	0,52	1,64	1,64	5,51	12,59	24,78	30,91	37,43	49,07
IDKA 2	0,99	2,24	2,24	5,19	9,48	20,66	31,64	42,92	55,95
IDKA 20	-1,51	-4,59	-4,59	5,22	18,67	18,54	9,63	26,29	33,79
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84	75,44	34,26
IBRX 100	-0,73	-4,29	-4,29	10,02	25,18	5,09	8,02	75,18	36,28
IBRX 50	-0,81	-4,06	-4,06	9,78	24,88	5,45	9,81	80,89	34,52
SMALL CAP	2,15	-4,09	-4,09	6,93	24,13	-10,57	-19,33	32,77	16,87
Índice Consumo - ICON	1,26	-7,10	-7,10	4,34	13,75	-29,62	-42,70	-13,51	-19,55
Índice Dividendos - IDIV	-1,20	-3,81	-3,81	10,25	27,20	19,02	32,90	85,19	70,79

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	3,37	13,68	13,68	22,26	25,75	22,31	15,98	95,38	137,68

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,43	2,92	2,92	5,87	23,44	22,60	19,72	36,65	37,26

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,14	11,17	11,17	18,97	19,08	16,07	2,01	70,15	97,45

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,16	1,42	1,42	2,51	3,93	8,76	21,05	28,43	32,67
INPC	0,19	1,58	1,58	2,36	3,40	7,91	20,56	28,93	33,20
IGPM	-0,47	-0,91	-0,91	0,91	-4,26	-4,10	10,07	44,30	54,12
SELIC	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,47	2,38	2,38	4,48	8,00	17,54	36,06	50,08	61,29
IPCA + 5,00%	0,55	2,62	2,62	4,96	9,02	19,79	39,99	55,90	69,16
IPCA + 5,50%	0,59	2,74	2,74	5,21	9,53	20,92	41,99	58,87	73,21
IPCA + 5,89%	0,62	2,83	2,83	5,39	9,92	21,81	43,56	61,21	76,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00	61,88	77,34
INPC + 4,00%	0,50	2,55	2,55	4,32	7,45	16,62	35,51	50,66	61,93
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43	62,51	78,04

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%)	590.561,17	5,750000	586.175,33	5,847100	-4.385,84
NTN-B 150545 (5,680000%)	10.857.534,67	5,680000	10.597.672,50	5,891100	-259.862,17
NTN-B 150555 (5,760000%)	43.567.838,19	5,760000	42.892.140,87	5,874700	-675.697,32
NTN-B 150555 (5,790000%)	10.885.538,52	5,790000	10.760.768,94	5,874700	-124.769,58
NTN-B 150840 (5,790000%)	9.974.079,49	5,790000	9.906.548,81	5,857500	-67.530,68
NTN-B 150840 (5,820000%)	524.748,74	5,820000	522.773,02	5,857500	-1.975,72
NTN-B 150850 (5,630000%)	2.016.238,84	5,630000	1.950.866,58	5,883900	-65.372,26
NTN-B 150850 (5,640000%)	18.789.110,64	5,640000	18.203.741,29	5,883900	-585.369,35
NTN-B 150850 (5,660000%)	8.163.666,81	5,660000	7.930.040,26	5,883900	-233.626,55
NTN-B 150850 (5,670000%)	22.053.960,76	5,670000	21.450.824,37	5,883900	-603.136,39
NTN-B 150850 (5,730000%)	5.734.339,21	5,730000	5.621.294,36	5,883900	-113.044,85
NTN-B 150850 (5,770000%)	7.414.122,25	5,770000	7.310.301,29	5,883900	-103.820,96
NTN-B 150850 (5,820000%)	5.271.774,66	5,820000	5.228.502,05	5,883900	-43.272,61
NTN-B 150850 (5,930000%)	6.316.983,72	5,930000	6.354.506,67	5,883900	37.522,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
466	12/03/2024	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	5.719.299,93	239.644,76652956	23,8657410000
467	14/03/2024	NTN-B 150850 (5,730000%)	5.713.511,82	0,00	1.288,00000000	4.435,9563819880
460	15/03/2024	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	7.400.000,00	276.045,91496900	26,8071346060
468	18/03/2024	NTN-B 150850 (5,770000%)	7.398.559,68	0,00	1.675,00000000	4.417,0505552240
462	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	420.000,00	120.985,79223513	3,4714820000
465	28/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.526.634,90	0,00	439.602,51235184	3,4727620000
463	28/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.440,34	0,00	7.037,72386360	3,4727620000
461	28/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	100.253,82	0,00	28.868,61236100	3,4727620000
464	28/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	53.442,04	0,00	15.388,91522080	3,4727620000
Total			14.816.842,60	13.539.299,93		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.667.195,10

Value-At-Risk: 0,64%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,52	0,16		0,05	0,04	0,85	220.954.066,02	85,31
Artigo 8º	11,54	6,88		0,09	0,05	1,36	5.205.128,43	2,01
Artigo 9º	12,38	5,51		0,18	0,21	3,48	11.556.314,23	4,46
Artigo 10º	8,82	4,63		0,30	0,25	3,08	17.830.985,16	6,88
Artigo 11º	9,19	6,78		0,03	0,33	3,87	3.449.733,76	1,33
CAMPO MOURÃO	1,30	0,64		0,64	0,25	1,16	258.996.227,60	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,16%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,750000%)	0,26	0,18	0,00	0,21	0,65	1,00	590.561,17	0,23
NTN-B 150545 (5,680000%)	0,26	0,18	-0,00	0,20	0,63	0,99	10.857.534,67	4,19
NTN-B 150555 (5,760000%)	0,26	0,18	-0,00	0,20	0,65	1,00	43.567.838,19	16,82
NTN-B 150555 (5,790000%)	0,26	0,18	0,00	0,21	0,66	1,00	10.885.538,52	4,20
NTN-B 150840 (5,790000%)	0,26	0,18	0,00	0,21	0,66	1,00	9.974.079,49	3,85
NTN-B 150840 (5,820000%)	0,26	0,18	0,00	0,21	0,67	1,00	524.748,74	0,20
NTN-B 150850 (5,630000%)	0,26	0,21	-0,00	0,24	0,61	0,99	2.016.238,84	0,78
NTN-B 150850 (5,640000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,62	0,99	18.789.110,64	7,25
NTN-B 150850 (5,660000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,62	0,99	8.163.666,81	3,15
NTN-B 150850 (5,670000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,63	0,99	22.053.960,76	8,52
NTN-B 150850 (5,730000%)	0,26	0,21	-0,00	0,24	0,64	1,00	5.734.339,21	2,21
NTN-B 150850 (5,770000%)	0,37	0,21	-0,00	0,25	0,28	0,94	7.414.122,25	2,86
NTN-B 150850 (5,820000%)	0,26	0,18	0,00	0,21	0,67	1,00	5.271.774,66	2,04
NTN-B 150850 (5,930000%)	0,26	0,18	0,00	0,21	0,70	1,01	6.316.983,72	2,44
Sub-total	0,26	0,13	-0,00		0,63	0,99	152.160.497,67	58,75

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,18	0,09	0,00	0,05	-0,21	0,80	19.584.504,08	7,56
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,93	0,53	0,01	0,01	-0,09	0,75	10.777.099,82	4,16
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,93	0,54	0,01	0,01	-0,09	0,75	10.767.263,19	4,16
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,88	NaN	0,00	NaN	-0,32	0,55	0,00	0,00
Sub-total	0,60	0,31	0,02		-0,10	0,77	41.128.867,09	15,88

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA-B	2,29	1,22	0,02	0,02	-0,34	0,04	10.562.949,51	4,08
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,03	0,01	0,00	0,01	0,64	0,85	5.500.898,36	2,12
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,01	0,00	0,01	-3,99	0,75	38.423,32	0,01
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	1,07	0,55	0,01	0,56	-0,32	0,49	10.228.254,27	3,95
Sub-total	1,31	0,70	0,03		-0,34	0,39	26.330.525,46	10,17

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	12,19	0,20	-0,00	0,19	-0,35	-3,38	1.334.175,80	0,52
Sub-total	12,19	0,20	-0,00		-0,35	-3,38	1.334.175,80	0,52

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 4,63%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	9,64	5,09	0,30	4,20	0,27	3,39	16.237.618,18	6,27
Sub-total	9,64	5,09	0,30		0,27	3,39	16.237.618,18	6,27

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	0,46	2,67	-0,00	2,67	-2,08	-0,13	1.593.366,98	0,62

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,46	2,67	-0,00		-2,08	-0,13	1.593.366,98	0,62

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,51%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	12,38	5,51	0,18	0,56	0,21	3,48	11.556.314,23	4,46
Sub-total	12,38	5,51	0,18		0,21	3,48	11.556.314,23	4,46

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,88%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	11,54	6,88	0,09	3,25	0,05	1,36	5.205.128,43	2,01
Sub-total	11,54	6,88	0,09		0,05	1,36	5.205.128,43	2,01

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 6,78%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	0,35	2,34	0,00	2,34	-2,69	-0,10	2.483.284,08	0,96
CARE11	35,32	23,86	0,02	23,53	0,42	15,68	966.449,68	0,37
Sub-total	9,19	6,78	0,03		0,33	3,87	3.449.733,76	1,33

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)