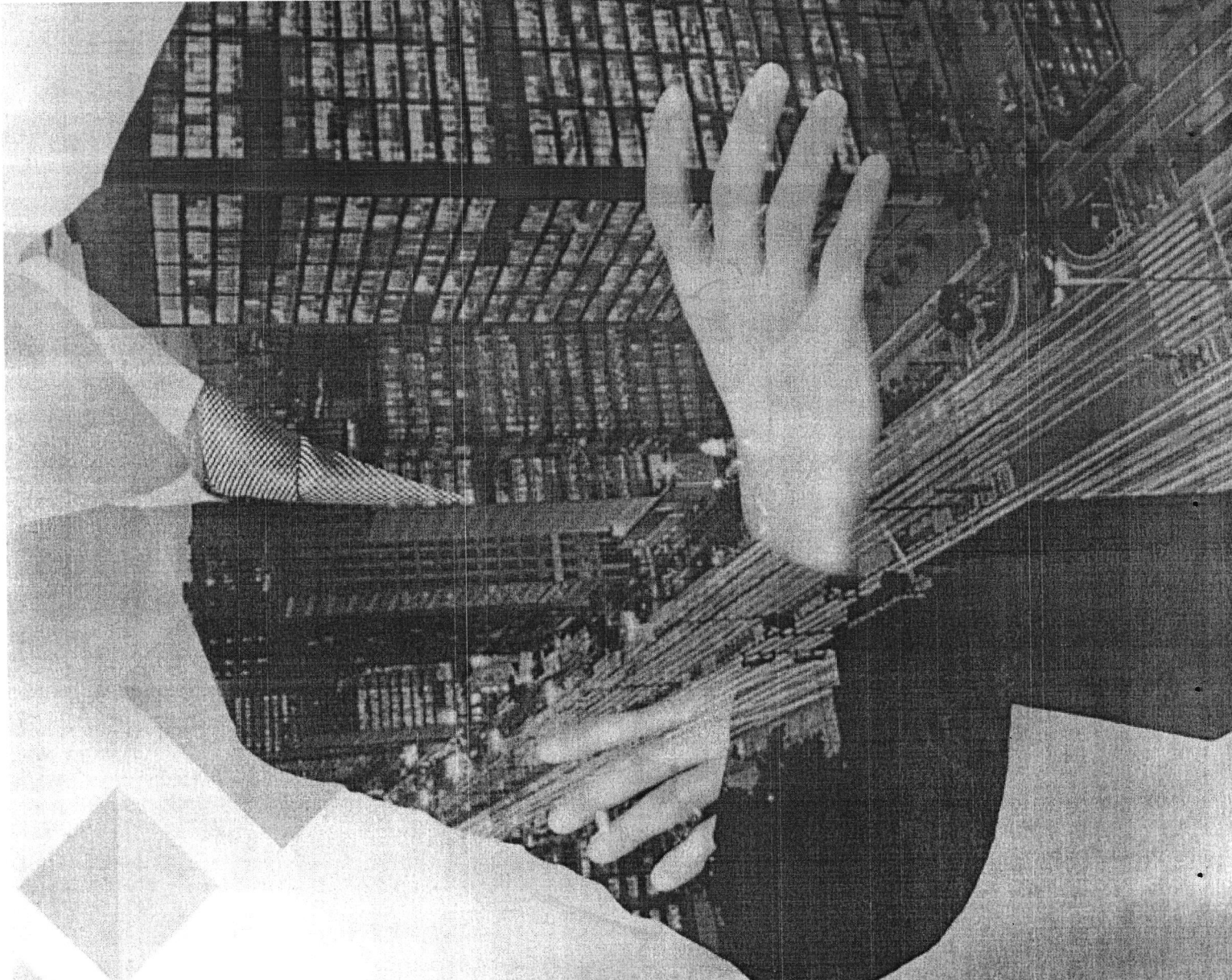


LDB
EMPRESAS

JALES
JUNHO 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 28.06.2024.

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.

Carteira: JALES

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Posição de Ativos e Enquadramento

76,35%

RENDA FIXA

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 150824	4,12	0,05	1,18	5,86	3.370.327,33	4,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	6,47	-0,97	-2,79	-5,95	2.586.872,00	3,61
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		3,96	-0,39	-0,59	0,37	5.957.199,33	8,31

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,61	-0,08	0,38	3,84	1.285.787,88	1,79	6.543.333.888,45	0,02
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	1,78	0,00	0,00	0,00	2.741.364,77	3,82	425.669.971,38	0,64
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,87	0,05	1,17	5,78	3.388.689,90	4,72	3.477.615.018,87	0,10
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	3,11	-0,38	-0,30	0,57	1.378.191,96	1,92	623.370.697,98	0,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,87	0,05	1,16	5,73	9.285.608,77	12,95	3.697.064.132,53	0,25
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,71	-0,24	0,20	2,96	824.564,55	1,15	4.585.046.250,25	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,80	-0,51	-1,00	-1,22	3.878.231,96	5,41	4.133.113.700,82	0,09
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,50	-0,28	-0,32	1,37	5.910.911,98	8,24	1.975.307.878,59	0,30
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	2,70	0,00	-0,18	1,93	0,00	0,00	2.052.875.038,41	0,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,28	-0,15	0,29	3,14	28.693.351,77	40,00		

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

Carteira: JALES

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 IMA-B	3,82	-0,50	-0,98	-1,28	2.915.483,55	4,06	843.817.661,01	0,35
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,09	0,04	0,82	5,36	3.994.415,03	5,57	16.508.104.382,05	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,98	0,00	0,59	3,79	0,00	0,00	672.683.891,15	0,00
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,10	0,04	0,12	0,12	2.586.049,91	3,61	5.723.870.469,63	0,05
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,10	0,04	0,82	3,78	5.539.530,81	7,72	2.969.679.625,74	0,19
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,41	-0,05	0,58	0,82	1.518.342,92	2,12	913.020.495,14	0,17
Sub-total Artigo 7º III, Alinea a			0,70	-0,07	0,44	3,74	16.553.822,22	23,08		

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SANTANDER	SANTANDER	LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 5,74% a.a	2,63	0,91	0,91	2,62	2.052.430,64	2,86		
SANTANDER	SANTANDER	LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 6,63% a.a	1,04	0,09	0,09	0,09	1.501.390,73	2,09		
Sub-total Artigo 7º IV			2,27	0,56	0,56	2,27	3.553.821,37	4,95		
Renda Fixa			19,04	-0,10	0,27	17,72	54.758.194,69	76,35		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

13,02%

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 DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	14,63	-1,03	1,09	-5,85	1.117.496,22	1,56	723.051.001,32	0,15
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	13,73	-0,14	1,13	-7,60	909.550,53	1,27	715.959.885,20	0,13
BRAM	BEM	BRADERCO F I A SELECTION	14,89	-0,75	-0,13	-13,33	1.450.210,60	2,02	305.744.233,44	0,47
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,31	-1,15	-0,44	-15,12	468.255,93	0,65	604.053.530,94	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	15,59	-0,97	-0,11	-6,86	5.395.694,98	7,52	660.651.400,16	0,82
Sub-total Artigo 8º I			14,24	-0,87	0,13	-8,32	9.341.208,26	13,02		
Renda Variável			14,24	-0,87	0,13	-8,32	9.341.208,26	13,02		

Carteira: JALES

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

6,13%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

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				
BB	BB	BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	13,62	0,06	9,77	30,18	4.397.741,02	6,13	1.649.294.012,28	0,27
		Sub-total Artigo 9º III	13,62	0,06	9,77	30,18	4.397.741,02	6,13		
		Investimentos no Exterior	14,52	0,06	9,77	30,18	4.397.741,02	6,13		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,50%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	2,87	0,06	1,11	4,92	3.227.348,22	4,50	48.617.657,15	6,64
Sub-total Artigo 10º I			2,87	0,06	1,11	4,92	3.227.348,22	4,50		
Investimentos Estruturados			1,08	0,06	1,11	4,92	3.227.348,22	4,50		
Total			2,73	-0,19	0,84	2,77	71.724.492,19	100,00		



Carteira: JALES

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	59.400,40
Sub-total Disponibilidades Financeiras	59.400,40
Total	71.783.892,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			ALM	Pró-Gestão Nivel 1
				Mínimo	Objetivo	Máximo		Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	5.957.199,33	8,31	0,00	12,00	80,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	28.693.351,77	40,00	0,00	28,00	80,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	16.553.822,22	23,08	0,00	22,00	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	3.553.821,37	4,95	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Fixa	54.758.194,69	76,35					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	9.341.208,26	13,02	0,00	15,30	35,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	9.341.208,26	13,02					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nivel I	4.397.741,02	6,13	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	4.397.741,02	6,13					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	3.227.348,22	4,50	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	3.227.348,22	4,50					15,00
Total		71.724.492,19	100,00					

Carteira: JALES

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, Alinea a % do CDI	-0,59 -74,26	0,37 7,13	-0,33 -13,06	0,37 7,13		-35.079,95	24.295,27
Artigo 7º I, Alinea b % do CDI	0,29 37,37	3,14 60,18	1,12 44,28	3,14 60,18		85.905,86	858.095,07
Artigo 7º III, Alinea a % do CDI	0,44 55,69	3,74 71,65	1,60 63,33	3,74 71,65		76.196,50	599.786,87
Artigo 7º IV % do CDI	0,56 71,14	2,27 80,44	2,07 81,89			19.819,05	53.821,37
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	0,13 -1,35	-8,32 -0,66	-7,93 -4,65	-8,32 -0,66		12.401,64	-848.049,50
Artigo 9º III % do CDI	9,77 1.239,46	30,18 577,97	14,26 563,56	30,18 577,97		391.455,37	1.019.472,05
Artigo 10º I % do CDI	1,11 140,98	4,92 94,25	2,50 98,83	4,92 94,25		35.475,28	151.367,47
JALES (Total)						586.173,75	1.858.788,60

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150545	2.661.187,06	0,00	0,00	0,00	2.586.872,00	-74.315,06	-166.465,00
NTN-B 150824	3.331.092,22	0,00	0,00	0,00	3.370.327,33	39.235,11	190.760,27
	5.992.279,28	0,00	0,00	0,00	5.957.199,33	-35.079,95	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1.280.882,85	0,00	0,00	0,00	1.285.787,88	4.905,03	45.190,92
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,00	2.741.364,77	0,00	0,00	2.741.364,77	0,00	0,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	3.349.588,60	0,00	0,00	0,00	3.388.689,90	39.101,30	186.461,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	1.382.361,05	0,00	0,00	0,00	1.378.191,96	-4.169,09	8.005,87
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	9.179.128,76	0,00	0,00	0,00	9.285.608,77	106.480,01	506.790,77
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	822.958,48	0,00	0,00	0,00	824.564,55	1.606,07	23.809,00
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.917.211,99	0,00	0,00	0,00	3.878.231,96	-38.980,03	-49.095,38
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.700.332,83	229.051,25	0,00	0,00	5.910.911,98	-18.472,10	64.759,72
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	2.568.458,11	0,00	-2.563.892,78	0,00	0,00	-4.565,33	48.623,36
	28.200.922,67	2.970.416,02	-2.563.892,78	0,00	28.693.351,77	85.905,86	

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 IMA-B	2.944.364,84	0,00	0,00	0,00	2.915.483,55	-28.881,29	-37.767,44
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.961.982,94	0,00	0,00	0,00	3.994.415,03	32.432,09	325.419,15
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	4.217.436,41	0,00	-4.241.364,77	0,00	0,00	23.928,36	153.853,47
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,00	2.582.944,03	0,00	0,00	2.586.049,91	3.105,88	3.105,88
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	6.850.892,51	1.436.066,48	-2.784.269,32	0,00	5.539.530,81	36.841,14	145.391,12
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	1.378.690,94	130.881,66	0,00	0,00	1.518.342,92	8.770,32	9.784,69
	19.353.367,64	4.149.892,17	-7.025.634,09	0,00	16.553.822,22	76.196,50	

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 5,74% a.a	2.034.002,32	0,00	0,00	0,00	2.052.430,64	18.428,32	52.430,64
LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 6,63% a.a	0,00	1.500.000,00	0,00	0,00	1.501.390,73	1.390,73	1.390,73
	2.034.002,32	1.500.000,00	0,00	0,00	3.553.821,37	19.819,05	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	1.105.406,80	0,00	0,00	0,00	1.117.496,22	12.089,42	-69.392,54
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	899.366,65	0,00	0,00	0,00	909.550,53	10.183,88	-74.800,75
BRASECO F I A SELECTION	1.452.072,94	0,00	0,00	0,00	1.450.210,60	-1.862,34	-223.046,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	470.343,09	0,00	0,00	0,00	468.255,93	-2.087,16	-83.381,99
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	5.401.617,14	0,00	0,00	0,00	5.395.694,98	-5.922,16	-397.427,80
	9.328.806,62	0,00	0,00	0,00	9.341.208,26	12.401,64	
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 GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	4.006.285,65	0,00	0,00	0,00	4.397.741,02	391.455,37	1.019.472,05
	4.006.285,65	0,00	0,00	0,00	4.397.741,02	391.455,37	
Artigo 10º I (Fundos Multimercados)							
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FI CAIXA HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	3.191.872,94	0,00	0,00	0,00	3.227.348,22	35.475,28	151.367,47
	3.191.872,94	0,00	0,00	0,00	3.227.348,22	35.475,28	

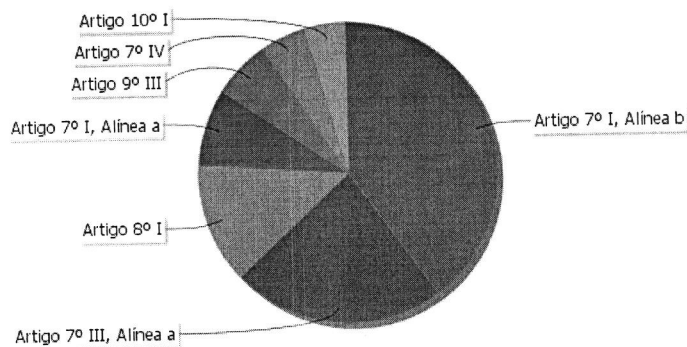
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	44.510.065,56	62,06		44.510.065,56	62,06	
de 31 dias a 365 dias	16.954.176,53	23,64		61.464.242,09	85,69	
acima de 365 dias	10.260.250,10	14,31		71.724.492,19	100,00	

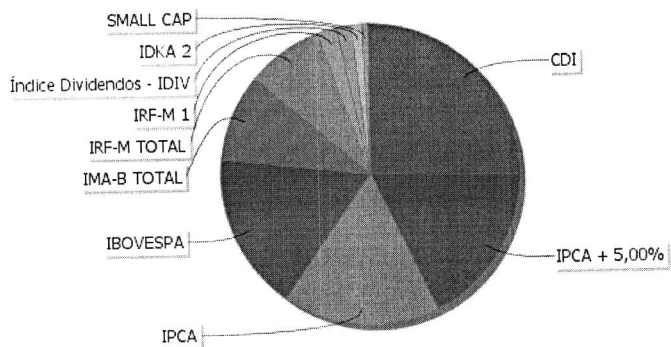
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



- Artigo 7º I, Alínea b: 40.00%
- Artigo 7º III, Alínea a: 23.08%
- Artigo 8º I: 13.02%
- Artigo 7º I, Alínea a: 8.31%
- Artigo 9º III: 6.13%
- Artigo 7º IV: 4.95%
- Artigo 10º I: 4.50%

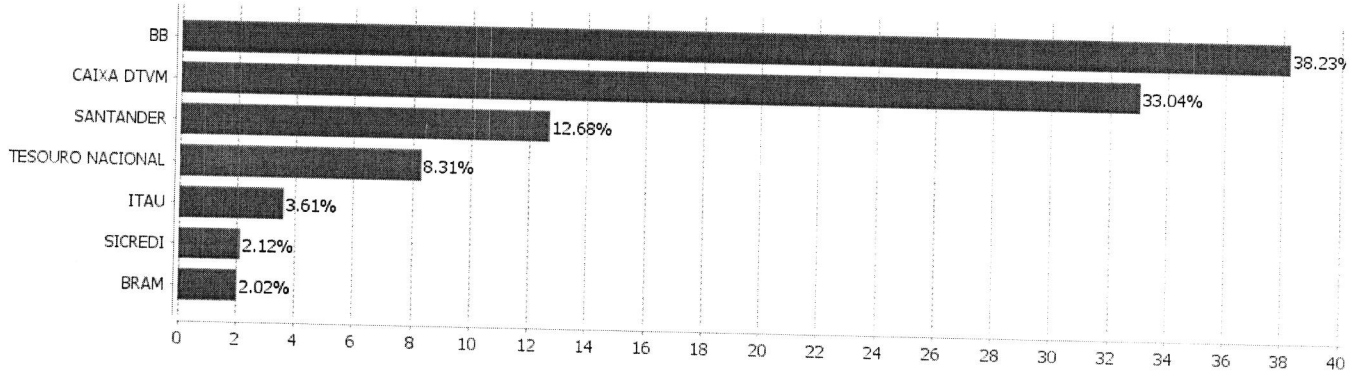
Alocação Por Estratégia



- CDI: 25.22%
- IPCA + 5,00%: 17.67%
- IPCA: 16.97%
- IBOVESPA: 16.94%
- IMA-B TOTAL: 9.47%
- IRF-M TOTAL: 8.24%
- IRF-M 1: 2.12%
- Índice Dividendos - IDIV: 1.56%
- IDKA 2: 1.15%
- SMALL CAP: 0.65%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: JALES

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	0,22	1,17	0,73	-0,95	0,73	0,84							2,77
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54	0,80	0,86	0,59							4,94
p.p. indexador	-0,62	-0,02	0,19	-1,75	-0,14	0,25							-2,17

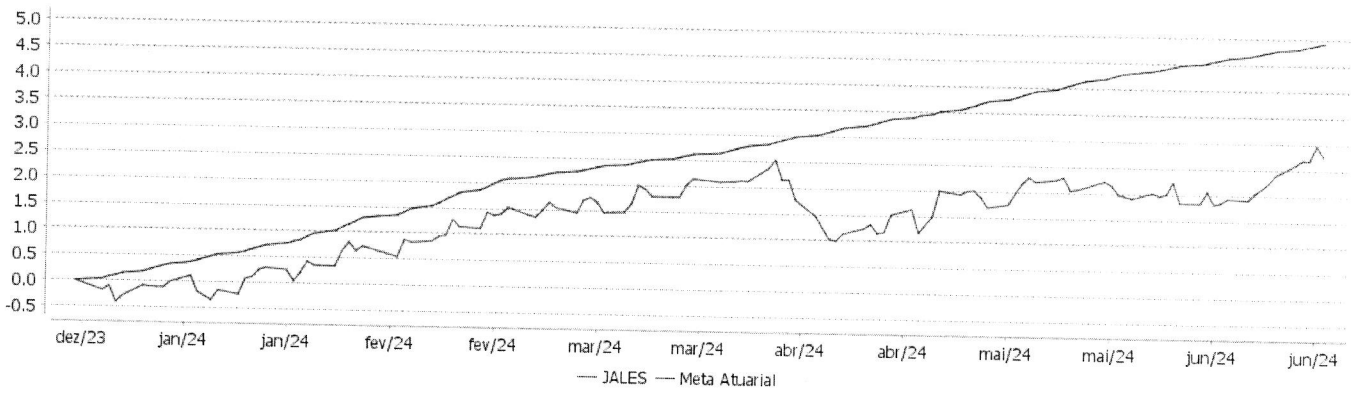
Performance Sobre a Meta Atuarial
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	2	33,33	03 meses	0,62	2,28	-1,66	2,93
Meses abaixo - Meta Atuarial	4	66,67	06 meses	2,77	4,94	-2,17	2,73
			12 meses				
			24 meses				
Desde 29/12/2023				2,77	4,94	-2,17	2,73

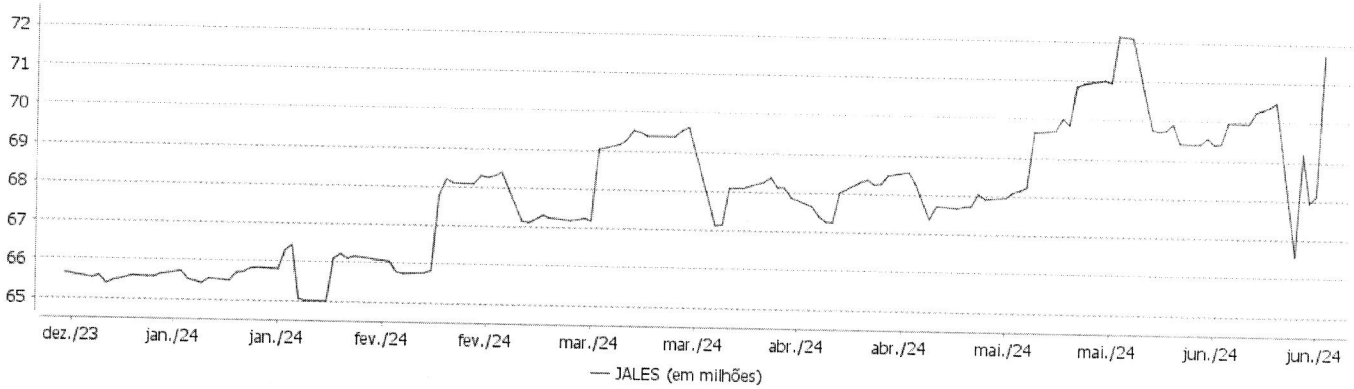
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,17	2024-02
Menor rentabilidade da Carteira	-0,95	2024-04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



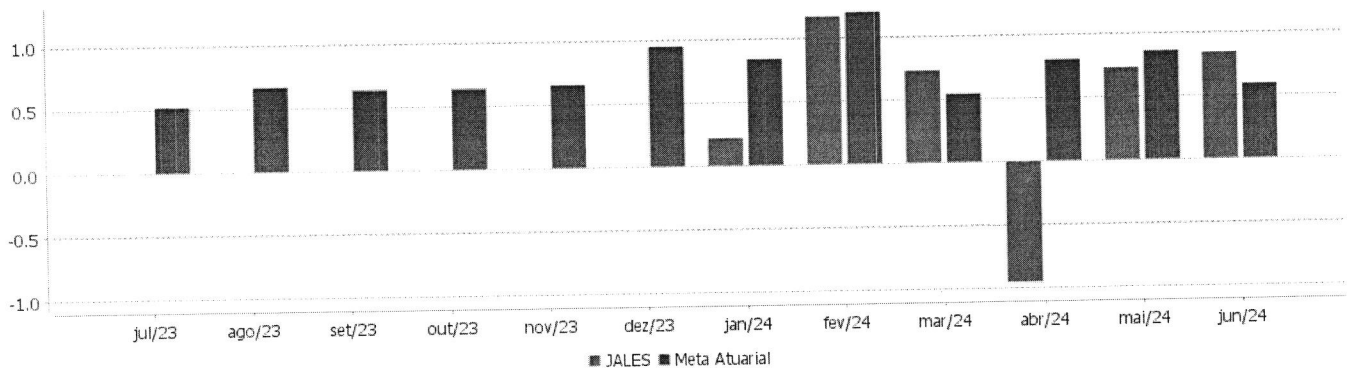
Patrimônio Líquido



Carteira: JALES

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
LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 5,74% a.a Var. IPCA p.p.	0,91 0,70	2,62 1,51	2,42 1,37				
LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 6,63% a.a Var. IPCA p.p.	0,09 0,07	0,09 0,07					
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	-2,79 -3,00	-5,95 -8,43	-4,22 -5,28	-5,95 -8,43	-2,07 -6,30	14,98 7,45	9,66 -10,65
NTN-B 150824 Var. IPCA p.p.	1,18 0,97	5,86 3,38	2,92 1,86	5,86 3,38	11,49 7,27	21,11 13,59	32,50 12,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,00 -0,03	-1,22 -0,13	-1,35 -0,08	-1,22 -0,13	2,87 -0,19	16,57 -0,43	20,68 -0,75
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA % do CDI	0,20 25,70	0,55 43,59					
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,20 0,02	2,96 -0,25	0,86 -0,09	2,96 -0,25	8,08 -0,29	18,05 -0,38	29,46 -0,94
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,16 0,56	5,73 0,75	2,86 0,57	5,73 0,75	11,35 1,97	20,70 2,24	
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,38 0,17	3,84 1,35	1,40 0,34	3,84 1,35	9,79 5,56	25,12 17,60	31,72 11,41
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,32 -0,02	1,37 -0,14	-0,24 -0,08	1,37 -0,14	7,62 -0,26	25,50 -0,45	27,54 -0,62
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,17 0,57	5,78 0,80	2,88 0,59	5,78 0,80	11,45 2,08		
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	-0,20 -0,41	1,91 -0,57	0,31 -0,74	1,91 -0,57	7,05 2,82	20,92 13,39	31,73 11,43
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI Var. IPCA p.p.	-0,30 -0,51	0,57 -1,91	-0,45 -1,51	0,57 -1,91	4,43 0,20		
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,83 104,68	5,49 105,16	2,62 103,39	5,49 105,16	12,54 107,24	27,99 104,38	40,33 106,72
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO Var. IRF-M 1 p.p.	0,58 -0,05	4,57 0,06	1,98 -0,03	4,57 0,06	11,14 0,19	26,56 0,28	36,21 0,85
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,98 -0,01	-1,28 -0,18	-1,34 -0,07	-1,28 -0,18	2,67 -0,39	16,26 -0,75	20,42 -1,00
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82	5,36	2,57	5,36	12,19	27,40	39,10

Carteira: JALES

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Varição da Estratégia							
% do CDI	103,84	102,72	101,69	102,72	104,28	102,16	103,45
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,82	5,48	2,62	5,48	12,39	27,67	39,60
% do CDI	103,65	105,02	103,49	105,02	106,00	103,19	104,77
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,60	3,80	1,59	3,80	8,65	23,59	29,68
Var. IPCA p.p.	0,39	1,31	0,54	1,31	4,42	16,06	9,37
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	-0,11	-6,86	-7,64	-6,86	4,76	26,67	7,51
Var. IBOVESPA p.p.	-1,59	0,80	-4,37	0,80	-0,17	0,93	9,79
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-0,44	-15,12	-11,33	-15,12	-12,55	3,93	-37,76
Var. SMALL CAP p.p.	-0,05	-0,26	-0,10	-0,26	-0,59	-1,53	-1,47
BRADESCO F I A SELECTION	-0,13	-13,33	-10,63	-13,33	-7,64	10,00	-18,58
Var. IBOVESPA p.p.	-1,61	-5,67	-7,35	-5,67	-12,57	-15,74	-16,29
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	1,09	-5,85	-7,70	-5,85	0,15	28,15	4,26
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,90	-2,44	-8,12	-2,44	-11,94	-3,82	-22,30
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	1,13	-7,60	-3,48	-7,60	3,60	13,77	-5,18
Var. IBOVESPA p.p.	-0,35	0,06	-0,20	0,06	-1,33	-11,97	-2,90
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	9,77	30,18	14,26	30,18	42,38	57,22	41,18
Var. IBOVESPA p.p.	8,29	37,84	17,54	37,84	37,45	31,48	43,47
FIC FI CAIXA HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	1,11	4,92	2,50	4,92	9,78	24,96	38,58
% do CDI	140,98	94,25	98,83	94,25	83,63	93,08	102,08
JALES	0,84	2,77	0,62	2,77			
Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,25	-2,17	-1,66	-2,17			
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+3 du		
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,00
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32		2,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF IMA-B	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,30
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BRDESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
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 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	D+0	D+0		D+1		
FIC FI CAIXA HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+1	D+1		0,10
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	D+1 du	D+0	D+13 du	D+15 du		2,00
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI			D+0	D+0		0,18
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20



Carteira: JALES

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FIC FI SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20

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	0,63	4,51	2,00	4,51	10,95	26,28	35,36	38,12	46,42
IRF-M 1+	-0,72	0,22	-1,14	0,22	6,61	26,65	25,36	23,98	38,61
IRF-M TOTAL	-0,29	1,51	-0,17	1,51	7,89	25,94	28,16	28,34	40,94
IMA-B 5	0,39	3,32	1,24	3,32	8,23	19,30	31,30	39,26	51,54
IMA-B 5+	-2,25	-5,04	-3,58	-5,04	-1,43	14,67	12,20	21,76	24,16
IMA-B TOTAL	-0,97	-1,10	-1,27	-1,10	3,07	17,01	21,42	30,44	36,89
IMA-GERAL TOTAL	0,05	2,42	0,77	2,42	8,23	23,40	29,99	34,60	43,37
IDKA 2	0,18	3,21	0,95	3,21	8,37	18,43	30,40	39,61	51,85
IDKA 20	-5,03	-12,09	-7,87	-12,09	-8,64	12,55	-2,74	9,26	4,14
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28	30,35	22,72
IBRX 100	1,51	-7,20	-3,03	-7,20	5,59	24,17	-4,44	30,28	24,20
IBRX 50	1,63	-6,12	-2,15	-6,12	7,39	26,37	-2,31	34,31	25,00
SMALL CAP	-0,39	-14,85	-11,23	-14,85	-11,96	5,47	-36,29	-11,04	-6,45
Índice Consumo - ICON	0,69	-14,03	-7,46	-14,03	-15,14	-8,69	-50,90	-42,61	-34,58
Índice Dividendos - IDIV	1,99	-3,41	0,42	-3,41	12,09	31,97	26,56	56,67	56,43

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	9,73	31,45	15,63	31,45	41,53	53,09	41,20	78,79	169,26

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,04	1,08	-1,78	1,08	6,09	19,73	21,51	19,28	27,46

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,28	26,67	13,94	26,67	35,48	42,62	23,79	55,10	122,26

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,21	2,48	1,05	2,48	4,23	7,52	20,30	30,35	33,12
INPC	0,25	2,68	1,08	2,68	3,70	6,81	19,54	30,56	33,63
IGPM	0,81	1,10	2,03	1,10	2,45	-4,57	5,64	43,41	53,90
SELIC	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,52	4,48	2,05	4,48	8,35	16,22	35,24	52,37	61,87
IPCA + 5,00%	0,60	4,97	2,29	4,97	9,38	18,45	39,16	58,28	69,77
IPCA + 5,50%	0,64	5,22	2,42	5,22	9,89	19,57	41,15	61,30	73,84
IPCA + 5,89%	0,67	5,41	2,51	5,41	10,29	20,45	42,71	63,69	77,07
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15	64,37	77,99
INPC + 4,00%	0,56	4,68	2,08	4,68	7,80	15,45	34,38	52,62	62,48
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24	64,64	78,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
56	03/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19.051,25	0,00	6.429,20442300	2,9632360000
64	03/06/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.394.513,57	5.306,94263700	262,7715552000
65	03/06/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	993.865,74	3.782,24249800	262,7715552000
66	03/06/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	45.890,01	174,63845300	262,7715552000
67	07/06/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	250.303,97	950,98089800	263,2060967000
68	07/06/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	99.696,03	378,77555900	263,2060967000
71	07/06/2024	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	130.881,66	0,00	52.097,94671890	2,5122230000
69	14/06/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	480.526,95	0,00	1.822,01038000	263,7344745000
57	18/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	210.000,00	0,00	71.023,44788400	2,9567700000
58	24/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,00	1.500.000,00	1.109,27250700	1.352,2376080000
63	24/06/2024	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	2.563.892,78	106.868,76350504	23,9910400000
61	25/06/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.563.892,78	0,00	565,07408028	4.537,2684210000
72	26/06/2024	LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 6,63% a.a	1.500.000,00	0,00	1,00000000	1.500,000,0000000000
59	26/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,00	2.741.364,77	2.026,11125800	1.353,0178850000
60	28/06/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	2.741.364,77	0,00	2.726.340,40151400	1,0055108190
62	28/06/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	19.051,25	0,00	4,19375654	4.542,7649000000
70	28/06/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	955.539,53	0,00	3.608,27109900	264,8192178000
Total			8.620.308,19	9.589.526,87		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 960.406,67

Value-At-Risk: 1,34%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,71	0,65	1,64	0,36	-0,31	0,26	54.758.194,69	76,35
Artigo 8º	16,32	7,20	8,52	0,86	-0,04	0,13	9.341.208,26	13,02
Artigo 9º	13,26	7,06	9,40	0,12	0,68	9,77	4.397.741,02	6,13
Artigo 10º	1,14	0,51	8,52	0,00	0,28	1,11	3.227.348,22	4,50
JALES		1,34		1,34			71.724.492,19	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,65%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824	1,02	0,32	0,00	0,34	0,38	1,18	3.370.327,33	4,70
NTN-B 150545	7,33	3,09	0,07	3,08	-0,49	-2,79	2.586.872,00	3,61
Sub-total	3,15	1,36	0,07		-0,44	-0,59	5.957.199,33	8,31

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1,00	0,42	0,01	0,42	-0,41	0,38	1.285.787,88	1,79
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	2,04	1,01	0,02	1,01	-0,29	0,20	2.741.364,77	3,82
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	1,02	0,31	0,00	0,33	0,37	1,17	3.388.689,90	4,72
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	3,31	1,73	0,02	1,72	-0,33	-0,30	1.378.191,96	1,92
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,02	0,31	0,00	0,33	0,37	1,16	9.285.608,77	12,95
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,07	1,10	0,01	0,24	-0,29	0,20	824.564,55	1,15
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,00	2,15	0,08	0,02	-0,45	-1,00	3.878.231,96	5,41
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,60	1,37	0,08	0,02	-0,31	-0,32	5.910.911,98	8,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,46	NaN	0,00	NaN	-0,29	-0,20	0,00	0,00
Sub-total	1,86	0,77	0,22		-0,27	0,29	28.693.351,77	40,00

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA-B	3,99	2,16	0,06	0,02	-0,44	-0,98	2.915.483,55	4,06
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,02	0,81	0,82	3.994.415,03	5,57
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,72	NaN	0,00	NaN	-0,26	0,60	0,00	0,00
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,04	0,03	0,00	0,03	0,84	0,83	2.586.049,91	3,61
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,07	0,03	0,00	0,03	0,42	0,82	5.539.530,81	7,72
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,75	0,24	0,00	0,05	-0,27	0,58	1.518.342,92	2,12
Sub-total	0,88	0,40	0,06		-0,40	0,44	16.553.822,22	23,08

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 5,74% a.a	3,20	0,36	-0,00	0,38	0,04	0,91	2.052.430,64	2,86
LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 6,63% a.a	1,04	0,00	0,00	0,11	0,01	0,09	1.501.390,73	2,09
Sub-total	1,99	0,21	-0,00		-0,11	0,56	3.553.821,37	4,95

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,20%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	14,54	6,61	0,09	3,93	0,02	1,09	1.117.496,22	1,56
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	11,30	6,03	0,06	1,12	0,03	1,13	909.550,53	1,27
BRADESCO F I A SELECTION	15,33	7,72	0,14	3,26	-0,06	-0,13	1.450.210,60	2,02
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,06	9,49	0,05	0,15	-0,06	-0,44	468.255,93	0,65
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	18,07	7,60	0,51	3,95	-0,05	-0,11	5.395.694,98	7,52
Sub-total	16,32	7,20	0,86		-0,04	0,13	9.341.208,26	13,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,06%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	13,26	7,06	0,12	9,41	0,68	9,77	4.397.741,02	6,13
Sub-total	13,26	7,06	0,12		0,68	9,77	4.397.741,02	6,13

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,51%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	1,14	0,51	0,00	0,51	0,28	1,11	3.227.348,22	4,50
Sub-total	1,14	0,51	0,00		0,28	1,11	3.227.348,22	4,50

(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 (%)