



UMUARAMA
SETEMBRO 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 29.09.2023.

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

									90,53%
--	--	--	--	--	--	--	--	--	--------

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				
SICREDI	SICREDI	SICREDI - FI RF LIQUIDEZ EMPRESARIAL REFERENCIADO DI	0,04	0,05	0,99	9,95	21.106.810,56	17,84	1.956.686.337,58	1,08
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,28	0,09	0,88	11,72	13.299.528,65	11,24	6.050.581.610,41	0,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	1,07	0,16	1,11	4,16	8.953.718,87	7,57	2.459.230.011,04	0,36
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	1,07	0,16	1,11	4,16	8.693.402,09	7,35	1.779.752.599,75	0,49
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,22	0,31	0,15	11,49	392.760,59	0,33	2.124.960.940,76	0,02
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,86	0,41	-0,30	11,35	5.301.735,23	4,48	2.195.169.805,31	0,24
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,42	0,17	0,40	10,36	4.469.238,69	3,78	5.614.661.167,38	0,08
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,87	0,16	1,10	8,82	21.083.043,35	17,82	3.520.695.315,59	0,60
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,98	0,14	0,91	9,99	83.300.238,03	70,40		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIC PRATICO CP	0,01	0,04	0,76	4,99	34.823,36	0,03	21.646.887.274,04	0,00
SICREDI	SICREDI	SICREDI - FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO TAXA SELIC	0,04	0,05	0,98	9,89	11.159.042,93	9,43	1.180.211.642,67	0,95
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	0,90	9,12	5.188.042,93	4,38	3.380.807.738,12	0,15
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,36	0,08	0,93	5,68	7.440.302,14	6,29	657.761.377,45	1,13
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,08	0,06	0,94	9,67	23.822.211,36	20,13		
Renda Fixa			0,79	0,12	0,92	10,13	107.122.449,39	90,53		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDAS VARIÁVEL

3,95%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	20,06	0,66	0,47	4,43	1.909.757,51	1,61	1.350.797.320,58	0,14
BB	BB	BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	25,79	1,33	-3,69	6,32	1.128.964,97	0,95	326.355.916,88	0,35
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	24,12	0,69	-2,47	-6,15	713.974,21	0,60	679.097.352,39	0,11
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	19,78	0,78	0,26	2,02	920.266,42	0,78	809.353.434,17	0,11
Sub-total Artigo 8º I			17,04	0,85	-1,06	7,27	4.672.963,11	3,95		
Renda Variável			16,95	0,85	-1,06	9,23	4.672.963,11	3,95		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,29%

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 ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	20,03	-0,45	-3,36	8,63	348.773,50	0,29	631.562.221,18	0,06
		Sub-total Artigo 9º III	20,03	-0,45	-3,36	8,63	348.773,50	0,29		
		Investimentos no Exterior	14,28	-0,45	-3,36	6,84	348.773,50	0,29		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

5,23%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO FI LP	1,09	0,16	0,83	9,25	11.134,31	0,01	328.550.492,06	0,00
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	1,39	0,16	0,47	8,46	6.176.677,91	5,22	129.062.339,73	4,79
Sub-total Artigo 10º I				1,32	0,16	0,47	8,46	6.187.812,22	5,23	
Investimentos Estruturados				1,30	0,16	0,47	8,62	6.187.812,22	5,23	
Total				1,46	0,15	0,80	9,89	118.331.998,22	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos					
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal	
Renda Fixa									
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	83.300.238,03	70,40	20,49	44,67	100,00	0,00	100,00	
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	23.822.211,36	20,13	20,89	26,88	60,00	0,00	60,00	
	Total Renda Fixa	107.122.449,39	90,53					100,00	
Renda Variável									
Artigo 8º I	Fundos de Ações	4.672.963,11	3,95	0,00	17,45	20,00	0,00	30,00	
	Total Renda Variável	4.672.963,11	3,95					30,00	
Investimentos no Exterior									
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	348.773,50	0,29	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00	
	Total Investimentos no Exterior	348.773,50	0,29					10,00	
Investimentos Estruturados									
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	6.187.812,22	5,23	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00	
	Total Investimentos Estruturados	6.187.812,22	5,23					15,00	
	Total	118.331.998,22	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 b % do CDI	0,91 92,94	9,99 100,60	2,87 89,17	6,13 94,86		747.820,01	7.424.981,55
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,94 96,80	9,67 97,41	3,17 98,46	6,38 98,61		243.990,68	1.715.388,11
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-1,06 -1,77	7,27 1,05	-4,11 -2,82	12,42 -1,99		-50.032,49	440.611,44
Artigo 9º III % do CDI	-3,36 -345,02	8,63 86,91	1,38 42,80	5,25 81,15		-12.136,84	217.445,66
Artigo 10º I % do CDI	0,47 48,06	8,46 85,21	1,78 55,32	4,64 71,81		28.851,67	482.632,80
UMUARAMA (Total)						958.493,03	10.281.059,56

RESULTADO POR ATIVO

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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	13.183.731,77	0,00	0,00	0,00	13.299.528,65	115.796,88	1.395.536,26
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	8.855.722,84	0,00	0,00	0,00	8.953.718,87	97.996,03	344.086,09
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	20.853.997,28	0,00	0,00	0,00	21.083.043,35	229.046,07	1.749.265,88
FI CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	8.598.291,92	0,00	0,00	0,00	8.693.402,09	95.110,17	347.247,86
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	392.187,88	0,00	0,00	0,00	392.760,59	572,71	40.489,23
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	4.451.263,15	0,00	0,00	0,00	4.469.238,69	17.975,54	424.530,19
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	5.317.646,15	0,00	0,00	0,00	5.301.735,23	-15.910,92	540.273,46
SICREDI - FI RF LIQUIDEZ EMPRESARIAL REFERENCIADO DI	20.899.577,03	0,00	0,00	0,00	21.106.810,56	207.233,53	1.820.237,47
	82.552.418,02	0,00	0,00	0,00	83.300.238,03	747.820,01	

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	6.963.420,89	4.650.560,60	-6.493.440,22	0,00	5.188.042,93	67.501,66	560.655,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC PRATICO CP	34.156,19	405,70	0,00	0,00	34.823,36	261,47	4.902,56
SICREDI - FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO TAXA SELIC	11.050.276,74	0,00	0,00	0,00	11.159.042,93	108.766,19	785.141,45
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	7.211.305,19	161.535,59	0,00	0,00	7.440.302,14	67.461,36	364.688,20
	25.259.159,01	4.812.501,89	-6.493.440,22	0,00	23.822.211,36	243.990,68	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	1.900.816,13	0,00	0,00	0,00	1.909.757,51	8.941,38	81.012,62
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	1.172.214,60	0,00	0,00	0,00	1.128.964,97	-43.249,63	67.122,91
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	917.888,42	0,00	0,00	0,00	920.266,42	2.378,00	15.968,09
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	732.076,45	0,00	0,00	0,00	713.974,21	-18.102,24	-46.816,34
	4.722.995,60	0,00	0,00	0,00	4.672.963,11	-50.032,49	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	360.910,34	0,00	0,00	0,00	348.773,50	-12.136,84	217.445,66
	360.910,34	0,00	0,00	0,00	348.773,50	-12.136,84	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

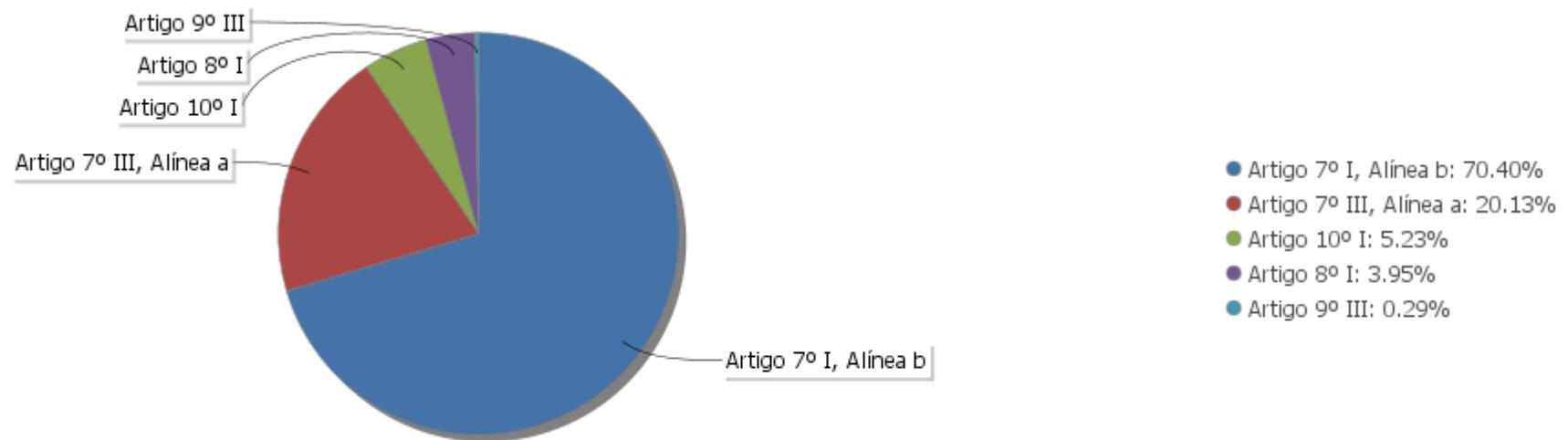
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	6.147.918,26	0,00	0,00	0,00	6.176.677,91	28.759,65	481.689,74
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	11.042,29	0,00	0,00	0,00	11.134,31	92,02	943,06
	6.158.960,55	0,00	0,00	0,00	6.187.812,22	28.851,67	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Análise de Liquidez

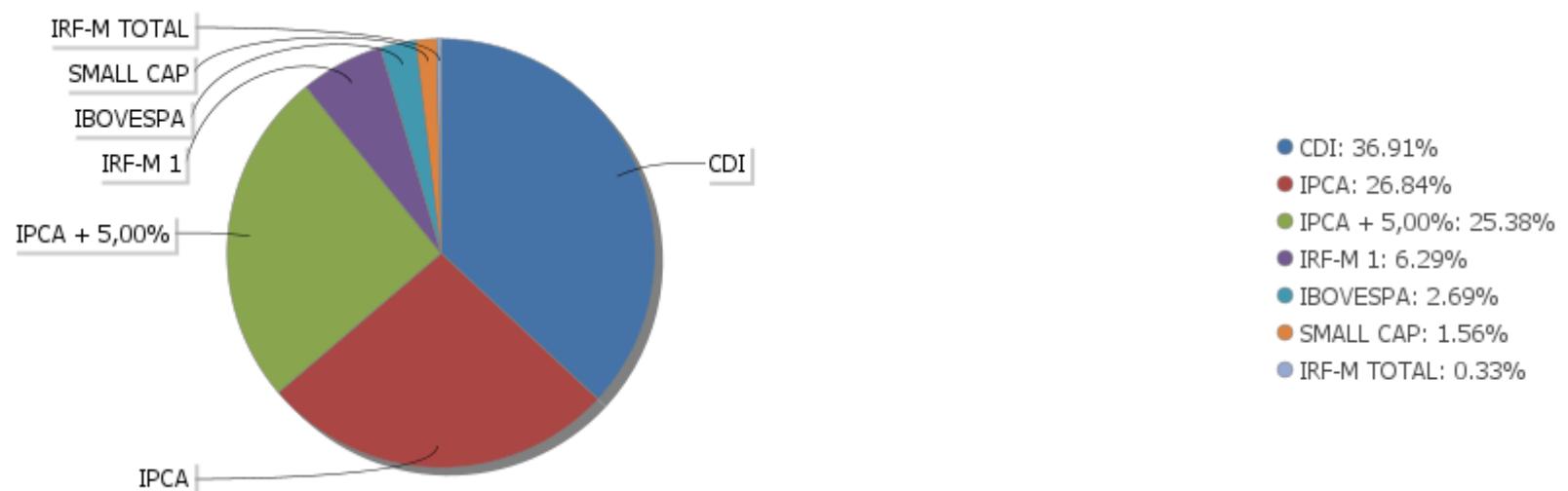
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	78.681.567,49	66,49		78.681.567,49	66,49	
de 31 dias a 365 dias	39.650.430,73	33,51		118.331.998,22	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00		118.331.998,22	100,00	

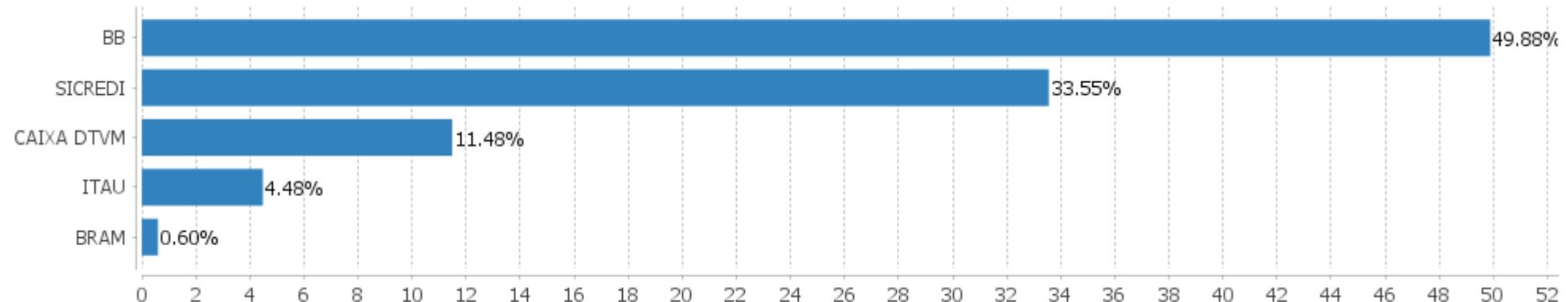
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**Alocação por Gestor**

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2023	1,63	0,48	1,15	0,89	1,26	1,51	1,12	0,65	0,80				9,89
IPCA + 4,90%	0,95	1,19	1,15	0,95	0,65	0,32	0,52	0,67	0,64				7,26
p.p. indexador	0,68	-0,71	0,00	-0,07	0,61	1,19	0,60	-0,02	0,16				2,63

Performance Sobre a Meta Atuarial

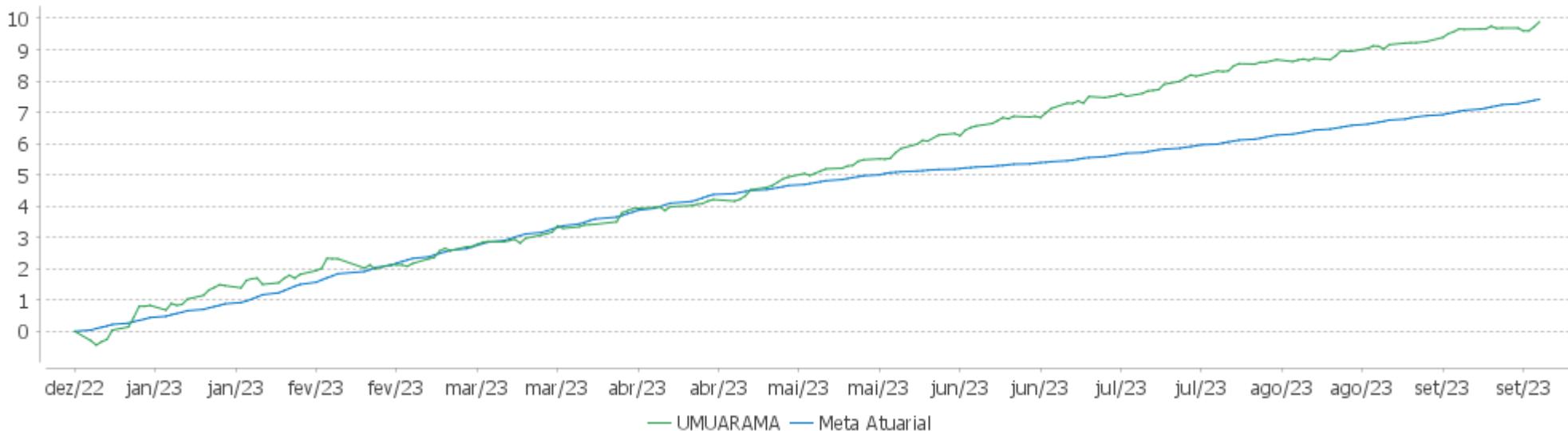
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	6	66,67
Meses abaixo - Meta Atuarial	3	33,33
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,63	2023-01
Menor rentabilidade da Carteira	0,48	2023-02

Relatório

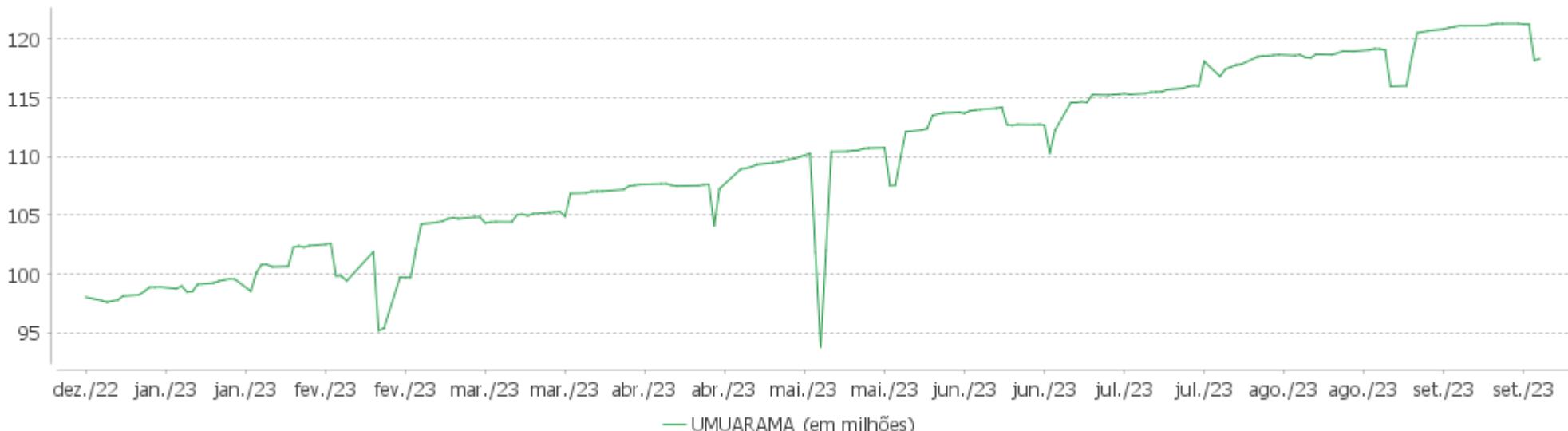
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,59	1,84	0,75	1,05
06 meses	6,39	3,81	2,58	1,07
12 meses				
24 meses				
Desde 30/12/2022	9,89	7,26	2,63	1,46

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

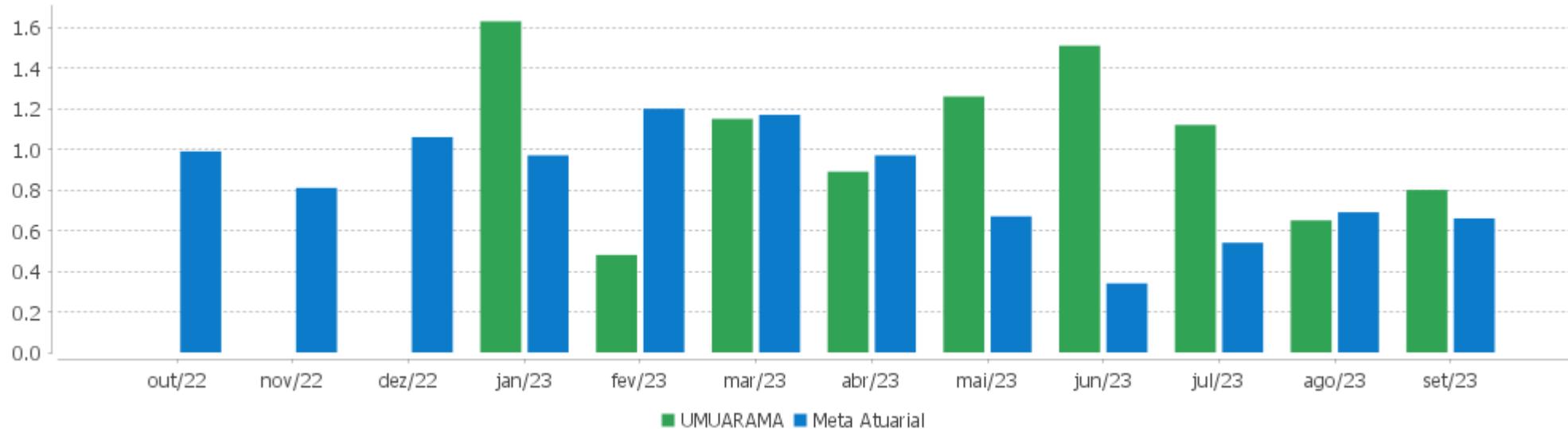


Patrimônio Líquido



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
SICREDI - FI RF LIQUIDEZ EMPRESARIAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,99 101,73	9,95 100,20	3,25 100,79	6,51 100,67	13,43 99,92	25,82 100,05	29,49 99,73
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,40 0,14	10,36 6,86	1,94 1,33	6,89 5,51	12,82 7,63	23,47 10,75	24,53 0,25
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,88 0,62	11,72 8,22	2,73 2,12	7,91 6,53	13,59 8,41	23,82 11,09	27,26 2,98
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,10 0,45	8,82 1,48	3,09 1,23	4,57 0,71	11,76 1,36		
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,15 -0,03	11,49 -0,13	1,77 -0,06	7,33 -0,11	13,46 -0,12	22,40 -0,27	20,86 -0,56
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,11 0,46	3,85 1,25	3,12 1,25				
FI CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA Var. IPCA p.p.	1,11 0,85	3,90 3,25	3,12 2,51				
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	-0,30 -0,56	11,35 7,85	0,97 0,36	6,94 5,56	10,76 5,57	22,65 9,93	25,99 1,71
FIC PRATICO CP % do CDI	0,76 78,22	7,77 78,25	2,53 78,59	5,08 78,49	10,50 78,12	19,62 76,05	20,99 71,01
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO Var. IRF-M 1 p.p.	0,93 -0,00	10,18 0,11	3,26 0,09	6,64 0,14	13,64 0,10	25,17 0,49	28,32 0,53
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,90 91,93	9,12 91,85	2,96 91,98	5,95 91,99	12,33 91,75	23,32 90,39	25,64 86,73
SICREDI - FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO TAXA SELIC % do CDI	0,98 100,98	9,89 99,66	3,23 100,23	6,48 100,16	13,36 99,40	25,66 99,43	29,29 99,07
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI Var. SMALL CAP p.p.	-3,69 -0,85	6,32 1,27	-7,34 -0,10	18,22 2,13	-3,12 -0,18	-21,29 -0,46	-12,37 -4,00
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	0,47 -0,24	4,43 -1,79	-0,70 0,59	13,47 -0,94	1,94 -4,00	0,42 -4,61	24,49 1,27
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,26 -0,45	2,02 -4,20	-1,96 -0,67	10,30 -4,11	-0,01 -5,94	-4,02 -9,06	24,18 0,96
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	-2,47 0,37	-6,15 -11,21	-9,95 -2,70	4,31 -11,79	-11,45 -8,51	-24,24 -3,41	-10,81 -2,45
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	-3,36	8,63	1,38	5,25	14,63	-9,67	7,13

Carteira: UMUARAMA

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-4,07	2,40	2,67	-9,16	8,69	-14,70	-16,08
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	0,47	8,46	1,78	4,64	11,35	22,61	24,39
% do CDI	47,99	85,20	55,28	71,78	84,40	87,61	82,48
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	0,83	9,25	2,52	5,77	12,29	24,46	28,86
% do CDI	85,50	93,21	78,28	89,19	91,38	94,81	97,60
UMUARAMA	0,80	9,89	2,59	6,39			
Var. IPCA + 5,10% p.p.	0,16	2,63	0,75	2,58			
CDI	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57
IBOVESPA	0,71	6,22	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21
INPC + 6,00%	0,57	7,49	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70
IPCA + 6,00%	0,72	8,10	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,60
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32		2,00
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	D+1 du	D+0		D+4 du	Será devida taxa de performance de 20% (vinte por cento), com baseno resultado do fundo, sobre a rentabilidade que exceder 100% da variação do Certificado de Depósito Interfinanceiro - CDI, após a dedução de todas as despesas do FUNDO, inclusive taxa de administração.	
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	D+0	D+0	D+0	D+4 du		0,60
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FI CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40

Carteira: UMUARAMA

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FIC PRATICO CP	D+0	D+0	D+0	D+0		3,90
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
SICREDI - FI RF LIQUIDEZ EMPRESARIAL REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
SICREDI - FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO TAXA SELIC	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
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	0,93	10,06	3,18	6,50	13,54	24,68	27,79	33,59	43,54
IRF-M 1+	-0,15	12,82	1,26	8,24	14,06	22,31	18,47	27,49	54,02
IRF-M TOTAL	0,17	11,62	1,83	7,45	13,57	22,67	21,42	29,39	51,16
IMA-B 5	0,13	8,89	1,73	4,32	11,65	21,97	29,23	38,58	59,92
IMA-B 5+	-1,92	12,08	-2,46	8,17	10,15	15,88	19,59	17,59	70,32
IMA-B TOTAL	-0,95	10,79	-0,52	6,55	11,05	19,09	24,70	27,33	67,28
IMA-GERAL TOTAL	0,18	10,59	1,80	6,72	12,50	22,90	25,94	31,42	53,46
IDKA 2	0,29	8,97	2,05	4,08	11,42	21,35	28,89	39,21	57,10
IDKA 20	-3,53	15,28	-5,76	12,78	8,75	9,82	12,05	2,09	75,69
CDI	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,71	6,22	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21	11,28	46,91
IBRX 100	0,84	5,50	-1,02	13,78	5,09	3,69	22,17	11,68	50,59
IBRX 50	1,21	4,92	-0,03	13,75	5,32	5,93	25,49	12,91	45,69
SMALL CAP	-2,84	5,06	-7,25	16,09	-2,94	-20,83	-8,36	-10,00	41,57
Índice Consumo - ICON	-4,02	-4,75	-12,11	9,02	-17,82	-40,64	-41,63	-42,24	-10,67
Índice Dividendos - IDIV	1,32	10,67	1,25	15,38	14,16	22,39	46,36	32,00	101,74

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	-3,22	7,19	0,12	2,85	10,76	-8,35	13,20	73,22	84,04

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,20	12,28	2,03	16,60	7,64	18,54	15,18	19,93	50,80

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,61	4,13	-0,05	0,10	9,93	-14,78	3,18	51,70	56,69

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,26	3,50	0,61	1,38	5,19	12,73	24,28	28,17	31,88
INPC	0,11	2,91	0,22	1,01	4,51	12,02	24,10	28,93	32,69
IGPM	0,37	-4,93	-0,49	-5,12	-5,97	1,79	27,09	49,89	54,94
SELIC	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	6,57	1,62	3,37	9,36	21,89	39,73	49,87	60,35
IPCA + 5,00%	0,65	7,34	1,87	3,86	10,40	24,23	43,78	55,70	68,19
IPCA + 5,50%	0,69	7,72	1,99	4,10	10,92	25,41	45,84	58,68	72,22
IPCA + 5,89%	0,72	8,01	2,08	4,30	11,33	26,34	47,45	61,03	75,41
IPCA + 6,00%	0,72	8,10	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91	61,70	76,32
INPC + 4,00%	0,42	5,97	1,22	3,00	8,65	21,12	39,53	50,75	61,34
INPC + 6,00%	0,57	7,49	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70	62,65	77,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
137	01/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.236.744,61	1.231.486,82569066	2,6283225630
138	05/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.435.947,53	0,00	925.990,64945140	2,6306394470
139	06/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.041.319,07	0,00	775.630,02116220	2,6318206030
140	08/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	139.273,07	0,00	52.895,26379985	2,6329969830
141	11/09/2023	FIC PRATICO CP	150,00	0,00	20.83700007	7,1987330000
142	14/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.854,11	0,00	702.93610285	2,6376650630
143	21/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.270,00	480,41395359	2,6435535240
144	21/09/2023	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	161.535,59	0,00	69.001,41791234	2,3410474000
145	22/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.846,02	2.210,39060232	2,6447904700
146	22/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.788,78	676,34091256	2,6447904700
147	25/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.000,00	377,93749880	2,6459401440
148	26/09/2023	FIC PRATICO CP	255,70	0,00	35,37173871	7,2289350000
149	26/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	32.156,47	0,00	12.147,84046209	2,6470935390
150	28/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.246.790,81	1.225.469,22592898	2,6494266370
151	29/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	10,35	0,00	3,90470726	2,6506468500
Total			4.812.501,89	6.493.440,22		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 570.837,73 Value-At-Risk: 0,48%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,46	0,28		0,20	-0,13	0,91	107.122.449,39	90,53
Artigo 8º	17,52	7,63		0,26	-0,12	-1,06	4.672.963,11	3,95
Artigo 9º	11,78	6,21		-0,00	-0,37	-3,36	348.773,50	0,29
Artigo 10º	1,56	0,64		0,03	-0,32	0,47	6.187.812,22	5,23
UMUARAMA		0,48		0,48			118.331.998,22	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,28%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SICREDI - FI RF LIQUIDEZ EMPRESARIAL REFERENCIADO DI	0,04	0,02	0,00	0,02	0,44	0,99	21.106.810,56	17,84
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,30	0,59	0,04	0,60	-0,32	0,88	13.299.528,65	11,24
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,70	0,49	0,02	0,49	0,19	1,11	8.953.718,87	7,57
FI CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,70	0,46	0,02	0,46	0,19	1,11	8.693.402,09	7,35
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,35	0,97	0,00	0,02	-0,35	0,15	392.760,59	0,33
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,39	1,29	0,05	1,30	-0,38	-0,30	5.301.735,23	4,48
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,26	0,86	0,02	0,87	-0,45	0,40	4.469.238,69	3,78
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,70	0,47	0,04	0,48	0,18	1,10	21.083.043,35	17,82
Sub-total	0,58	0,35	0,19		-0,12	0,91	83.300.238,03	70,40

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC PRATICO CP	0,01	0,01	0,00	0,01	-17,32	0,76	34.823,36	0,03
SICREDI - FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO TAXA SELIC	0,04	0,02	0,00	0,02	0,26	0,98	11.159.042,93	9,43
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,01	0,00	0,01	-4,74	0,90	5.188.042,93	4,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,22	0,15	0,01	0,04	-0,21	0,93	7.440.302,14	6,29
Sub-total	0,06	0,05	0,01		-0,52	0,94	23.822.211,36	20,13

Investimentos Estruturados	Value-At-Risk: 0,64%
----------------------------	----------------------

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	1,14	0,45	0,00	0,45	-0,12	0,83	11.134,31	0,01
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	1,56	0,64	0,03	0,64	-0,32	0,47	6.176.677,91	5,22
Sub-total	1,56	0,64	0,03		-0,32	0,47	6.187.812,22	5,23

Renda Variável	Value-At-Risk: 7,63%
----------------	----------------------

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	16,02	6,93	0,09	0,84	-0,03	0,47	1.909.757,51	1,61
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	21,32	10,04	0,08	0,92	-0,22	-3,69	1.128.964,97	0,95
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	19,77	9,02	0,05	2,96	-0,17	-2,47	713.974,21	0,60
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	16,26	6,98	0,05	1,08	-0,04	0,26	920.266,42	0,78
Sub-total	17,52	7,63	0,26		-0,12	-1,06	4.672.963,11	3,95

Investimentos no Exterior	Value-At-Risk: 6,21%
---------------------------	----------------------

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	11,78	6,21	-0,00	9,90	-0,37	-3,36	348.773,50	0,29
Sub-total	11,78	6,21	-0,00		-0,37	-3,36	348.773,50	0,29

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

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

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

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

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS