



**LDB**  
EMPRESAS

**RUBINÉIA**  
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

RENDA FIXA

100,00%

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 TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI            | 1,86                | 0,16              | 1,09        | 8,79        | 376.051,99           | 0,96         | 188.464.404,15   | 0,20    |
| BB                                     | BB       | BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI       | 1,87                | 0,16              | 1,10        | 8,82        | 2.479.809,46         | 6,34         | 3.520.695.315,59 | 0,07    |
| BRAM                                   | BRADESCO | BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS            | 0,36                | 0,05              | 0,91        | 9,91        | 3.201.144,44         | 8,18         | 697.408.847,56   | 0,46    |
| BRAM                                   | BRADESCO | BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB | 4,95                | 0,51              | -0,97       | 0,46        | 446.018,23           | 1,14         | 559.428.321,06   | 0,08    |
| CAIXA DTVM                             | CEF      | FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP     | 2,19                | 0,22              | 0,11        | 8,79        | 5.153.487,50         | 13,17        | 8.162.684.334,70 | 0,06    |
| CAIXA DTVM                             | CEF      | FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP       | 4,96                | 0,51              | -0,96       | 10,65       | 6.633.675,99         | 16,95        | 5.222.821.325,49 | 0,13    |
| CAIXA DTVM                             | CEF      | FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP   | 2,36                | 0,26              | 0,15        | 10,54       | 2.664.818,53         | 6,81         | 594.550.248,64   | 0,45    |
| CAIXA DTVM                             | CEF      | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF        | 0,36                | 0,06              | 0,91        | 9,91        | 52.081,73            | 0,13         | 7.513.988.203,57 | 0,00    |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b> |          |  | <b>2,63</b>         | <b>0,29</b>       | <b>0,01</b> | <b>9,74</b> | <b>21.007.087,87</b> | <b>53,69</b> |                  |         |

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          |                      |              |                   |         |
| BRAM                                     | BRADESCO | BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM        | 0,07                | 0,05              | 1,05         | 10,30        | 4.415.850,95         | 11,29        | 8.906.699.435,49  | 0,05    |
| BRAM                                     | BRADESCO | BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B      | 4,99                | 0,53              | -1,13        | 10,65        | 7.297.036,19         | 18,65        | 569.383.114,96    | 1,28    |
| CAIXA DTVM                               | CEF      | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,06                | 0,05              | 1,03         | 10,09        | 1.632.720,55         | 4,17         | 14.368.447.188,06 | 0,01    |
| CAIXA DTVM                               | CEF      | FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP      | 5,09                | 0,52              | -1,00        | 10,71        | 4.743.500,11         | 12,12        | 1.357.142.226,13  | 0,35    |
| <b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b> |          |   | <b>3,15</b>         | <b>0,37</b>       | <b>-0,36</b> | <b>10,39</b> | <b>18.089.107,80</b> | <b>46,23</b> |                   |         |

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   |             |            |               |         |
| PETRA  | FINAXIS | FIDC PREMIUM | 13,62               | -0,46             | -0,46 | -9,25 | 29.486,65   | 0,08       | 31.280.700,45 | 0,09    |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor | Admin. | Ativo                                  | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |              |              | Valor (R\$)      | % Carteira  | PL do Fundo | % Fundo |
|--------|--------|--|------------------------|-------------------|--------------|--------------|------------------|-------------|-------------|---------|
|        |        |  |                        | Dia               | Mês          | Ano          |                  |             |             |         |
|        |        | <b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b> | <b>13,62</b>           | <b>-0,46</b>      | <b>-0,46</b> | <b>-9,25</b> | <b>29.486,65</b> | <b>0,08</b> |             |         |
|        |        | Renda Fixa                             | 2,85                   | 0,32              | -0,16        | 10,02        | 39.125.682,32    | 100,00      |             |         |
|        |        | Total                                  | 2,85                   | 0,32              | -0,16        | 10,02        | 39.125.682,32    | 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 |
| <b>Renda Fixa</b>       |                              |                      |               |                           |          |        |      |              |
| Artigo 7º I, Alínea b   | Fundos 100% Títulos Públicos | 21.007.087,87        | 53,69         | 0,00                      | 54,95    | 100,00 | 0,00 | 100,00       |
| Artigo 7º III, Alínea a | Fundos Renda Fixa            | 18.089.107,80        | 46,23         | 0,00                      | 45,00    | 60,00  | 0,00 | 60,00        |
| Artigo 7º V, Alínea a   | FIDC Cota Sênior             | 29.486,65            | 0,08          | 0,00                      | 0,05     | 5,00   | 0,00 | 5,00         |
|                         | <b>Total Renda Fixa</b>      | <b>39.125.682,32</b> | <b>100,00</b> |                           |          |        |      | 100,00       |
| <b>Total</b>            |                              | <b>39.125.682,32</b> | <b>100,00</b> |                           |          |        |      |              |

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<br>% do CDI   | 0,01<br>0,84    | 9,74<br>98,09   | 1,32<br>41,09   | 5,63<br>87,04    | 11,64<br>86,58 | 1.717,62          | 1.835.817,08        |
| Artigo 7º III, Alínea a<br>% do CDI | -0,36<br>-37,03 | 10,39<br>104,70 | 0,77<br>24,02   | 6,50<br>100,55   | 11,72<br>87,21 | -63.168,03        | 1.656.875,35        |
| Artigo 7º V, Alínea a<br>% do CDI   | -0,46<br>-47,08 | -9,25<br>-93,18 | -1,37<br>-42,57 | -8,75<br>-135,35 | 0,98<br>7,31   | -135,94           | -3.005,80           |
| <b>RUBINÉIA (Total)</b>             |                 |                 |                 |                  |                | <b>-61.586,35</b> | <b>3.489.686,63</b> |

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 TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI            | 371.980,09     | 0,00       | 0,00      | 0,00        | 376.051,99    | 4.071,90                    | 31.395,93                   |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI       | 2.452.868,82   | 0,00       | 0,00      | 0,00        | 2.479.809,46  | 26.940,64                   | 198.543,04                  |
| BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS            | 3.181.831,62   | 0,00       | -9.710,97 | 0,00        | 3.201.144,44  | 29.023,79                   | 290.271,41                  |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB | 450.399,64     | 0,00       | 0,00      | 0,00        | 446.018,23    | -4.381,41                   | 2.053,90                    |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP     | 5.147.726,56   | 0,00       | 0,00      | 0,00        | 5.153.487,50  | 5.760,94                    | 416.326,74                  |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP       | 6.697.778,29   | 0,00       | 0,00      | 0,00        | 6.633.675,99  | -64.102,30                  | 638.516,64                  |
| FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP   | 2.660.883,74   | 0,00       | 0,00      | 0,00        | 2.664.818,53  | 3.934,79                    | 254.011,40                  |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF        | 51.612,46      | 0,00       | 0,00      | 0,00        | 52.081,73     | 469,27                      | 4.698,02                    |
|  | 21.015.081,22  | 0,00       | -9.710,97 | 0,00        | 21.007.087,87 | 1.717,62                    |                             |

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

| Ativo   | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates   | Amortização | Saldo         | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|------------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM        | 4.369.992,41   | 0,00       | 0,00       | 0,00        | 4.415.850,95  | 45.858,54                   | 397.884,81                  |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B      | 7.044.500,42   | 330.638,84 | 0,00       | 0,00        | 7.297.036,19  | -78.103,07                  | 620.622,81                  |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 1.648.627,27   | 0,00       | -32.655,46 | 0,00        | 1.632.720,55  | 16.748,74                   | 217.259,55                  |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP      | 4.791.172,35   | 0,00       | 0,00       | 0,00        | 4.743.500,11  | -47.672,24                  | 421.108,18                  |
|   | 17.854.292,45  | 330.638,84 | -32.655,46 | 0,00        | 18.089.107,80 | -63.168,03                  |                             |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

| Ativo        | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo     | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>Financ. Ano (R\$) |
|--------------|----------------|------------|----------|-------------|-----------|--------------------------------|--------------------------------|
| FIDC PREMIUM | 29.622,59      | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 29.486,65 | -135,94                        | -3.005,80                      |
|              | 29.622,59      | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 29.486,65 | -135,94                        |                                |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

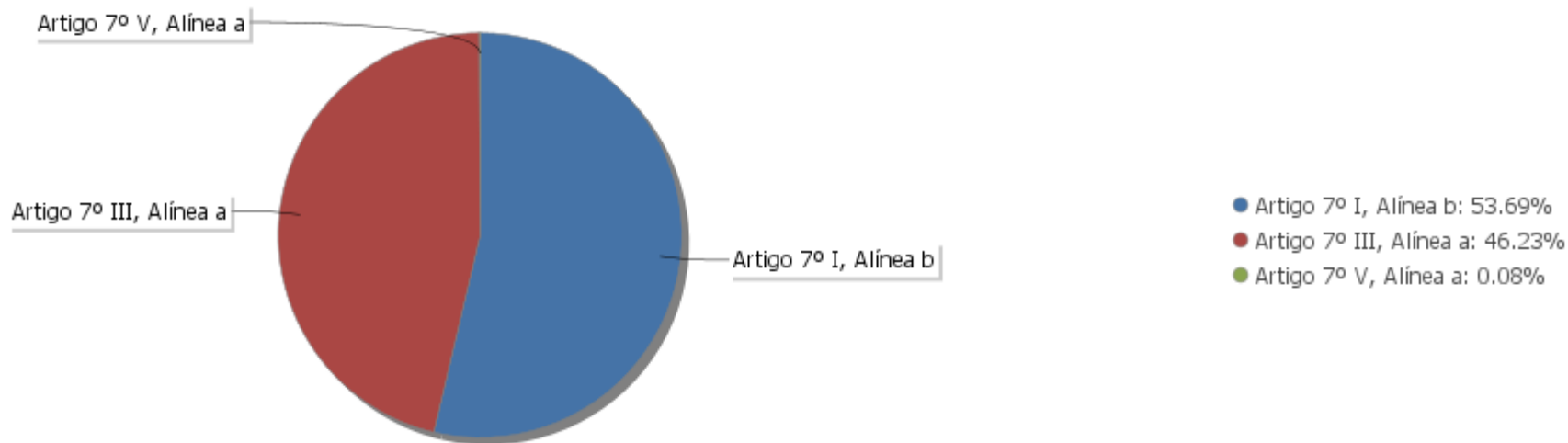
## Análise de Liquidez

| Período               | Valor (R\$)   | (%)   | (%) Limite Mínimo P.I. | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. | (%) Limite Mínimo Acum. |
|-----------------------|---------------|-------|------------------------|-----------------------|-----------|-------------------------|
| de 0 a 30 dias        | 36.269.820,87 | 92,70 |                        | 36.269.820,87         | 92,70     |                         |
| de 31 dias a 365 dias | 2.855.861,45  | 7,30  |                        | 39.125.682,32         | 100,00    |                         |
| acima de 365 dias     | 0,00          | 0,00  |                        | 39.125.682,32         | 100,00    |                         |

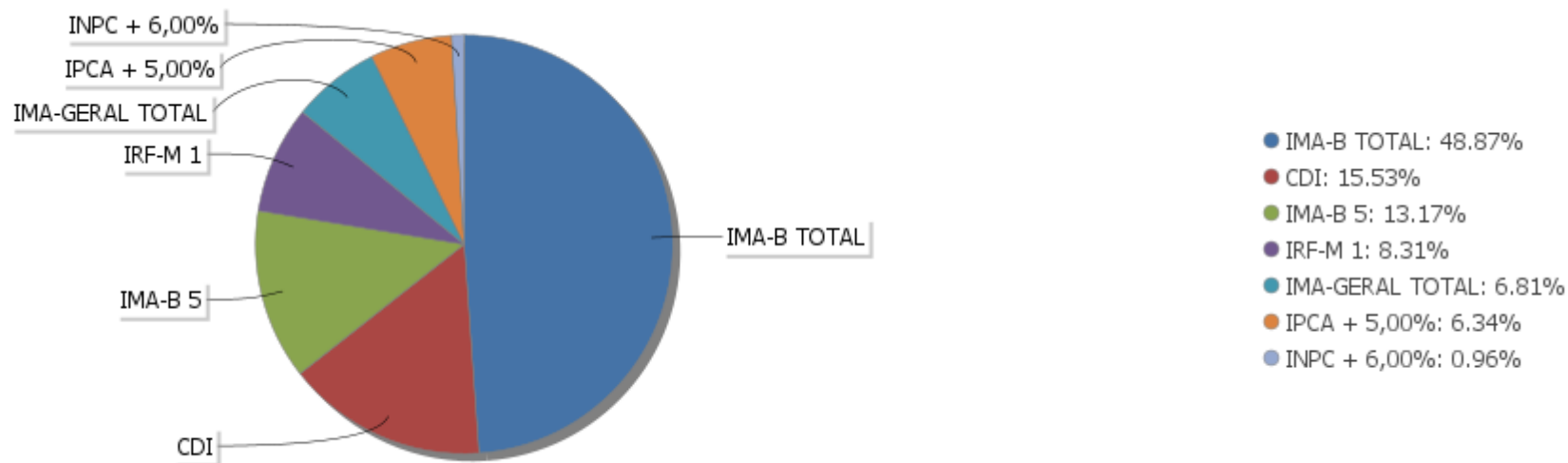


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

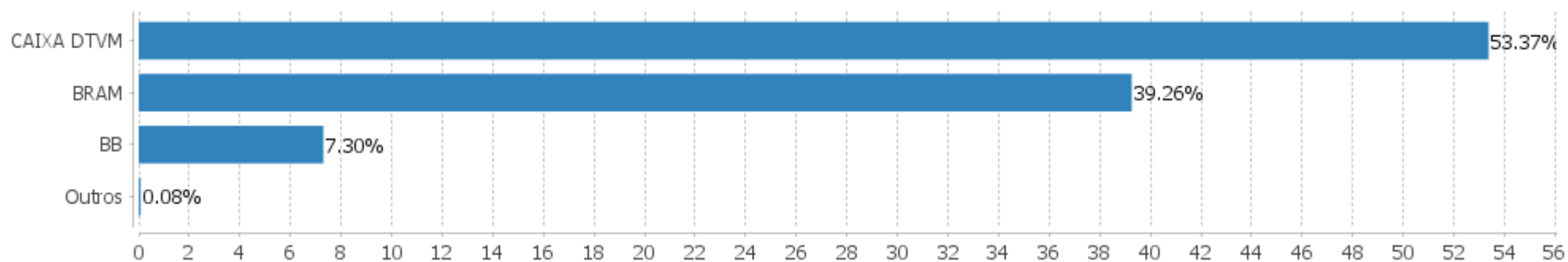


Alocação Por Estratégia



## 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           | 0,62  | 1,16  | 1,95  | 1,39  | 1,70  | 1,73  | 0,93  | 0,30  | -0,16 |       |       |       | 10,02     |
| IPCA + 4,94%   | 0,95  | 1,19  | 1,15  | 0,96  | 0,65  | 0,32  | 0,52  | 0,67  | 0,64  |       |       |       | 7,29      |
| p.p. indexador | -0,34 | -0,03 | 0,80  | 0,44  | 1,04  | 1,40  | 0,41  | -0,37 | -0,81 |       |       |       | 2,73      |
| 2022           | -0,14 | 0,70  | 2,25  | 0,89  | 0,81  | 0,17  | -0,11 | 0,96  | 1,16  | 1,27  | -0,23 | 0,46  | 8,47      |
| IPCA + 4,83%   | 0,94  | 1,37  | 2,04  | 1,42  | 0,88  | 1,07  | -0,29 | 0,07  | 0,10  | 0,97  | 0,79  | 1,04  | 10,87     |
| p.p. indexador | -1,07 | -0,67 | 0,21  | -0,53 | -0,08 | -0,90 | 0,18  | 0,89  | 1,06  | 0,30  | -1,02 | -0,57 | -2,40     |
| 2021           | -0,44 | -0,98 | -0,26 | 0,57  | 0,71  | 0,29  | -0,12 | -0,47 | 0,19  | -1,58 | 2,38  | 0,51  | 0,75      |
| IPCA + 5,40%   | 0,67  | 1,24  | 1,42  | 0,73  | 1,27  | 0,97  | 1,42  | 1,33  | 1,60  | 1,67  | 1,37  | 1,21  | 15,98     |
| p.p. indexador | -1,10 | -2,22 | -1,68 | -0,16 | -0,56 | -0,68 | -1,55 | -1,81 | -1,41 | -3,25 | 1,00  | -0,71 | -15,23    |
| 2020           | 0,37  | 0,42  | -3,29 | 0,75  | 1,20  | 1,19  | 2,17  | -0,73 | -0,79 | 0,15  | 1,23  | 2,85  | 5,51      |
| IPCA + 5,87%   | 0,71  | 0,66  | 0,57  | 0,14  | 0,07  | 0,74  | 0,88  | 0,72  | 1,12  | 1,34  | 1,35  | 1,86  | 10,63     |
| p.p. indexador | -0,34 | -0,24 | -3,86 | 0,61  | 1,13  | 0,45  | 1,29  | -1,45 | -1,91 | -1,19 | -0,11 | 0,99  | -5,12     |
| 2019           | 1,39  | 0,47  | 0,53  | 0,80  | 1,47  | 1,89  | 0,91  | 0,06  | 1,64  | 1,87  | -0,97 | 1,18  | 11,80     |
| IPCA + 6,00%   | 0,83  | 0,90  | 1,19  | 1,06  | 0,64  | 0,45  | 0,72  | 0,62  | 0,45  | 0,63  | 0,98  | 1,64  | 10,59     |
| p.p. indexador | 0,56  | -0,42 | -0,66 | -0,26 | 0,83  | 1,44  | 0,18  | -0,56 | 1,20  | 1,23  | -1,95 | -0,46 | 1,21      |
| 2018           | 1,17  | 0,55  | 0,82  | 0,39  | -0,54 | 0,40  | 1,45  | 0,10  | 0,52  | 2,34  | 0,52  | 0,91  | 8,94      |
| IPCA + 6,00%   | 0,80  | 0,74  | 0,58  | 0,71  | 0,89  | 1,75  | 0,84  | 0,44  | 0,92  | 0,96  | 0,25  | 0,61  | 9,92      |
| p.p. indexador | 0,37  | -0,19 | 0,24  | -0,32 | -1,43 | -1,35 | 0,61  | -0,34 | -0,40 | 1,38  | 0,27  | 0,29  | -0,98     |

**Performance Sobre a Meta Atuarial**

|                              | Quantidade | Perc. (%) |
|------------------------------|------------|-----------|
| Meses acima - Meta Atuarial  | 28         | 40,58     |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 41         | 59,42     |

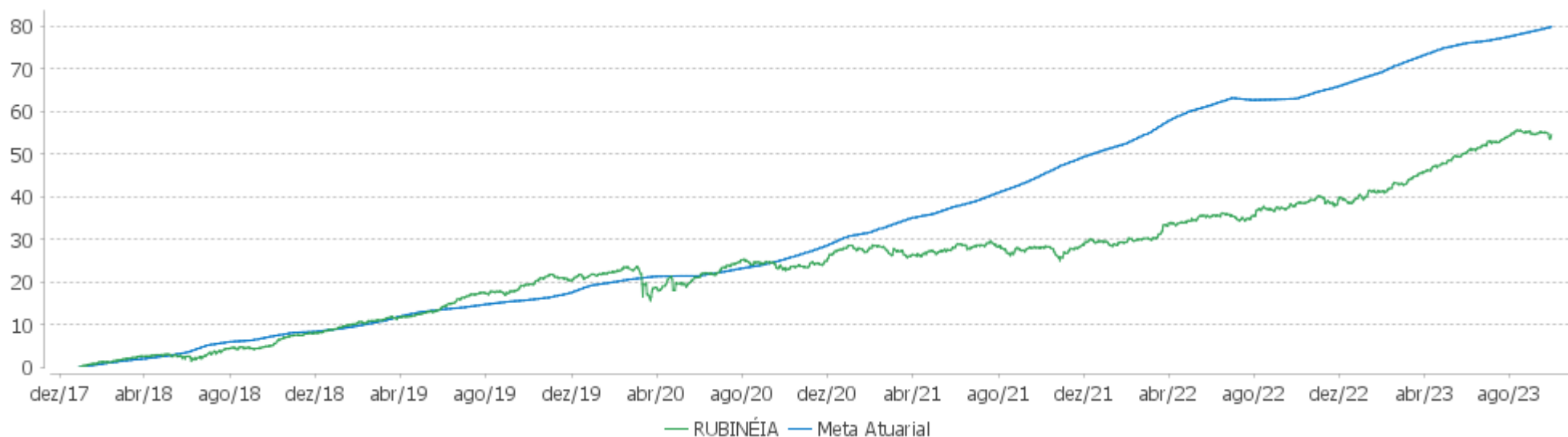
|                                 | Rentabilidade | Mês     |
|---------------------------------|---------------|---------|
| Maior rentabilidade da Carteira | 2,85          | 2020-12 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -3,29         | 2020-03 |

**Relatório**

| Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| 03 meses         | 1,07     | 1,85          | -0,78      | 2,38               |
| 06 meses         | 6,02     | 3,83          | 2,19       | 2,27               |
| 12 meses         | 11,67    | 10,31         | 1,36       | 2,85               |
| 24 meses         | 20,86    | 24,10         | -3,24      | 3,06               |
| 36 meses         | 25,37    | 44,33         | -18,96     | 3,12               |
| 48 meses         | 29,48    | 57,64         | -28,16     | 4,22               |
| 60 meses         | 47,23    | 71,90         | -24,67     | 3,86               |
| Desde 29/12/2017 | 54,52    | 85,54         | -31,02     | 3,75               |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

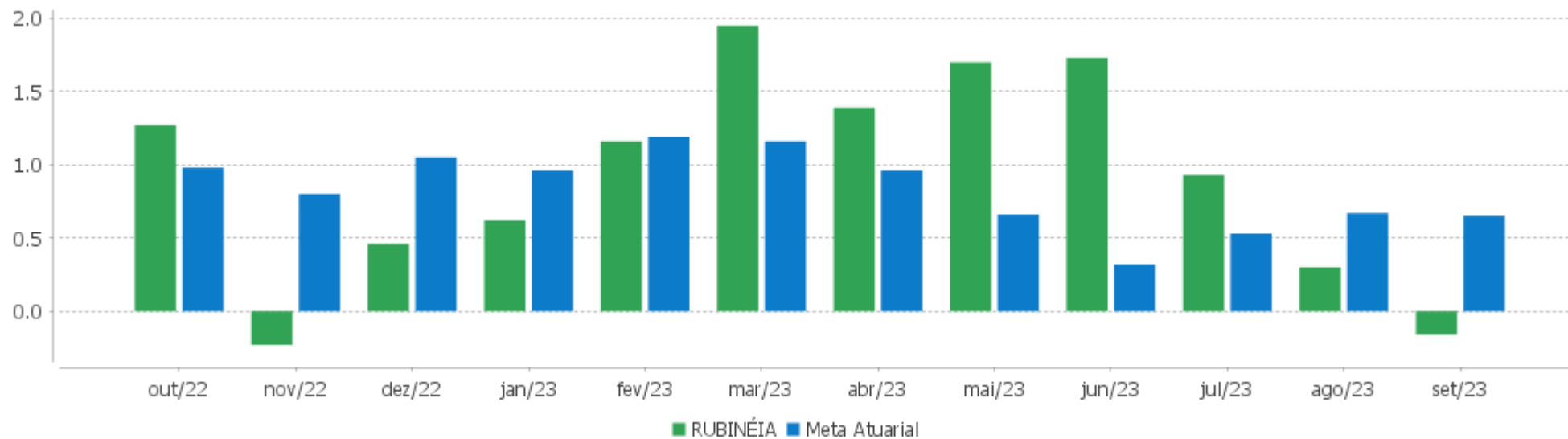


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

| Fundo<br>Variação da Estratégia   | No Mês          | No Ano          | 3 meses         | 6 meses          | 12 meses        | 24 meses          | 36 meses          |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|-------------------|
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.         | -0,96<br>-0,01  | 10,65<br>-0,14  | -0,53<br>-0,01  | 6,49<br>-0,06    | 10,76<br>-0,28  | 18,68<br>-0,41    | 23,96<br>-0,74    |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5 p.p.           | 0,11<br>-0,02   | 8,79<br>-0,10   | 1,67<br>-0,06   | 4,28<br>-0,04    | 11,46<br>-0,19  | 21,66<br>-0,31    | 28,58<br>-0,64    |
| BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS<br>Var. IRF-M 1 p.p.                  | 0,91<br>-0,02   | 9,91<br>-0,16   | 3,13<br>-0,05   | 6,40<br>-0,10    | 13,31<br>-0,23  | 24,18<br>-0,50    | 26,96<br>-0,83    |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI<br>Var. IPCA + 5,00% p.p.        | 1,10<br>0,45    | 8,82<br>1,48    | 3,09<br>1,23    | 4,57<br>0,71     | 11,76<br>1,36   |                   |                   |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IRF-M 1 p.p.              | 0,91<br>-0,02   | 9,91<br>-0,15   | 3,12<br>-0,05   | 6,37<br>-0,13    | 13,31<br>-0,22  | 24,16<br>-0,52    | 26,95<br>-0,84    |
| FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-GERAL TOTAL p.p. | 0,15<br>-0,03   | 10,54<br>-0,05  | 1,67<br>-0,13   | 6,69<br>-0,02    | 12,49<br>-0,01  | 22,56<br>-0,34    | 24,83<br>-1,11    |
| BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI<br>Var. INPC + 6,00% p.p.             | 1,09<br>0,52    | 8,79<br>1,31    | 3,08<br>1,37    | 4,56<br>0,59     | 11,73<br>1,00   | 22,62<br>-3,19    | 31,02<br>-16,69   |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.   | -0,97<br>-0,03  | 10,54<br>-0,25  | -0,60<br>-0,08  | 6,39<br>-0,16    | 10,71<br>-0,34  | 18,31<br>-0,78    | 23,45<br>-1,25    |
| FIDC PREMIUM<br>% do CDI  | -0,46<br>-47,08 | -9,25<br>-93,18 | -1,37<br>-42,57 | -8,75<br>-135,35 | 0,98<br>7,31    | -59,73<br>-231,48 | -61,87<br>-209,24 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.             | -1,13<br>-0,19  | 10,65<br>-0,14  | -0,74<br>-0,22  | 6,40<br>-0,15    | 10,68<br>-0,36  | 18,20<br>-0,89    | 22,69<br>-2,01    |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM<br>% do CDI                            | 1,05<br>107,67  | 10,30<br>103,80 | 3,54<br>109,96  | 6,88<br>106,36   | 13,98<br>104,03 | 27,19<br>105,36   | 31,34<br>105,99   |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.             | -1,00<br>-0,05  | 10,71<br>-0,08  | -0,52<br>-0,00  | 6,60<br>0,05     | 10,65<br>-0,40  | 18,53<br>-0,56    | 23,83<br>-0,87    |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP<br>% do CDI                     | 1,03<br>105,29  | 10,09<br>101,61 | 3,44<br>106,94  | 6,80<br>105,20   | 13,67<br>101,69 | 26,38<br>102,24   | 30,56<br>103,37   |
| RUBINÉIA<br>Var. IPCA + 4,97% p.p.  | -0,16<br>-0,81  | 10,02<br>2,73   | 1,07<br>-0,78   | 6,02<br>2,19     | 11,67<br>1,33   | 20,86<br>-3,23    | 25,37<br>-18,17   |
| 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 PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI            | D+0           | D+0           | D+0       | D+0        |             | 0,20          |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI       |               |               | D+0       | D+0        |             |               |
| BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS            | D+0           | D+0           | D+0       | D+0        |             | 0,20          |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM             | D+0           | D+0           | D+0       | D+0        |             | 0,20          |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B           | D+0           | D+0           | D+1 du    | D+1 du     |             | 0,20          |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB | D+0           | D+0           | D+1 du    | D+1 du     |             | 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 IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP       | D+0           | D+0           | D+0       | D+0        |             | 0,20          |
| FI CAIXA BRASIL IMA GERAL 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 CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP      | D+0           | D+0           | D+0       | D+0        |             | 0,20          |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP           | D+0           | D+0           | D+0       | D+0        |             | 0,20          |
| FIDC PREMIUM                                       | 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         | 0,93   | 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   |
|--------------|------------|---|-------------------|------------------|-----------------|--------------|
| 70           | 01/09/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00              | 17.070,88        | 3.553,25613014  | 4,8042920000 |
| 69           | 04/09/2023 | BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS       | 0,00              | 9.710,97         | 3.014,51647360  | 3,2214022000 |
| 71           | 04/09/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00              | 100,00           | 20,80426371     | 4,8067070000 |
| 72           | 19/09/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00              | 550,00           | 113,83604712    | 4,8315100000 |
| 73           | 25/09/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00              | 130,53           | 26,96090885     | 4,8414540000 |
| 68           | 28/09/2023 | BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B      | 330.638,84        | 0,00             | 56.453,53657300 | 5,8568313000 |
| 74           | 29/09/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00              | 14.254,00        | 2.938,15910954  | 4,8513370000 |
| 75           | 29/09/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00              | 550,05           | 113,38111535    | 4,8513370000 |
| <b>Total</b> |            |   | <b>330.638,84</b> | <b>42.366,43</b> |                 |              |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 413.275,68

Value-At-Risk: 1,06%

|           | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | Limite <sup>(5)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|-----------|-----------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| Artigo 7º | 3,06                        | 1,06               |                       | 1,06                | -0,37  | -0,16 | 39.125.682,32 | 100,00     |
| RUBINÉIA  |                             | 1,06               |                       | 1,06                |        |       | 39.125.682,32 | 100,00     |

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,06%

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo  | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI            | 0,70                        | 0,47               | 0,00                | 0,49                | 0,17   | 1,09  | 376.051,99    | 0,96       |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI       | 0,70                        | 0,47               | 0,01                | 0,48                | 0,18   | 1,10  | 2.479.809,46  | 6,34       |
| BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS            | 0,13                        | 0,13               | 0,00                | 0,01                | -0,47  | 0,91  | 3.201.144,44  | 8,18       |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB | 5,35                        | 1,85               | 0,02                | 0,00                | -0,36  | -0,97 | 446.018,23    | 1,14       |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP     | 2,07                        | 0,78               | 0,09                | 0,03                | -0,42  | 0,11  | 5.153.487,50  | 13,17      |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP       | 5,31                        | 1,83               | 0,31                | 0,04                | -0,36  | -0,96 | 6.633.675,99  | 16,95      |
| FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP   | 2,18                        | 0,86               | 0,06                | 0,04                | -0,38  | 0,15  | 2.664.818,53  | 6,81       |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF        | 0,15                        | 0,13               | 0,00                | 0,01                | -0,44  | 0,91  | 52.081,73     | 0,13       |
| <b>Sub-total</b>                                   | 2,60                        | 0,92               | 0,49                |                     | -0,37  | 0,01  | 21.007.087,87 | 53,69      |

Artigo 7º III, Alínea a

| Ativo   | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM        | 0,07                        | 0,02               | -0,00               | 0,02                | 1,04   | 1,05  | 4.415.850,95  | 11,29      |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B      | 5,43                        | 1,84               | 0,34                | 0,13                | -0,39  | -1,13 | 7.297.036,19  | 18,65      |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,03                        | 0,02               | 0,00                | 0,02                | 1,67   | 1,03  | 1.632.720,55  | 4,17       |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP      | 5,46                        | 1,83               | 0,22                | 0,06                | -0,36  | -1,00 | 4.743.500,11  | 12,12      |
| <b>Sub-total</b>                              | 3,59                        | 1,22               | 0,56                |                     | -0,37  | -0,36 | 18.089.107,80 | 46,23      |

Artigo 7º V, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo            | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|------------|------------|
| FIDC PREMIUM     | 1,63                        | 0,40               | -0,00               | 0,40                | -0,88  | -0,46 | 29.486,65  | 0,08       |
| <b>Sub-total</b> | 1,63                        | 0,40               | -0,00               |                     | -0,88  | -0,46 | 29.486,65  | 0,08       |

(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 (%)