



**LDB**  
EMPRESAS

**RUBINÉIA**  
DEZEMBRO 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 29.12.2023.

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            | 1,37                | 0,10              | 0,92        | 11,14        | 384.150,17           | 0,95         | 192.522.932,52   | 0,20    |
| BB                                     | BB       | BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI       | 1,38                | 0,10              | 0,92        | 11,17        | 2.533.384,49         | 6,23         | 3.596.758.160,15 | 0,07    |
| BRAM                                   | BRADESCO | BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS            | 0,35                | 0,04              | 0,90        | 13,00        | 3.291.230,57         | 8,10         | 757.349.589,40   | 0,43    |
| BRAM                                   | BRADESCO | BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB | 4,48                | 0,10              | 2,73        | 5,16         | 466.872,03           | 1,15         | 577.738.512,78   | 0,08    |
| CAIXA DTVM                             | CEF      | FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP     | 1,96                | 0,10              | 1,44        | 11,96        | 5.303.929,87         | 13,05        | 7.603.591.100,02 | 0,07    |
| CAIXA DTVM                             | CEF      | FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP       | 4,45                | 0,10              | 2,73        | 15,86        | 6.945.828,46         | 17,09        | 5.157.397.073,53 | 0,13    |
| CAIXA DTVM                             | CEF      | FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP   | 2,00                | 0,06              | 1,60        | 14,71        | 2.765.458,25         | 6,80         | 629.703.068,32   | 0,44    |
| CAIXA DTVM                             | CEF      | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF        | 0,35                | 0,04              | 0,89        | 13,02        | 53.553,24            | 0,13         | 8.470.280.308,74 | 0,00    |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b> |          |  | <b>2,29</b>         | <b>0,08</b>       | <b>1,74</b> | <b>13,59</b> | <b>21.744.407,08</b> | <b>53,49</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                | 0,04              | 0,94        | 13,63        | 4.548.801,29         | 11,19        | 10.327.922.782,38 | 0,04    |
| BRAM                                     | BRADESCO | BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B      | 4,50                | 0,09              | 2,72        | 15,82        | 7.782.458,55         | 19,15        | 543.399.103,62    | 1,43    |
| CAIXA DTVM                               | CEF      | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,07                | 0,04              | 0,92        | 13,32        | 1.340.349,95         | 3,30         | 13.988.008.512,08 | 0,01    |
| CAIXA DTVM                               | CEF      | FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP      | 4,58                | 0,09              | 2,77        | 15,98        | 5.204.805,71         | 12,80        | 1.298.723.695,54  | 0,40    |
| <b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b> |          |   | <b>2,89</b>         | <b>0,08</b>       | <b>2,15</b> | <b>14,99</b> | <b>18.876.415,50</b> | <b>46,44</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 | 8,62                | -0,49             | -0,49 | -14,39 | 27.817,87   | 0,07       | 29.510.379,86 | 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>8,62</b>            | <b>-0,49</b>      | <b>-0,49</b> | <b>-14,39</b> | <b>27.817,87</b> | <b>0,07</b> |             |         |
|        |        | Renda Fixa                             | 2,55                   | 0,08              | 1,93         | 14,21         | 40.648.640,45    | 100,00      |             |         |
|        |        | Total                                  | 2,55                   | 0,08              | 1,93         | 14,20         | 40.648.640,45    | 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 | 21.744.407,08        | 53,49         | 0,00                      | 54,95    | 100,00 | 0,00 | 100,00       |
| Artigo 7º III, Alínea a | Fundos Renda Fixa            | 18.876.415,50        | 46,44         | 0,00                      | 45,00    | 60,00  | 0,00 | 60,00        |
| Artigo 7º V, Alínea a   | FIDC Cota Sênior             | 27.817,87            | 0,07          | 0,00                      | 0,05     | 5,00   | 0,00 | 5,00         |
|                         | <b>Total Renda Fixa</b>      | <b>40.648.640,45</b> | <b>100,00</b> |                           |          |        |      | 100,00       |
| <b>Total</b>            |                              | <b>40.648.640,45</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   | 1,74<br>194,11  | 13,59<br>104,15   | 3,51<br>123,67   | 4,88<br>79,35    | 13,59<br>104,15   | 371.843,37        | 2.573.136,29        |
| Artigo 7º III, Alínea a<br>% do CDI | 2,15<br>240,30  | 14,99<br>114,86   | 4,16<br>146,58   | 4,97<br>80,75    | 14,99<br>114,86   | 402.458,32        | 2.415.972,61        |
| Artigo 7º V, Alínea a<br>% do CDI   | -0,49<br>-54,20 | -14,39<br>-110,26 | -5,66<br>-199,41 | -6,95<br>-113,06 | -14,39<br>-110,26 | -135,80           | -4.674,58           |
| <b>RUBINÉIA (Total)</b>             |                 |                   |                  |                  |                   | <b>774.165,89</b> | <b>4.984.434,32</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            | 380.647,70     | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 384.150,17    | 3.502,47                    | 39.494,11                   |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI       | 2.510.211,29   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 2.533.384,49  | 23.173,20                   | 252.118,07                  |
| BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS            | 3.262.018,58   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 3.291.230,57  | 29.211,99                   | 380.357,54                  |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB | 454.483,85     | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 466.872,03    | 12.388,18                   | 22.907,70                   |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP     | 5.228.713,18   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 5.303.929,87  | 75.216,69                   | 566.769,11                  |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP       | 6.761.470,89   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 6.945.828,46  | 184.357,57                  | 950.669,11                  |
| FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP   | 2.721.935,46   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 2.765.458,25  | 43.522,79                   | 354.651,12                  |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF        | 53.082,76      | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 53.553,24     | 470,48                      | 6.169,53                    |
|  | 21.372.563,71  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 21.744.407,08 | 371.843,37                  |                             |

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        | 4.506.542,67   | 0,00       | 0,00        | 0,00        | 4.548.801,29  | 42.258,62                   | 530.835,15                  |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B      | 7.565.086,02   | 11.687,36  | 0,00        | 0,00        | 7.782.458,55  | 205.685,17                  | 966.547,92                  |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 1.602.597,51   | 2.866,82   | -279.307,70 | 0,00        | 1.340.349,95  | 14.193,32                   | 263.645,25                  |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP      | 5.064.484,50   | 0,00       | 0,00        | 0,00        | 5.204.805,71  | 140.321,21                  | 654.944,29                  |
|   | 18.738.710,70  | 14.554,18  | -279.307,70 | 0,00        | 18.876.415,50 | 402.458,32                  |                             |

## 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 | 27.953,67      | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 27.817,87 | -135,80                        | -4.674,58                      |
|              | 27.953,67      | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 27.817,87 | -135,80                        |                                |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

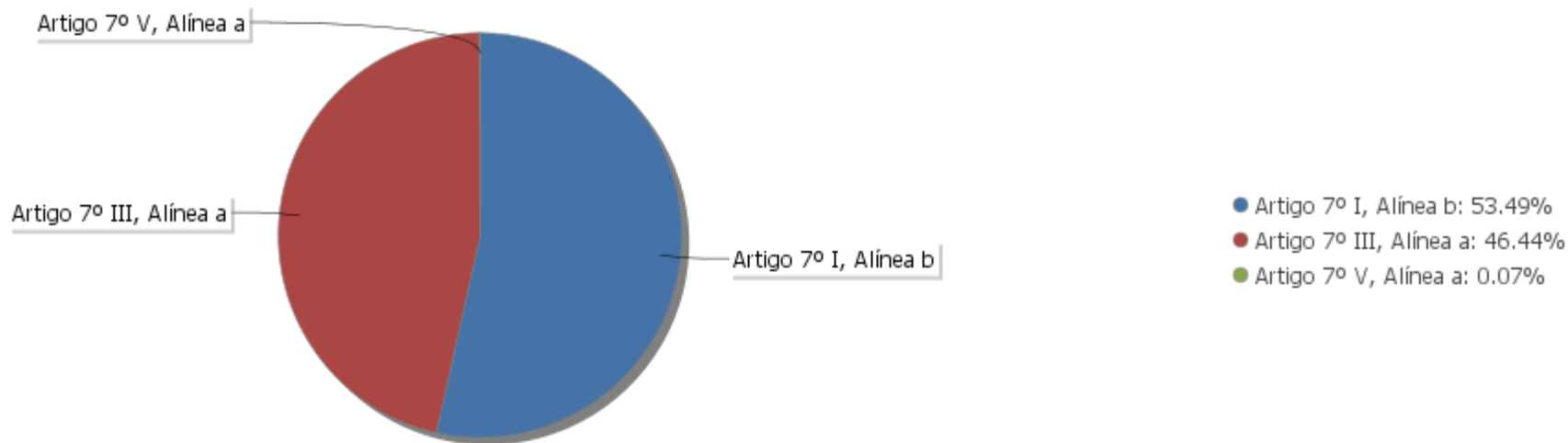
## Análise de Liquidez

| Período               | Valor (R\$)   | (%)   | (%) Limite Mínimo P.I. | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. | (%) Limite Mínimo Acum. |
|-----------------------|---------------|-------|------------------------|-----------------------|-----------|-------------------------|
| de 0 a 30 dias        | 37.731.105,79 | 92,82 |                        | 37.731.105,79         | 92,82     |                         |
| de 31 dias a 365 dias | 2.917.534,66  | 7,18  |                        | 40.648.640,45         | 100,00    |                         |
| acima de 365 dias     | 0,00          | 0,00  |                        | 40.648.640,45         | 100,00    |                         |

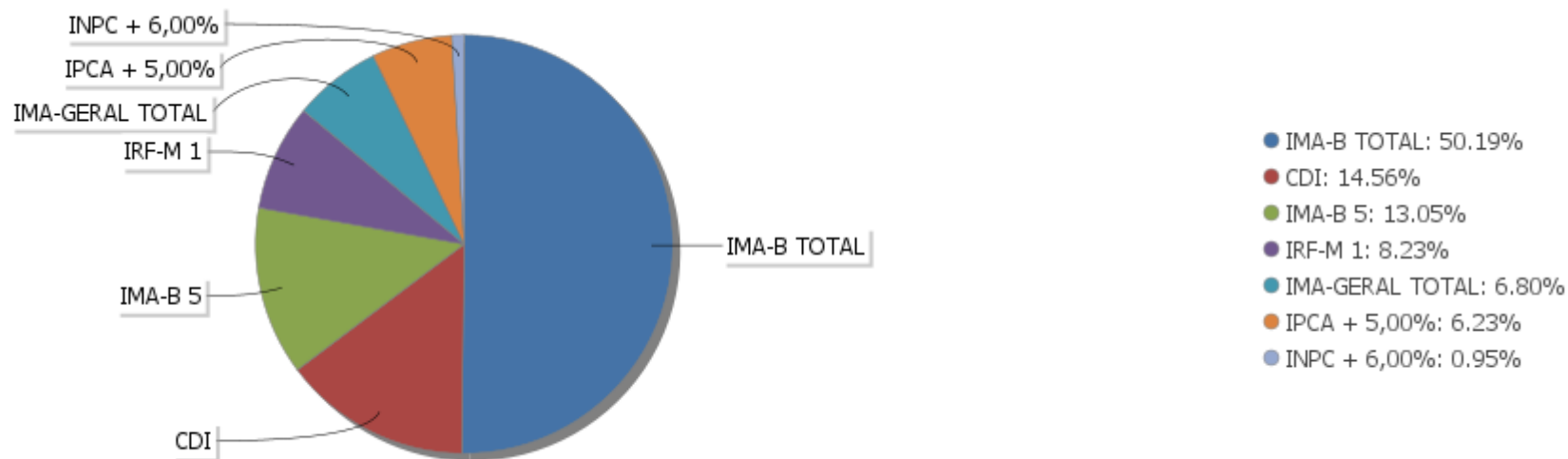


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

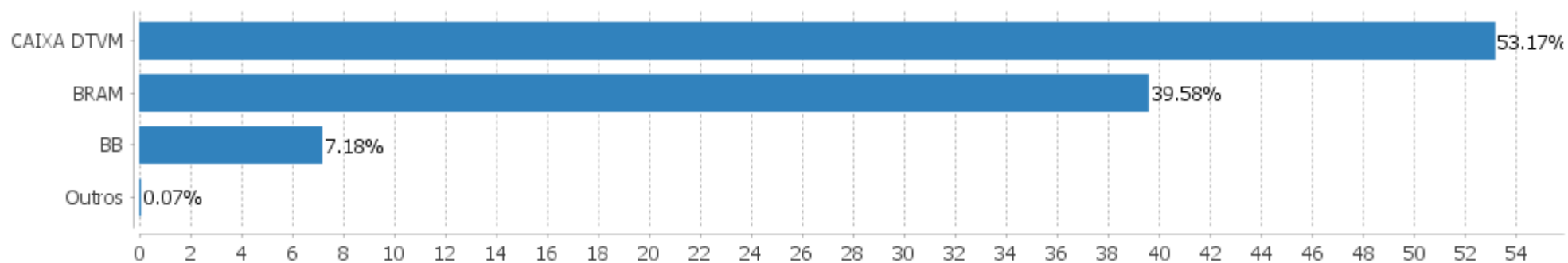


Alocação Por Estratégia



## 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 | -0,06 | 1,90  | 1,93  | 14,20     |
| IPCA + 4,94%   | 0,95  | 1,19  | 1,15  | 0,96  | 0,65  | 0,32  | 0,52  | 0,67  | 0,64  | 0,64  | 0,66  | 0,95  | 9,73      |
| p.p. indexador | -0,34 | -0,03 | 0,80  | 0,44  | 1,04  | 1,40  | 0,41  | -0,37 | -0,81 | -0,71 | 1,24  | 0,99  | 4,48      |
| 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  | 30         | 41,67     |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 42         | 58,33     |

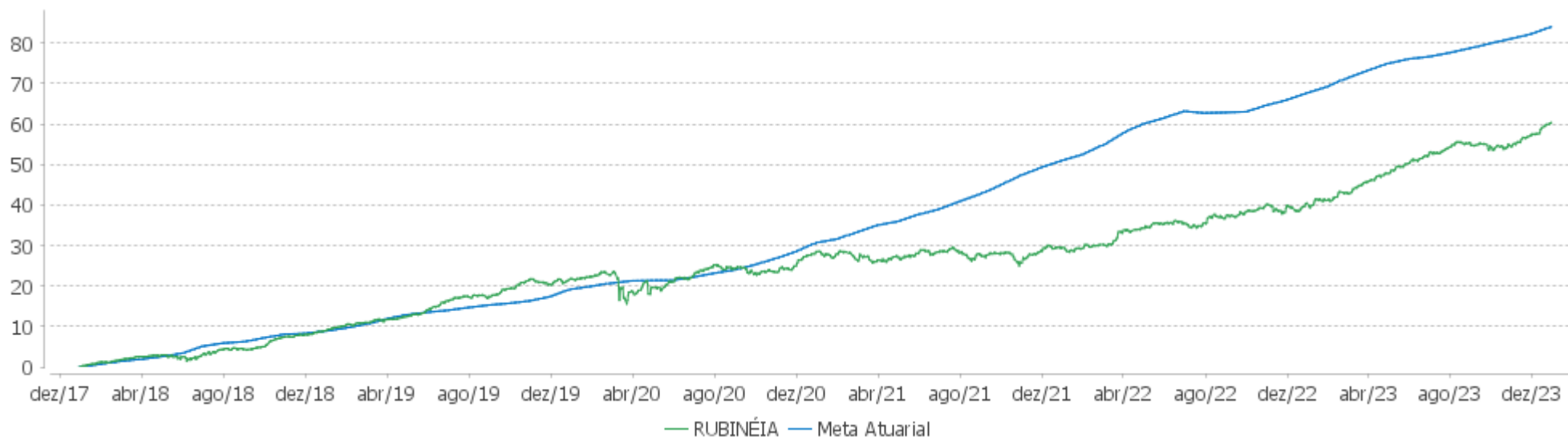
|                                 | Rentabilidade | Mês     |
|---------------------------------|---------------|---------|
| Maior rentabilidade da Carteira | 2,85          | 2020-12 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -3,29         | 2020-03 |

**Relatório**

| Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| 03 meses         | 3,80     | 2,27          | 1,53       | 2,79               |
| 06 meses         | 4,91     | 4,16          | 0,75       | 2,60               |
| 12 meses         | 14,20    | 9,73          | 4,48       | 2,55               |
| 24 meses         | 23,88    | 21,66         | 2,22       | 2,87               |
| 36 meses         | 24,81    | 41,10         | -16,29     | 3,12               |
| 48 meses         | 31,69    | 56,09         | -24,41     | 4,24               |
| 60 meses         | 47,23    | 72,62         | -25,39     | 3,89               |
| Desde 29/12/2017 | 60,40    | 89,75         | -29,35     | 3,72               |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

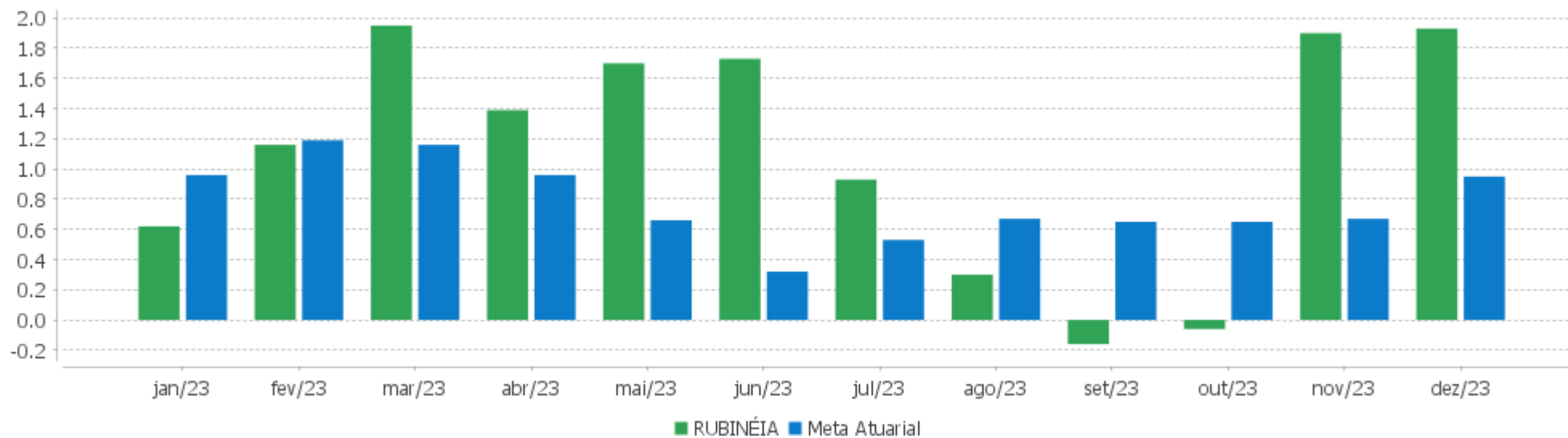


Patrimônio Líquido



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.         | 2,73<br>-0,02   | 15,86<br>-0,20    | 4,71<br>-0,05    | 4,15<br>-0,06    | 15,86<br>-0,20    | 23,03<br>-0,41    | 21,15<br>-0,73    |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5 p.p.           | 1,44<br>-0,02   | 11,96<br>-0,16    | 2,92<br>-0,05    | 4,64<br>-0,11    | 11,96<br>-0,16    | 22,79<br>-0,30    | 28,09<br>-0,63    |
| BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS<br>Var. IRF-M 1 p.p.                  | 0,90<br>-0,02   | 13,00<br>-0,25    | 2,81<br>-0,08    | 6,03<br>-0,13    | 13,00<br>-0,25    | 26,31<br>-0,55    | 29,67<br>-0,91    |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IRF-M 1 p.p.              | 0,89<br>-0,03   | 13,02<br>-0,23    | 2,83<br>-0,07    | 6,04<br>-0,12    | 13,02<br>-0,23    | 26,29<br>-0,57    | 29,70<br>-0,87    |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI<br>Var. IPCA + 5,00% p.p.        | 0,92<br>-0,03   | 11,17<br>1,38     | 2,16<br>-0,12    | 5,32<br>1,13     | 11,17<br>1,38     |                   |                   |
| FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-GERAL TOTAL p.p. | 1,60<br>-0,03   | 14,71<br>-0,09    | 3,78<br>-0,03    | 5,51<br>-0,17    | 14,71<br>-0,09    | 25,52<br>-0,37    | 25,96<br>-1,14    |
| BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI<br>Var. INPC + 6,00% p.p.             | 0,92<br>-0,10   | 11,14<br>1,28     | 2,15<br>-0,05    | 5,30<br>1,35     | 11,14<br>1,28     | 22,94<br>-0,38    | 29,66<br>-14,31   |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.   | 2,73<br>-0,02   | 15,71<br>-0,35    | 4,68<br>-0,08    | 4,05<br>-0,16    | 15,71<br>-0,35    | 22,65<br>-0,79    | 20,66<br>-1,22    |
| FIDC PREMIUM<br>% do CDI  | -0,49<br>-54,20 | -14,39<br>-110,26 | -5,66<br>-199,41 | -6,95<br>-113,06 | -14,39<br>-110,26 | -61,62<br>-227,94 | -63,86<br>-195,78 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.             | 2,72<br>-0,03   | 15,82<br>-0,23    | 4,68<br>-0,08    | 3,91<br>-0,30    | 15,82<br>-0,23    | 22,72<br>-0,73    | 19,85<br>-2,03    |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM<br>% do CDI                            | 0,94<br>104,62  | 13,63<br>104,43   | 3,01<br>106,08   | 6,66<br>108,27   | 13,63<br>104,43   | 28,40<br>105,03   | 34,74<br>106,51   |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.             | 2,77<br>0,02    | 15,98<br>-0,08    | 4,76<br>0,01     | 4,21<br>0,00     | 15,98<br>-0,08    | 22,96<br>-0,49    | 21,12<br>-0,76    |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP<br>% do CDI                     | 0,92<br>103,12  | 13,32<br>102,09   | 2,94<br>103,46   | 6,48<br>105,39   | 13,32<br>102,09   | 27,68<br>102,38   | 33,54<br>102,84   |
| RUBINÉIA<br>Var. IPCA + 4,97% p.p.  | 1,93<br>0,99    | 14,20<br>4,48     | 3,80<br>1,53     | 4,91<br>0,75     | 14,20<br>4,48     | 23,88<br>2,09     | 24,81<br>-15,82   |
| CDI   | 0,90            | 13,05             | 2,84             | 6,15             | 13,05             | 27,03             | 32,62             |
| IBOVESPA  | 5,38            | 22,28             | 15,12            | 13,63            | 22,28             | 28,01             | 12,74             |
| INPC + 6,00%  | 1,02            | 9,85              | 2,20             | 3,95             | 9,85              | 23,32             | 43,97             |
| IPCA + 6,00%  | 1,03            | 10,82             | 2,52             | 4,68             | 10,82             | 24,24             | 44,91             |

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         | 0,91   | 13,25  | 2,89    | 6,16    | 13,25    | 26,86    | 30,57    | 35,59    | 44,75    |
| IRF-M 1+        | 1,73   | 18,52  | 5,05    | 6,37    | 18,52    | 27,30    | 20,95    | 31,18    | 49,86    |
| IRF-M TOTAL     | 1,48   | 16,51  | 4,38    | 6,28    | 16,51    | 26,79    | 24,26    | 32,58    | 48,53    |
| IMA-B 5         | 1,46   | 12,13  | 2,97    | 4,75    | 12,13    | 23,09    | 28,71    | 39,06    | 57,35    |
| IMA-B 5+        | 3,94   | 19,28  | 6,42    | 3,80    | 19,28    | 23,21    | 15,14    | 21,47    | 58,36    |
| IMA-B TOTAL     | 2,75   | 16,05  | 4,76    | 4,21    | 16,05    | 23,45    | 21,89    | 29,69    | 59,46    |
| IMA-GERAL TOTAL | 1,63   | 14,80  | 3,81    | 5,67    | 14,80    | 25,89    | 27,10    | 33,88    | 51,04    |
| IDKA 2          | 1,45   | 12,13  | 2,89    | 5,00    | 12,13    | 22,60    | 28,70    | 39,79    | 56,32    |
| IDKA 20         | 6,58   | 27,13  | 10,28   | 3,92    | 27,13    | 24,70    | 6,62     | 8,97     | 57,20    |
| CDI             | 0,90   | 13,05  | 2,84    | 6,15    | 13,05    | 27,03    | 32,62    | 36,29    | 44,42    |

**Renda Variável**

| Indexador                | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA                 | 5,38   | 22,28  | 15,12   | 13,63   | 22,28    | 28,01    | 12,74    | 16,03    | 52,68    |
| IBRX 100                 | 5,48   | 21,27  | 14,95   | 13,77   | 21,27    | 26,15    | 12,05    | 15,97    | 54,69    |
| IBRX 50                  | 5,31   | 20,06  | 14,43   | 14,39   | 20,06    | 26,93    | 13,55    | 17,66    | 51,96    |
| SMALL CAP                | 7,05   | 17,12  | 11,48   | 3,40    | 17,12    | -0,52    | -16,63   | -17,18   | 31,02    |
| Índice Consumo - ICON    | 5,98   | 6,98   | 12,32   | -1,29   | 6,98     | -20,15   | -40,99   | -40,51   | -7,65    |
| Índice Dividendos - IDIV | 6,90   | 26,84  | 14,61   | 16,04   | 26,84    | 42,88    | 33,72    | 32,38    | 92,17    |



**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   | 2,43   | 15,27  | 7,54    | 7,67    | 15,27    | -13,18   | 18,31    | 77,33    | 137,73   |

**Investimentos Imobiliários**

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IFIX      | 4,25   | 15,50  | 2,86    | 4,95    | 15,50    | 18,06    | 15,37    | 3,56     | 40,82    |

**Investimentos no Exterior**

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| MSCI ACWI | 2,70   | 11,43  | 7,01    | 6,95    | 11,43    | -16,44   | 4,80     | 54,48    | 99,34    |

**Indicadores Econômicos**

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA      | 0,56   | 4,62   | 1,08    | 1,70    | 4,62     | 10,67    | 21,81    | 27,31    | 32,79    |
| INPC      | 0,55   | 3,71   | 0,77    | 0,99    | 3,71     | 9,86     | 21,02    | 27,61    | 33,33    |
| IGPM      | 0,74   | -3,18  | 1,84    | 1,34    | -3,18    | 2,10     | 20,25    | 48,08    | 58,89    |
| SELIC     | 0,90   | 13,05  | 2,84    | 6,15    | 13,05    | 27,03    | 32,62    | 36,29    | 44,42    |

**Meta Atuarial**

| Indexador    | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 0,87   | 8,76   | 2,05    | 3,70    | 8,76     | 19,63    | 36,91    | 48,80    | 61,44    |
| IPCA + 5,00% | 0,95   | 9,79   | 2,28    | 4,19    | 9,79     | 21,92    | 40,87    | 54,57    | 69,32    |
| IPCA + 5,50% | 0,99   | 10,30  | 2,40    | 4,44    | 10,30    | 23,08    | 42,88    | 57,51    | 73,37    |
| IPCA + 5,89% | 1,02   | 10,71  | 2,49    | 4,63    | 10,71    | 23,98    | 44,46    | 59,84    | 76,59    |
| IPCA + 6,00% | 1,03   | 10,82  | 2,52    | 4,68    | 10,82    | 24,24    | 44,91    | 60,50    | 77,50    |
| INPC + 4,00% | 0,86   | 7,80   | 1,73    | 2,98    | 7,80     | 18,75    | 36,03    | 49,15    | 62,09    |
| INPC + 6,00% | 1,02   | 9,85   | 2,20    | 3,95    | 9,85     | 23,32    | 43,97    | 60,89    | 78,22    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

| APR          | Data       | Ativo   | Aplicação        | Resgate           | Quantidade      | Valor Cota   |
|--------------|------------|---|------------------|-------------------|-----------------|--------------|
| 91           | 07/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00             | 2.866,82          | 577,98756800    | 4,9600030000 |
| 92           | 07/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00             | 2.866,82          | 577,98756900    | 4,9600030000 |
| 90           | 08/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 2.866,82         | 0,00              | 577,71174300    | 4,9623710000 |
| 88           | 20/12/2023 | BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B       | 11.687,36        | 0,00              | 1.908,41194790  | 6,1241285000 |
| 89           | 21/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00             | 258.019,63        | 51.781,23621600 | 4,9828790000 |
| 93           | 21/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00             | 15.548,00         | 3.120,28454400  | 4,9828790000 |
| 94           | 22/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00             | 6,43              | 1,28984500      | 4,9850880000 |
| <b>Total</b> |            |   | <b>14.554,18</b> | <b>279.307,70</b> |                 |              |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 573.487,50

Value-At-Risk: 1,41%

|           | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | Limite <sup>(5)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|-----------|-----------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| Artigo 7º | 1,71                        | 1,41               |                       | 1,41                | 0,60   | 1,93  | 40.648.640,45 | 100,00     |
| RUBINÉIA  |                             | 1,41               |                       | 1,41                |        |       | 40.648.640,45 | 100,00     |

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,41%

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                        | 0,36               | 0,00                | 0,36                | 0,03   | 0,92  | 384.150,17    | 0,95       |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI       | 0,71                        | 0,36               | 0,01                | 0,36                | 0,04   | 0,92  | 2.533.384,49  | 6,23       |
| BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS            | 0,09                        | 0,09               | 0,00                | 0,01                | -0,01  | 0,90  | 3.291.230,57  | 8,10       |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB | 3,04                        | 2,23               | 0,03                | 0,00                | 0,60   | 2,73  | 466.872,03    | 1,15       |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP     | 1,02                        | 1,24               | 0,15                | 0,01                | 0,53   | 1,44  | 5.303.929,87  | 13,05      |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP       | 3,02                        | 2,20               | 0,37                | 0,03                | 0,61   | 2,73  | 6.945.828,46  | 17,09      |
| FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP   | 1,22                        | 1,05               | 0,07                | 0,03                | 0,58   | 1,60  | 2.765.458,25  | 6,80       |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF        | 0,06                        | 0,09               | 0,00                | 0,02                | -0,16  | 0,89  | 53.553,24     | 0,13       |
| <b>Sub-total</b>                                   | 1,40                        | 1,19               | 0,64                |                     | 0,60   | 1,74  | 21.744.407,08 | 53,49      |

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        | 0,03                        | 0,03               | -0,00               | 0,02                | 1,38   | 0,94  | 4.548.801,29  | 11,19      |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B      | 3,03                        | 2,56               | 0,49                | 0,44                | 0,60   | 2,72  | 7.782.458,55  | 19,15      |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,04                        | 0,03               | -0,00               | 0,02                | 0,67   | 0,92  | 1.340.349,95  | 3,30       |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP      | 3,11                        | 2,26               | 0,29                | 0,07                | 0,60   | 2,77  | 5.204.805,71  | 12,80      |
| <b>Sub-total</b>                              | 2,06                        | 1,67               | 0,77                |                     | 0,61   | 2,15  | 18.876.415,50 | 46,44      |

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     | 1,73                        | 0,31               | -0,00               | 0,31                | -0,80  | -0,49 | 27.817,87  | 0,07       |
| <b>Sub-total</b> | 1,73                        | 0,31               | -0,00               |                     | -0,80  | -0,49 | 27.817,87  | 0,07       |

(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 (%)