



LDB
EMPRESAS

RUBINÉIA
JUNHO 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 30.06.2023.

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	2,11	0,05	0,93	5,54	375.600,25	0,98	188.237.769,14	0,20
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,32	0,74	1,07	1,07	448.712,93	1,18	503.623.885,64	0,09
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,35	0,73	2,35	11,24	6.669.250,96	17,48	4.240.209.456,14	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,37	0,08	1,16	6,59	50.504,45	0,13	7.342.301.496,88	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,38	0,08	1,17	6,57	3.117.015,18	8,17	623.688.292,44	0,50
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,52	0,31	1,72	8,72	2.621.147,64	6,87	540.330.909,91	0,49
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,39	0,22	1,03	7,00	5.068.936,83	13,28	8.254.253.931,25	0,06
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,39	0,06	0,93	5,56	2.472.987,96	6,48	3.511.010.528,94	0,07
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,86	0,36	1,57	8,30	20.824.156,20	54,57		

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	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,05	1,12	6,42	1.951.222,38	5,11	15.331.819.820,88	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	5,34	0,75	2,38	11,47	6.557.010,56	17,18	379.962.570,16	1,73
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,47	0,74	2,37	11,29	4.535.884,15	11,89	1.330.366.206,19	0,34
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,04	1,13	6,53	4.264.851,90	11,18	8.773.662.957,45	0,05
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			3,36	0,49	1,92	9,55	17.308.968,99	45,36		

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	13,60	-0,50	-0,50	-7,99	29.896,41	0,08	31.875.398,91	0,09

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea a	13,60	-0,50	-0,50	-7,99	29.896,41	0,08		
		Renda Fixa	3,08	0,42	1,73	8,86	38.163.021,60	100,00		
		Total	3,08	0,42	1,73	8,86	38.163.021,60	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	20.824.156,20	54,57	0,00	54,95	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	17.308.968,99	45,36	0,00	45,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	29.896,41	0,08	0,00	0,05	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	38.163.021,60	100,00					100,00
Total		38.163.021,60	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,57 146,39	8,30 127,80	4,25 135,08	8,30 127,80	12,12 89,50	317.187,68	1.560.109,31
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,92 178,68	9,55 146,90	5,68 180,72	9,55 146,90	13,44 99,23	328.827,94	1.524.386,77
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,50 -46,83	-7,99 -122,95	-7,48 -237,93	-7,99 -122,95	0,83 6,15	-150,83	-2.596,04
RUBINÉIA (Total)						645.864,79	3.081.900,04

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	372.145,78	0,00	0,00	0,00	375.600,25	3.454,47	19.981,89
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2.450.173,39	0,00	0,00	0,00	2.472.987,96	22.814,57	123.096,75
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	3.080.910,90	0,00	0,00	0,00	3.117.015,18	36.104,28	192.953,14
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	0,00	443.964,33	0,00	0,00	448.712,93	4.748,60	4.748,60
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.017.181,98	0,00	0,00	0,00	5.068.936,83	51.754,85	331.776,07
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.515.902,37	0,00	0,00	0,00	6.669.250,96	153.348,59	674.091,61
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.576.763,46	0,00	0,00	0,00	2.621.147,64	44.384,18	210.340,51
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	49.926,31	0,00	0,00	0,00	50.504,45	578,14	3.120,74
					20.824.156,20	317.187,68	

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	4.217.095,23	0,00	0,00	0,00	4.264.851,90	47.756,67	246.885,76
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	6.404.659,04	0,00	0,00	0,00	6.557.010,56	152.351,52	674.555,44
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.296.480,29	0,00	-370.598,15	0,00	1.951.222,38	25.340,24	154.083,09
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	4.312.127,43	120.377,21	0,00	0,00	4.535.884,15	103.379,51	448.862,48
					17.308.968,99	328.827,94	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC PREMIUM	30.047,24	0,00	0,00	0,00	29.896,41	-150,83	-2.596,04
					29.896,41	-150,83	

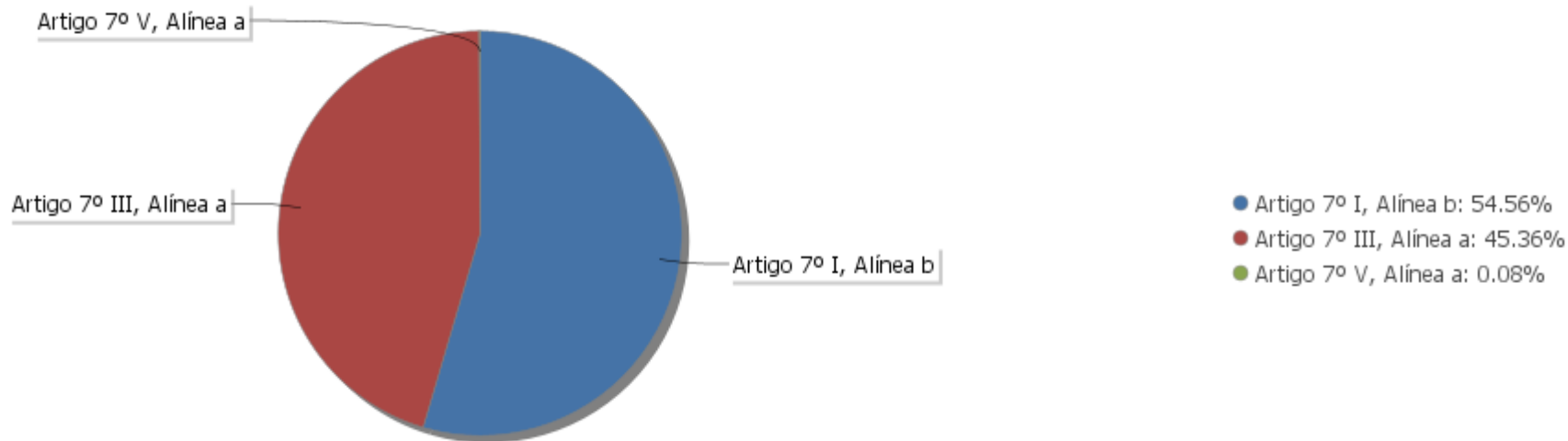
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

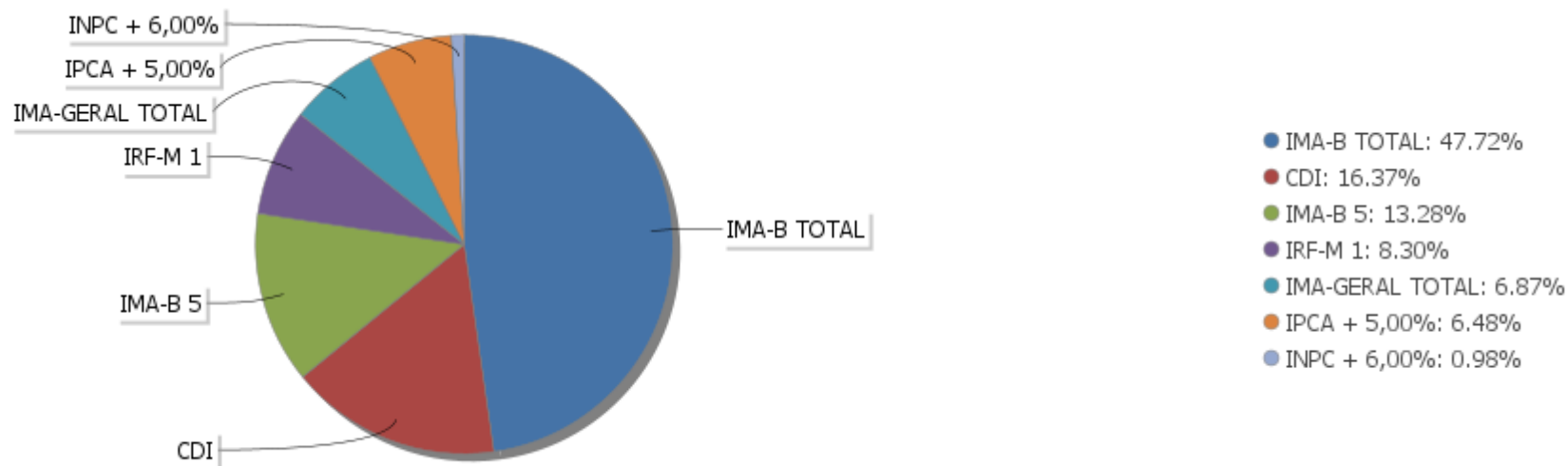
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	35.314.433,39	92,54	35.314.433,39	92,54	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	35.314.433,39	92,54	
acima de 365 dias	2.848.588,21	7,46	38.163.021,60	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

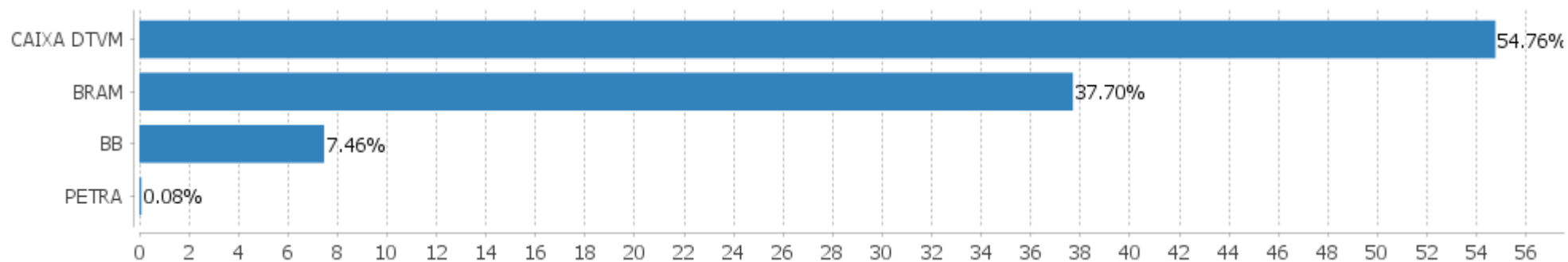


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2023	0,62	1,16	1,95	1,39	1,70	1,73							8,86
IPCA + 4,94%	0,95	1,19	1,15	0,96	0,65	0,32							5,34
p.p. indexador	-0,34	-0,03	0,80	0,44	1,04	1,40							3,51
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	27	40,91
Meses abaixo - Meta Atuarial	39	59,09

	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	4,90	1,94	2,95	2,05
06 meses	8,86	5,34	3,51	2,49
12 meses	12,71	8,18	4,53	3,08
24 meses	19,10	27,23	-8,14	3,16
36 meses	24,82	45,60	-20,78	3,22
48 meses	31,49	57,57	-26,08	4,21
60 meses	48,70	72,52	-23,82	3,87
Desde 29/12/2017	52,88	82,16	-29,28	3,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

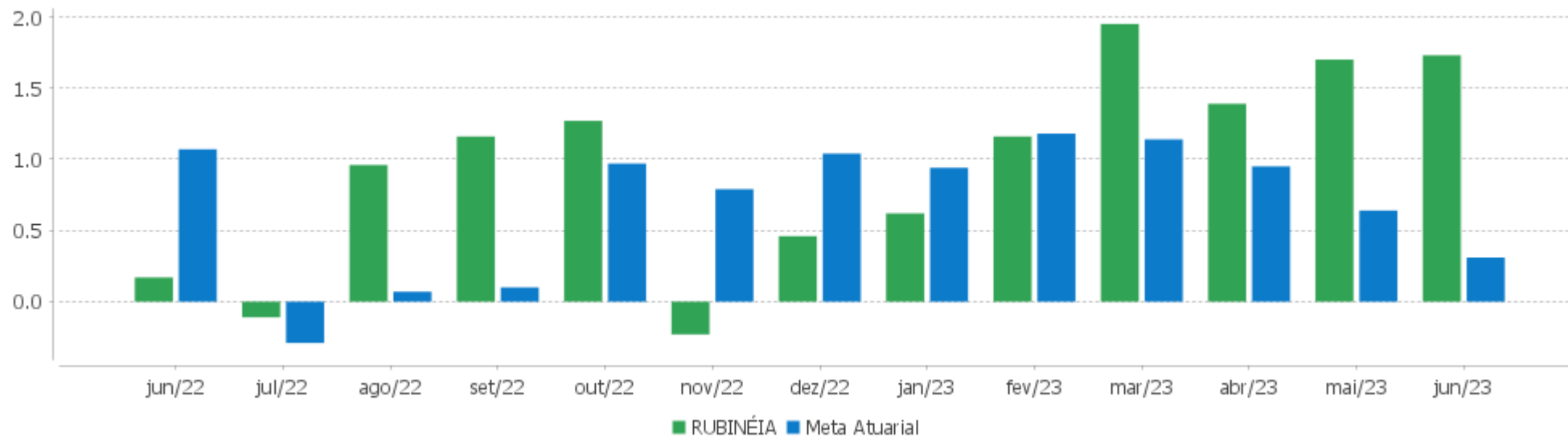


Patrimônio Líquido



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
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,35 -0,04	11,24 -0,12	7,06 -0,04	11,24 -0,12	13,32 -0,21	17,31 -0,50	25,74 -0,82
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	7,00 -0,04	2,57 0,02	7,00 -0,04	10,18 -0,05	21,01 -0,30	28,00 -0,68
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	1,17 -0,02	6,57 -0,11	3,17 -0,05	6,57 -0,11	13,59 -0,23	21,54 -0,46	23,53 -0,96
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,16 -0,03	6,59 -0,09	3,15 -0,07	6,59 -0,09	13,58 -0,24	21,47 -0,53	23,68 -0,80
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,93 0,60	5,56 0,19	1,44 -0,52	5,56 0,19	8,39 0,10		
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	1,72 -0,02	8,72 0,09	4,95 0,11	8,72 0,09	14,17 0,16	19,92 -0,19	23,15 -1,21
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6,00% p.p.	0,93 0,54	5,54 -0,13	1,44 -0,78	5,54 -0,13	9,24 0,09	21,24 -8,25	28,43 -21,46
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,37 -0,02	11,20 -0,16	7,03 -0,07	11,20 -0,16	13,18 -0,35	17,03 -0,78	25,29 -1,27
FIDC PREMIUM % do CDI	-0,50 -46,83	-7,99 -122,95	-7,48 -237,93	-7,99 -122,95	0,83 6,15	-59,45 -254,39	-62,45 -238,64
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,38 -0,01	11,47 0,10	7,19 0,08	11,47 0,10	13,33 -0,20	16,94 -0,87	24,73 -1,83
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,13 105,64	6,53 100,53	3,22 102,48	6,53 100,53	13,87 102,45	24,53 104,96	27,55 105,26
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,37 -0,02	11,29 -0,08	7,16 0,06	11,29 -0,08	13,23 -0,30	17,19 -0,62	25,59 -0,97
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,12 104,05	6,42 98,84	3,25 103,25	6,42 98,84	13,55 100,07	23,98 102,62	26,71 102,07
RUBINÉIA Var. IPCA + 4,83% p.p.	1,73 1,40	8,86 3,51	4,90 2,95	8,86 3,51	12,71 4,47	19,10 -7,99	24,82 -19,65
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88

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	1,19	6,68	3,22	6,68	13,82	22,00	24,49	31,97	41,51
IRF-M 1+	2,65	11,41	6,89	11,41	18,80	17,59	16,30	30,02	54,96
IRF-M TOTAL	2,12	9,62	5,52	9,62	16,74	18,79	18,96	30,63	51,17
IMA-B 5	1,05	7,04	2,55	7,04	10,23	21,32	28,68	40,02	60,53
IMA-B 5+	3,37	14,91	10,90	14,91	16,34	13,82	23,52	25,96	77,32
IMA-B TOTAL	2,39	11,37	7,10	11,37	13,52	17,81	26,56	32,82	71,02
IMA-GERAL TOTAL	1,74	8,64	4,83	8,64	14,01	20,10	24,37	32,47	53,53
IDKA 2	0,97	6,79	1,99	6,79	9,28	20,32	28,82	40,12	58,67
IDKA 20	5,91	22,33	19,68	22,33	23,20	6,46	19,60	13,99	89,13
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23	16,96	62,29
IBRX 100	8,87	6,59	14,96	6,59	17,60	-9,50	23,38	17,63	65,59
IBRX 50	8,77	4,96	13,79	4,96	17,68	-9,03	25,07	16,40	59,58
SMALL CAP	8,17	13,26	25,16	13,26	19,79	-27,64	1,04	6,25	50,57
Índice Consumo - ICON	9,53	8,38	24,04	8,38	7,60	-42,14	-32,37	-22,91	3,43
Índice Dividendos - IDIV	8,78	9,30	13,95	9,30	17,73	12,91	39,77	39,55	106,18

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	0,69	7,06	2,73	7,06	8,17	-0,23	26,33	90,25	104,62

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,71	10,05	14,28	10,05	12,87	14,54	12,44	20,15	48,47

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,09	4,18	0,15	4,18	5,27	-8,63	14,48	64,05	68,93

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,08	2,87	0,76	2,87	3,16	15,42	25,06	27,72	32,02
INPC	-0,10	2,69	0,79	2,69	3,00	15,28	25,91	28,86	33,13
IGPM	-1,93	-4,46	-4,65	-4,46	-6,86	3,11	39,98	50,22	60,00
SELIC	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,25	4,88	1,72	4,88	7,27	24,82	40,63	49,40	60,53
IPCA + 5,00%	0,33	5,37	1,96	5,37	8,30	27,23	44,71	55,22	68,37
IPCA + 5,50%	0,37	5,62	2,08	5,62	8,81	28,44	46,79	58,20	72,40
IPCA + 5,89%	0,40	5,81	2,17	5,81	9,21	29,39	48,42	60,54	75,60
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88	61,21	76,52
INPC + 4,00%	0,23	4,69	1,75	4,69	7,10	24,66	41,58	50,73	61,88
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89	62,65	78,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
47	12/06/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	11.100,00	2.384,24694500	4,6555580000
48	13/06/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	150,00	32,20297500	4,6579540000
49	27/06/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	8.197,32	1.750,61361700	4,6825410000
51	27/06/2023	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	120.377,21	0,00	26.553,13054200	4,5334470000
45	28/06/2023	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	443.964,33	0,00	103.197,45583887	4,3020860000
46	29/06/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	335.846,92	71.647,87803600	4,6874650000
50	29/06/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	15.303,91	3.264,85848100	4,6874650000
Total			564.341,54	370.598,15		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 414.078,92

Value-At-Risk: 1,09%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RUBINÉIA		1,09	1,09			38.163.021,60	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,09%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI		0,83	0,00	0,82			375.600,25	0,98
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		1,85	0,02	0,01			448.712,93	1,18
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,86	0,32	0,04			6.669.250,96	17,48
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,22	0,00	0,01			50.504,45	0,13
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS		0,21	0,01	0,01			3.117.015,18	8,17
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,83	0,06	0,03			2.621.147,64	6,87
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,91	0,10	0,03			5.068.936,83	13,28
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,83	0,03	0,82			2.472.987,96	6,48
Sub-total	2,21	1,02	0,55		0,23	1,57	20.824.156,20	54,57

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,04	-0,00	0,04			1.951.222,38	5,11
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B		1,81	0,31	0,18			6.557.010,56	17,18
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		1,94	0,23	0,11			4.535.884,15	11,89
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,03			4.264.851,90	11,18
Sub-total	2,87	1,19	0,53		0,29	1,92	17.308.968,99	45,36

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC PREMIUM		0,37	0,00	0,37			29.896,41	0,08
Sub-total	1,74	0,37	0,00		-0,90	-0,50	29.896,41	0,08