



LDB
EMPRESAS

LENÇÓIS PAULISTA
MAIO 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 31.05.2023.

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 PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	1,20	0,01	-0,03	-0,03	106.004.802,91	21,61	1.986.077.619,19	5,34	
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,03	0,05	1,13	3,36	60.055.042,50	12,24	7.062.035.271,33	0,85	
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,38	0,06	1,12	5,36	10.629.120,59	2,17	290.581.279,71	3,66	
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,29	-0,02	2,51	8,65	32.265.794,79	6,58	222.800.133,95	14,48	
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,39	0,04	1,12	5,27	1.124.819,03	0,23	6.724.495.811,47	0,02	
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,26	-0,01	2,58	8,70	910.921,65	0,19	5.943.377.738,68	0,02	
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,30	-0,02	2,50	8,63	15.692.768,00	3,20	435.684.441,46	3,60	
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,39	0,04	1,16	5,34	3.153.083,08	0,64	124.748.910,11	2,53	
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,38	0,04	1,12	5,37	43.501.908,07	8,87	7.491.213.170,65	0,58	
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,38	0,04	1,15	5,34	18.088.359,93	3,69	627.616.958,18	2,88	
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,45	0,00	0,63	5,91	62.338.225,62	12,71	8.623.099.025,61	0,72	
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,69	0,01	0,39	5,49	15.560.472,13	3,17	7.232.116.284,73	0,22	
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	5,31	-0,02	2,51	8,64	8.943.429,87	1,82	447.876.024,07	2,00	
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	5,31	0,03	2,84	7,79	1.049.794,27	0,21	1.321.509.484,64	0,08	
BB	BB	BB PREV RF IPCA	1,46	0,00	0,69	5,35	0,00	0,00	241.807.690,53	0,00	
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,82	0,01	2,35	7,88	42.916.368,96	8,75	2.062.404.983,41	2,08	
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,52	0,01	-0,01	4,58	10.268.664,33	2,09	3.478.619.664,42	0,30	
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,42	0,02	1,19	6,22	432.503.575,73	88,16			

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	0,05	0,06	1,16	5,34	58.065.939,63	11,84	8.436.127.357,01	0,69

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 III, Alínea a	0,05	0,06	1,16	5,28	58.065.939,63	11,84		
		Renda Fixa	1,02	0,02	1,19	6,01	490.569.515,36	100,00		
		Total	1,02	0,02	1,19	6,01	490.569.515,36	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	432.503.575,73	88,16	60,00	80,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	58.065.939,63	11,84	10,00	10,00	60,00	0,00	65,00
	Total Renda Fixa	490.569.515,36	100,00					100,00
Total		490.569.515,36	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	1,19 106,01	6,22 115,92	3,81 117,33	7,16 109,30	11,55 85,73	5.117.361,88	22.824.043,26
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,16 103,35	5,28 98,37	3,26 100,21	6,48 98,96	13,34 98,99	666.359,42	5.113.761,23
LENÇÓIS PAULISTA (Total)						5.783.721,30	27.937.804,49

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 IDKA2	15.264.624,80	236.745,43	0,00	0,00	15.560.472,13	59.101,90	766.727,02
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	888.045,36	0,00	0,00	0,00	910.921,65	22.876,29	62.624,36
BB PREV RF IPCA	105.310.447,51	0,00	-106.034.571,85	0,00	0,00	724.124,34	5.382.078,85
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	937.030,88	200.000,00	-24.000,00	0,00	1.124.819,03	11.788,15	46.360,55
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,00	106.034.571,85	0,00	0,00	106.004.802,91	-29.768,94	-29.768,94
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	10.269.587,59	0,00	0,00	0,00	10.268.664,33	-923,26	456.989,52
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	17.882.869,76	0,00	0,00	0,00	18.088.359,93	205.490,17	916.221,28
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	15.309.674,58	0,00	0,00	0,00	15.692.768,00	383.093,42	1.247.146,41
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	61.947.614,38	0,00	0,00	0,00	62.338.225,62	390.611,24	3.479.249,31
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.487.771,50	0,00	-3.508.127,23	0,00	43.501.908,07	522.263,80	2.472.020,52
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	1.020.810,63	0,00	0,00	0,00	1.049.794,27	28.983,64	75.903,79
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	41.930.185,94	0,00	0,00	0,00	42.916.368,96	986.183,02	2.671.737,70
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLAÇÃO FICFI	31.476.976,97	0,00	0,00	0,00	32.265.794,79	788.817,82	2.207.720,90
ITAU SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	10.511.586,45	0,00	0,00	0,00	10.629.120,59	117.534,14	540.493,70
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.116.992,29	0,00	0,00	0,00	3.153.083,08	36.090,79	127.197,58
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	6.223.251,16	2.523.000,00	0,00	0,00	8.943.429,87	197.178,71	425.197,46
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	59.381.125,85	0,00	0,00	0,00	60.055.042,50	673.916,65	1.969.114,25
					432.503.575,73	0,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	57.399.580,21	0,00	0,00	0,00	58.065.939,63	666.359,42	2.943.454,72
					58.065.939,63	0,00	

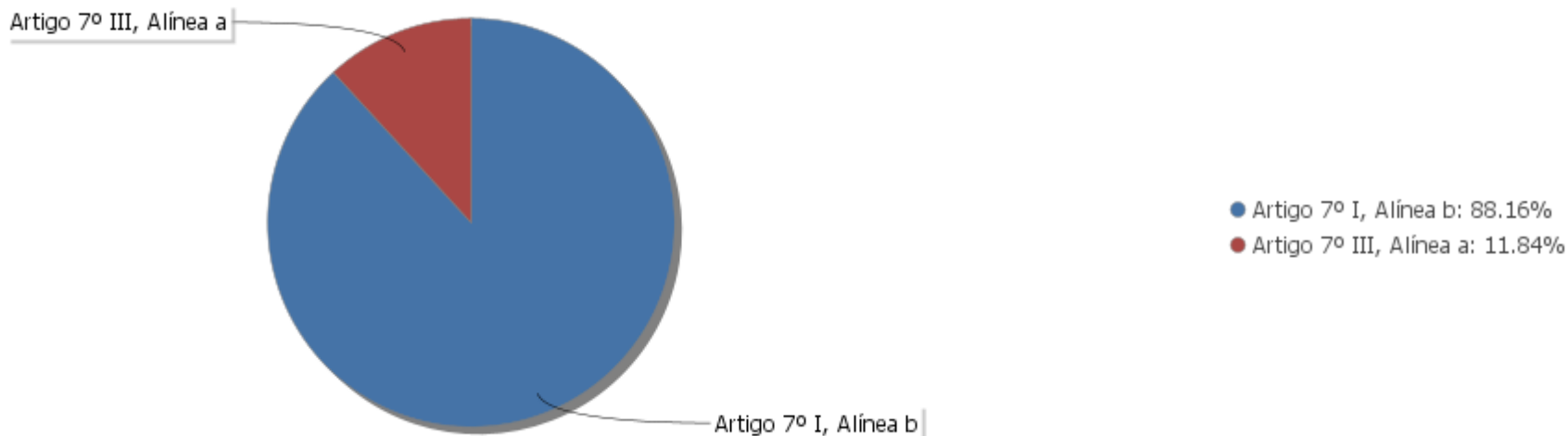
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

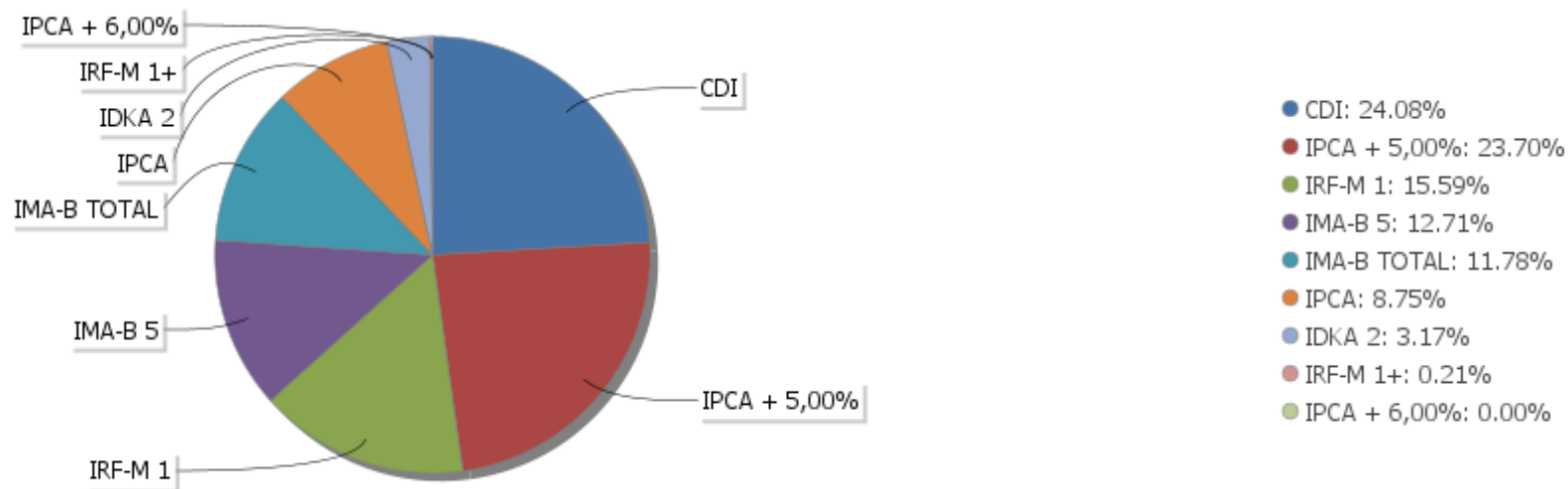
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	374.296.048,12	76,30	374.296.048,12	76,30	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	374.296.048,12	76,30	
acima de 365 dias	116.273.467,24	23,70	490.569.515,36	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

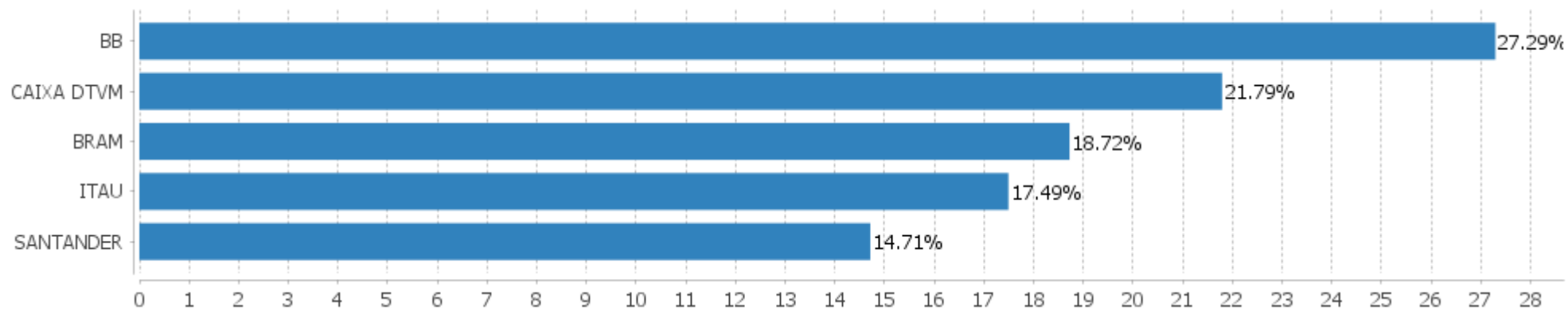


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2023	1,18	0,99	1,49	1,03	1,19								6,01
IPCA + 4,72%	0,94	1,17	1,13	0,94	0,63								4,91
p.p. indexador	0,24	-0,18	0,35	0,09	0,55								1,10
2022	0,31	0,89	1,63	1,10	0,84	0,60	0,52	0,68	0,80	1,44	0,58	0,98	10,88
IPCA + 4,87%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,29	0,07	0,11	0,97	0,79	1,04	10,92
p.p. indexador	-0,63	-0,48	-0,41	-0,32	-0,04	-0,47	0,81	0,61	0,70	0,47	-0,21	-0,06	-0,03
2021	-0,02	-0,30	0,07	0,41	0,41	0,14	0,08	0,15	0,54	-0,69	1,50	0,83	3,18
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,67	1,37	1,22	15,99
p.p. indexador	-0,69	-1,54	-1,35	-0,32	-0,86	-0,83	-1,34	-1,18	-1,06	-2,36	0,13	-0,38	-12,81
2020	0,36	0,42	-0,38	0,41	0,83	0,58	0,66	0,03	-0,19	0,16	0,64	1,09	4,71
IPCA + 6,00%	0,72	0,67	0,58	0,15	0,08	0,75	0,90	0,73	1,13	1,35	1,36	1,87	10,76
p.p. indexador	-0,36	-0,25	-0,96	0,26	0,75	-0,17	-0,23	-0,70	-1,32	-1,19	-0,72	-0,77	-6,05
2019	0,87	0,34	0,50	0,87	1,64	2,45	1,12	-0,16	2,15	2,42	-1,46	1,38	12,76
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	0,04	-0,55	-0,69	-0,19	1,00	2,00	0,40	-0,78	1,70	1,79	-2,43	-0,26	2,17
2018												0,76	0,76
IPCA + 6,00%												0,61	0,61
p.p. indexador												0,15	0,15

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	18	33,33
Meses abaixo - Meta Atuarial	36	66,67

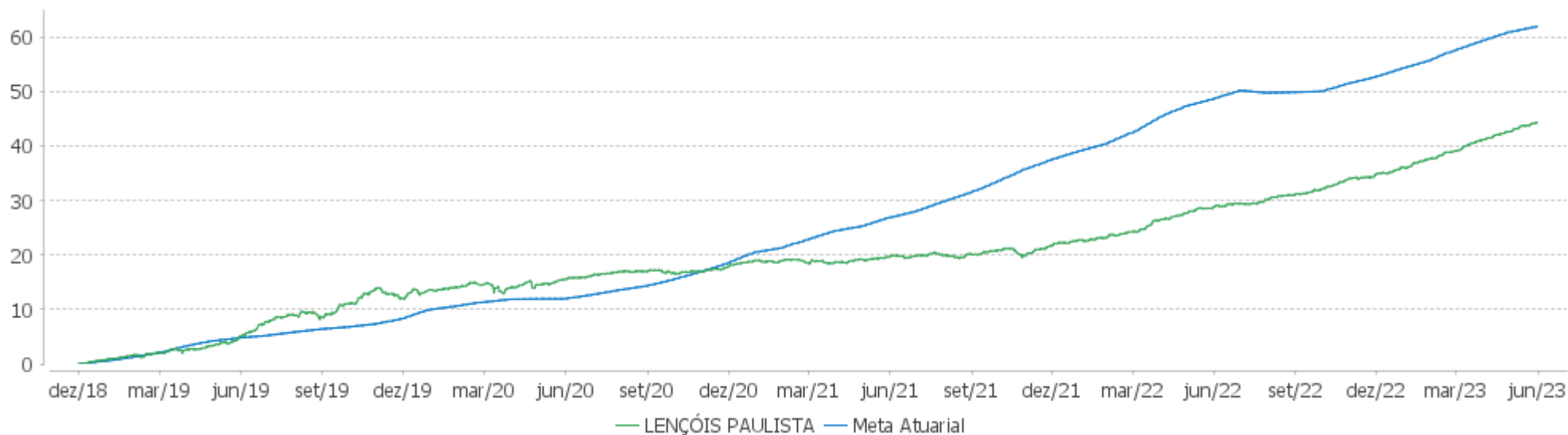
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,45	2019-06
Menor rentabilidade da Carteira	-1,46	2019-11

Relatório

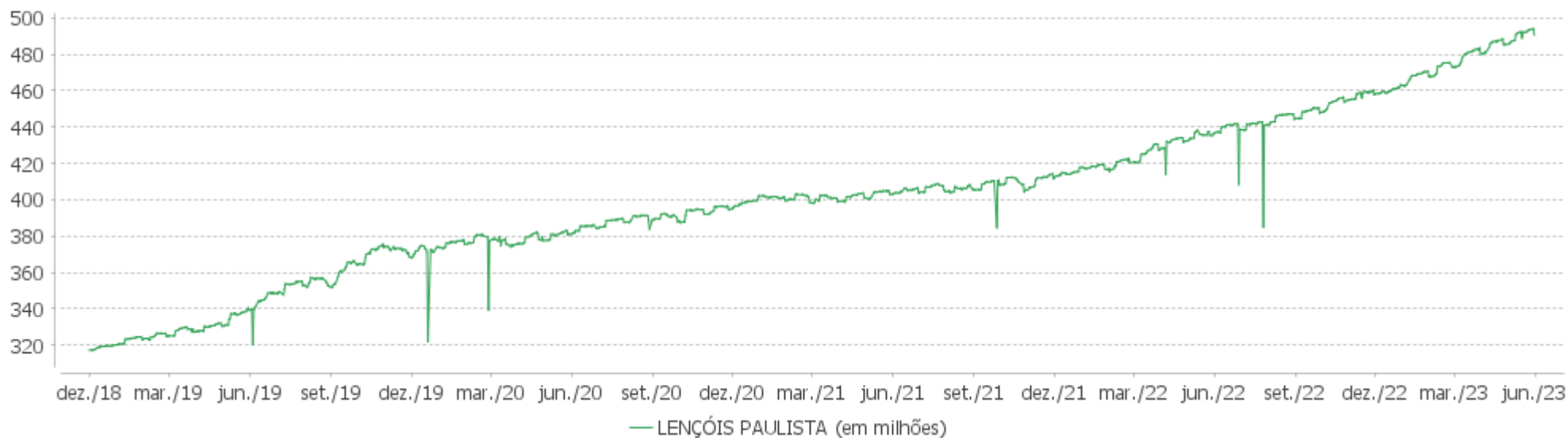
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,75	2,74	1,01	0,87
06 meses	7,05	6,00	1,05	0,90
12 meses	12,09	8,91	3,18	1,02
24 meses	20,59	28,00	-7,41	1,28
36 meses	24,93	46,25	-21,32	1,28
48 meses	37,30	57,90	-20,60	1,90
Desde 30/11/2018	44,29	66,35	-22,06	1,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

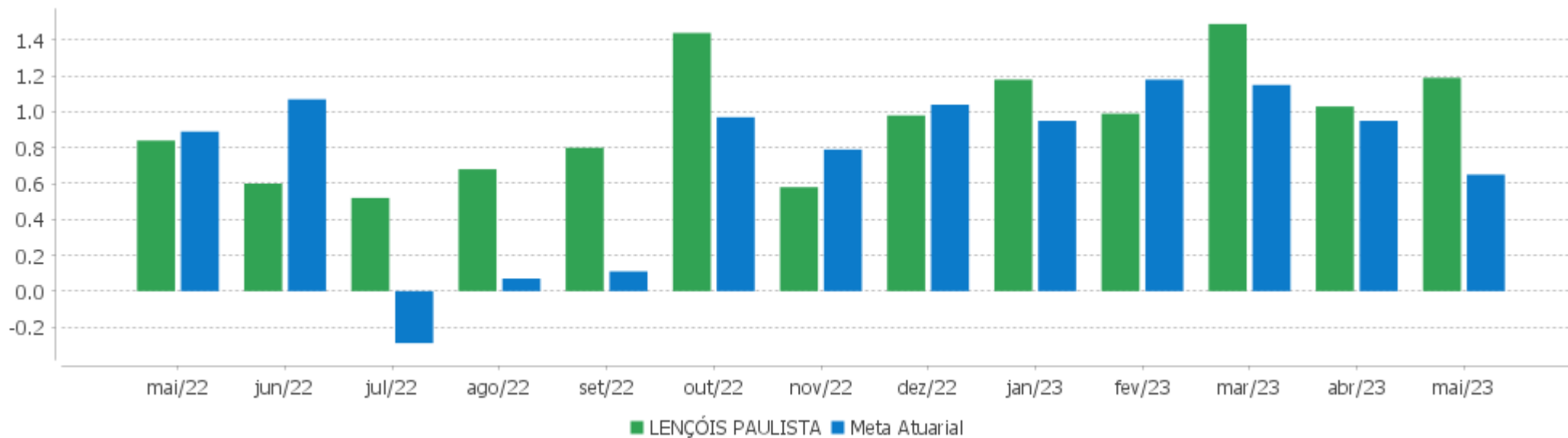


Patrimônio Líquido



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
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,12 -0,03	5,36 -0,06	3,20 -0,06	6,58 -0,09	13,35 -0,18	20,46 -0,37	22,68 -0,69
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,63 0,06	5,91 -0,02	3,04 0,02	6,89 -0,04	9,41 -0,03	19,60 -0,30	28,08 -0,68
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,12 -0,02	5,27 -0,15	3,18 -0,08	6,49 -0,17	13,21 -0,32	20,16 -0,66	22,24 -1,13
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,01 -0,67	4,58 -0,44	1,78 -1,02	5,96 -0,17	7,63 -1,48		
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,23 -0,62	-0,23 -0,62					
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,50 -0,03	8,63 -0,13	7,31 -0,08	8,39 -0,16	10,13 -0,34	14,77 -0,77	24,87 -1,26
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	2,35 2,12	7,88 4,93	6,13 4,57	7,48 3,89	11,36 7,43	20,73 4,60	22,83 -2,65
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	2,84 -0,01	8,39 -0,15	6,81 -0,11	10,09 -0,20	15,28 -0,56	13,87 -0,93	13,34 -1,14
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,51 -0,03	8,65 -0,12	7,31 -0,07	8,42 -0,14	10,21 -0,26	15,02 -0,52	25,18 -0,96
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,39 0,10	5,49 -0,27	2,47 -0,13	6,77 -0,30	8,61 -0,13	18,88 0,09	28,11 -0,73
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	1,15 0,00	5,34 -0,09	3,20 -0,06	6,55 -0,11	13,31 -0,22	20,37 -0,45	22,41 -0,96
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,19 0,45	5,87 0,44	3,36 0,31	6,88 0,25	10,46 0,32	21,15 -9,30	30,14 -19,25
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,16 0,01	5,34 -0,08	3,20 -0,06	6,57 -0,09	13,41 -0,12	20,53 -0,30	22,66 -0,71
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,58 0,04	8,70 -0,06	7,35 -0,04	8,46 -0,09	10,27 -0,20	14,95 -0,60	25,18 -0,96
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,12 -0,02	5,37 -0,06	3,20 -0,06	6,58 -0,08	13,30 -0,22	20,31 -0,52	22,58 -0,79
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	1,13 101,03	5,32 99,02	3,19 98,28	6,47 98,70	13,37 99,24	22,33 99,54	24,48 97,54
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	2,51	8,64	7,32	8,40	10,19	14,96	25,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,12	-0,07	-0,15	-0,28	-0,58	-1,02
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,16 103,35	5,34 99,46	3,26 100,23	6,57 100,23	13,81 102,50	23,57 105,06	26,44 105,36
LENÇÓIS PAULISTA Var. IPCA + 4,87% p.p.	1,19 0,55	6,01 1,10	3,75 1,01	7,05 1,06	12,09 3,27	20,59 -6,74	24,93 -19,12
CDI	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10
IBOVESPA	3,74	-1,28	3,24	-3,69	-2,71	-14,17	23,95
INPC + 6,00%	0,87	5,27	3,03	6,53	9,94	30,40	50,49
IPCA + 6,00%	0,74	5,43	3,05	6,63	10,15	30,45	49,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IPCA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADERCO 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 IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,18
ITAU SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,18
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,14	5,42	3,26	6,67	13,53	20,82	23,37	31,17	40,60
IRF-M 1+	2,85	8,54	6,92	10,30	15,84	14,80	14,48	30,11	50,74
IRF-M TOTAL	2,20	7,34	5,54	8,93	14,73	16,57	17,40	30,67	48,09
IMA-B 5	0,57	5,93	3,02	6,92	9,45	19,90	28,76	40,94	59,58
IMA-B 5+	4,13	11,16	11,29	9,84	11,30	11,03	22,89	28,01	69,69
IMA-B TOTAL	2,53	8,76	7,39	8,55	10,47	15,54	26,13	34,56	66,49
IMA-GERAL TOTAL	1,77	6,78	4,95	7,60	12,55	18,47	23,45	32,82	51,09
IDKA 2	0,29	5,76	2,60	7,07	8,74	18,79	28,85	40,48	57,41
IDKA 20	7,14	15,51	20,12	11,68	12,90	1,60	17,65	14,97	73,96
CDI	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10	31,21	39,57

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,74	-1,28	3,24	-3,69	-2,71	-14,17	23,95	11,65	41,15
IBRX 100	3,59	-2,09	2,36	-4,66	-4,47	-16,34	23,50	12,48	44,21
IBRX 50	2,92	-3,51	0,95	-5,97	-4,44	-15,81	25,71	11,41	38,93
SMALL CAP	13,54	4,71	13,69	1,56	-7,34	-32,24	6,89	5,09	34,10
Índice Consumo - ICON	12,26		6,51	-6,28	-15,80	-46,84	-32,02	-26,79	-9,87
Índice Dividendos - IDIV	0,84	0,48	2,64	-1,14	-0,85	1,55	39,98	32,28	81,33

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	2,16	6,32	3,02	-1,39	9,00	-3,17	28,94	96,40	109,24

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	5,43	5,10	7,30	5,10	6,84	6,99	13,39	18,05	36,10

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,56	4,28	0,55	-1,39	6,70	-11,51	19,15	69,85	72,84

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,23	2,95	1,56	3,59	3,94	16,13	25,48	27,84	33,80
INPC	0,36	2,79	1,54	3,50	3,74	16,08	26,41	29,00	35,17
IGPM	-1,84	-2,58	-2,73	-2,14	-4,47	5,78	44,96	54,39	66,19
SELIC	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10	31,21	39,57

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	4,62	2,56	5,63	8,08	25,59	41,11	49,48	62,68
IPCA + 5,00%	0,66	5,03	2,80	6,13	9,11	28,01	45,21	55,30	70,63
IPCA + 5,50%	0,70	5,23	2,93	6,38	9,63	29,23	47,29	58,27	74,72
IPCA + 5,89%	0,73	5,39	3,02	6,57	10,03	30,18	48,92	60,62	77,96
IPCA + 6,00%	0,74	5,43	3,05	6,63	10,15	30,45	49,38	61,28	78,88
INPC + 4,00%	0,70	4,45	2,54	5,53	7,87	25,54	42,15	50,84	64,35
INPC + 6,00%	0,87	5,27	3,03	6,53	9,94	30,40	50,49	62,75	80,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
203	03/05/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	24.000,00	7.367,67226800	3,2574738840
198	08/05/2023	BB PREV RF IDKA2	236.745,43	0,00	67.781,70002800	3,4927632370
202	10/05/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	200.000,00	0,00	61.251,52456800	3,2652248480
205	10/05/2023	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	2.523.000,00	0,00	78.881,12757600	31,9848369000
195	17/05/2023	BB PREV RF IPCA	0,00	62.366.154,40	20.576.695,04391500	3,0309121200
196	17/05/2023	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	60.464.922,00	0,00	60.583.614,50953300	0,9980408480
199	17/05/2023	BB PREV RF IPCA	0,00	43.668.417,45	14.407.681,81988600	3,0309121200
200	17/05/2023	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	42.337.185,62	0,00	42.420.293,42269900	0,9980408480
197	18/05/2023	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	1.901.232,40	0,00	1.906.928,15221000	0,9970131270
201	18/05/2023	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	1.331.231,83	0,00	1.335.219,96245400	0,9970131270
204	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.508.127,23	1.110.337,96292200	3,1595130000
Total			108.994.317,28	109.566.699,08		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 2.786.987,46

Value-At-Risk: 0,57%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LENÇÓIS PAULISTA		0,57	0,57			490.569.515,36	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,57%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI		0,55	0,06	0,54			106.004.802,91	21,61
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI		0,02	-0,00	0,02			60.055.042,50	12,24
ITAU SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,23	-0,00	0,31			10.629.120,59	2,17
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI		1,95	0,12	0,01			32.265.794,79	6,58
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,22	0,00	0,01			1.124.819,03	0,23
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,94	0,00	0,03			910.921,65	0,19
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		1,96	0,06	0,01			15.692.768,00	3,20
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,22	0,00	0,02			3.153.083,08	0,64
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,22	0,01	0,01			43.501.908,07	8,87
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS		0,22	0,01	0,01			18.088.359,93	3,69
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,86	0,11	0,03			62.338.225,62	12,71
BB PREV RF IDKA2		0,99	0,03	0,16			15.560.472,13	3,17
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR		1,96	0,03	0,01			8.943.429,87	1,82
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		2,06	0,00	0,04			1.049.794,27	0,21
BB PREV RF IPCA		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,54	0,12	1,55			42.916.368,96	8,75
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,87	0,02	0,86			10.268.664,33	2,09
Sub-total	0,88	0,64	0,57		0,08	1,19	432.503.575,73	88,16

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,03			58.065.939,63	11,84
Sub-total	0,05	0,03	-0,00		0,69	1,16	58.065.939,63	11,84