



**LDB**  
EMPRESAS

**LENÇÓIS PAULISTA**  
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 PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	1,17	0,06	0,94	0,91	107.001.748,65	21,47	2.310.416.906,99	4,63
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,03	0,05	1,08	4,47	60.701.954,09	12,18	6.942.662.276,99	0,87
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,37	0,06	1,15	6,57	10.751.334,84	2,16	307.873.930,44	3,49
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,31	0,74	2,37	11,22	33.030.610,80	6,63	215.728.409,32	15,31
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,38	0,07	1,16	6,49	914.916,12	0,18	6.781.214.720,11	0,01
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,28	0,74	2,37	11,28	5.209.869,08	1,05	6.493.608.770,37	0,08
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,32	0,74	2,37	11,20	34.528.789,36	6,93	503.623.885,64	6,86
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,38	0,00	1,04	6,44	0,00	0,00	100.253.072,29	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,37	0,07	1,16	6,59	41.993.637,49	8,42	7.342.301.496,88	0,57
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,38	0,00	1,03	6,42	0,00	0,00	623.688.292,44	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,39	0,22	1,03	7,00	62.981.276,90	12,63	8.254.253.931,25	0,76
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,60	0,17	1,02	6,56	8.364.996,15	1,68	6.483.473.627,64	0,13
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	5,32	0,74	2,37	11,22	14.947.960,64	3,00	369.070.369,54	4,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	5,15	0,41	2,63	10,63	5.094.137,66	1,02	1.526.513.940,56	0,33
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,91	0,44	2,22	10,28	43.870.867,92	8,80	2.099.537.000,43	2,09
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,39	0,06	0,93	5,56	10.364.280,11	2,08	3.511.010.528,94	0,30
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,43</b>	<b>0,26</b>	<b>1,40</b>	<b>7,71</b>	<b>439.756.379,81</b>	<b>88,22</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	0,05	0,04	1,13	6,53	58.723.509,81	11,78	8.773.662.957,45	0,67
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,05</b>	<b>0,04</b>	<b>1,13</b>	<b>6,47</b>	<b>58.723.509,81</b>	<b>11,78</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa	1,01	0,24	1,37	7,46	498.479.889,62	100,00
Total	1,01	0,24	1,37	7,46	498.479.889,62	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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	439.756.379,81	88,22	60,00	80,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	58.723.509,81	11,78	10,00	10,00	60,00	0,00	65,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>498.479.889,62</b>	<b>100,00</b>					100,00
<b>Total</b>		<b>498.479.889,62</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 % do CDI	1,40 130,45	7,71 118,63	3,68 116,98	7,71 118,63	12,47 92,08	6.086.617,95	28.910.661,21
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,13 105,64	6,47 99,62	3,22 102,48	6,47 99,62	13,73 101,36	657.570,18	5.771.331,41
<b>LENÇÓIS PAULISTA (Total)</b>						<b>6.744.188,13</b>	<b>34.681.992,62</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 IDKA2	15.560.472,13	236.745,43	-7.580.277,05	0,00	8.364.996,15	148.055,64	914.782,66
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	910.921,65	4.246.347,23	0,00	0,00	5.209.869,08	52.600,20	115.224,56
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.124.819,03	0,00	-222.410,44	0,00	914.916,12	12.507,53	58.868,08
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	106.004.802,91	0,00	0,00	0,00	107.001.748,65	996.945,74	967.176,80
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	10.268.664,33	0,00	0,00	0,00	10.364.280,11	95.615,78	552.605,30
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	18.088.359,93	0,00	-18.275.099,76	0,00	0,00	186.739,83	1.102.961,11
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	15.692.768,00	18.275.099,76	0,00	0,00	34.528.789,36	560.921,60	1.808.068,01
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	62.338.225,62	0,00	0,00	0,00	62.981.276,90	643.051,28	4.122.300,59
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	43.501.908,07	0,00	-1.993.517,70	0,00	41.993.637,49	485.247,12	2.957.267,64
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	1.049.794,27	3.941.298,66	0,00	0,00	5.094.137,66	103.044,73	178.948,52
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	42.916.368,96	0,00	0,00	0,00	43.870.867,92	954.498,96	3.626.236,66
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	32.265.794,79	0,00	0,00	0,00	33.030.610,80	764.816,01	2.972.536,91
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	10.629.120,59	0,00	0,00	0,00	10.751.334,84	122.214,25	662.707,95
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.153.083,08	0,00	-3.185.872,05	0,00	0,00	32.788,97	159.986,55
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	8.943.429,87	5.723.872,05	0,00	0,00	14.947.960,64	280.658,72	705.856,18
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	60.055.042,50	0,00	0,00	0,00	60.701.954,09	646.911,59	2.616.025,84
					439.756.379,81	6.086.617,95	

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

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	58.065.939,63	0,00	0,00	0,00	58.723.509,81	657.570,18	3.601.024,90
					58.723.509,81	657.570,18	

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

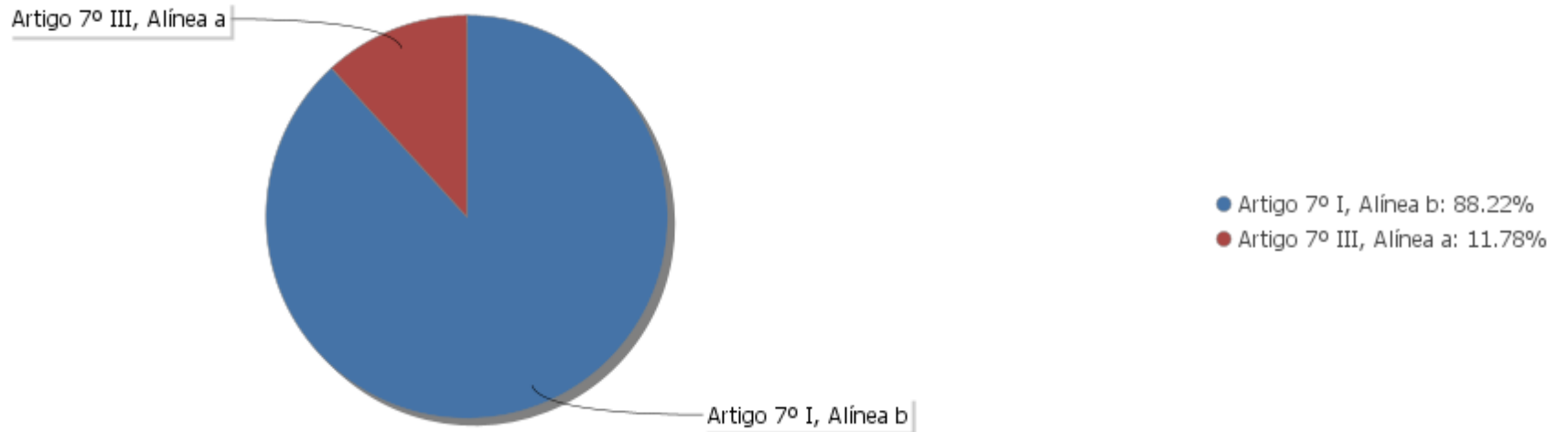
## Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	381.113.860,86	76,46	381.113.860,86	76,46	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	381.113.860,86	76,46	
acima de 365 dias	117.366.028,76	23,54	498.479.889,62	100,00	

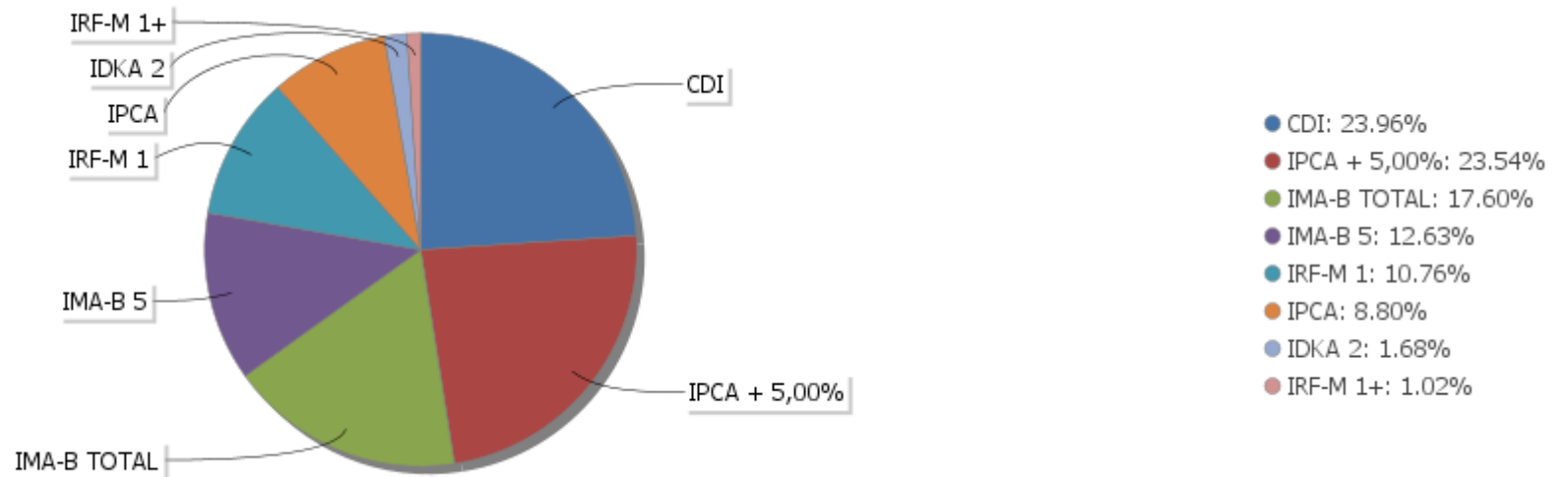


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

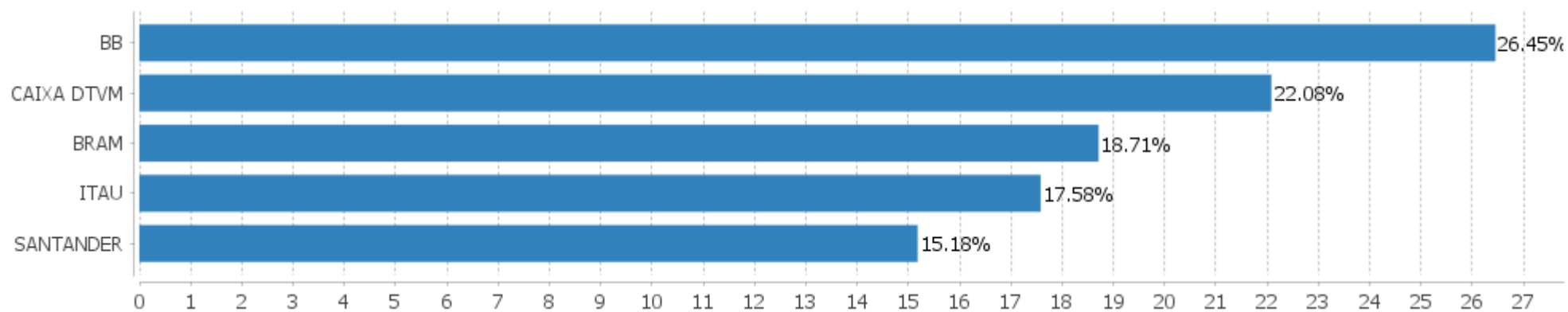


Alocação Por Estratégia



## 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	1,37							7,46
IPCA + 4,72%	0,94	1,17	1,13	0,94	0,63	0,30							5,23
p.p. indexador	0,24	-0,18	0,35	0,09	0,55	1,06							2,23
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

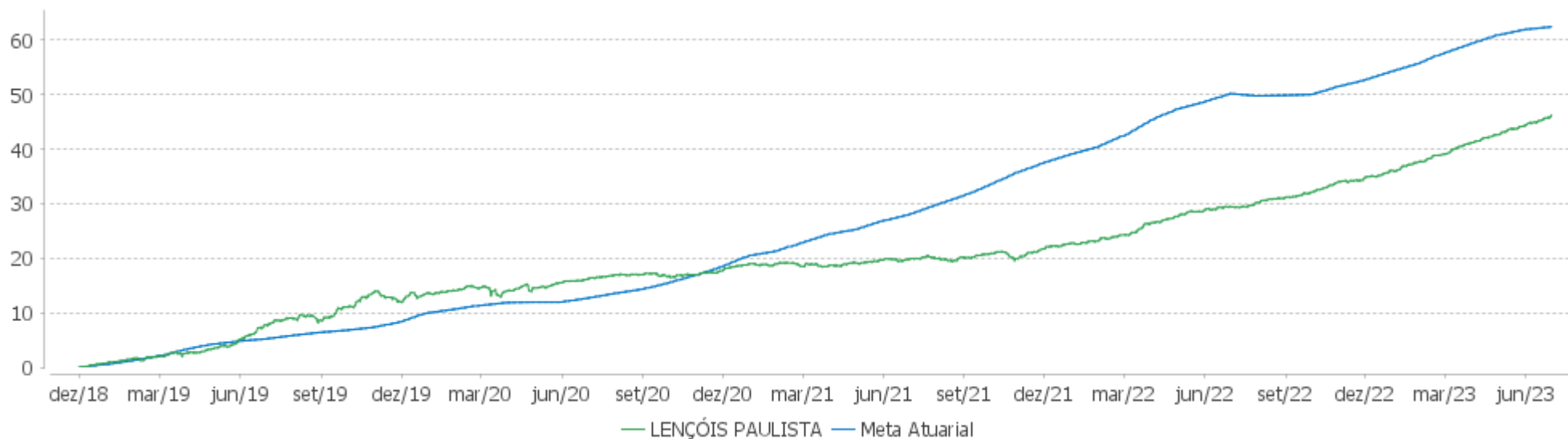
**Performance Sobre a Meta Atuarial**

**Relatório**

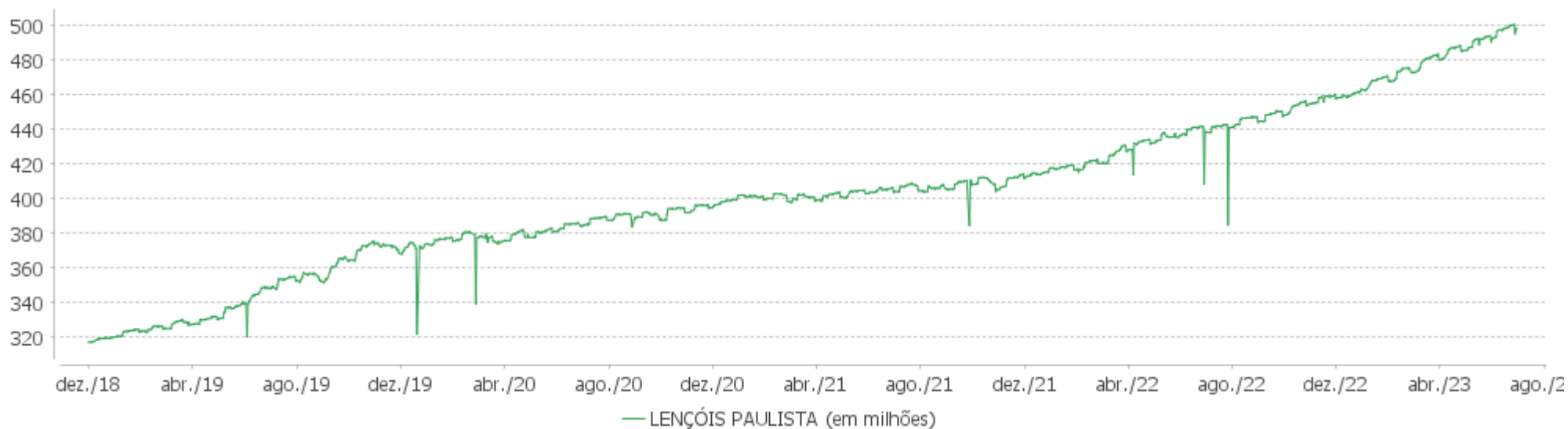
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	19	34,55	03 meses	3,63	1,89	1,73	0,99
Meses abaixo - Meta Atuarial	36	65,45	06 meses	7,46	5,23	2,23	0,98
			12 meses	12,95	8,09	4,86	1,01
			24 meses	22,06	27,16	-5,10	1,28
Maior rentabilidade da Carteira	2,45	2019-06	36 meses	25,91	45,61	-19,70	1,29
Menor rentabilidade da Carteira	-1,46	2019-11	48 meses	35,85	57,67	-21,82	1,85
			Desde 30/11/2018	46,26	66,85	-20,59	1,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

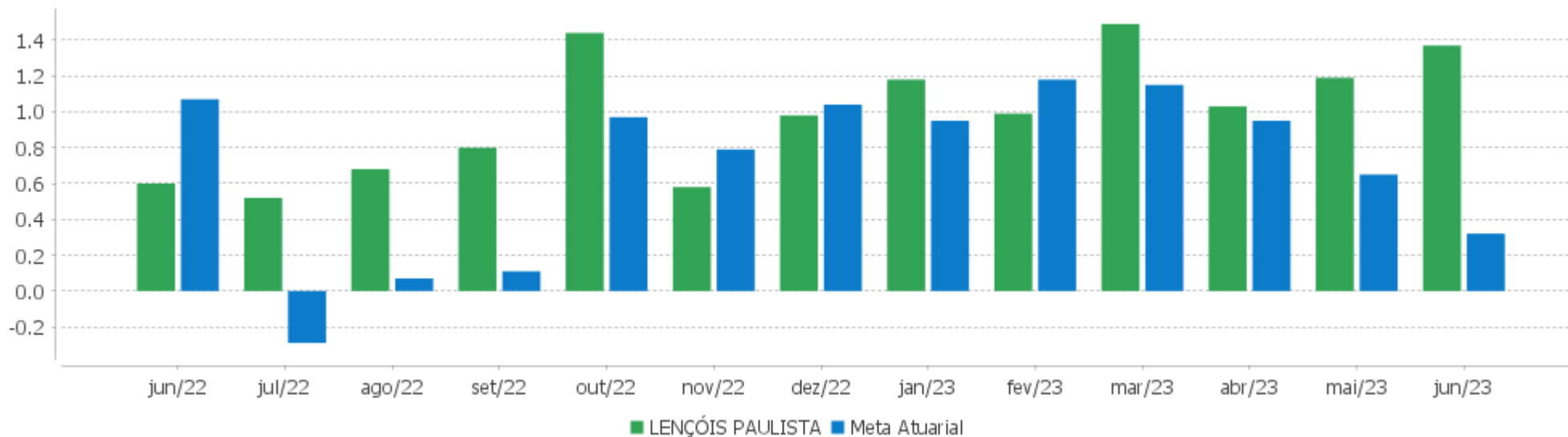


Patrimônio Líquido



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.	1,15 -0,04	6,57 -0,11	3,14 -0,08	6,57 -0,11	13,60 -0,22	21,58 -0,42	23,74 -0,74
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
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,16 -0,03	6,49 -0,18	3,14 -0,08	6,49 -0,18	13,48 -0,34	21,33 -0,67	23,34 -1,15
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		
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,94 0,61	0,71 -0,01					
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	2,22 2,30	10,28 7,41	5,91 5,15	10,28 7,41	12,95 9,79	23,06 7,64	25,02 -0,04
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TÍTULOS 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
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	2,63 -0,02	11,25 -0,17	6,86 -0,04	11,25 -0,17	18,26 -0,54	16,67 -0,92	15,15 -1,15
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLAÇÃO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,37 -0,02	11,22 -0,14	7,04 -0,07	11,22 -0,14	13,25 -0,27	17,28 -0,53	25,63 -0,93
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,02 0,05	6,56 -0,22	2,10 0,11	6,56 -0,22	9,43 0,15	20,20 -0,12	27,87 -0,96
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS 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
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,18 -0,01	6,59 -0,09	3,19 -0,04	6,59 -0,09	13,68 -0,14	21,72 -0,28	23,80 -0,68
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,37 -0,02	11,28 -0,09	7,11 0,01	11,28 -0,09	13,29 -0,24	17,23 -0,58	25,61 -0,95
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
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	1,08 100,49	6,45 99,26	3,13 99,44	6,45 99,26	13,44 99,27	23,27 99,57	25,58 97,74
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,37 -0,02	11,22 -0,15	7,05 -0,06	11,22 -0,15	13,24 -0,29	17,23 -0,58	25,57 -0,99
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1,13	6,53	3,22	6,53	13,87	24,53	27,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	105,64	100,53	102,48	100,53	102,45	104,96	105,26
LENÇÓIS PAULISTA	1,37	7,46	3,63	7,46	12,95	22,06	25,91
Var. IPCA + 4,87% p.p.	1,06	2,23	1,73	2,23	4,94	-4,49	-17,66
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 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 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		
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 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
ITAÚ 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	1,19	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
215	01/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	984.339,59	0,00	345.925,59753494	2,8455240000
213	02/06/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	24.000,00	7.287,46591200	3,2933258680
214	06/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.993.517,70	629.519,51533400	3,1667290000
216	06/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.892.721,09	0,00	659.537,09562990	2,8697720000
206	07/06/2023	BB PREV RF IDKA2	236.745,43	0,00	67.773,12260500	3,4932052840
217	07/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	100.796,61	0,00	35.182,84876172	2,8649360000
218	07/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	963.441,37	0,00	336.287,22247199	2,8649360000
224	07/06/2023	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	2.538.000,00	0,00	77.611,09288684	32,7015109000
209	28/06/2023	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	192.362,30	0,00	25.560,82837100	7,5256676820
212	28/06/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	198.410,44	59.697,40500200	3,3236023790
219	28/06/2023	BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	16.439.476,61	0,00	3.821.280,33005384	4,3020860000
221	28/06/2023	BRDESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	18.275.099,76	5.810.272,40379529	3,1453086000
222	28/06/2023	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	911.005,92	27.915,38880413	32,6345417000
223	28/06/2023	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.274.866,13	69.707,31045995	32,6345417000
207	29/06/2023	BB PREV RF IDKA2	0,00	3.532.340,26	1.003.855,35058915	3,5187741520
208	29/06/2023	BB PREV RF IDKA2	0,00	4.047.936,79	1.150.382,66660200	3,5187741520
210	29/06/2023	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3.928.057,12	0,00	520.259,37553456	7,5501899720
220	29/06/2023	BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	1.835.623,15	0,00	425.300,38024470	4,3160628000
225	29/06/2023	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	3.185.872,05	0,00	96.449,88850145	33,0313710000
211	30/06/2023	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	125.927,81	0,00	16.556,76249400	7,6058233030
<b>Total</b>			<b>32.423.363,13</b>	<b>31.257.177,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.363.330,87

Value-At-Risk: 0,67%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LENÇÓIS PAULISTA		0,67	0,67			498.479.889,62	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,67%

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 PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI		0,61	0,09	0,67			107.001.748,65	21,47
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI		0,01	-0,00	0,01			60.701.954,09	12,18
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,21	-0,00	0,30			10.751.334,84	2,16
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI		1,84	0,11	0,01			33.030.610,80	6,63
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,21	0,00	0,01			914.916,12	0,18
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,83	0,02	0,04			5.209.869,08	1,05
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		1,85	0,12	0,01			34.528.789,36	6,93
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,22	0,01	0,01			41.993.637,49	8,42
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,91	0,11	0,03			62.981.276,90	12,63
BB PREV RF IDKA2		0,99	0,01	0,15			8.364.996,15	1,68
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR		1,85	0,05	0,01			14.947.960,64	3,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		1,81	0,02	0,04			5.094.137,66	1,02
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,45	0,12	1,47			43.870.867,92	8,80
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,83	0,01	0,82			10.364.280,11	2,08
<b>Sub-total</b>	1,46	0,77	0,68		0,22	1,40	439.756.379,81	88,22

Artigo 7º III, 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
BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,03			58.723.509,81	11,78
<b>Sub-total</b>	0,05	0,03	-0,00		1,21	1,13	58.723.509,81	11,78