



LDB
EMPRESAS

LENÇÓIS PAULISTA
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 PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,98	0,10	0,93	6,33	109.511.806,44	20,73	2.604.177.083,80	4,21
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,04	0,04	0,89	10,80	55.999.507,48	10,60	7.015.670.587,94	0,80
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,35	0,05	0,92	13,06	3.959.223,40	0,75	482.364.488,83	0,82
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	4,47	0,10	2,73	15,78	34.383.166,44	6,51	275.179.124,16	12,49
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,36	0,04	0,89	12,88	2.083.448,12	0,39	7.852.193.725,16	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,45	0,09	2,74	15,77	6.735.110,09	1,27	5.283.374.941,87	0,13
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	4,48	0,10	2,73	15,71	35.926.145,35	6,80	577.738.512,78	6,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	0,04	0,89	13,02	37.138.870,82	7,03	8.470.280.308,74	0,44
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,96	0,10	1,44	11,96	65.901.053,22	12,47	7.603.591.100,02	0,87
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	1,99	0,09	1,41	11,72	4.330.807,26	0,82	5.798.399.930,42	0,07
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	4,47	0,10	2,73	15,77	23.550.129,99	4,46	491.094.331,97	4,80
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	3,89	0,04	1,71	17,53	24.220.074,33	4,58	1.537.705.344,55	1,58
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,31	0,05	1,61	15,84	46.083.194,53	8,72	2.287.059.745,87	2,01
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,38	0,10	0,92	11,17	10.617.401,67	2,01	3.596.758.160,15	0,30
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,54	0,08	1,49	13,30	460.439.939,14	87,14		

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	67.922.787,14	12,86	10.327.922.782,38	0,66
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,07	0,04	0,94	13,56	67.922.787,14	12,86		
Renda Fixa			1,30	0,07	1,42	13,21	528.362.726,28	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Total

1,30

0,07

1,42

13,21

528.362.726,28

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	460.439.939,14	87,14	60,00	80,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	67.922.787,14	12,86	10,00	10,00	60,00	0,00	65,00
	Total Renda Fixa	528.362.726,28	100,00					100,00
Total		528.362.726,28	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	1,49 166,54	13,30 101,95	3,29 115,77	5,19 84,43	13,30 101,95	6.784.871,13	51.764.148,62
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,94 104,62	13,56 103,95	3,01 106,08	6,66 108,27	13,56 103,95	631.006,36	9.790.608,74
LENÇÓIS PAULISTA (Total)						7.415.877,49	61.554.757,36

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	3.799.649,44	471.620,46	0,00	0,00	4.330.807,26	59.537,36	1.087.878,13
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	6.555.264,83	0,00	0,00	0,00	6.735.110,09	179.845,26	355.109,00
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.758.049,04	350.000,00	-40.000,00	0,00	2.083.448,12	15.399,08	139.400,08
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	108.501.364,52	0,00	0,00	0,00	109.511.806,44	1.010.441,92	6.598.305,64
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	10.520.282,91	0,00	0,00	0,00	10.617.401,67	97.118,76	1.093.332,99
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	34.972.865,53	0,00	0,00	0,00	35.926.145,35	953.279,82	3.205.424,00
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	64.966.489,62	0,00	0,00	0,00	65.901.053,22	934.563,60	7.042.076,91
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.812.602,45	0,00	0,00	0,00	37.138.870,82	326.268,37	5.320.996,65
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	18.969.814,33	4.866.383,90	0,00	0,00	24.220.074,33	383.876,10	1.264.309,66
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	45.352.792,58	0,00	0,00	0,00	46.083.194,53	730.401,95	5.838.563,27
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	33.469.627,87	0,00	0,00	0,00	34.383.166,44	913.538,57	4.325.092,55
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	3.923.292,18	0,00	0,00	0,00	3.959.223,40	35.931,22	1.005.730,71
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	22.925.108,33	0,00	0,00	0,00	23.550.129,99	625.021,66	1.593.025,53
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	60.169.830,46	0,00	-4.689.970,44	0,00	55.999.507,48	519.647,46	6.242.847,99
	452.697.034,09	5.688.004,36	-4.729.970,44	0,00	460.439.939,14	6.784.871,13	

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	67.291.780,78	0,00	0,00	0,00	67.922.787,14	631.006,36	7.620.302,23
	67.291.780,78	0,00	0,00	0,00	67.922.787,14	631.006,36	

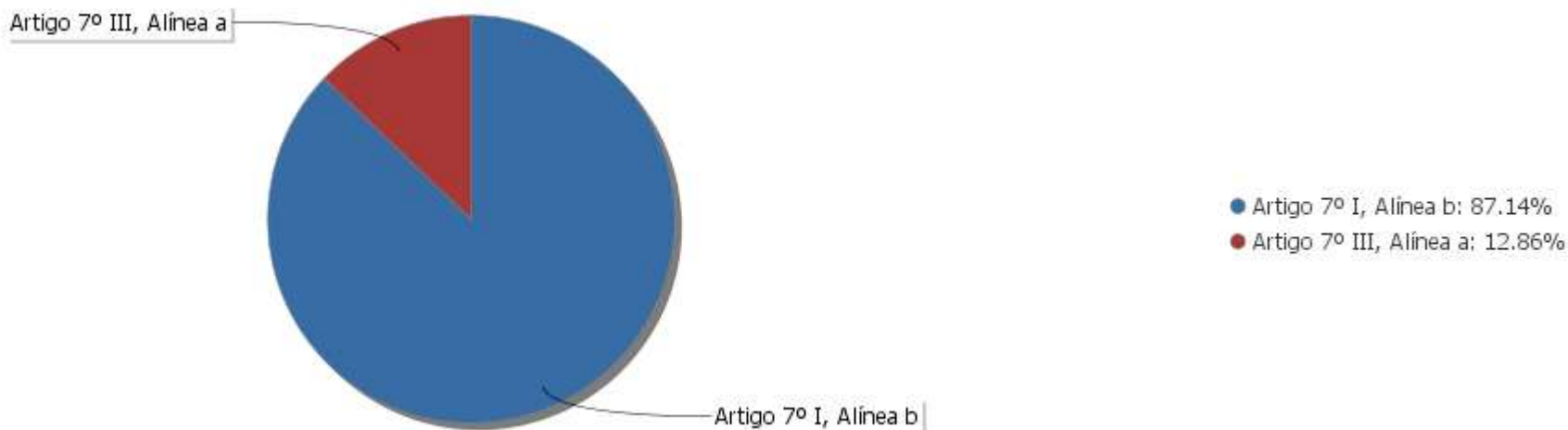
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

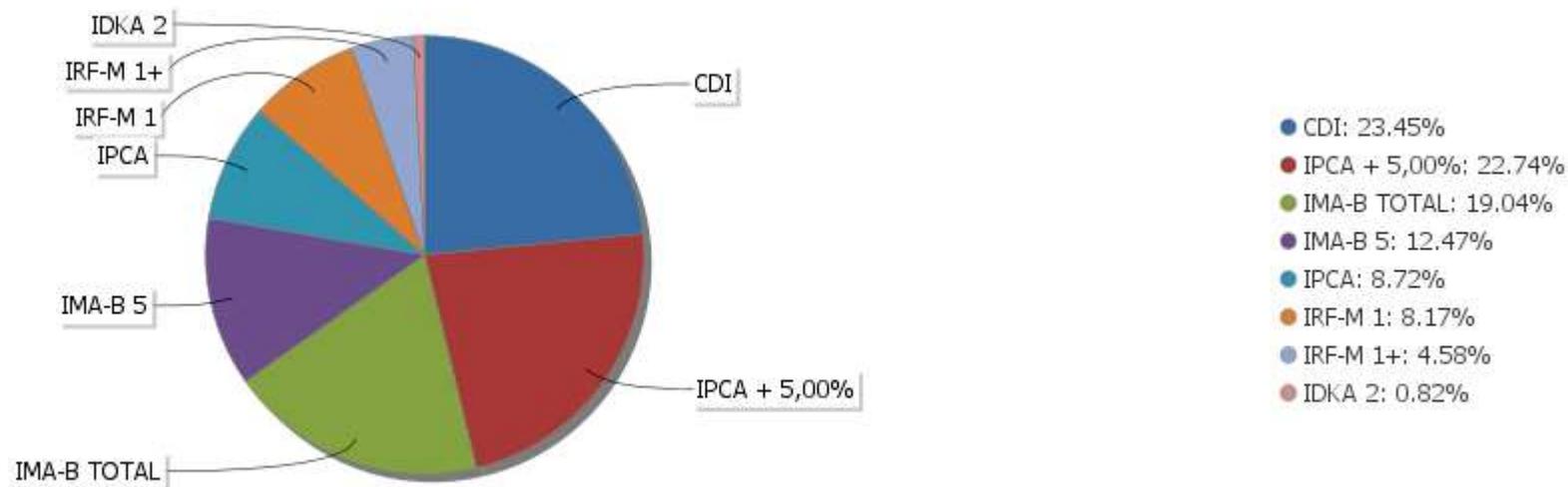
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	408.233.518,17	77,26	408.233.518,17	77,26	
de 31 dias a 365 dias	120.129.208,11	22,74	528.362.726,28	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	528.362.726,28	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

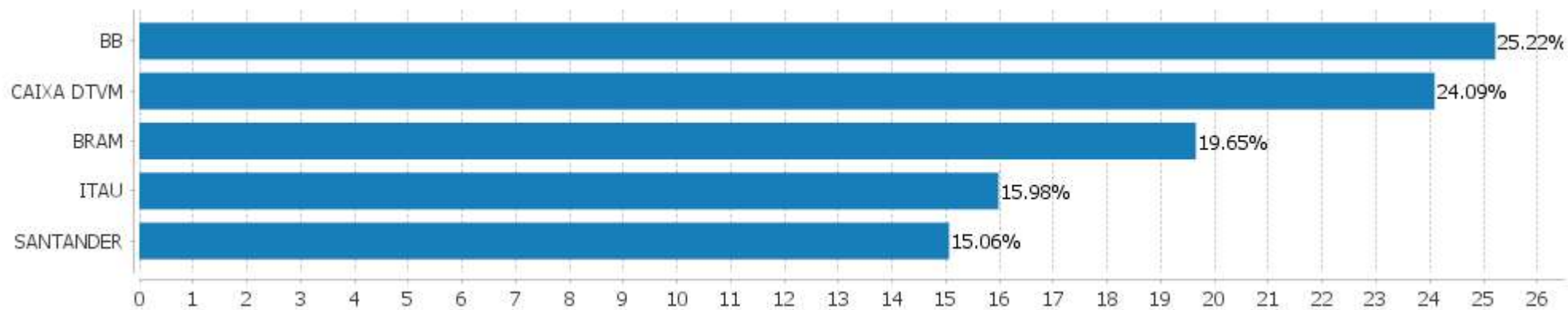


Alocação Por Estratégia



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	0,99	0,66	0,38	0,25	1,55	1,42	13,21
IPCA + 4,72%	0,94	1,17	1,13	0,94	0,63	0,30	0,51	0,65	0,63	0,63	0,65	0,93	9,50
p.p. indexador	0,24	-0,18	0,35	0,09	0,55	1,06	0,49	0,00	-0,25	-0,38	0,90	0,49	3,71
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	23	37,70
Meses abaixo - Meta Atuarial	38	62,30

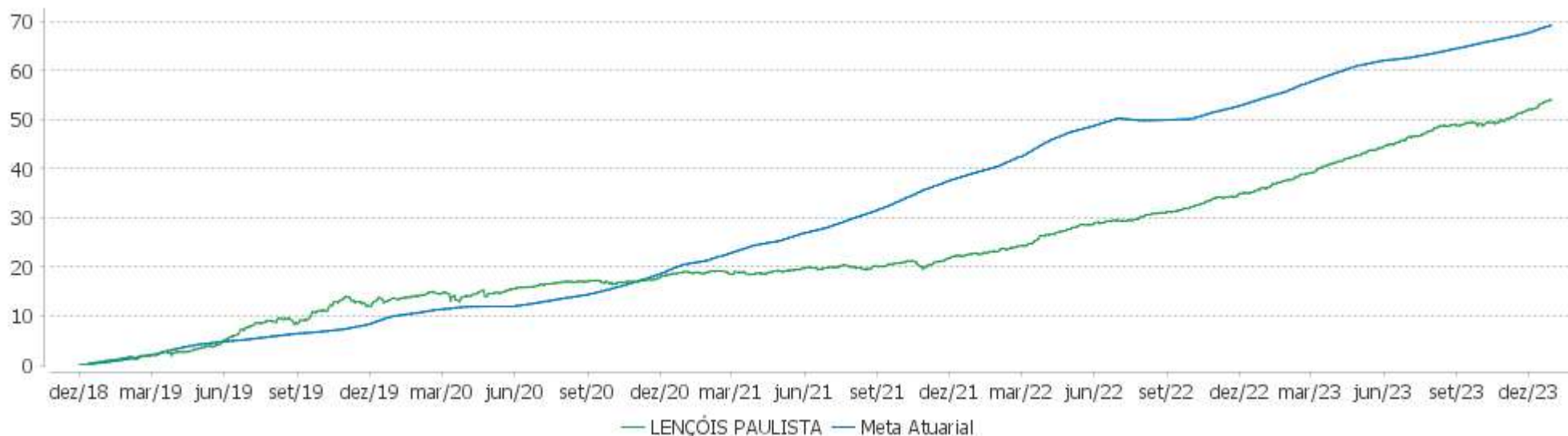
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,45	2019-06
Menor rentabilidade da Carteira	-1,46	2019-11

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,25	2,22	1,03	1,66
06 meses	5,36	4,05	1,30	1,54
12 meses	13,21	9,50	3,71	1,30
24 meses	25,53	21,45	4,08	1,22
36 meses	29,52	40,87	-11,35	1,35
48 meses	35,63	56,03	-20,41	1,61
60 meses	52,93	72,56	-19,63	1,84
Desde 30/11/2018	54,10	73,62	-19,52	1,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

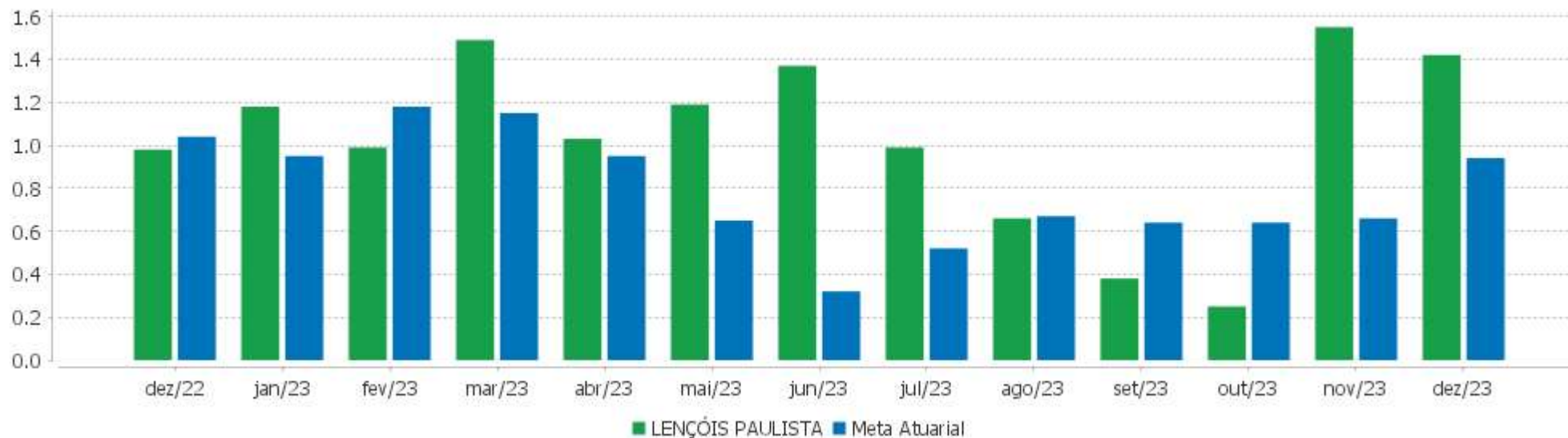


Patrimônio Líquido



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.	0,92 0,00	13,06 -0,19	2,85 -0,04	6,09 -0,07	13,06 -0,19	26,46 -0,40	29,99 -0,58
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,44 -0,02	11,96 -0,16	2,92 -0,05	4,64 -0,11	11,96 -0,16	22,79 -0,30	28,09 -0,63
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,89 -0,03	12,88 -0,36	2,80 -0,09	6,00 -0,16	12,88 -0,36	26,12 -0,73	29,46 -1,12
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,92 -0,03	11,17 1,38	2,16 -0,12	5,32 1,13	11,17 1,38		
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,93 -0,02	6,12 1,18	2,18 -0,10	5,37 1,18			
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	1,61 1,05	15,84 11,22	4,04 2,95	5,04 3,34	15,84 11,22	24,91 14,24	30,57 8,76
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TÍTULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,73 -0,02	15,71 -0,35	4,68 -0,08	4,05 -0,16	15,71 -0,35	22,65 -0,79	20,66 -1,22
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	1,71 -0,02	18,18 -0,33	5,00 -0,05	6,24 -0,14	18,18 -0,33	26,41 -0,89	19,70 -1,26
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLAÇÃO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,73 -0,02	15,78 -0,28	4,69 -0,06	4,09 -0,12	15,78 -0,28	22,88 -0,57	21,05 -0,83
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,41 -0,04	11,72 -0,40	2,88 -0,01	4,84 -0,16	11,72 -0,40	22,14 -0,46	27,81 -0,89
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,74 -0,01	15,77 -0,28	4,71 -0,04	4,04 -0,17	15,77 -0,28	22,83 -0,62	20,97 -0,92
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,89 -0,03	13,02 -0,23	2,83 -0,07	6,04 -0,12	13,02 -0,23	26,29 -0,57	29,70 -0,87
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,89 99,35	12,90 98,84	2,78 97,89	6,05 98,46	12,90 98,84	26,78 99,06	32,28 98,95
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,73 -0,02	15,77 -0,28	4,69 -0,06	4,09 -0,12	15,77 -0,28	22,85 -0,60	20,97 -0,92
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,94 104,62	13,63 104,43	3,01 106,08	6,66 108,27	13,63 104,43	28,40 105,03	34,74 106,51
LENÇÓIS PAULISTA Var. IPCA + 4,87% p.p.	1,42 0,49	13,21 3,71	3,25 1,03	5,36 1,30	13,21 3,71	25,53 4,26	29,52 -10,23
CDI	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
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 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 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 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	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	8,75	2,05	3,70	8,75	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
272	04/12/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	40.000,00	11.428,98485400	3,4998733930
273	07/12/2023	BB PREV RF IDKA2	471.620,46	0,00	129.188,95634900	3,6506252030
266	08/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	1.134.974,95	0,00	372.047,54905300	3,0506180000
268	08/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	2.600.000,00	0,00	852.286,32362300	3,0506180000
269	14/12/2023	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	3.514.970,44	93.815,42686900	37,4668704000
270	27/12/2023	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.175.000,00	31.253,50504800	37,5957832000
267	28/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	1.131.408,95	0,00	365.214,96962800	3,0979260000
271	28/12/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	350.000,00	0,00	99.252,51704300	3,5263589320
Total			5.688.004,36	4.729.970,44		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 4.506.772,43 Value-At-Risk: 0,85%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LENÇÓIS PAULISTA		0,85		0,85			528.362.726,28	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,85%

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		0,36	0,03	0,36			109.511.806,44	20,73
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI		0,02	-0,00	0,01			55.999.507,48	10,60
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,08	-0,00	0,12			3.959.223,40	0,75
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI		2,22	0,14	0,00			34.383.166,44	6,51
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,09	0,00	0,01			2.083.448,12	0,39
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,21	0,03	0,02			6.735.110,09	1,27
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		2,23	0,15	0,00			35.926.145,35	6,80
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,09	0,00	0,02			37.138.870,82	7,03
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,24	0,15	0,01			65.901.053,22	12,47
BB PREV RF IDKA2		1,15	0,01	0,16			4.330.807,26	0,82
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR		2,22	0,10	0,01			23.550.129,99	4,46
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		1,96	0,08	0,02			24.220.074,33	4,58
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,84	0,16	1,84			46.083.194,53	8,72
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,36	0,00	0,36			10.617.401,67	2,01
Sub-total	1,03	0,98	0,85		0,58	1,49	460.439.939,14	87,14

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,02			67.922.787,14	12,86
Sub-total	0,03	0,03	-0,00		1,38	0,94	67.922.787,14	12,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

- (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 (%)