



LDB
EMPRESAS

LENÇÓIS PAULISTA
JUNHO 2024



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 28.06.2024.

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 IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,81	-0,51	-0,99	-1,23	3.946.545,31	0,72	4.649.802.742,18	0,08
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,35	-0,02	0,61	4,40	1.422.388,70	0,26	8.181.670.586,25	0,02
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,70	-0,22	0,26	3,11	6.632.401,30	1,21	5.571.325.652,69	0,12
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,87	0,05	1,17	5,78	112.561.793,58	20,50	3.477.615.018,87	3,24
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,87	0,05	1,16	5,73	10.913.498,53	1,99	3.697.064.132,53	0,30
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	3,81	-0,51	-1,00	-1,26	1.645.203,28	0,30	493.224.578,38	0,33
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,72	-0,18	0,37	3,21	56.455.088,85	10,28	7.303.046.549,52	0,77
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	-0,02	0,61	4,48	65.854.524,04	11,99	7.877.165.450,51	0,84
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	3,51	0,00	-0,26	0,57	0,00	0,00	963.696.117,89	0,00
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,70	-0,11	-0,20	1,91	46.963.155,04	8,55	2.052.875.038,41	2,29
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	3,81	-0,51	-0,98	-1,20	1.149.741,15	0,21	340.562.033,85	0,34
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	0,35	0,04	0,69	4,49	37.149.450,64	6,77	572.668.094,57	6,49
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	3,81	-0,51	-0,99	-1,24	304.940,87	0,06	476.058.771,06	0,06
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,06	0,04	0,78	5,16	89.898.552,92	16,37	7.377.738.310,48	1,22
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,51	-0,03	0,40	3,04	434.897.284,21	79,20		

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	0,11	0,04	0,83	5,69	114.235.557,66	20,80	11.692.368.410,92	0,98
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,11	0,04	0,83	5,69	114.235.557,66	20,80		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa	1,32	-0,01	0,47	3,39	549.132.841,87	100,00
Total	1,32	-0,01	0,47	3,39	549.132.841,87	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	434.897.284,21	79,20	60,00	80,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	114.235.557,66	20,80	2,00	9,00	60,00	0,00	65,00
	Total Renda Fixa	549.132.841,87	100,00					100,00
Total		549.132.841,87	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	0,40 50,78	3,04 58,27	1,20 47,58	3,04 58,27	8,39 71,78	1.883.879,67	14.026.005,73
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,83 105,90	5,69 108,90	2,69 106,17	5,69 108,90	12,72 108,82	671.349,82	3.995.770,52
LENÇÓIS PAULISTA (Total)						2.555.229,49	18.021.776,25

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 IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	8.011.763,06	0,00	-3.986.281,35	0,00	3.946.545,31	-78.936,40	-96.952,42
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.270.937,96	280.000,00	-137.000,00	0,00	1.422.388,70	8.450,74	83.700,98
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	5.677.291,83	936.542,84	0,00	0,00	6.632.401,30	18.566,63	159.756,59
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	111.262.969,16	0,00	0,00	0,00	112.561.793,58	1.298.824,42	6.193.670,38
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	10.788.351,15	0,00	0,00	0,00	10.913.498,53	125.147,38	595.637,89
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	35.830.192,02	0,00	-34.000.000,00	0,00	1.645.203,28	-184.988,74	-280.942,07
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	56.245.651,72	0,00	0,00	0,00	56.455.088,85	209.437,13	1.903.074,01
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	61.466.015,71	4.007.007,34	0,00	0,00	65.854.524,04	381.500,99	1.807.107,26
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	2.663.437,38	0,00	-2.656.420,50	0,00	0,00	-7.016,88	130.334,33
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	47.057.684,49	0,00	0,00	0,00	46.963.155,04	-94.529,45	879.960,51
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	34.308.604,37	0,00	-33.000.000,00	0,00	1.149.741,15	-158.863,22	-233.425,29
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	4.108.729,32	33.000.000,00	0,00	0,00	37.149.450,64	40.721,32	190.227,24
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	31.448.416,09	0,00	-31.000.000,00	0,00	304.940,87	-143.475,22	-205.189,12
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	58.429.511,95	31.000.000,00	0,00	0,00	89.898.552,92	469.040,97	2.899.045,44
	468.569.556,21	69.223.550,18	-104.779.701,85	0,00	434.897.284,21	1.883.879,67	

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	76.761.207,84	36.803.000,00	0,00	0,00	114.235.557,66	671.349,82	3.995.770,52
	76.761.207,84	36.803.000,00	0,00	0,00	114.235.557,66	671.349,82	

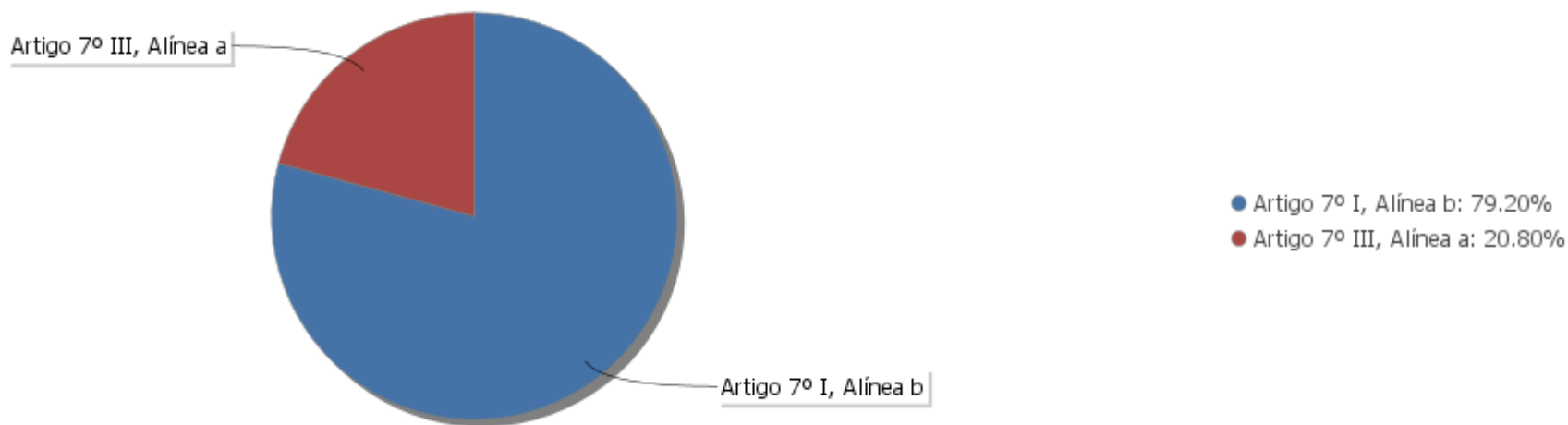
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

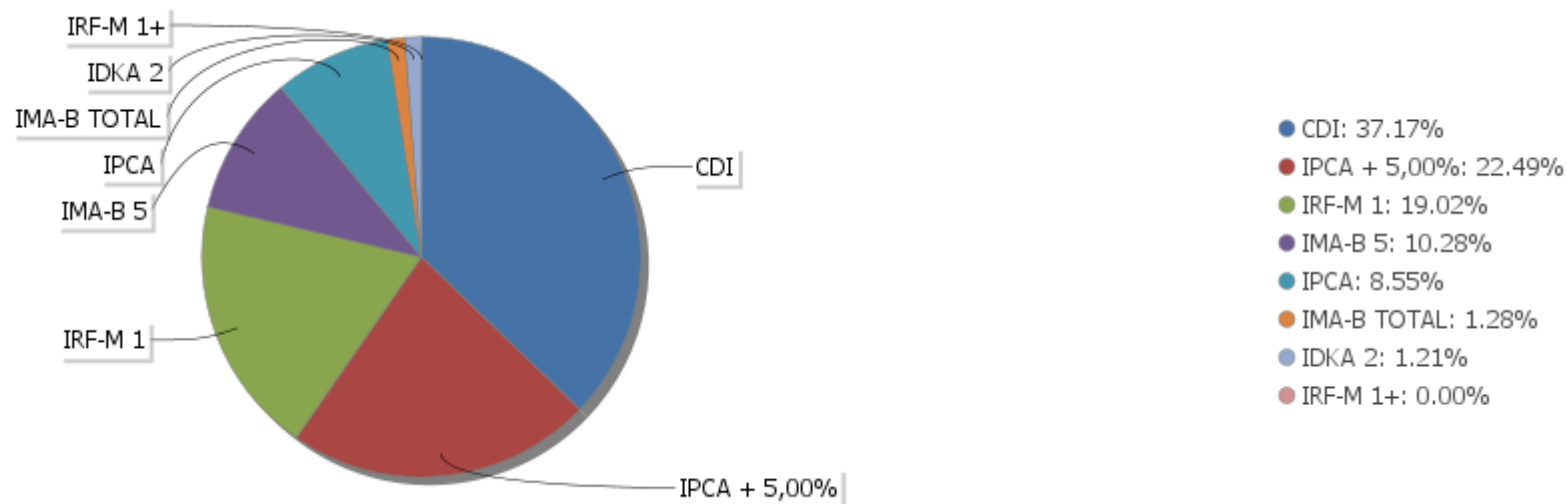
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	425.657.549,76	77,51		425.657.549,76	77,51	
de 31 dias a 365 dias	123.475.292,11	22,49		549.132.841,87	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00		549.132.841,87	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

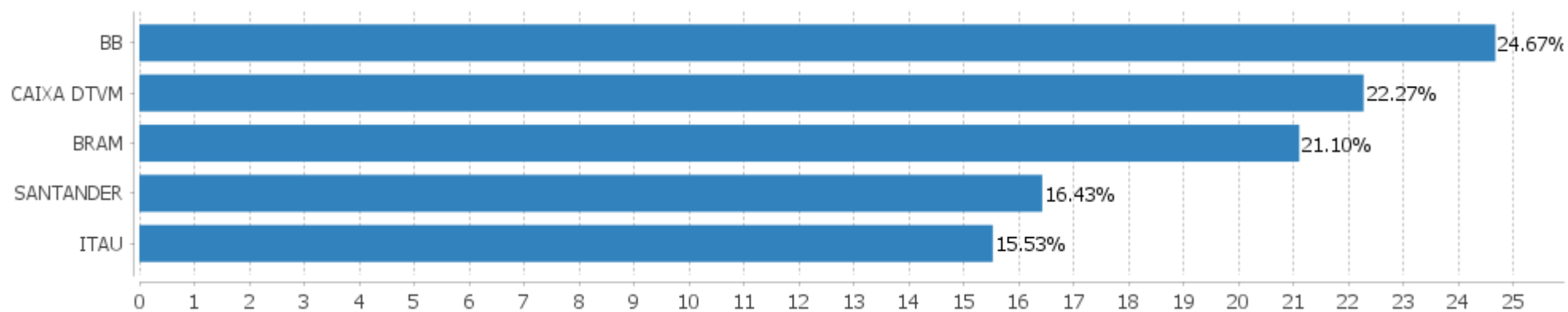


Alocação Por Estratégia



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
2024	0,63	0,67	0,65	0,01	0,93	0,47							3,39
IPCA + 5,00%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60							4,97
p.p. indexador	-0,22	-0,53	0,10	-0,80	0,06	-0,13							-1,58
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

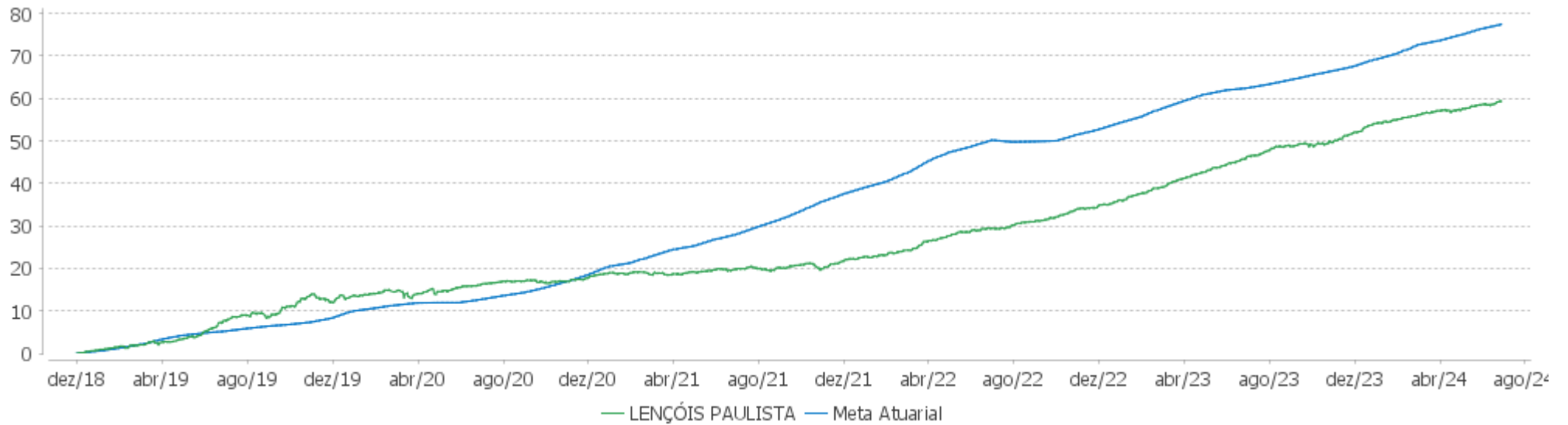
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	25	37,31
Meses abaixo - Meta Atuarial	42	62,69
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,45	2019-06
Menor rentabilidade da Carteira	-1,46	2019-11

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,41	2,29	-0,89	1,26
06 meses	3,39	4,97	-1,58	1,04
12 meses	8,93	9,23	-0,30	1,32
24 meses	23,04	18,07	4,97	1,18
36 meses	32,96	38,90	-5,93	1,29
48 meses	37,15	59,05	-21,89	1,30
60 meses	47,98	72,22	-24,24	1,75
Desde 30/11/2018	59,33	82,25	-22,93	1,77

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

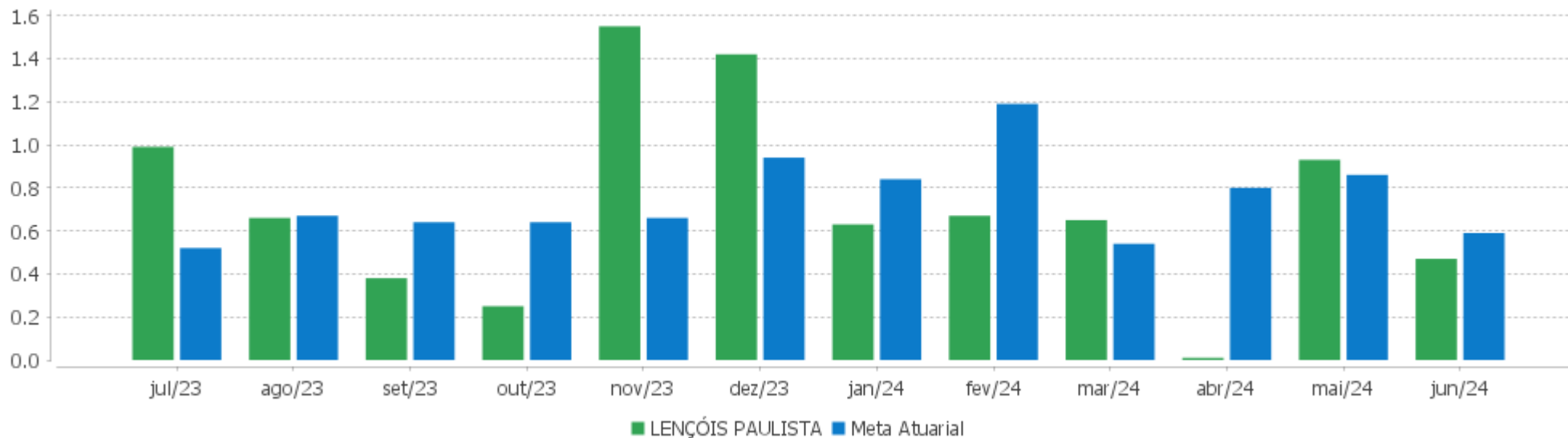


Patrimônio Líquido



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 INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,69 0,05	4,49 -0,02	2,01 0,01	4,49 -0,02	10,86 -0,09	25,93 -0,35	34,78 -0,58
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,37 -0,02	3,21 -0,11	1,18 -0,06	3,21 -0,11	8,00 -0,23	18,98 -0,31	30,69 -0,61
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,61 -0,03	4,40 -0,11	1,93 -0,08	4,40 -0,11	10,66 -0,28	25,58 -0,70	34,27 -1,09
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,16 0,56	5,73 0,75	2,86 0,57	5,73 0,75	11,35 1,97	20,70 2,24	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,17 0,57	5,78 0,80	2,88 0,59	5,78 0,80	11,45 2,08		
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,00 -0,03	-1,26 -0,16	-1,36 -0,09	-1,26 -0,16	2,73 -0,33	16,27 -0,74	20,23 -1,19
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	-0,20 -0,41	1,91 -0,57	0,31 -0,74	1,91 -0,57	7,05 2,82	20,92 13,39	31,73 11,43
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,75 -0,03	0,08 -0,13	-1,20 -0,06	0,08 -0,13	6,33 -0,28	25,74 -0,91	24,05 -1,30
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,98 -0,01	-1,20 -0,10	-1,32 -0,05	-1,20 -0,10	2,85 -0,22	16,48 -0,53	20,62 -0,80
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IDKA 2 p.p.	0,26 0,08	3,11 -0,10	1,05 0,09	3,11 -0,10	8,11 -0,26	18,30 -0,13	29,95 -0,45
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,99 -0,02	-1,23 -0,13	-1,33 -0,06	-1,23 -0,13	2,76 -0,30	16,42 -0,59	20,47 -0,95
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,61 -0,03	4,48 -0,02	1,97 -0,04	4,48 -0,02	10,79 -0,16	25,84 -0,44	34,58 -0,78
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,78 99,21	5,16 98,74	2,49 98,56	5,16 98,74	11,52 98,55	26,51 98,87	37,47 99,15
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,99 -0,02	-1,24 -0,14	-1,34 -0,07	-1,24 -0,14	2,80 -0,26	16,41 -0,59	20,51 -0,91
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,83 105,90	5,69 108,90	2,69 106,17	5,69 108,90	12,72 108,82	28,36 105,76	40,37 106,82
LENÇÓIS PAULISTA Var. IPCA + 4,87% p.p.	0,47 -0,13	3,39 -1,58	1,41 -0,89	3,39 -1,58	8,93 -0,44	23,04 4,58	32,96 -6,19
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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 RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
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 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 INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 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	0,63	4,51	2,00	4,51	10,95	26,28	35,36	38,12	46,42
IRF-M 1+	-0,72	0,22	-1,14	0,22	6,61	26,65	25,36	23,98	38,61
IRF-M TOTAL	-0,29	1,51	-0,17	1,51	7,89	25,94	28,16	28,34	40,94
IMA-B 5	0,39	3,32	1,24	3,32	8,23	19,30	31,30	39,26	51,54
IMA-B 5+	-2,25	-5,04	-3,58	-5,04	-1,43	14,67	12,20	21,76	24,16
IMA-B TOTAL	-0,97	-1,10	-1,27	-1,10	3,07	17,01	21,42	30,44	36,89
IMA-GERAL TOTAL	0,05	2,42	0,77	2,42	8,23	23,40	29,99	34,60	43,37
IDKA 2	0,18	3,21	0,95	3,21	8,37	18,43	30,40	39,61	51,85
IDKA 20	-5,03	-12,09	-7,87	-12,09	-8,64	12,55	-2,74	9,26	4,14
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28	30,35	22,72
IBRX 100	1,51	-7,20	-3,03	-7,20	5,59	24,17	-4,44	30,28	24,20
IBRX 50	1,63	-6,12	-2,15	-6,12	7,39	26,37	-2,31	34,31	25,00
SMALL CAP	-0,39	-14,85	-11,23	-14,85	-11,96	5,47	-36,29	-11,04	-6,45
Índice Consumo - ICON	0,69	-14,03	-7,46	-14,03	-15,14	-8,69	-50,90	-42,61	-34,58
Índice Dividendos - IDIV	1,99	-3,41	0,42	-3,41	12,09	31,97	26,56	56,67	56,43

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	9,73	31,45	15,63	31,45	41,53	53,09	41,20	78,79	169,26

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,04	1,08	-1,78	1,08	6,09	19,73	21,51	19,28	27,46

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,28	26,67	13,94	26,67	35,48	42,62	23,79	55,10	122,26

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,21	2,48	1,05	2,48	4,23	7,52	20,30	30,35	33,12
INPC	0,25	2,68	1,08	2,68	3,70	6,81	19,54	30,56	33,63
IGPM	0,81	1,10	2,03	1,10	2,45	-4,57	5,64	43,41	53,90
SELIC	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,52	4,48	2,05	4,48	8,35	16,22	35,24	52,37	61,87
IPCA + 5,00%	0,60	4,97	2,29	4,97	9,38	18,45	39,16	58,28	69,77
IPCA + 5,50%	0,64	5,22	2,42	5,22	9,89	19,57	41,15	61,30	73,84
IPCA + 5,89%	0,67	5,41	2,51	5,41	10,29	20,45	42,71	63,69	77,07
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15	64,37	77,99
INPC + 4,00%	0,56	4,68	2,08	4,68	7,80	15,45	34,38	52,62	62,48
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24	64,64	78,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
321	04/06/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	27.000,00	7.370,08371800	3,6634590640
319	07/06/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	936.542,84	0,00	246.840,96335500	3,7941143450
327	07/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	108.755,96	0,00	30.878,57873700	3,5220520000
328	10/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.241.830,88	0,00	352.527,16631400	3,5226530000
333	10/06/2024	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	2.803.000,00	0,00	161.162,27078893	17,3924082000
322	14/06/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	280.000,00	0,00	76.274,72499693	3,6709408000
323	24/06/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	40.000,00	10.867,40130200	3,6807327610
325	26/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.396.776,84	0,00	677.002,05633400	3,5402800000
329	26/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	2.656.420,50	852.286,32287362	3,1168170000
332	26/06/2024	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	0,00	33.000.000,00	710.614,97265747	46,4386500000
349	26/06/2024	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	0,00	31.000.000,00	901.262,38019069	34,3961988000
326	27/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	259.643,66	0,00	73.313,08997400	3,5415730000
330	27/06/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	31.000.000,00	0,00	783.764,87988054	39,5526781000
331	27/06/2024	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	33.000.000,00	0,00	719.837,01319468	45,8437110000
334	27/06/2024	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	34.000.000,00	0,00	1.944.274,18543418	17,4872455000
336	27/06/2024	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	0,00	34.000.000,00	7.572.812,48063643	4,4897454000
320	28/06/2024	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	3.986.281,35	510.011,78082100	7,8160573930
324	28/06/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	70.000,00	19.005,82538800	3,6830812960
Total			106.026.550,18	104.779.701,85		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.324.084,74

Value-At-Risk: 0,24%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,17	0,24		0,24	-0,26	0,49	549.132.841,87	100,00
LENÇÓIS PAULISTA		0,24		0,24			549.132.841,87	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,24%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,99	2,16	0,01	0,01	-0,44	-0,99	3.946.545,31	0,72
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,51	0,24	0,00	0,01	-0,36	0,61	1.422.388,70	0,26
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,95	0,99	0,01	0,16	-0,27	0,26	6.632.401,30	1,21
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	1,02	0,31	0,03	0,33	0,37	1,17	112.561.793,58	20,50
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,02	0,31	0,00	0,33	0,37	1,16	10.913.498,53	1,99
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	3,99	2,15	0,01	0,00	-0,45	-1,00	1.645.203,28	0,30
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,71	0,91	0,09	0,01	-0,24	0,37	56.455.088,85	10,28
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,52	0,23	0,02	0,02	-0,35	0,61	65.854.524,04	11,99
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	5,03	NaN	0,00	NaN	-0,31	-0,75	0,00	0,00
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,46	0,90	0,07	0,90	-0,29	-0,20	46.963.155,04	8,55
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	3,99	2,15	0,00	0,01	-0,44	-0,98	1.149.741,15	0,21
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	0,48	0,23	0,00	0,32	-0,21	0,69	37.149.450,64	6,77
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	4,00	2,15	0,00	0,01	-0,44	-0,99	304.940,87	0,06
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,01	0,01	0,00	0,00	-0,56	0,78	89.898.552,92	16,37
Sub-total	1,46	0,31	0,24		-0,27	0,40	434.897.284,21	79,20

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,04	-0,00	0,04	0,98	0,83	114.235.557,66	20,80
Sub-total	0,05	0,04	-0,00		0,98	0,83	114.235.557,66	20,80

(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 (%)