



LDB
EMPRESAS

LENÇÓIS PAULISTA
OUTUBRO 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 31.10.2024.

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	3,67	0,10	-0,67	-0,08	3.992.324,17	0,70	4.070.369.176,30	0,10
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,41	0,04	0,82	7,85	1.616.997,08	0,28	8.415.592.732,29	0,02
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,70	0,01	0,81	5,91	3.709.457,93	0,65	4.919.072.193,80	0,08
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2025 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,76	0,07	1,16	2,60	48.291.342,40	8,48	1.342.605.683,75	3,60
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	1,99	0,02	0,89	1,51	79.479.485,57	13,95	3.760.040.315,03	2,11
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BRASIL 2026 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA	2,10	0,02	0,89	3,03	86.372.535,68	15,16	882.411.661,21	9,79
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,41	0,04	0,83	7,99	71.815.821,69	12,61	8.121.204.821,20	0,88
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	0,41	0,05	0,83	7,97	60.143.788,23	10,56	646.326.239,15	9,31
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,04	0,04	0,92	8,89	102.474.598,47	17,99	7.209.598.357,18	1,42
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,10	0,04	0,89	6,46	457.896.351,22	80,40		

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				
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,10	0,04	0,93	9,68	108.802.067,12	19,10	15.416.999.740,59	0,71
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,07	0,04	0,59	0,59	2.853.799,98	0,50	7.254.276.668,81	0,04
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,10	0,04	0,93	9,68	111.655.867,10	19,60		
Renda Fixa			0,95	0,04	0,90	6,91	569.552.218,32	100,00		
Total			0,95	0,04	0,90	6,91	569.552.218,32	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	457.896.351,22	80,40	60,00	80,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	111.655.867,10	19,60	2,00	9,00	60,00	0,00	65,00
	Total Renda Fixa	569.552.218,32	100,00					100,00
Total		569.552.218,32	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	0,89 96,18	6,46 71,81	2,37 89,28	4,70 89,15	9,81 89,34	4.081.310,93	28.685.033,74
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,93 99,98	9,68 107,60	2,75 103,75	5,56 105,54	11,80 107,47	1.016.800,86	8.103.450,08
LENÇÓIS PAULISTA (Total)						5.098.111,79	36.788.483,82

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	4.019.293,46	0,00	0,00	0,00	3.992.324,17	-26.969,29	-51.173,56
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.414.250,20	260.000,00	-70.000,00	0,00	1.616.997,08	12.746,88	132.309,36
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	3.432.845,57	247.720,49	0,00	0,00	3.709.457,93	28.891,87	318.189,49
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2025 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	47.739.423,72	0,00	0,00	0,00	48.291.342,40	551.918,68	1.224.705,56
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	78.778.378,52	0,00	0,00	0,00	79.479.485,57	701.107,05	1.180.932,28
CAIXA BRASIL 2026 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA	85.612.675,70	0,00	0,00	0,00	86.372.535,68	759.859,98	2.333.342,87
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	73.927.339,23	1.350.686,82	-4.080.312,69	0,00	71.815.821,69	618.108,33	4.144.670,42
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	59.645.844,06	0,00	0,00	0,00	60.143.788,23	497.944,17	1.922.604,69
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	101.536.895,21	0,00	0,00	0,00	102.474.598,47	937.703,26	6.325.994,94
	456.106.945,67	1.858.407,31	-4.150.312,69	0,00	457.896.351,22	4.081.310,93	

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	107.802.066,24	0,00	0,00	0,00	108.802.067,12	1.000.000,88	8.086.650,10
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,00	2.837.000,00	0,00	0,00	2.853.799,98	16.799,98	16.799,98
	107.802.066,24	2.837.000,00	0,00	0,00	111.655.867,10	1.016.800,86	

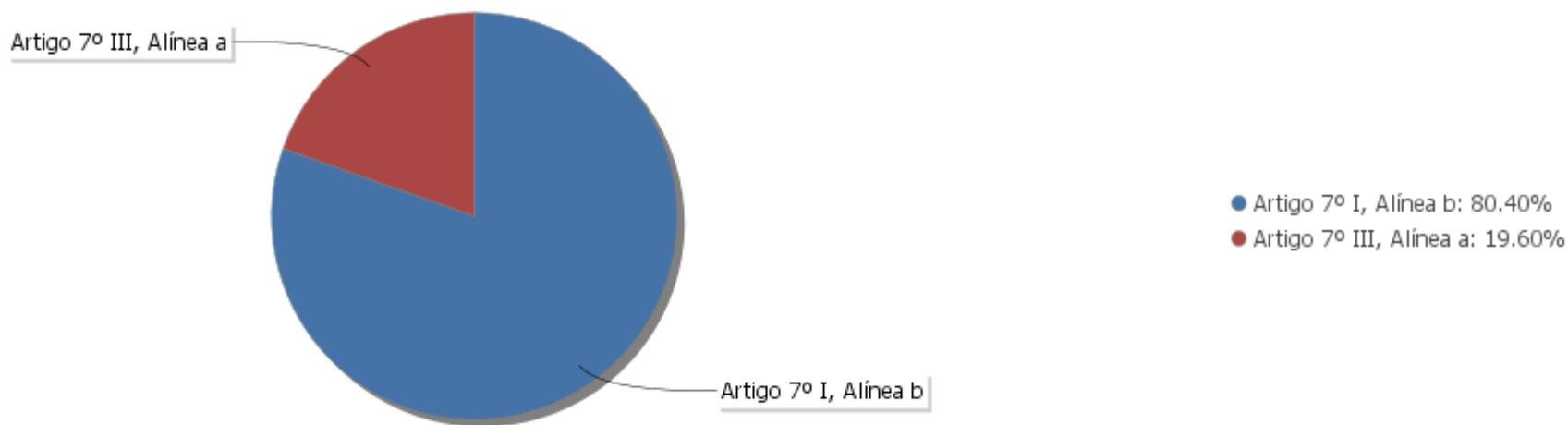
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

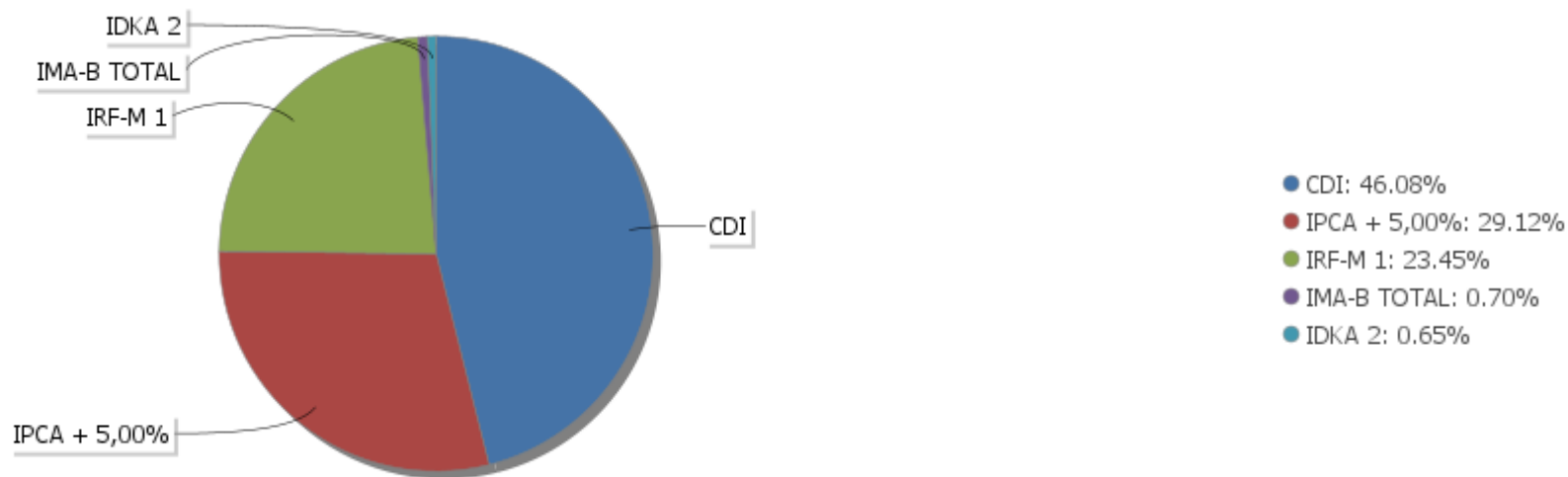
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	441.781.390,35	77,57		441.781.390,35	77,57	
de 31 dias a 365 dias	48.291.342,40	8,48		490.072.732,75	86,05	
acima de 365 dias	79.479.485,57	13,95		569.552.218,32	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

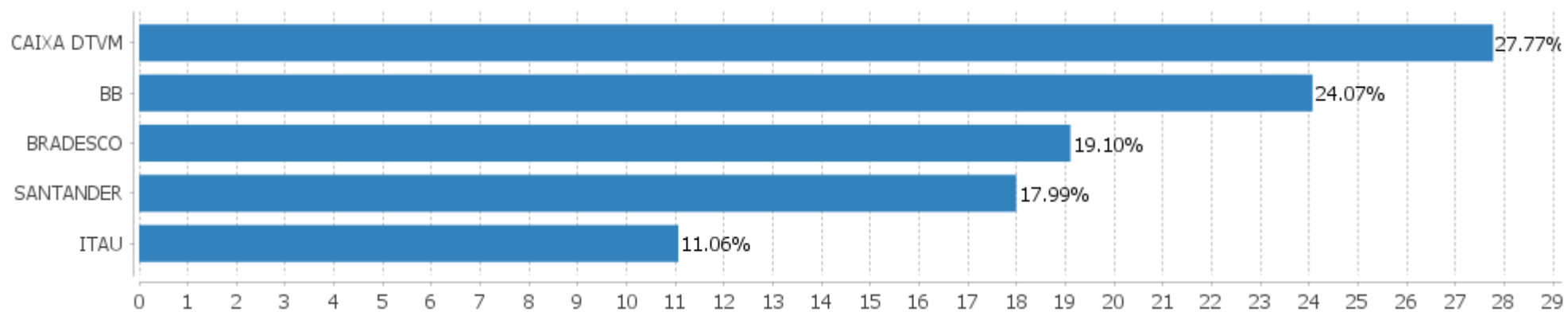


Alocação Por Estratégia



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	0,94	0,78	0,74	0,90			6,91
IPCA + 5,00%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60	0,83	0,41	0,85	1,01			8,26
p.p. indexador	-0,22	-0,53	0,10	-0,80	0,06	-0,13	0,11	0,37	-0,11	-0,11			-1,34
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

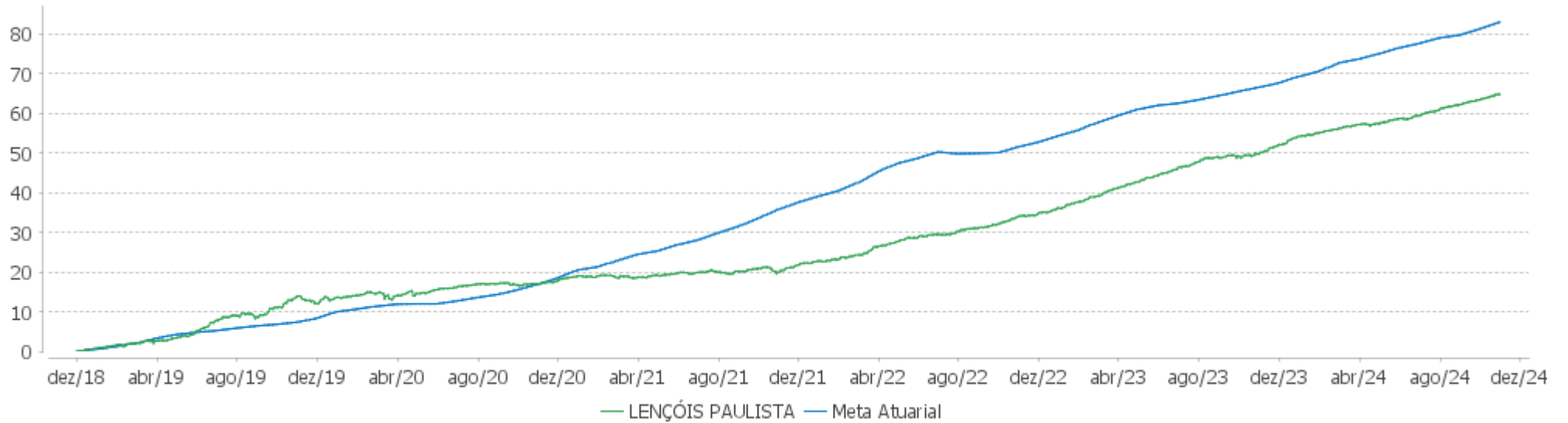
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	27	38,03
Meses abaixo - Meta Atuarial	44	61,97
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,45	2019-06
Menor rentabilidade da Carteira	-1,46	2019-11

Relatório

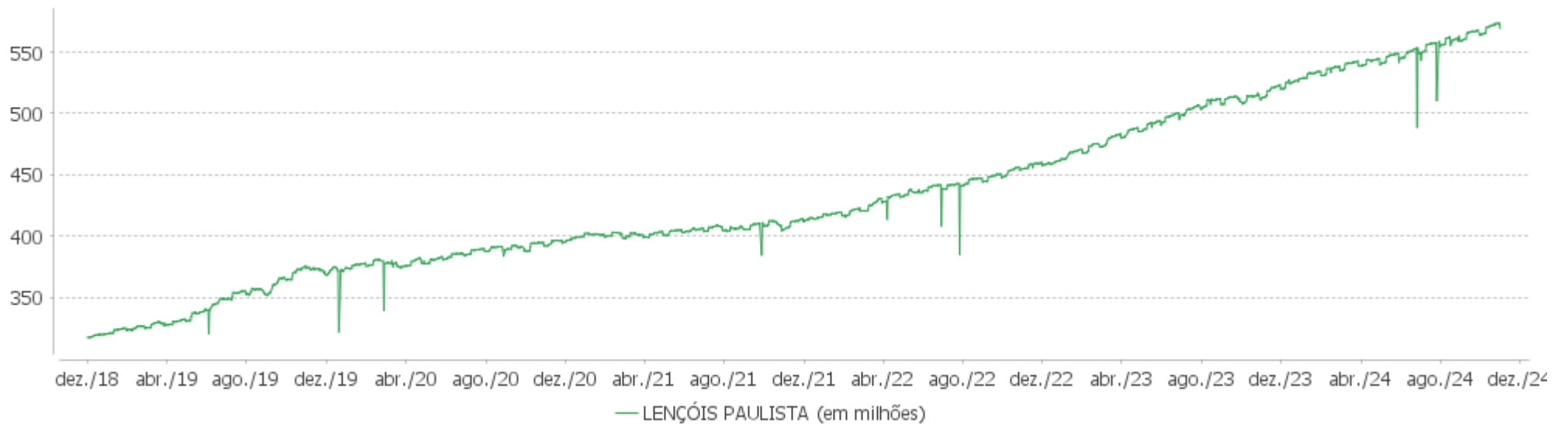
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,44	2,28	0,16	0,61
06 meses	4,85	4,65	0,20	0,81
12 meses	10,11	9,97	0,14	0,95
24 meses	22,94	20,72	2,22	1,14
36 meses	37,37	34,91	2,46	1,15
48 meses	40,89	57,46	-16,57	1,24
60 meses	44,87	73,37	-28,50	1,58
Desde 30/11/2018	64,75	87,96	-23,20	1,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

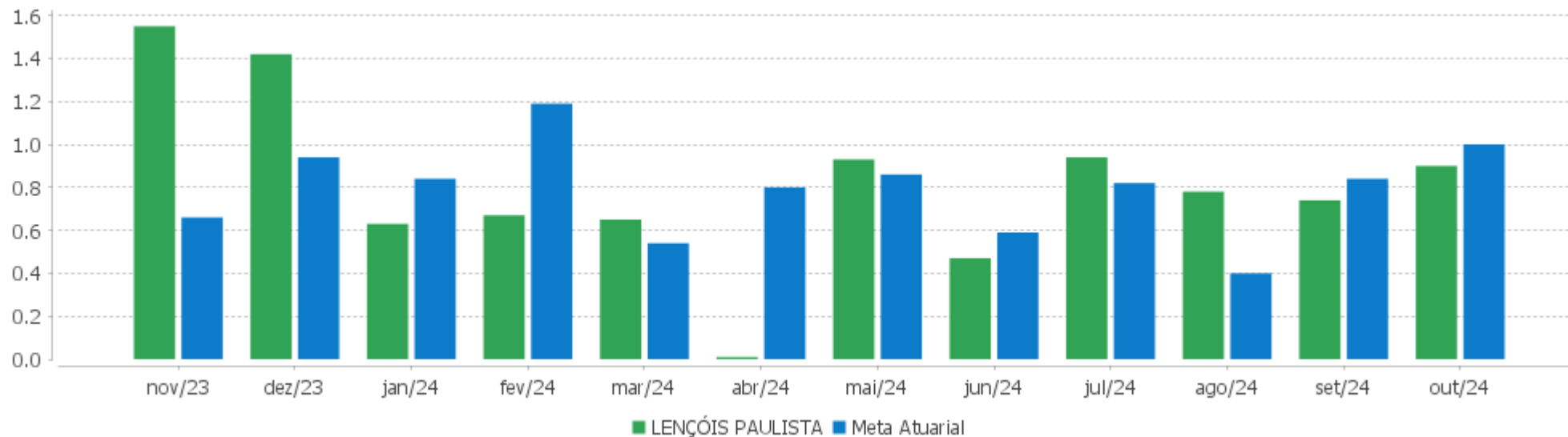


Patrimônio Líquido



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
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2025 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA % do CDI	1,16 124,59	5,14 104,08	3,07 115,59				
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,83 -0,01	7,97 -0,11	2,44 -0,02	4,72 -0,16	10,02 -0,13	24,62 -0,39	38,86 -0,54
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IDKA 2 p.p.	0,81 0,00	5,91 0,05	1,93 0,13	4,06 0,21	9,33 -0,05	18,99 -0,26	33,44 -0,71
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,89 -0,12	3,29 -0,97	2,01 -0,28				
CAIXA BRASIL 2026 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,89 -0,12	3,77 -1,37	2,02 -0,26	4,00 -0,65			
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,82 -0,03	7,85 -0,23	2,38 -0,08	4,70 -0,18	9,86 -0,30	24,28 -0,73	38,24 -1,17
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,67 -0,02	-0,08 -0,24	-0,90 -0,09	1,47 -0,16	5,34 -0,28	14,51 -0,59	27,21 -1,01
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,83 -0,02	7,99 -0,10	2,40 -0,05	4,77 -0,11	10,00 -0,15	24,59 -0,42	38,60 -0,80
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,92 99,52	8,89 98,91	2,64 99,43	5,22 98,98	10,85 98,79	25,52 98,65	39,90 98,91
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,93 100,36	9,37 104,17	2,70 101,86	5,43 103,03	11,50 104,72	26,96 104,20	42,53 105,45
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,93 99,97	9,68 107,60	2,75 103,74	5,56 105,54	11,80 107,47	27,41 105,95	42,87 106,28
LENÇÓIS PAULISTA Var. IPCA + 4,87% p.p.	0,90 -0,11	6,91 -1,34	2,44 0,16	4,85 0,20	10,11 0,10	22,94 1,88	37,37 2,03
CDI	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87	40,33
IBOVESPA	-1,60	-3,33	1,61	3,01	14,64	11,79	25,33
INPC + 6,00%	1,15	9,17	2,50	5,04	10,90	22,40	38,12
IPCA + 6,00%	1,10	9,13	2,54	5,16	11,07	23,38	39,24

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						
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2025 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
CAIXA BRASIL 2026 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI			D+0	D+0		0,18
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,18
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	0,84	8,08	2,45	4,88	10,15	25,01	39,40	41,88	47,64
IRF-M 1+	-0,14	2,35	0,56	2,01	7,39	21,52	36,19	28,16	34,10
IRF-M TOTAL	0,21	4,12	1,21	2,94	8,27	22,29	36,91	32,39	38,26
IMA-B 5	0,74	6,08	1,74	4,16	9,57	19,66	34,90	40,87	48,92
IMA-B 5+	-1,66	-4,23	-2,31	0,15	2,92	11,54	22,86	21,61	14,50
IMA-B TOTAL	-0,65	0,16	-0,80	1,63	5,62	15,10	28,22	30,57	29,26
IMA-GERAL TOTAL	0,38	5,39	1,52	3,92	9,08	21,85	36,23	37,66	41,34
IDKA 2	0,81	5,86	1,81	3,85	9,37	19,24	34,15	40,34	49,79
IDKA 20	-4,24	-13,00	-6,80	-4,11	-2,93	4,69	12,47	6,78	-7,39
CDI	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87	40,33	45,00	49,67

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-1,60	-3,33	1,61	3,01	14,64	11,79	25,33	38,06	20,98
IBRX 100	-1,53	-2,74	1,84	2,99	15,29	11,28	24,40	37,33	22,16
IBRX 50	-1,49	-1,71	1,51	3,10	15,95	12,48	27,12	41,91	24,29
SMALL CAP	-1,37	-14,85	-1,46	-3,76	2,51	-14,14	-14,08	-10,98	-16,47
Índice Consumo - ICON	-0,02	-11,24	1,22	1,62	9,43	-22,91	-34,44	-40,10	-41,26
Índice Dividendos - IDIV	-1,72	2,45	4,09	7,11	21,24	28,86	50,07	70,74	52,68

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	5,00	42,76	5,43	26,58	55,42	61,95	26,85	74,67	171,04

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-3,06	-3,22	-4,75	-5,23	1,56	7,13	19,78	15,83	14,79

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,63	36,63	4,32	22,90	49,35	56,01	14,35	51,21	124,74

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	3,88	0,98	2,05	4,76	9,81	16,91	29,39	34,46
INPC	0,61	3,92	0,95	1,93	4,60	8,93	15,97	28,82	34,96
IGPM	1,52	4,20	2,45	4,83	5,59	0,76	7,33	30,65	58,00
SELIC	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87	40,33	45,00	49,67

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,92	7,39	2,02	4,13	8,97	18,77	31,51	51,32	63,49
IPCA + 5,00%	1,01	8,26	2,28	4,65	10,02	21,06	35,34	57,21	71,47
IPCA + 5,50%	1,05	8,69	2,41	4,90	10,54	22,22	37,28	60,22	75,58
IPCA + 5,89%	1,09	9,03	2,51	5,10	10,95	23,12	38,81	62,60	78,84
IPCA + 6,00%	1,10	9,13	2,54	5,16	11,07	23,38	39,24	63,27	79,77
INPC + 4,00%	0,97	7,43	1,99	4,02	8,80	17,82	30,45	50,65	64,10
INPC + 6,00%	1,15	9,17	2,50	5,04	10,90	22,40	38,12	62,56	80,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
402	08/10/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	247.720,49	0,00	63.582,56359300	3,8960443870
412	10/10/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.837.000,00	0,00	605,94088000	4.681,9749147805
411	10/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.350.686,82	0,00	371.222,10962900	3,6384870000
405	15/10/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	260.000,00	0,00	68.648,94590500	3,7873851750
400	31/10/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	70.000,00	18.397,79412100	3,8048039640
403	31/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.080.312,69	1.114.940,36443700	3,6596690000
Total			4.695.407,31	4.150.312,69		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 2.417.998,20

Value-At-Risk: 0,42%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,60	0,42		0,42	-0,05	0,90	569.552.218,32	100,00
LENÇÓIS PAULISTA		0,42		0,42			569.552.218,32	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,42%

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	3,97	2,09	0,01	0,03	-0,40	-0,67	3.992.324,17	0,70
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,30	0,24	0,00	0,01	-0,37	0,82	1.616.997,08	0,28
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,82	1,14	0,01	0,21	-0,07	0,81	3.709.457,93	0,65
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2025 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,58	0,45	0,03	0,45	0,39	1,16	48.291.342,40	8,48
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	1,79	1,19	0,17	1,19	-0,02	0,89	79.479.485,57	13,95
CAIXA BRASIL 2026 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA	1,79	1,19	0,18	1,19	-0,02	0,89	86.372.535,68	15,16
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,30	0,24	0,03	0,02	-0,34	0,83	71.815.821,69	12,61
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	0,31	0,24	0,01	0,31	-0,30	0,83	60.143.788,23	10,56
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,09	0,02	-0,00	0,02	-0,05	0,92	102.474.598,47	17,99
Sub-total	0,73	0,53	0,42		-0,05	0,89	457.896.351,22	80,40

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	0,05	0,03	-0,00	0,03	-0,01	0,93	108.802.067,12	19,10
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,04	0,02	-0,00	0,02	0,09	0,93	2.853.799,98	0,50
Sub-total	0,05	0,03	-0,00		-0,01	0,93	111.655.867,10	19,60

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 (%)