



LDB
EMPRESAS

LENÇÓIS PAULISTA
DEZEMBRO 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 31.12.2024.

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	4,62	0,05	-2,62	-2,69	3.888.183,65	0,67	3.482.330.917,61	0,11
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,45	0,05	0,68	9,17	2.251.682,44	0,39	8.464.677.137,84	0,03
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,18	0,06	-0,15	6,08	8.817.647,71	1,51	4.598.383.674,88	0,19
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2025 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,77	0,04	0,88	4,56	47.820.000,36	8,19	1.347.057.459,94	3,55
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	2,40	0,06	0,10	2,02	79.883.712,62	13,68	3.989.816.161,41	2,00
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BRASIL 2026 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA	2,42	0,06	0,10	3,55	86.812.029,68	14,86	895.921.187,59	9,69
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,45	0,05	0,69	9,33	69.007.857,48	11,81	8.167.774.869,09	0,84
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	0,44	0,04	0,65	9,30	60.884.471,31	10,42	633.173.463,16	9,62
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM RF REF DI CIC FIF RESP LIMITADA	0,04	0,04	0,87	10,71	104.188.058,98	17,84	7.022.509.346,32	1,48
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,10	0,05	0,49	7,62	463.553.644,23	79,35		

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 FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,09	0,04	0,86	11,52	110.628.857,76	18,94	15.214.543.760,15	0,73
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,06	0,04	0,86	2,26	9.971.919,09	1,71	6.911.306.522,53	0,14
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,09	0,04	0,86	11,52	120.600.776,85	20,65		
Renda Fixa			0,92	0,05	0,57	8,21	584.154.421,08	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Total

0,92

0,05

0,57

8,21

584.154.421,08

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	463.553.644,23	79,35	60,00	80,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	120.600.776,85	20,65	2,00	9,00	60,00	0,00	65,00
	Total Renda Fixa	584.154.421,08	100,00					100,00
Total		584.154.421,08	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	Atribuição Desemp. (%)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,49 53,11	7,62 70,11	2,00 74,81	4,45 82,75	7,62 70,11	2.274.381,44	0,39	33.707.871,75
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,86 93,03	11,52 105,91	2,62 98,17	5,52 102,69	11,52 105,91	1.009.162,45	0,17	10.034.678,15
LENÇÓIS PAULISTA (Total)						3.283.543,89	0,57	43.742.549,90

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	3.992.755,70	0,00	0,00	0,00	3.888.183,65	-104.572,05	-155.314,08
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.814.296,87	440.000,00	-15.000,00	0,00	2.251.682,44	12.385,57	153.994,72
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	3.968.294,91	4.837.858,98	0,00	0,00	8.817.647,71	11.493,82	340.799,80
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2025 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	47.404.798,91	0,00	0,00	0,00	47.820.000,36	415.201,45	2.130.045,20
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	79.800.720,92	0,00	0,00	0,00	79.883.712,62	82.991,70	1.585.159,33
CAIXA BRASIL 2026 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA	86.721.114,20	0,00	0,00	0,00	86.812.029,68	90.915,48	2.772.836,87
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	69.430.787,23	1.420.047,68	-2.322.567,20	0,00	69.007.857,48	479.589,77	5.024.149,00
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	60.492.066,12	0,00	0,00	0,00	60.884.471,31	392.405,19	2.663.287,77
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM RF REF DI CIC FIF RESP LIMITADA	103.294.088,47	0,00	0,00	0,00	104.188.058,98	893.970,51	8.039.455,45
	456.918.923,33	6.697.906,66	-2.337.567,20	0,00	463.553.644,23	2.274.381,44	33.707.871,75

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADERCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	109.681.737,20	0,00	0,00	0,00	110.628.857,76	947.120,56	9.913.440,74
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	7.099.877,20	2.810.000,00	0,00	0,00	9.971.919,09	62.041,89	121.237,41
	116.781.614,40	2.810.000,00	0,00	0,00	120.600.776,85	1.009.162,45	10.034.678,15

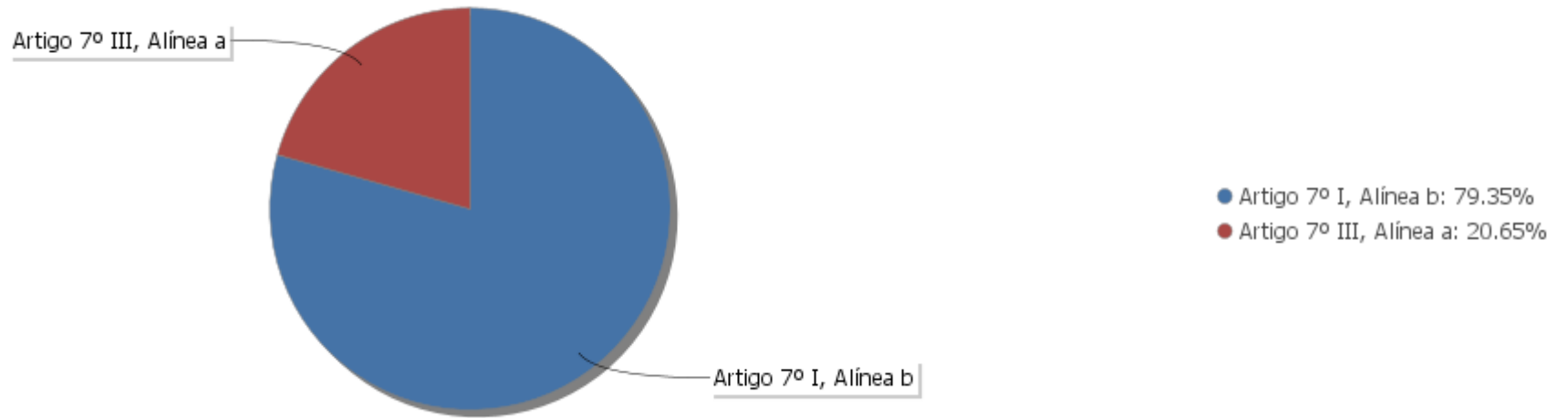
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

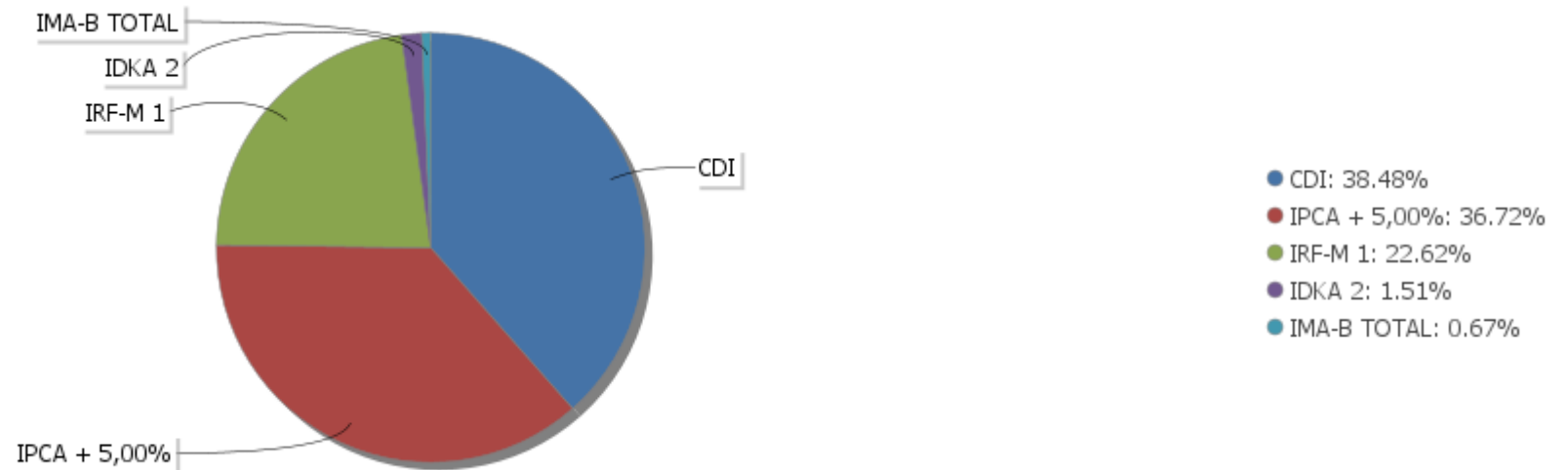
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	456.450.708,10	78,14		456.450.708,10	78,14	
de 31 dias a 365 dias	47.820.000,36	8,19		504.270.708,46	86,32	
acima de 365 dias	79.883.712,62	13,68		584.154.421,08	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

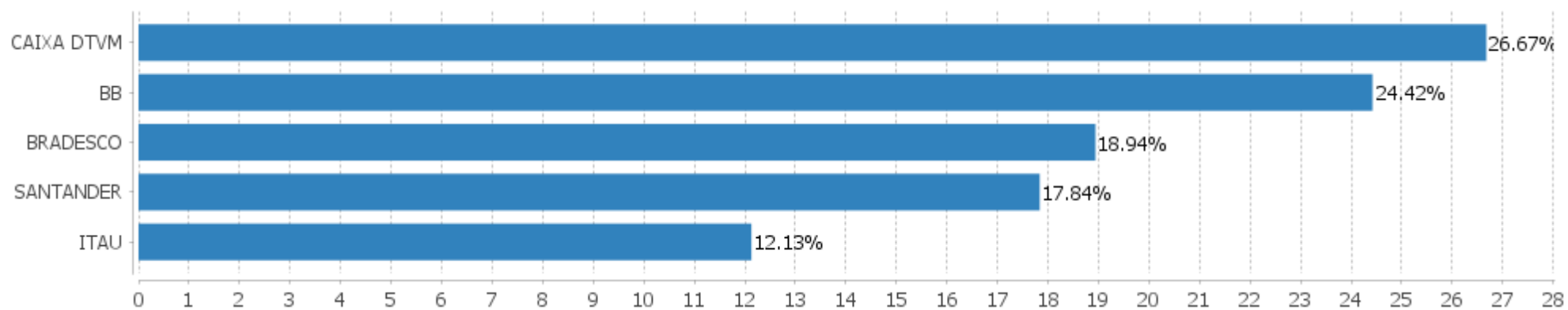


Alocação Por Estratégia



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	0,64	0,57	8,21
IPCA + 5,00%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60	0,83	0,41	0,85	1,01	0,76	0,93	10,09
p.p. indexador	-0,22	-0,53	0,10	-0,80	0,06	-0,13	0,11	0,37	-0,11	-0,11	-0,12	-0,36	-1,88
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

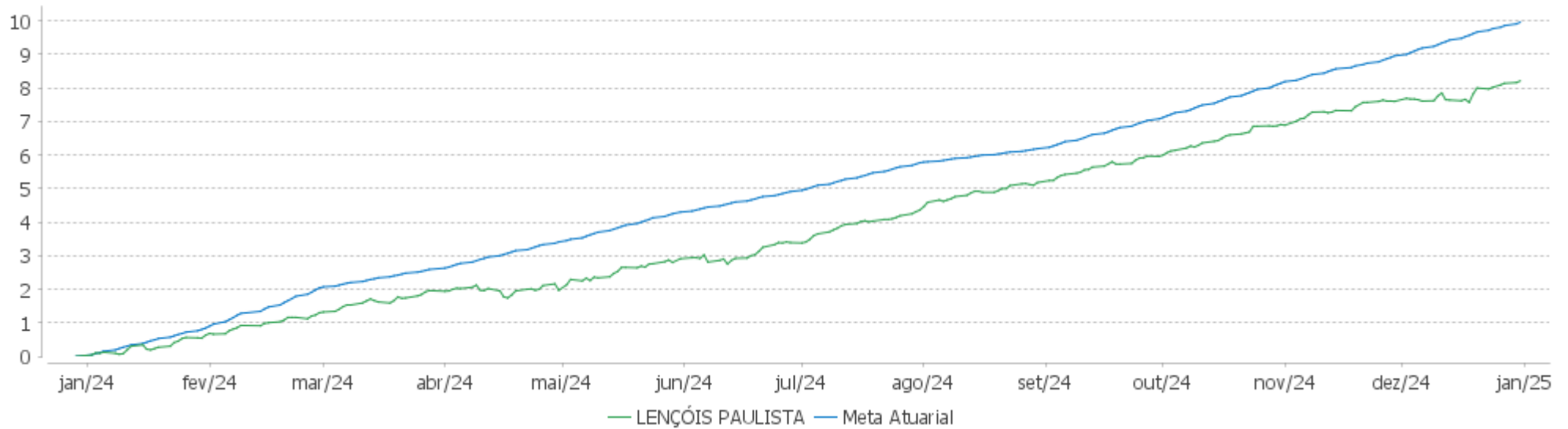
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	27	36,99
Meses abaixo - Meta Atuarial	46	63,01
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,45	2019-06
Menor rentabilidade da Carteira	-1,46	2019-11

Relatório

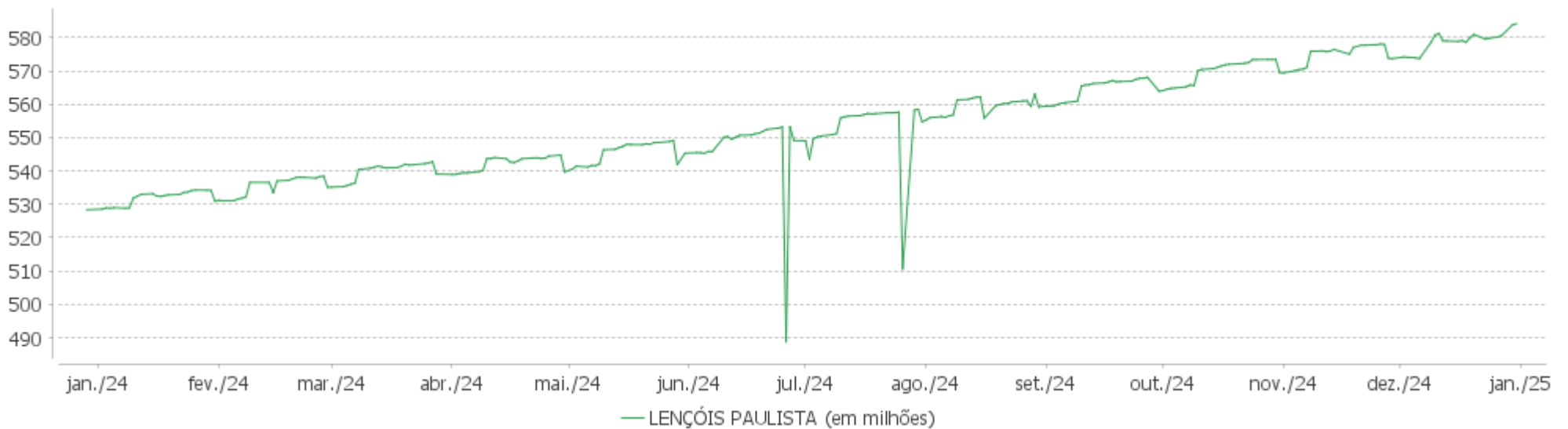
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,12	2,72	-0,60	0,97
06 meses	4,66	4,88	-0,22	0,79
12 meses	8,21	10,09	-1,88	0,92
24 meses	22,51	20,55	1,96	1,13
36 meses	35,84	33,71	2,13	1,13
48 meses	40,16	55,09	-14,93	1,25
60 meses	46,76	71,79	-25,02	1,49
Desde 30/11/2018	66,75	91,14	-24,39	1,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução No Ano

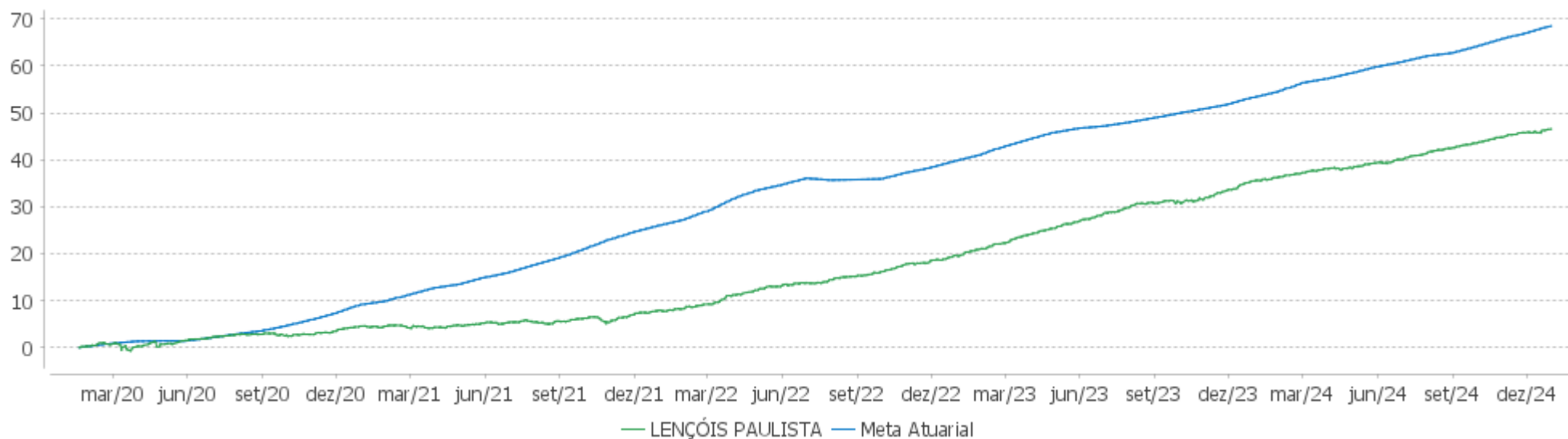


Patrimônio Líquido No Ano

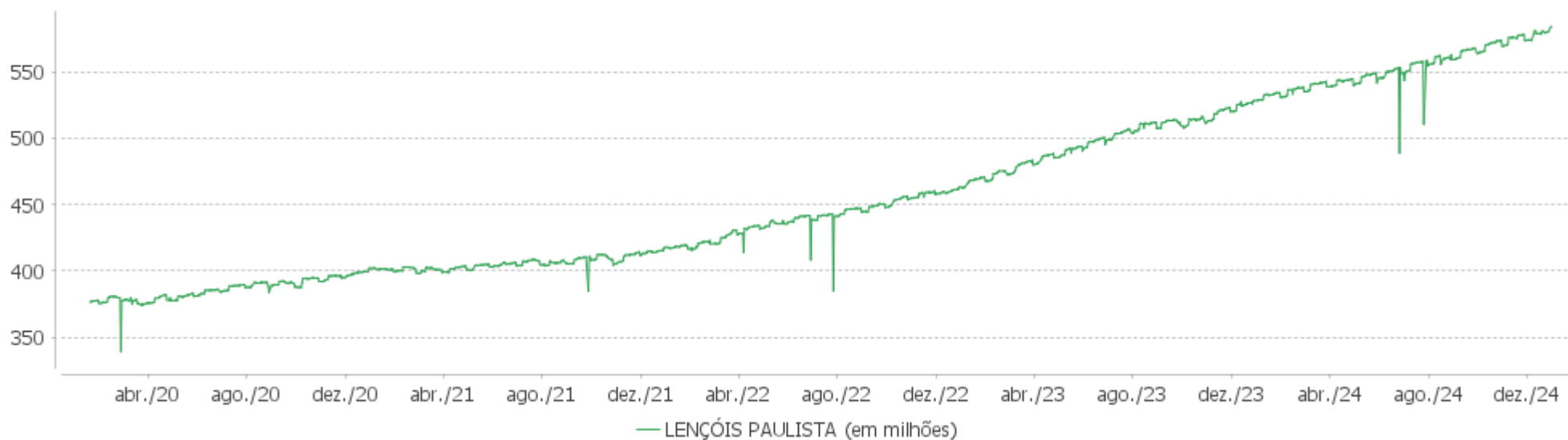


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

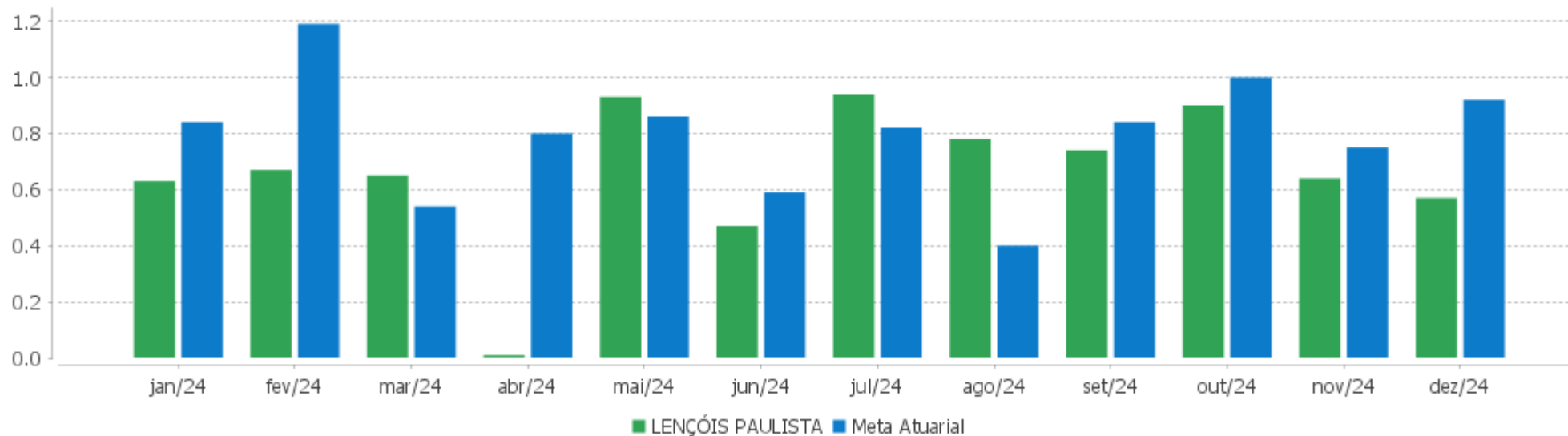


Patrimônio Líquido



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 Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,88 -0,05	7,14 1,07	3,09 0,36	5,89 1,01			
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,65 -0,05	9,30 -0,16	2,08 -0,05	4,60 -0,14	9,30 -0,16	23,57 -0,39	38,21 -0,65
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IDKA 2 p.p.	-0,15 0,09	6,08 0,24	0,97 0,19	2,88 0,33	6,08 0,24	18,52 -0,15	29,57 -0,19
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,10 -0,83	3,81 -2,22	1,40 -1,32	3,24 -1,64			
CAIXA BRASIL 2026 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,10 -0,82	4,30 -2,63	1,40 -1,32	3,26 -1,62			
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,68 -0,03	9,17 -0,29	2,05 -0,08	4,57 -0,17	9,17 -0,29	23,24 -0,72	37,69 -1,17
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,62 0,00	-2,69 -0,25	-3,26 -0,03	-1,48 -0,12	-2,69 -0,25	12,66 -0,56	19,53 -0,91
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,69 -0,01	9,33 -0,13	2,08 -0,05	4,64 -0,10	9,33 -0,13	23,57 -0,39	38,07 -0,79
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM RF REF DI CIC FIF RESP LIMITADA % do CDI	0,87 93,28	10,71 98,54	2,61 97,78	5,29 98,41	10,71 98,54	24,99 98,63	40,37 98,82
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,86 92,30	11,18 102,85	2,61 97,66	5,40 100,46	11,18 102,85	26,27 103,68	42,85 104,90
BRASESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA % do CDI	0,86 93,07	11,52 105,91	2,62 98,20	5,52 102,70	11,52 105,91	26,71 105,41	43,18 105,71
LENÇÓIS PAULISTA Var. IPCA + 4,87% p.p.	0,57 -0,36	8,21 -1,88	2,12 -0,60	4,66 -0,22	8,21 -1,88	22,51 1,64	35,84 1,61
CDI	0,93	10,87	2,67	5,37	10,87	25,34	40,85
IBOVESPA	-4,28	-10,36	-8,75	-2,92	-10,36	9,61	14,75
INPC + 6,00%	0,97	11,08	2,91	5,12	11,08	22,02	36,99
IPCA + 6,00%	1,01	11,15	2,97	5,39	11,15	23,17	38,09

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
BRADERCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	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
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,18
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM RF REF DI CIC FIF RESP LIMITADA	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	0,70	9,46	2,13	4,74	9,46	23,96	38,86	42,92	48,41
IRF-M 1+	-2,96	-1,81	-4,20	-2,02	-1,81	16,38	25,01	18,77	28,81
IRF-M TOTAL	-1,66	1,86	-1,97	0,34	1,86	18,67	29,15	26,57	35,05
IMA-B 5	-0,28	6,16	0,82	2,75	6,16	19,03	30,68	36,64	47,63
IMA-B 5+	-4,37	-8,63	-6,17	-3,78	-8,63	8,98	12,58	5,20	10,99
IMA-B TOTAL	-2,62	-2,44	-3,23	-1,36	-2,44	13,22	20,43	18,91	26,53
IMA-GERAL TOTAL	-0,59	5,10	0,10	2,61	5,10	20,65	32,31	33,58	40,70
IDKA 2	-0,24	5,84	0,79	2,55	5,84	18,67	29,76	36,21	47,96
IDKA 20	-8,35	-20,91	-12,95	-10,03	-20,91	0,55	-1,38	-15,68	-13,82
CDI	0,93	10,87	2,67	5,37	10,87	25,34	40,85	47,04	51,11

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-4,28	-10,36	-8,75	-2,92	-10,36	9,61	14,75	1,06	4,01
IBRX 100	-4,38	-9,71	-8,59	-2,71	-9,71	9,50	13,89	1,17	4,71
IBRX 50	-4,02	-8,13	-7,92	-2,14	-8,13	10,30	16,61	4,32	8,10
SMALL CAP	-7,83	-25,03	-13,16	-11,95	-25,03	-12,20	-25,42	-37,50	-37,91
Índice Consumo - ICON	-7,28	-22,56	-12,77	-9,92	-22,56	-17,15	-38,16	-54,30	-53,93
Índice Dividendos - IDIV	-4,89	-2,62	-6,59	0,81	-2,62	23,51	39,14	30,22	28,91

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	-0,26	57,72	16,01	19,99	57,72	81,80	36,93	86,59	179,68

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,67	-5,89	-5,74	-6,90	-5,89	8,69	11,11	8,58	-2,54

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,22	48,02	12,27	16,86	48,02	64,93	23,68	55,12	128,67

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,52	4,83	1,48	2,29	4,83	9,68	16,02	27,69	33,46
INPC	0,48	4,77	1,43	2,04	4,77	8,65	15,10	26,79	33,70
IGPM	0,94	6,54	3,80	5,38	6,54	3,15	8,77	28,11	57,76
SELIC	0,93	10,87	2,67	5,37	10,87	25,34	40,85	47,04	51,11

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,85	9,04	2,48	4,36	9,04	18,59	30,45	49,29	62,25
IPCA + 5,00%	0,93	10,09	2,72	4,88	10,09	20,87	34,23	55,09	70,17
IPCA + 5,50%	0,97	10,62	2,84	5,13	10,62	22,02	36,15	58,05	74,24
IPCA + 5,89%	1,00	11,03	2,94	5,33	11,03	22,92	37,66	60,40	77,48
IPCA + 6,00%	1,01	11,15	2,97	5,39	11,15	23,17	38,09	61,06	78,40
INPC + 4,00%	0,81	8,98	2,43	4,10	8,98	17,48	29,41	48,24	62,54
INPC + 6,00%	0,97	11,08	2,91	5,12	11,08	22,02	36,99	59,92	78,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
426	05/12/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	15.000,00	3.915,57795500	3,8308520920
427	09/12/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.837.858,98	0,00	1.238.547,58397900	3,9060743750
421	10/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.366.618,47	0,00	370.535,04526500	3,6882300000
423	12/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.091.982,23	296.011,56683100	3,6889850000
424	23/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.230.584,97	332.859,15838100	3,6970140000
422	30/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	53.429,21	0,00	14.426,27895000	3,7036030000
425	30/12/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	440.000,00	0,00	114.298,04318500	3,8495847150
428	30/12/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.810.000,00	0,00	587,15038009	4.785,8267580000
Total			9.507.906,66	2.337.567,20		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 2.225.297,47

Value-At-Risk: 0,38%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,41	0,38		0,38	-0,25	0,57	584.154.421,08	100,00
LENÇÓIS PAULISTA		0,38		0,38			584.154.421,08	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,38%

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	9,59	3,42	0,02	0,04	-0,37	-2,62	3.888.183,65	0,67
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,48	0,23	0,00	0,01	-0,53	0,68	2.251.682,44	0,39
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,73	1,02	0,02	0,22	-0,23	-0,15	8.817.647,71	1,51
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2025 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,91	0,41	0,02	0,41	-0,06	0,88	47.820.000,36	8,19
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	4,17	1,09	0,15	1,09	-0,20	0,10	79.883.712,62	13,68
CAIXA BRASIL 2026 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA	4,15	1,08	0,16	1,08	-0,20	0,10	86.812.029,68	14,86
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,48	0,22	0,02	0,01	-0,49	0,69	69.007.857,48	11,81
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	0,45	0,22	-0,00	0,33	-0,62	0,65	60.884.471,31	10,42
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM RF REF DI CIC FIF RESP LIMITADA	0,08	0,04	-0,00	0,04	-0,76	0,87	104.188.058,98	17,84
Sub-total	1,76	0,48	0,38		-0,25	0,49	463.553.644,23	79,35

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,08	0,03	-0,00	0,04	-0,80	0,86	110.628.857,76	18,94
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,07	0,02	-0,00	0,03	-0,99	0,86	9.971.919,09	1,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,08	0,03	-0,00		-0,82	0,86	120.600.776,85	20,65

(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 (%)