



**LDB**  
EMPRESAS

**LENÇÓIS PAULISTA**  
AGOSTO 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 30.08.2024.

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	4,05	-0,27	0,46	1,29	4.047.044,83	0,72	4.414.843.191,53	0,09
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,40	0,04	0,74	6,13	1.379.007,45	0,25	8.469.459.153,05	0,02
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,82	0,12	0,64	4,56	7.224.900,79	1,29	5.319.492.629,16	0,14
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2025 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,82	0,13	0,39	0,39	47.249.409,65	8,45	1.247.479.989,66	3,79
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	2,14	0,14	0,11	0,11	78.388.938,18	14,02	3.467.274.754,62	2,26
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,76	0,00	0,54	7,40	0,00	0,00	586.369.898,98	0,00
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,75	0,00	0,54	7,33	0,00	0,00	392.787.249,14	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	4,06	-0,27	0,48	1,26	0,00	0,00	466.521.869,13	0,00
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BRASIL 2026 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA	2,25	0,14	0,62	1,62	85.190.818,39	15,23	858.081.736,34	9,93
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,40	0,05	0,75	6,24	71.989.570,25	12,87	8.028.368.624,38	0,90
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	4,05	0,00	0,88	1,72	0,00	0,00	341.019.926,92	0,00
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	0,40	0,01	0,75	6,19	56.359.161,65	10,08	593.630.240,92	9,49
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	4,06	0,00	0,88	1,69	0,00	0,00	504.694.691,80	0,00
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,05	0,04	0,86	7,01	100.703.524,39	18,01	7.436.483.772,61	1,35
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,41</b>	<b>0,08</b>	<b>0,75</b>	<b>4,77</b>	<b>452.532.375,58</b>	<b>80,92</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				
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,10	0,04	0,91	7,71	106.692.296,32	19,08	15.057.333.281,43	0,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
		<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>	<b>0,10</b>	<b>0,04</b>	<b>0,91</b>	<b>7,71</b>	<b>106.692.296,32</b>	<b>19,08</b>		
		Renda Fixa	1,23	0,07	0,78	5,18	559.224.671,90	100,00		
		Total	1,23	0,07	0,78	5,18	559.224.671,90	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	452.532.375,58	80,92	60,00	80,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	106.692.296,32	19,08	2,00	9,00	60,00	0,00	65,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>559.224.671,90</b>	<b>100,00</b>					100,00
<b>Total</b>		<b>559.224.671,90</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	0,75 86,42	4,77 67,27	2,09 80,75	3,53 67,49	8,53 76,11	3.360.434,10	21.381.916,17
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,91 105,43	7,71 108,70	2,77 107,17	5,61 107,31	12,12 108,13	989.766,78	6.141.443,45
<b>LENÇÓIS PAULISTA (Total)</b>						<b>4.350.200,88</b>	<b>27.523.359,62</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 IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.028.409,85	0,00	0,00	0,00	4.047.044,83	18.634,98	3.547,10
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.503.090,90	0,00	-135.000,00	0,00	1.379.007,45	10.916,55	108.319,73
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	6.932.063,91	248.716,44	0,00	0,00	7.224.900,79	44.120,44	254.429,45
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2025 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,00	47.066.636,84	0,00	0,00	47.249.409,65	182.772,81	182.772,81
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,00	78.298.553,29	0,00	0,00	78.388.938,18	90.384,89	90.384,89
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	113.669.824,50	0,00	-114.286.044,18	0,00	0,00	616.219,68	7.917.920,98
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	11.019.931,70	0,00	-11.079.145,95	0,00	0,00	59.214,25	761.285,31
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	1.679.139,24	0,00	-1.687.255,71	0,00	0,00	8.116,47	-238.889,64
CAIXA BRASIL 2026 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA	86.954.810,62	0,00	0,00	2.301.171,84	85.190.818,39	537.179,61	1.151.625,58
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	67.822.582,31	3.651.886,68	0,00	0,00	71.989.570,25	515.101,26	2.939.479,95
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	1.173.398,86	0,00	-1.183.707,63	0,00	0,00	10.308,77	-199.458,81
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	54.762.815,21	1.183.707,63	0,00	0,00	56.359.161,65	412.638,81	942.978,11
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	311.252,76	0,00	-313.987,72	0,00	0,00	2.734,96	-196.142,27
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	96.697.446,05	3.153.987,72	0,00	0,00	100.703.524,39	852.090,62	4.554.920,86
	446.554.765,91	133.603.488,60	-128.685.141,19	2.301.171,84	452.532.375,58	3.360.434,10	

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	108.215.463,81	0,00	-2.512.934,27	0,00	106.692.296,32	989.766,78	6.141.443,45
	108.215.463,81	0,00	-2.512.934,27	0,00	106.692.296,32	989.766,78	

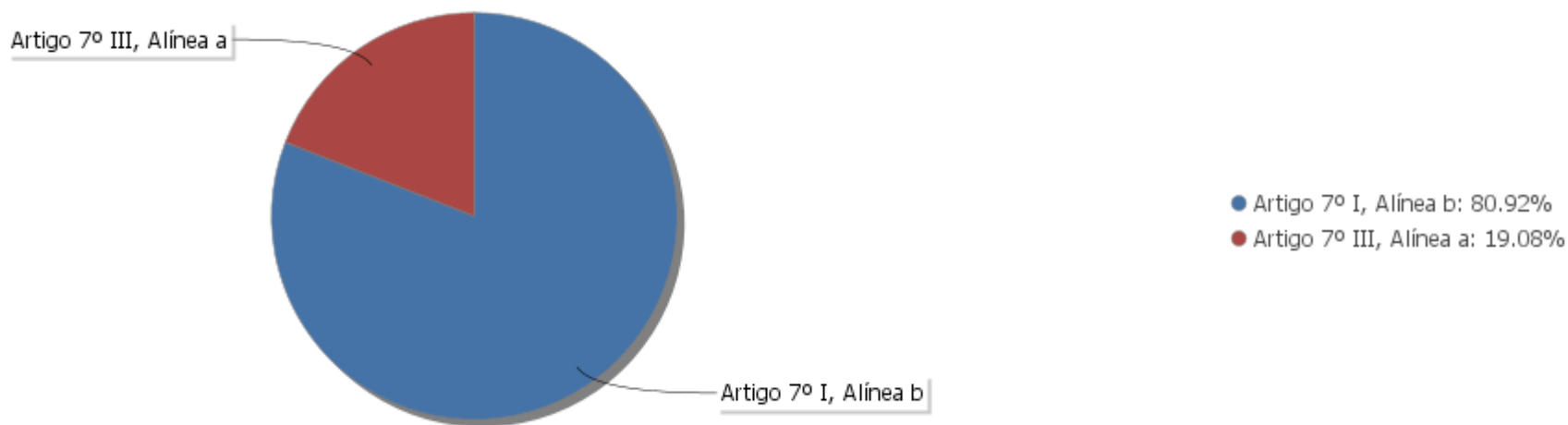
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

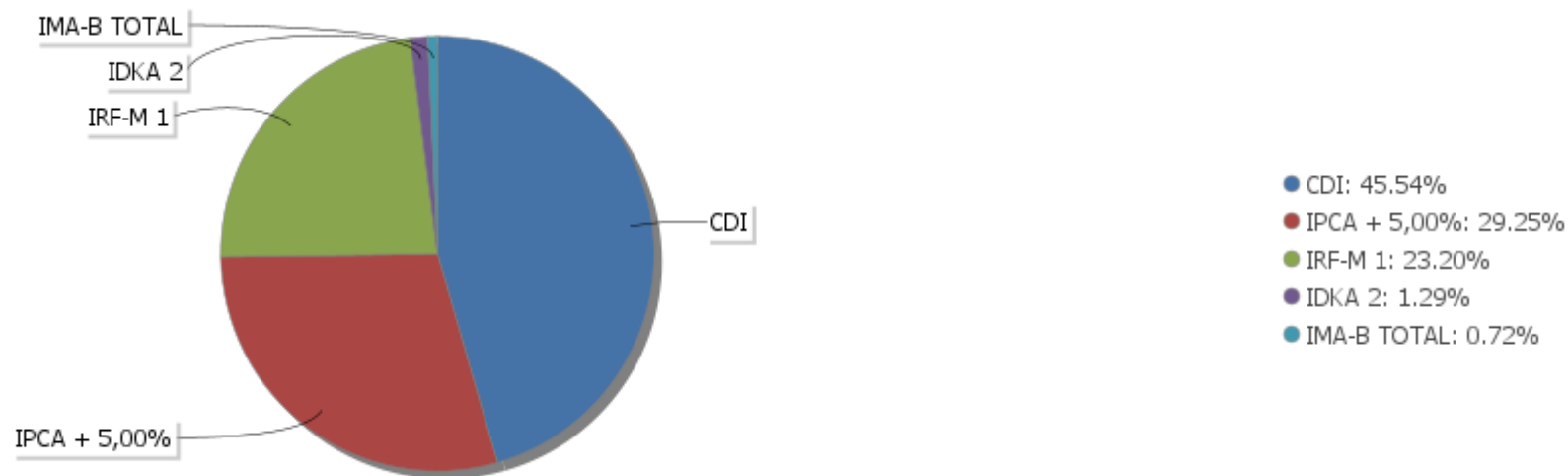
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	433.586.324,07	77,53		433.586.324,07	77,53	
de 31 dias a 365 dias	47.249.409,65	8,45		480.835.733,72	85,98	
acima de 365 dias	78.388.938,18	14,02		559.224.671,90	100,00	

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

#### Alocação por Artigo

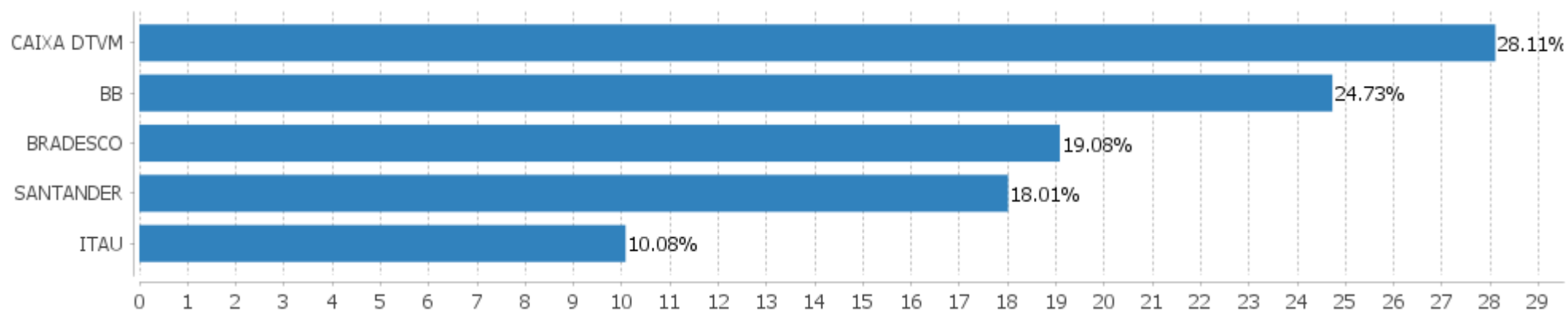


#### Alocação Por Estratégia



## 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					5,18
IPCA + 5,00%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60	0,83	0,41					6,27
p.p. indexador	-0,22	-0,53	0,10	-0,80	0,06	-0,13	0,11	0,37					-1,09
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	39,13
Meses abaixo - Meta Atuarial	42	60,87

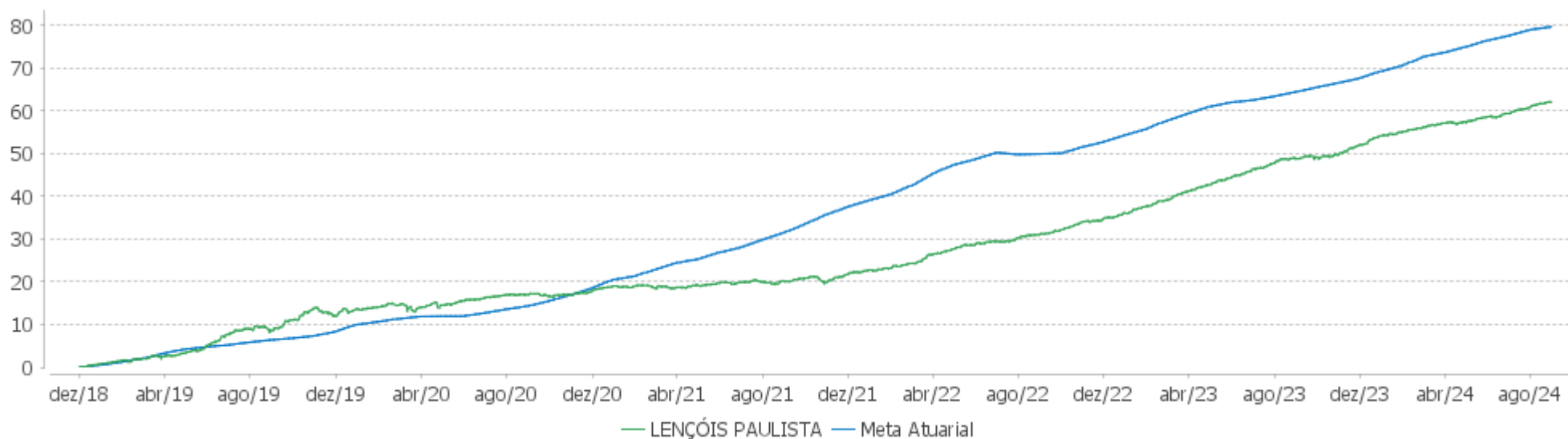
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,45	2019-06
Menor rentabilidade da Carteira	-1,46	2019-11

**Relatório**

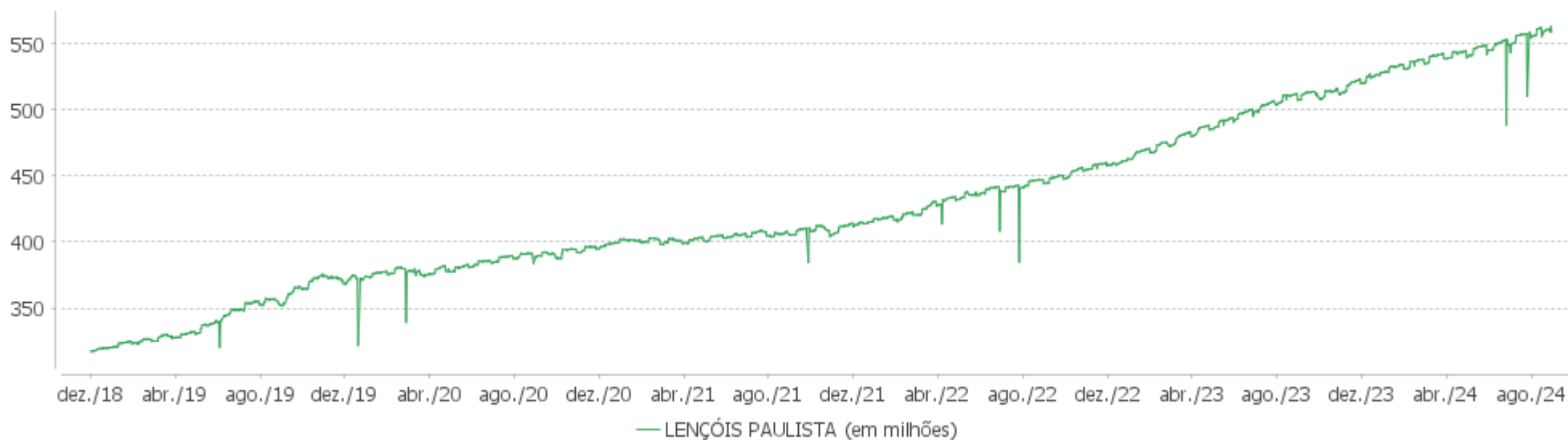
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,20	1,84	0,36	0,84
06 meses	3,83	4,13	-0,30	0,99
12 meses	9,01	9,31	-0,31	1,23
24 meses	23,67	19,78	3,89	1,15
36 meses	34,94	36,81	-1,87	1,24
48 meses	38,57	58,43	-19,87	1,29
60 meses	49,11	72,04	-22,93	1,67
Desde 30/11/2018	62,08	84,51	-22,43	1,75

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

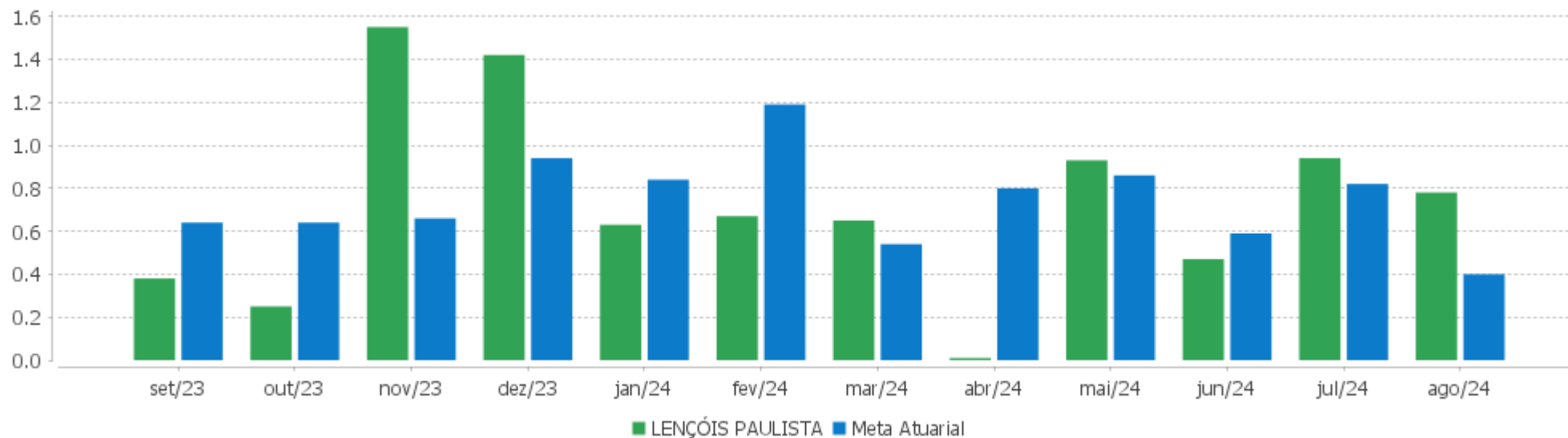


Patrimônio Líquido



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	0,84 97,13	2,87 92,22	2,30 88,86				
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,75 -0,01	6,19 -0,11	2,33 -0,03	4,54 -0,08	10,20 -0,20	25,18 -0,39	36,28 -0,64
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,61 0,20	1,87 -0,48	1,52 -0,33				
CAIXA BRASIL 2026 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,62 0,21	2,35 -0,87	1,53 -0,31				
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,74 -0,02	6,13 -0,17	2,27 -0,09	4,45 -0,18	10,09 -0,30	24,84 -0,73	35,82 -1,10
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,92 0,52	7,74 1,47	3,09 1,24	5,79 1,66	11,28 1,87	23,62 3,47	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,66 0,25	7,52 1,25	2,84 0,99	5,55 1,42	11,09 1,68		
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,48 -0,03	1,26 -0,23	1,53 -0,10	1,22 -0,18	4,96 -0,35	19,05 -0,76	25,20 -1,25
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,50 -0,02	1,34 -0,16	1,56 -0,07	1,28 -0,12	5,08 -0,24	19,25 -0,56	25,59 -0,86
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IDKA 2 p.p.	0,64 0,04	4,56 -0,04	1,66 0,13	3,36 0,03	7,81 -0,13	20,28 -0,39	31,43 -0,62
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,75 -0,02	6,24 -0,06	2,30 -0,06	4,51 -0,11	10,24 -0,15	25,14 -0,43	36,15 -0,77
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,46 -0,05	1,29 -0,20	1,54 -0,09	1,24 -0,15	5,04 -0,28	19,17 -0,65	25,43 -1,02
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,86 99,57	7,01 98,81	2,56 99,10	5,16 98,77	11,05 98,57	25,97 98,82	38,79 99,04
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,50 -0,02	1,31 -0,19	1,56 -0,07	1,26 -0,14	5,04 -0,28	19,20 -0,61	25,51 -0,95
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,91 105,43	7,71 108,70	2,77 107,16	5,61 107,31	12,12 108,13	27,88 106,10	41,82 106,78
LENÇÓIS PAULISTA Var. IPCA + 4,87% p.p.	0,78 0,37	5,18 -1,09	2,20 0,36	3,83 -0,30	9,01 -0,40	23,67 3,52	34,94 -2,22
CDI	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	39,16

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	6,54	1,36	11,39	5,41	17,51	24,18	14,50
INPC + 6,00%	0,37	6,90	1,89	4,44	9,88	21,17	39,78
IPCA + 6,00%	0,49	6,95	2,09	4,63	10,44	22,43	41,11

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 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
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
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 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	0,77	6,30	2,36	4,62	10,39	25,57	36,92	39,98	47,06
IRF-M 1+	0,60	2,39	1,43	1,43	7,39	24,61	30,60	26,26	39,69
IRF-M TOTAL	0,66	3,54	1,70	2,39	8,26	24,46	32,14	30,49	41,85
IMA-B 5	0,59	4,88	1,91	3,56	8,14	21,08	33,04	39,39	52,27
IMA-B 5+	0,77	-1,21	1,69	-0,25	3,11	18,58	20,29	22,46	28,23
IMA-B TOTAL	0,52	1,49	1,63	1,40	5,32	19,81	26,45	30,58	39,25
IMA-GERAL TOTAL	0,79	4,63	2,21	3,49	8,81	23,74	33,48	35,98	44,83
IDKA 2	0,60	4,60	1,53	3,33	7,94	20,67	32,05	38,75	52,22
IDKA 20	0,42	-6,26	1,27	-3,24	-0,28	18,04	10,08	10,85	10,58
CDI	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	39,16	42,92	48,46

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,54	1,36	11,39	5,41	17,51	24,18	14,50	36,87	34,48
IBRX 100	6,60	1,79	11,34	5,58	18,00	22,90	12,85	36,41	34,88
IBRX 50	6,51	3,14	11,66	6,63	19,46	24,91	15,69	41,27	38,19
SMALL CAP	4,51	-9,69	5,65	-3,81	-2,18	-4,07	-25,42	-12,75	-7,50
Índice Consumo - ICON	6,25	-6,83	9,13	1,55	0,43	-15,02	-41,58	-41,33	-37,96
Índice Dividendos - IDIV	6,69	5,00	10,87	7,85	21,94	34,91	40,69	67,98	61,87

**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	2,18	38,35	15,49	25,80	44,00	55,98	37,34	66,82	163,79

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,86	2,48	0,33	1,00	5,63	14,02	23,41	21,98	27,74

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,29	33,98	14,52	24,30	39,63	48,51	23,68	47,36	123,03

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,02	2,85	0,57	1,58	4,24	9,04	18,56	30,03	33,20
INPC	-0,14	2,80	0,37	1,40	3,71	7,92	17,44	29,68	33,49
IGPM	0,29	2,00	1,72	2,46	4,26	-3,24	5,07	37,76	55,70
SELIC	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	39,16	42,92	48,46

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,32	5,59	1,59	3,62	8,37	17,88	33,30	52,03	61,96
IPCA + 5,00%	0,41	6,27	1,84	4,13	9,41	20,15	37,17	57,93	69,87
IPCA + 5,50%	0,45	6,61	1,97	4,38	9,92	21,29	39,13	60,95	73,94
IPCA + 5,89%	0,48	6,88	2,07	4,58	10,33	22,18	40,67	63,33	77,17
IPCA + 6,00%	0,49	6,95	2,09	4,63	10,44	22,43	41,11	64,01	78,09
INPC + 4,00%	0,20	5,54	1,39	3,44	7,82	16,67	32,04	51,61	62,31
INPC + 6,00%	0,37	6,90	1,89	4,44	9,88	21,17	39,78	63,57	78,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
384	05/08/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	6.000,00	1.610,52470600	3,7254939210
378	07/08/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	248.716,44	0,00	64.386,88268500	3,8628433250
368	09/08/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	2.840.000,00	0,00	70.944,67450600	40,0311936000
373	09/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.350.686,84	0,00	376.917,27942700	3,5835100000
377	16/08/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	75.920.187,95	0,00	74.612.465,78258600	1,0175268590
380	16/08/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2025 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	45.636.933,99	0,00	44.536.586,01760400	1,0247066080
383	16/08/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	67.000,00	17.954,06922100	3,7317445520
387	16/08/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,00	11.079.145,95	8.550.341,84684300	1,2957547370
388	16/08/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,00	67.219.407,34	58.981.419,03907300	1,1396709070
389	16/08/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,00	47.066.636,84	41.298.445,49679000	1,1396709070
376	19/08/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	2.378.365,34	0,00	2.338.722,54748900	1,0169506180
379	19/08/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2025 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	1.429.702,85	0,00	1.395.578,22429100	1,0244519620
370	28/08/2024	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	0,00	17.584,34	499,20366900	35,2247972000
371	28/08/2024	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	0,00	296.403,38	8.414,62283200	35,2247972000
386	28/08/2024	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	0,00	1.183.707,63	24.892,53107000	47,5527230000
369	29/08/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	313.987,72	0,00	7.800,76314300	40,2508978000
372	29/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.301.199,84	0,00	639.392,50483600	3,5990410000
385	29/08/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	1.183.707,63	0,00	25.401,14604000	46,6005600000
382	30/08/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	62.000,00	16.559,56685800	3,7440592820
390	30/08/2024	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	0,00	1.687.255,71	368.307,50265300	4,5811060000
391	30/08/2024	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	2.512.934,27	140.936,70200000	17,8302333000
<b>Total</b>			<b>133.603.488,60</b>	<b>131.198.075,46</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 2.659.612,21

Value-At-Risk: 0,48%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,70	0,48		0,48	-0,12	0,78	559.224.671,90	100,00
LENÇÓIS PAULISTA		0,48		0,48			559.224.671,90	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,48%

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 PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,10	2,03	0,01	0,04	-0,08	0,46	4.047.044,83	0,72
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,64	0,29	0,00	0,01	-0,20	0,74	1.379.007,45	0,25
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,63	1,26	0,02	0,20	-0,09	0,64	7.224.900,79	1,29
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2025 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	1,03	0,45	0,03	0,45	-0,02	0,84	47.249.409,65	8,45
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	2,69	1,22	0,17	1,22	-0,10	0,61	78.388.938,18	14,02
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,37	NaN	0,00	NaN	-0,56	0,66	0,00	0,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,18	NaN	0,00	NaN	0,31	0,92	0,00	0,00
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,12	NaN	0,00	NaN	-0,07	0,48	0,00	0,00
CAIXA BRASIL 2026 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA	2,67	1,33	0,20	1,33	-0,09	0,62	85.190.818,39	15,23
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,64	0,30	0,03	0,02	-0,19	0,75	71.989.570,25	12,87
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,11	NaN	0,00	NaN	-0,07	0,50	0,00	0,00
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	0,64	0,28	0,01	0,38	-0,18	0,75	56.359.161,65	10,08
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	5,12	NaN	0,00	NaN	-0,07	0,50	0,00	0,00
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,02	0,01	0,00	0,00	-0,24	0,86	100.703.524,39	18,01
<b>Sub-total</b>	<b>0,85</b>	<b>0,59</b>	<b>0,48</b>		<b>-0,14</b>	<b>0,75</b>	<b>452.532.375,58</b>	<b>80,92</b>

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º III, Alínea a

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	0,08	0,05	-0,00	0,05	0,58	0,91	106.692.296,32	19,08
<b>Sub-total</b>	0,08	0,05	-0,00		0,58	0,91	106.692.296,32	19,08

(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 (%)