



LENÇÓIS PAULISTA
JULHO 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 31.07.2024.

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

RENTA 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	3,92	0,29	2,07	0,82	4.028.409,85	0,73	4.446.980.761,25	0,09
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,38	0,04	0,91	5,35	1.503.090,90	0,27	8.157.420.248,33	0,02
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,75	0,09	0,76	3,90	6.932.063,91	1,25	5.421.914.339,44	0,13
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,84	0,04	0,98	6,82	113.669.824,50	20,49	3.539.594.658,05	3,21
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,84	0,04	0,98	6,76	11.019.931,70	1,99	3.733.119.507,19	0,30
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	3,93	0,29	2,06	0,77	1.679.139,24	0,30	498.541.358,61	0,34
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BRASIL 2026 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA	2,13	0,09	0,99	0,99	86.954.810,62	15,67	554.035.800,58	15,69
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,73	0,00	-0,20	3,00	0,00	0,00	7.242.310.243,82	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,38	0,05	0,93	5,46	67.822.582,31	12,23	7.874.458.233,45	0,86
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,62	0,00	0,66	2,58	0,00	0,00	1.916.003.713,61	0,00
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	3,92	0,29	2,06	0,84	1.173.398,86	0,21	322.126.868,53	0,36
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	0,38	0,05	0,87	5,40	54.762.815,21	9,87	590.814.067,12	9,27
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	3,93	0,29	2,07	0,81	311.252,76	0,06	464.449.639,14	0,07
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,06	0,04	0,89	6,10	96.697.446,05	17,43	7.130.754.638,24	1,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,46	0,06	0,92	3,99	446.554.765,91	80,49		

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	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,10	0,05	1,00	6,74	108.215.463,81	19,51	12.128.254.135,40	0,89
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,10	0,05	1,00	6,74	108.215.463,81	19,51		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS							
Renda Fixa	1,28	0,06	0,94	4,36	554.770.229,72	100,00	
Total	1,28	0,06	0,94	4,36	554.770.229,72	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	446.554.765,91	80,49	60,00	80,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	108.215.463,81	19,51	2,00	9,00	60,00	0,00	65,00
	Total Renda Fixa	554.770.229,72	100,00					100,00
Total		554.770.229,72	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	0,92 101,80	3,99 64,67	2,28 89,25	3,41 66,06	8,34 72,49	3.995.476,34	18.021.482,07
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,00 109,74	6,74 109,10	2,74 107,26	5,59 108,36	12,51 108,72	1.155.906,15	5.151.676,67
LENÇÓIS PAULISTA (Total)						5.151.382,49	23.173.158,74

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	3.946.545,31	0,00	0,00	0,00	4.028.409,85	81.864,54	-15.087,88
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.422.388,70	285.000,00	-218.000,00	0,00	1.503.090,90	13.702,20	97.403,18
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	6.632.401,30	249.110,19	0,00	0,00	6.932.063,91	50.552,42	210.309,01
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	112.561.793,58	0,00	0,00	0,00	113.669.824,50	1.108.030,92	7.301.701,30
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	10.913.498,53	0,00	0,00	0,00	11.019.931,70	106.433,17	702.071,06
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	1.645.203,28	0,00	0,00	0,00	1.679.139,24	33.935,96	-247.006,11
CAIXA BRASIL 2026 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,00	86.340.364,65	0,00	0,00	86.954.810,62	614.445,97	614.445,97
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	56.455.088,85	0,00	-56.340.364,65	0,00	0,00	-114.724,20	1.788.349,81
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	65.854.524,04	1.350.786,84	0,00	0,00	67.822.582,31	617.271,43	2.424.378,69
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	46.963.155,04	0,00	-47.273.252,51	0,00	0,00	310.097,47	1.190.057,98
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	1.149.741,15	0,00	0,00	0,00	1.173.398,86	23.657,71	-209.767,58
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	37.149.450,64	17.273.252,51	0,00	0,00	54.762.815,21	340.112,06	530.339,30
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	304.940,87	0,00	0,00	0,00	311.252,76	6.311,89	-198.877,23
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	89.898.552,92	5.995.108,33	0,00	0,00	96.697.446,05	803.784,80	3.702.830,24
	434.897.284,21	111.493.622,52	-103.831.617,16	0,00	446.554.765,91	3.995.476,34	

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\$)
BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	114.235.557,66	2.824.000,00	-10.000.000,00	0,00	108.215.463,81	1.155.906,15	5.151.676,67
	114.235.557,66	2.824.000,00	-10.000.000,00	0,00	108.215.463,81	1.155.906,15	

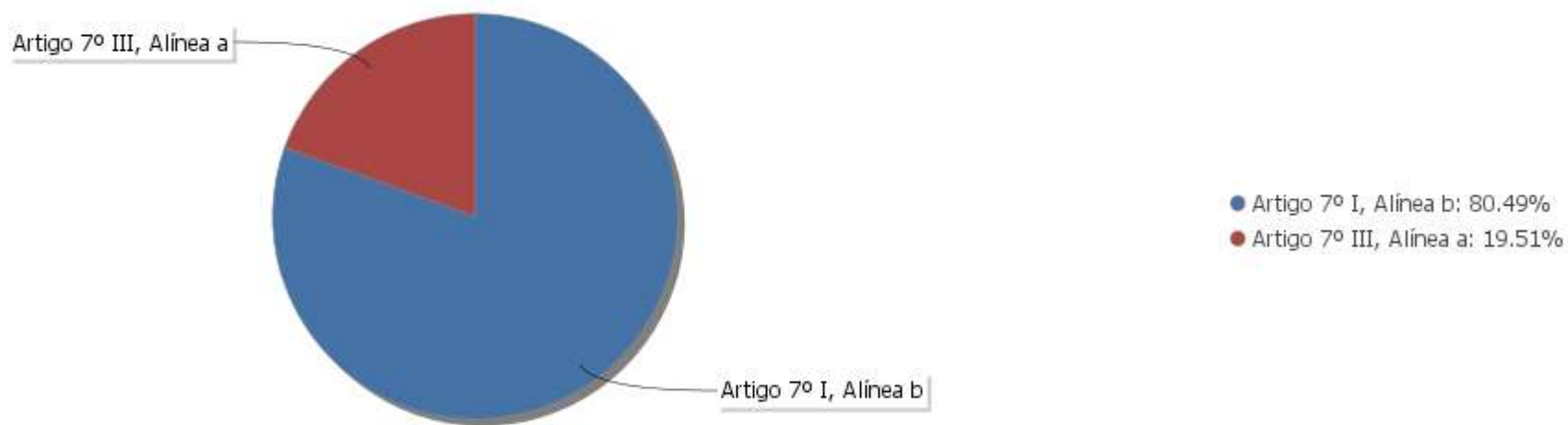
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

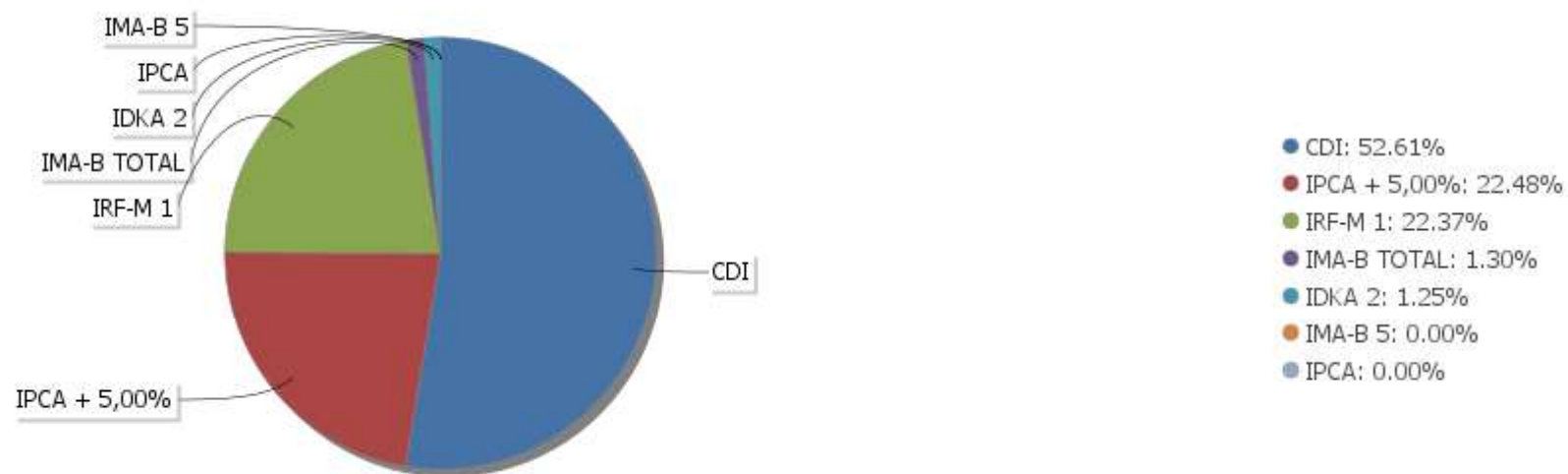
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	554.770.229,72	100,00		554.770.229,72	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00		554.770.229,72	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00		554.770.229,72	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

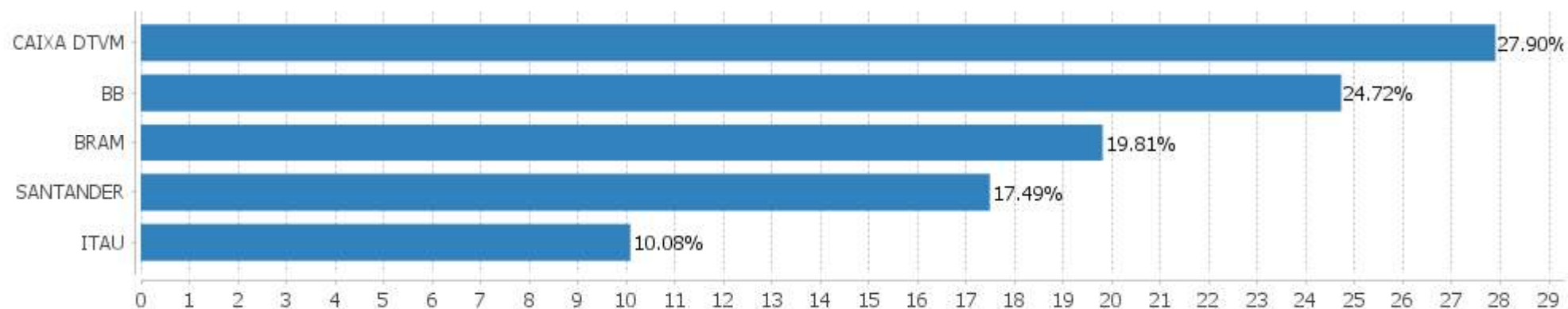


Alocação Por Estratégia



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						4,36
IPCA + 5,00%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60	0,83						5,84
p.p. indexador	-0,22	-0,53	0,10	-0,80	0,06	-0,13	0,11						-1,48
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	26	38,24
Meses abaixo - Meta Atuarial	42	61,76
	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	2,35	2,31	0,04	0,98
06 meses	3,71	4,95	-1,24	0,99
12 meses	8,87	9,58	-0,71	1,28
24 meses	23,55	19,38	4,17	1,16
36 meses	34,10	38,08	-3,97	1,27
48 meses	37,53	58,94	-21,41	1,29
60 meses	47,72	72,40	-24,68	1,73
Desde 30/11/2018	60,82	83,76	-22,94	1,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

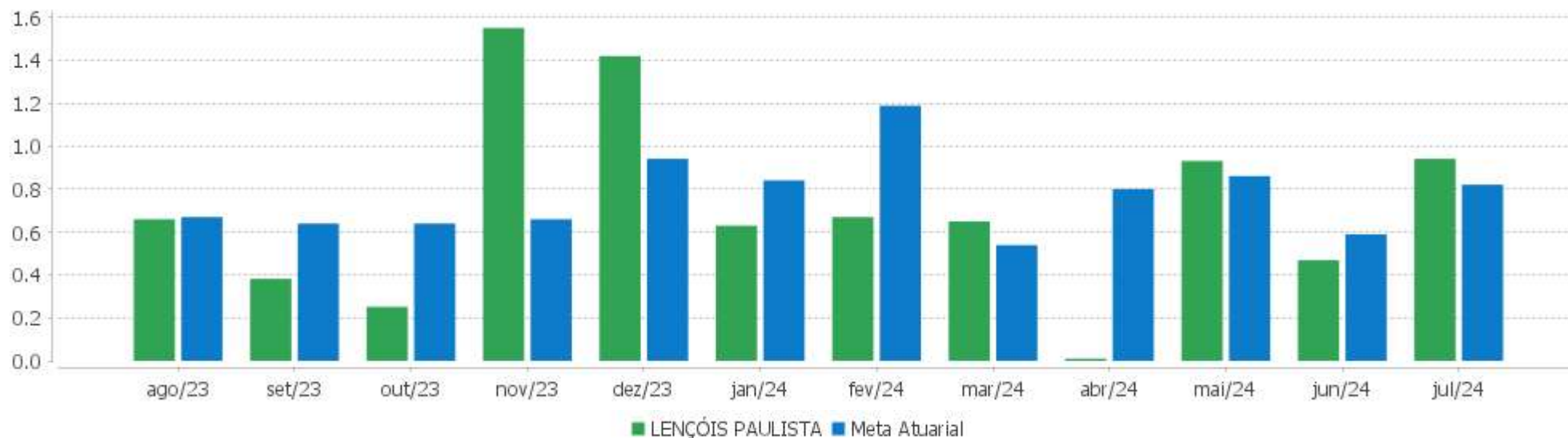


Patrimônio Líquido



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.	0,87 -0,07	5,40 -0,09	2,23 -0,14	4,54 -0,08	10,64 -0,16	25,77 -0,37	35,64 -0,73
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,89 -0,02	4,13 -0,13	2,31 -0,06	3,45 -0,12	7,93 -0,23	20,02 -0,35	31,84 -0,63
CAIXA BRASIL 2026 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA % do CDI	0,70 77,43	1,72 55,81	1,94 76,23				
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,91 -0,03	5,35 -0,15	2,27 -0,10	4,44 -0,18	10,50 -0,31	25,41 -0,73	35,27 -1,11
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,98 0,15	6,76 0,91	3,05 0,74	5,59 0,64	11,26 1,56	22,27 2,51	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,98 0,16	6,82 0,97	3,07 0,76	5,64 0,68	11,37 1,66		
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,06 -0,03	0,77 -0,20	2,36 -0,09	1,26 -0,17	4,04 -0,34	19,75 -0,76	23,21 -1,22
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,88 0,50	2,80 -0,07	1,43 0,37	2,32 -0,13	7,03 2,53	21,01 12,34	32,68 13,07
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLAÇÃO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,06 -0,04	0,84 -0,14	2,38 -0,07	1,31 -0,12	4,14 -0,24	19,95 -0,56	23,58 -0,85
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IDKA 2 p.p.	0,76 0,01	3,90 -0,08	2,08 0,08	3,17 0,01	7,92 -0,20	19,47 -0,05	30,83 -0,78
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,93 -0,01	5,46 -0,04	2,31 -0,05	4,50 -0,12	10,64 -0,17	25,71 -0,43	35,60 -0,77
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,07 -0,02	0,82 -0,15	2,39 -0,06	1,31 -0,12	4,13 -0,25	19,89 -0,62	23,44 -0,99
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,89 98,57	6,10 98,70	2,51 98,54	5,09 98,65	11,35 98,62	26,35 98,87	38,17 99,02
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,07 -0,02	0,81 -0,16	2,38 -0,07	1,29 -0,14	4,10 -0,28	19,90 -0,61	23,50 -0,93
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,00 109,74	6,74 109,10	2,74 107,26	5,59 108,36	12,51 108,72	28,26 106,00	41,22 106,93
LENÇÓIS PAULISTA Var. IPCA + 4,87% p.p.	0,94 0,11	4,36 -1,48	2,35 0,04	3,71 -1,24	8,87 -0,83	23,55 3,79	34,10 -4,28
CDI	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	3,02	-4,87	1,37	-0,08	4,68	23,74	4,80
INPC + 6,00%	0,79	6,50	2,48	5,36	10,28	20,99	41,20
IPCA + 6,00%	0,92	6,43	2,56	5,45	10,74	22,05	42,36

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		
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
CAIXA BRASIL 2026 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
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
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 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	0,94	5,49	2,37	4,62	10,81	26,14	36,37	39,08	46,74
IRF-M 1+	1,55	1,77	1,44	1,17	7,38	27,10	28,37	24,09	39,00
IRF-M TOTAL	1,34	2,87	1,71	2,19	8,37	26,19	30,49	28,67	41,29
IMA-B 5	0,91	4,27	2,37	3,56	8,16	20,37	32,46	39,16	51,45
IMA-B 5+	3,24	-1,97	2,52	-0,51	1,03	20,60	16,72	17,12	26,27
IMA-B TOTAL	2,09	0,97	2,45	1,43	4,38	20,51	24,43	27,57	37,98
IMA-GERAL TOTAL	1,36	3,81	2,36	3,33	8,64	24,49	31,89	34,10	43,92
IDKA 2	0,75	3,98	2,01	3,15	8,12	19,52	31,61	39,35	51,45
IDKA 20	6,19	-6,65	2,88	-3,43	-3,72	23,96	4,78	3,52	8,64
CDI	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55	41,92	47,93

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,02	-4,87	1,37	-0,08	4,68	23,74	4,80	24,04	25,38
IBRX 100	2,90	-4,51	1,13	0,00	5,15	22,39	2,42	23,65	26,33
IBRX 50	3,15	-3,17	1,57	1,02	6,82	24,69	4,81	28,10	28,40
SMALL CAP	1,49	-13,59	-2,33	-7,53	-13,35	1,79	-31,36	-17,55	-11,07
Índice Consumo - ICON	2,01	-12,31	0,40	-4,34	-15,32	-14,69	-47,16	-45,60	-38,99
Índice Dividendos - IDIV	1,89	-1,58	2,90	2,00	11,06	31,85	31,21	49,86	55,10

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	3,01	35,40	20,06	30,27	43,70	45,91	38,90	83,71	178,66

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,52	1,61	-0,50	0,94	5,24	19,57	19,14	23,11	26,52

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,40	30,98	17,81	27,34	37,49	39,32	24,28	60,53	133,51

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,38	2,87	1,05	2,44	4,50	8,67	19,61	30,37	33,38
INPC	0,26	2,95	0,97	2,36	4,06	7,73	18,64	30,33	33,84
IGPM	0,61	1,71	2,33	1,64	3,82	-4,19	5,46	41,14	54,22
SELIC	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55	41,92	47,93

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,74	5,25	2,07	4,46	8,66	17,50	34,49	52,40	62,17
IPCA + 5,00%	0,83	5,84	2,31	4,95	9,70	19,76	38,39	58,31	70,09
IPCA + 5,50%	0,87	6,14	2,44	5,20	10,22	20,90	40,36	61,34	74,17
IPCA + 5,89%	0,91	6,37	2,53	5,39	10,63	21,79	41,92	63,72	77,40
IPCA + 6,00%	0,92	6,43	2,56	5,45	10,74	22,05	42,36	64,40	78,32
INPC + 4,00%	0,62	5,33	1,98	4,37	8,21	16,49	33,39	52,35	62,74
INPC + 6,00%	0,79	6,50	2,48	5,36	10,28	20,99	41,20	64,35	78,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
354	02/07/2024	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	56.340.364,65	13.226.217,00205300	4,2597490000
363	02/07/2024	CAIXA BRASIL 2026 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA	50.703.173,73	0,00	50.338.693,89988320	1,0072405500
364	03/07/2024	CAIXA BRASIL 2026 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA	5.637.190,92	0,00	5.585.886,83959195	1,0091845900
358	05/07/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	20.000,00	5.412,65730300	3,6950427270
355	08/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	108.855,96	0,00	30.624,23601800	3,5545690000
366	10/07/2024	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	2.824.000,00	0,00	160.890,90400000	17,5522664000
356	10/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.241.930,88	0,00	348.920,00999000	3,5593570000
357	10/07/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	285.000,00	0,00	77.001,03405800	3,7012489960
361	17/07/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	249.110,19	0,00	64.855,17914100	3,8410223100
359	24/07/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	136.000,00	36.658,11333100	3,7099563410
353	26/07/2024	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	47.273.252,51	1.957.982,70624212	24,1438560000
352	29/07/2024	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	17.273.252,51	0,00	373.795,42403877	46,2104440000
365	29/07/2024	CAIXA BRASIL 2026 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA	30.000.000,00	0,00	29.557.636,27740330	1,0149661400
367	31/07/2024	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	10.000.000,00	565.974,79300000	17,6686314000
360	31/07/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	62.000,00	16.682,59980100	3,7164471210
362	31/07/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	5.995.108,33	0,00	150.171,16034300	39,9218353000
Total			114.317.622,52	113.831.617,16		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.520.490,18

Value-At-Risk: 0,27%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,48	0,27		0,27	0,06	0,94	554.770.229,72	100,00
LENÇÓIS PAULISTA		0,27		0,27			554.770.229,72	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,27%

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	4,44	2,23	0,01	0,01	0,26	2,07	4.028.409,85	0,73
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,58	0,27	0,00	0,02	-0,00	0,91	1.503.090,90	0,27
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,98	1,12	0,01	0,19	-0,07	0,76	6.932.063,91	1,25
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,54	0,31	0,02	0,32	0,14	0,98	113.669.824,50	20,49
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,54	0,31	0,00	0,32	0,13	0,98	11.019.931,70	1,99
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	4,45	2,22	0,01	0,00	0,26	2,06	1.679.139,24	0,30
CAIXA BRASIL 2026 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA	2,08	1,21	0,18	1,21	-0,10	0,70	86.954.810,62	15,67
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,76	NaN	0,00	NaN	-0,01	0,89	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,60	0,28	0,03	0,03	0,04	0,93	67.822.582,31	12,23
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,18	NaN	0,00	NaN	-0,02	0,88	0,00	0,00
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	4,45	2,22	0,00	0,02	0,26	2,06	1.173.398,86	0,21
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	0,60	0,27	0,01	0,35	-0,07	0,87	54.762.815,21	9,87
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	4,45	2,22	0,00	0,01	0,26	2,07	311.252,76	0,06
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,01	0,01	-0,00	0,01	-1,76	0,89	96.697.446,05	17,43
Sub-total	0,57	0,34	0,27		0,03	0,92	446.554.765,91	80,49

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRABCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11	0,04	-0,00	0,04	0,78	1,00	108.215.463,81	19,51
Sub-total	0,11	0,04	-0,00		0,78	1,00	108.215.463,81	19,51

(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 (%)