



LDB
EMPRESAS

ILHA SOLTEIRA
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 76,50%

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	6.339.395,79	3,09	4.649.802.742,18	0,14
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,72	-0,18	0,37	3,20	7.327.316,19	3,58	4.972.766.310,86	0,15
BB	BB	BB PREV RF IRF M	2,50	-0,28	-0,32	1,37	2.806.282,68	1,37	3.792.665.736,98	0,07
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,72	-0,18	0,37	3,21	7.385.909,41	3,60	7.303.046.549,52	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,89	-0,82	-2,25	-5,08	2.688.060,58	1,31	1.144.374.704,79	0,23
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,80	-0,51	-1,00	-1,22	6.329.305,64	3,09	4.133.113.700,82	0,15
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRF-M TITULOS PUBLICOS RF	2,52	-0,28	0,26	0,26	7.184.794,42	3,51	873.699.171,24	0,82
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,87	-0,15	0,30	0,30	7.187.243,34	3,51	285.872.986,61	2,51
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	1,72	-0,18	0,37	3,19	9.312.833,95	4,55	1.312.208.437,83	0,71
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	3,81	-0,51	-0,99	-1,24	16.480.500,47	8,04	476.058.771,06	3,46
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,87	-0,34	-0,40	0,60	73.041.642,47	35,65		

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				
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,07	0,04	0,79	5,24	19.449.558,83	9,49	17.821.452.916,03	0,11
BRASESCO	BRASESCO	BRASESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11	0,04	0,83	5,69	20.800.793,75	10,15	11.692.368.410,92	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,09	0,04	0,82	5,36	31.759.179,68	15,50	16.508.104.382,05	0,19
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,06	0,04	0,71	4,70	131.480,56	0,06	976.883.009,20	0,01
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,10	0,04	0,82	5,48	11.555.352,51	5,64	2.969.679.625,74	0,39
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,08	0,04	0,82	5,42	83.696.365,33	40,85		
Renda Fixa			1,33	-0,14	0,26	3,17	156.738.007,80	76,50		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

23,50%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	13,25	-0,37	0,65	-9,36	4.193.944,83	2,05	314.142.041,59	1,34
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	12,79	-0,34	1,59	-6,31	3.751.393,19	1,83	567.596.143,42	0,66
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	13,80	-0,33	1,55	-6,94	2.739.207,31	1,34	649.126.137,40	0,42
BRAM	BEM	BRADERCO F I A SELECTION	14,89	-0,75	-0,13	-13,33	3.931.399,05	1,92	305.744.233,44	1,29
BRAM	BEM	BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	19,36	-1,35	-0,04	-12,82	4.716.315,74	2,30	572.598.578,35	0,82
BRAM	BRADERCO	BRADERCO FIA IBOVESPA PLUS	13,68	-0,32	1,53	-7,74	12.036.539,82	5,87	234.298.636,37	5,14
CAIXA DTVM	CEF	FIA BRASIL IBX-50	13,56	-0,19	1,58	-7,39	9.794.744,61	4,78	378.771.354,66	2,59
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,31	-1,15	-0,44	-15,12	2.569.724,06	1,25	604.053.530,94	0,43
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	13,70	-0,54	1,11	-10,19	3.433.301,86	1,68	324.809.945,67	1,06
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	13,79	-0,28	1,60	-10,39	982.803,92	0,48	60.154.496,51	1,63
Sub-total Artigo 8º I			14,12	-0,50	1,04	-9,31	48.149.374,39	23,50		
Renda Variável			14,12	-0,50	1,04	-9,31	48.149.374,39	23,50		
Total			4,10	-0,22	0,43	-0,05	204.887.382,19	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	73.041.642,47	35,65					100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	83.696.365,33	40,85					65,00
	Total Renda Fixa	156.738.007,80	76,50					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	48.149.374,39	23,50					35,00
	Total Renda Variável	48.149.374,39	23,50					35,00
Total		204.887.382,19	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 -50,28	0,60 11,42	-0,29 -11,36	0,60 11,42	5,00 42,75	-254.101,31	469.336,25
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,82 103,44	5,42 103,89	2,60 102,60	5,42 103,89	12,22 104,55	679.279,89	4.413.596,32
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,04 -0,44	-9,31 -1,65	-5,11 -1,83	-9,31 -1,65	-0,28 -5,21	496.301,85	-4.940.290,26
ILHA SOLTEIRA (Total)						921.480,43	-57.357,69

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	6.402.476,59	0,00	0,00	0,00	6.339.395,79	-63.080,80	-78.649,51
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	7.300.024,63	0,00	0,00	0,00	7.327.316,19	27.291,56	227.288,49
BB PREV RF IRF M	2.815.172,71	0,00	0,00	0,00	2.806.282,68	-8.890,03	37.824,53
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7.358.509,15	0,00	0,00	0,00	7.385.909,41	27.400,26	229.739,94
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.749.859,23	0,00	0,00	0,00	2.688.060,58	-61.798,65	-143.845,09
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.392.921,37	0,00	0,00	0,00	6.329.305,64	-63.615,73	-78.369,94
SANTANDER FI IRF-M TITULOS PUBLICOS RF	0,00	7.166.015,52	0,00	0,00	7.184.794,42	18.778,90	18.778,90
SANTANDER RF ATIVO FIC	0,00	7.166.015,52	0,00	0,00	7.187.243,34	21.227,82	21.227,82
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	16.319.129,21	0,00	-7.041.479,96	0,00	9.312.833,95	35.184,70	481.609,42
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	23.957.650,89	0,00	-7.290.551,08	0,00	16.480.500,47	-186.599,34	-246.268,31
	73.295.743,78	14.332.031,04	-14.332.031,04	0,00	73.041.642,47	-254.101,31	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	19.777.092,07	0,00	-480.000,00	0,00	19.449.558,83	152.466,76	1.033.015,40
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	19.876.364,19	1.500.000,00	-750.000,00	0,00	20.800.793,75	174.429,56	1.087.542,07
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	31.541.692,90	200.000,00	-240.000,00	0,00	31.759.179,68	257.486,78	1.637.954,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	130.556,93	0,00	0,00	0,00	131.480,56	923,63	5.901,09
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	12.311.379,35	0,00	-850.000,00	0,00	11.555.352,51	93.973,16	649.183,38
	83.637.085,44	1.700.000,00	-2.320.000,00	0,00	83.696.365,33	679.279,89	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	4.166.792,92	0,00	0,00	0,00	4.193.944,83	27.151,91	-433.033,80
BB AÇÕES DIVIDENDOS	3.692.532,86	0,00	0,00	0,00	3.751.393,19	58.860,33	-252.444,14
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	2.697.278,47	0,00	0,00	0,00	2.739.207,31	41.928,84	-204.425,41
BRADESCO F I A SELECTION	3.936.447,72	0,00	0,00	0,00	3.931.399,05	-5.048,67	-604.660,11
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	4.717.986,85	0,00	0,00	0,00	4.716.315,74	-1.671,11	-693.729,58
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	11.854.972,81	0,00	0,00	0,00	12.036.539,82	181.567,01	-1.009.720,16
FIA BRASIL IBX-50	9.642.852,70	0,00	0,00	0,00	9.794.744,61	151.891,91	-781.284,21
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	2.581.178,12	0,00	0,00	0,00	2.569.724,06	-11.454,06	-457.588,88
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	3.395.692,39	0,00	0,00	0,00	3.433.301,86	37.609,47	-389.478,97
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	967.337,70	0,00	0,00	0,00	982.803,92	15.466,22	-113.925,00
	47.653.072,54	0,00	0,00	0,00	48.149.374,39	496.301,85	

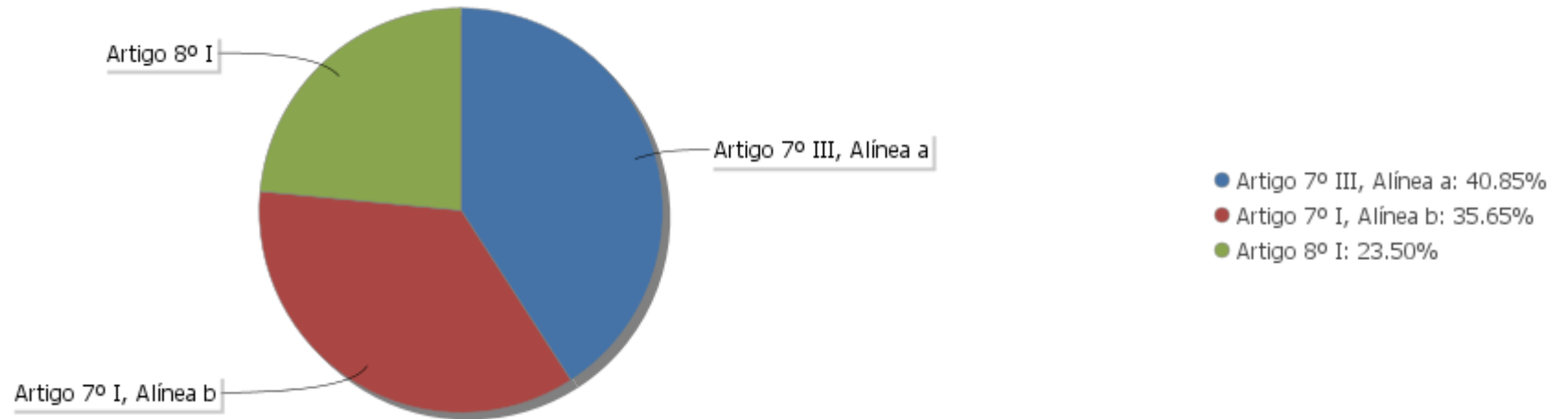
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

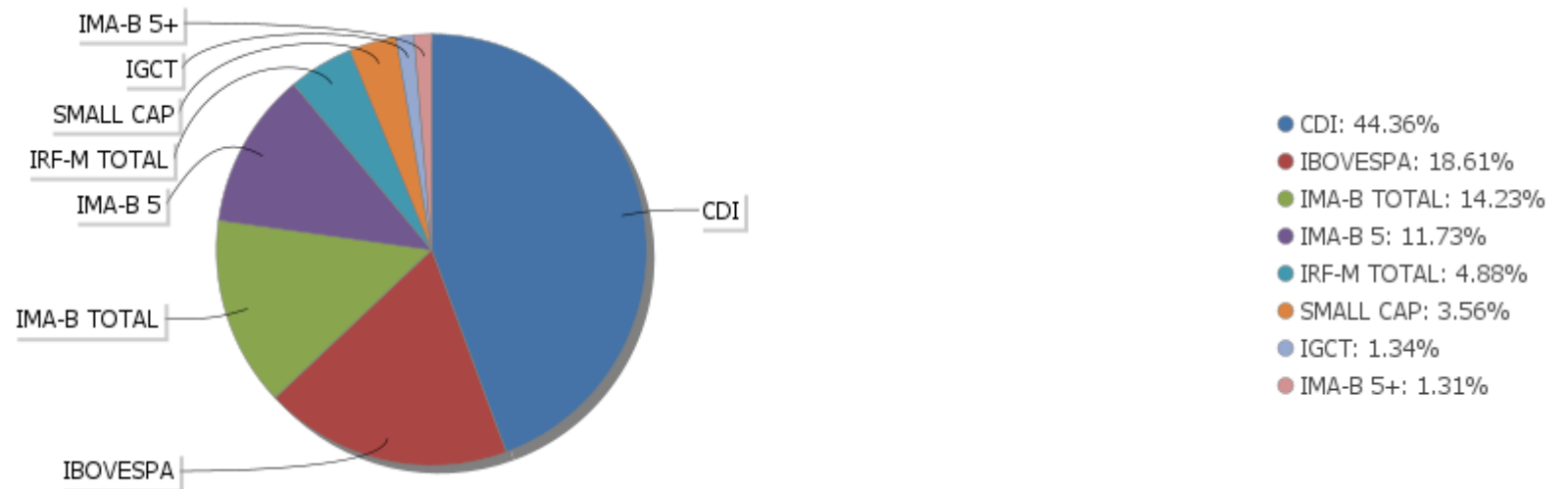
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	204.887.382,19	100,00		204.887.382,19	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00		204.887.382,19	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00		204.887.382,19	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

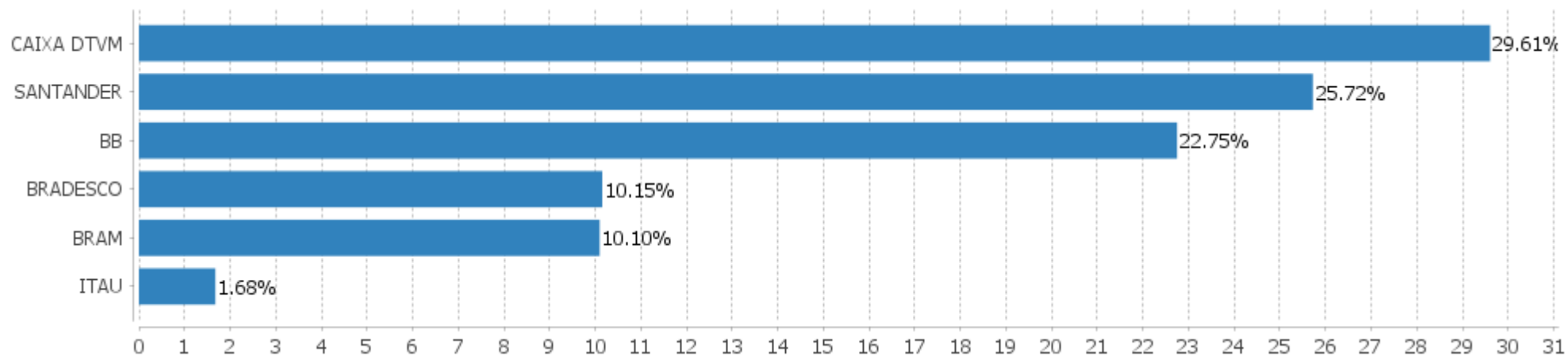


Alocação Por Estratégia



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	-0,84	0,77	0,34	-0,81	0,07	0,43							-0,05
IPCA + 4,64%	0,82	1,18	0,52	0,78	0,84	0,57							4,80
p.p. indexador	-1,66	-0,41	-0,18	-1,59	-0,77	-0,14							-4,84
2023	1,43	-1,02	0,62	1,33	2,25	3,02	1,52	-0,97	0,25	-0,73	3,88	2,58	14,97
IPCA + 4,64%	0,93	1,17	1,13	0,94	0,63	0,30	0,50	0,65	0,62	0,62	0,64	0,92	9,42
p.p. indexador	0,50	-2,18	-0,51	0,40	1,62	2,72	1,02	-1,61	-0,37	-1,35	3,24	1,66	5,55
2022	1,34	0,49	3,60	-1,67	1,24	-3,06	0,86	2,25	0,72	2,59	-1,71	-0,39	6,24
IPCA + 4,80%	0,93	1,37	2,04	1,42	0,88	1,06	-0,29	0,07	0,10	0,96	0,78	1,03	10,84
p.p. indexador	0,41	-0,88	1,57	-3,09	0,36	-4,12	1,16	2,18	0,62	1,62	-2,49	-1,42	-4,60
2021	-1,25	-1,72	1,08	1,36	2,39	0,39	-1,37	-1,38	-1,68	-3,56	1,56	1,08	-3,23
IPCA + 5,42%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,68	1,37	1,22	16,00
p.p. indexador	-1,92	-2,97	-0,34	0,63	1,12	-0,58	-2,79	-2,72	-3,29	-5,24	0,19	-0,13	-19,23
2020	0,07	-2,11	-11,70	2,89	2,80	3,28	4,26	-1,48	-1,92	-0,10	4,59	4,91	4,37
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,65
p.p. indexador	-0,64	-2,77	-12,27	2,74	2,73	2,54	3,38	-2,19	-3,04	-1,44	3,24	3,06	-6,28
2019	4,73	-0,18	0,32	1,16	1,98	3,00	1,22	-0,06	2,34	2,42	-0,78	3,49	21,34
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	3,90	-1,08	-0,87	0,10	1,34	2,55	0,50	-0,68	1,90	1,79	-1,75	1,85	10,75
2018	3,56	0,54	0,75	0,28	-3,68	-1,22	3,16	-0,91	0,92	5,90	1,11	0,71	11,33
IPCA + 6,00%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	2,75	-0,20	0,17	-0,43	-4,57	-2,97	2,32	-1,35	-0,00	4,93	0,85	0,09	1,41
2017	1,97	1,97	0,71	0,39	-0,92	0,38	2,98	1,87	1,82	0,02	-0,78	1,65	12,66
IPCA + 6,00%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	1,07	1,22	-0,08	-0,17	-1,75	0,13	2,26	1,15	1,20	-0,89	-1,53	0,75	3,61

Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	44	48,89	03 meses	-0,31	2,21	-2,51	3,59
Meses abaixo - Meta Atuarial	46	51,11	06 meses	-0,05	4,80	-4,84	3,51
			12 meses	6,57	9,00	-2,44	4,10
			24 meses	19,89	17,74	2,16	5,64
			36 meses	15,59	38,47	-22,88	6,13
			48 meses	30,48	58,48	-28,01	6,44
			60 meses	34,25	71,53	-37,28	8,99

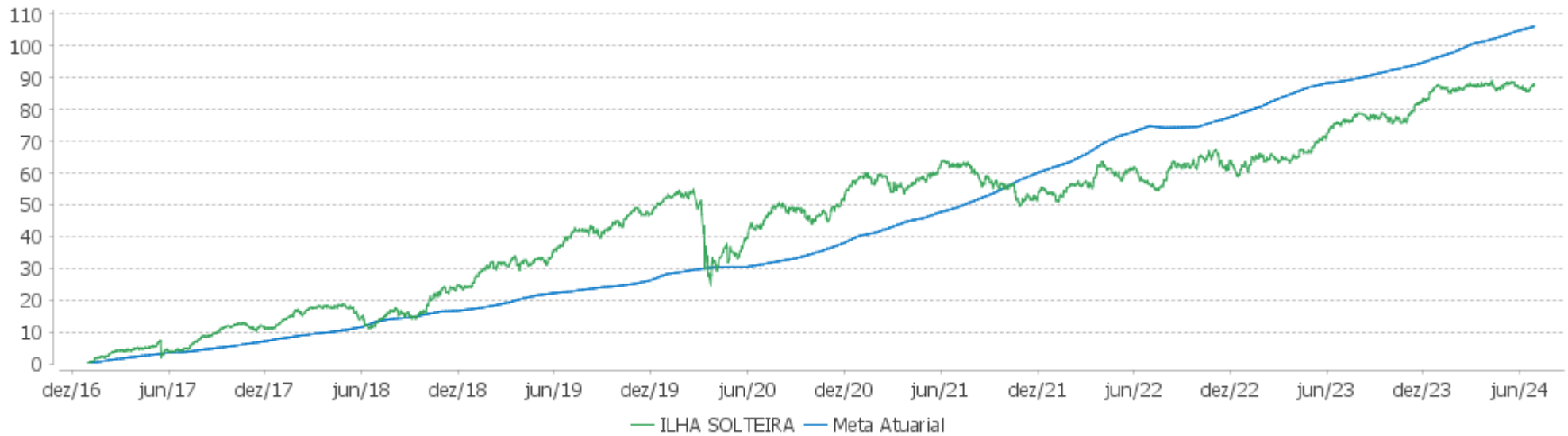
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	5,90	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-11,70	2020-03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Desde 30/12/2016	87,63	116,25	-28,62	8,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

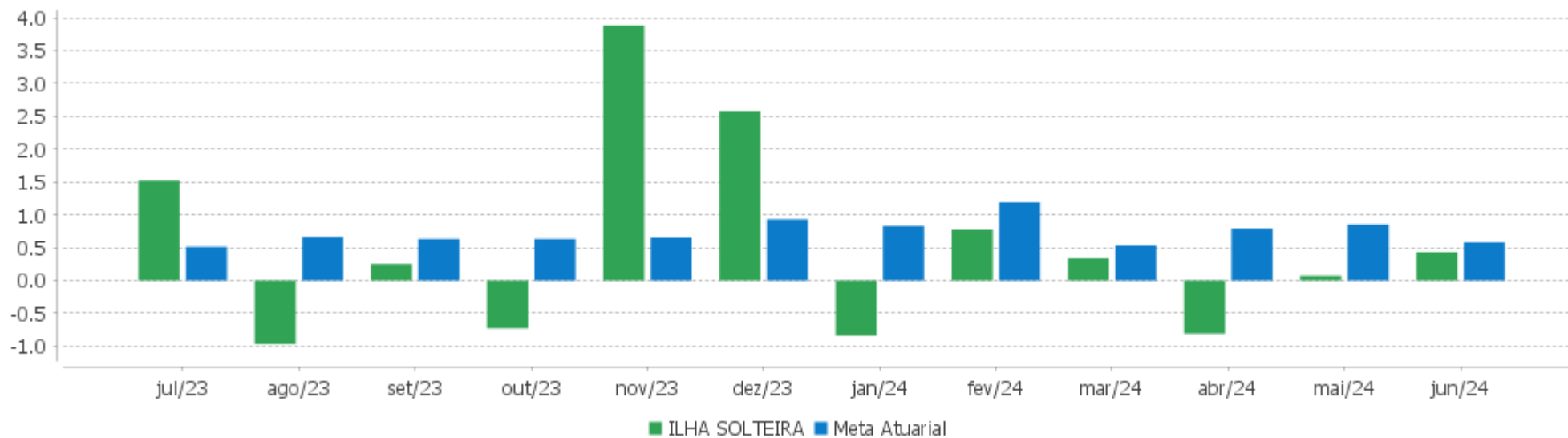


Patrimônio Líquido



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
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,00 -0,03	-1,22 -0,13	-1,35 -0,08	-1,22 -0,13	2,87 -0,19	16,57 -0,43	20,68 -0,75
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
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,37 -0,02	3,19 -0,13	1,18 -0,06	3,19 -0,13	7,97 -0,26	18,76 -0,54	30,43 -0,87
SANTANDER FI IRF-M TITULOS PUBLICOS RF Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,31 -0,02	1,34 -0,17	-0,25 -0,09	1,34 -0,17	7,60 -0,29	25,30 -0,65	27,11 -1,05
SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI	0,16 20,19	2,02 38,75	0,65 25,61	2,02 38,75	7,36 62,92	21,17 78,93	29,44 77,90
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,37 -0,02	3,20 -0,12	1,18 -0,06	3,20 -0,12	7,97 -0,26	18,82 -0,48	30,38 -0,92
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,32 -0,02	1,37 -0,14	-0,24 -0,07	1,37 -0,14	7,50 -0,39	25,10 -0,84	26,99 -1,17
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 IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-2,25 0,00	-5,08 -0,04	-3,61 -0,03	-5,08 -0,04	-1,41 0,02	14,09 -0,59	11,11 -1,08
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
BRADESCO 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
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,79 100,10	5,24 100,37	2,53 99,91	5,24 100,37	11,71 100,14	26,83 100,06	38,23 101,15
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,82 103,84	5,36 102,72	2,57 101,69	5,36 102,72	12,19 104,28	27,40 102,16	39,10 103,45
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,82 103,65	5,48 105,02	2,62 103,49	5,48 105,02	12,39 106,00	27,67 103,19	39,60 104,77
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES % do CDI	0,71 89,74	4,70 90,00	2,27 89,81	4,70 90,00	10,59 90,59	23,51 87,67	32,30 85,47
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,65 -0,83	-9,36 -1,70	-4,13 -0,85	-9,36 -1,70	2,49 -2,44	19,19 -6,55	-8,06 -5,78
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-0,44	-15,12	-11,33	-15,12	-12,55	3,93	-37,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. SMALL CAP p.p.	-0,05	-0,26	-0,10	-0,26	-0,59	-1,53	-1,47
BRADESCO F I A SELECTION	-0,13	-13,33	-10,63	-13,33	-7,64	10,00	-18,58
Var. IBOVESPA p.p.	-1,61	-5,67	-7,35	-5,67	-12,57	-15,74	-16,29
FIA BRASIL IBX-50	1,58	-7,39	-3,39	-7,39	3,54	20,07	-9,63
Var. IBOVESPA p.p.	0,09	0,27	-0,11	0,27	-1,39	-5,67	-7,35
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	1,60	-10,39	-4,96	-10,39	-4,12	7,18	-21,54
Var. IBOVESPA p.p.	0,12	-2,73	-1,68	-2,73	-9,05	-18,56	-19,25
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	1,11	-10,19	-6,16	-10,19	-0,28	18,70	-11,98
Var. IBOVESPA p.p.	-0,37	-2,53	-2,88	-2,53	-5,21	-7,03	-9,70
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1,59	-6,31	-2,19	-6,31	5,99	21,37	-1,52
Var. IBOVESPA p.p.	0,11	1,36	1,09	1,36	1,06	-4,37	0,76
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	1,55	-6,94	-2,88	-6,94	5,04	22,95	-7,18
Var. IGCT p.p.	0,13	0,01	0,26	0,01	-0,75	-2,79	-2,93
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	-0,04	-12,82	-8,16	-12,82	-13,42	-5,00	-34,26
Var. SMALL CAP p.p.	0,36	2,03	3,07	2,03	-1,46	-10,47	2,03
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	1,53	-7,74	-3,29	-7,74	4,89	25,82	-2,38
Var. IBOVESPA p.p.	0,05	-0,08	-0,01	-0,08	-0,04	0,08	-0,10
ILHA SOLTEIRA	0,43	-0,05	-0,31	-0,05	6,57	19,89	15,59
Var. IPCA + 4,80% p.p.	-0,14	-4,84	-2,51	-4,84	-2,44	2,25	-22,15
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79
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 AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IRF M	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	D+0	D+0	D+0	D+2 du		0,50
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		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 IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA BRASIL IBX-50	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	D+1 du	D+0	D+2 du	D+4 du		1,50
SANTANDER FI IRF-M TITULOS PUBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
SANTANDER RF ATIVO FIC	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,10
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração

FIC FI

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
399	03/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	200.000,00	38.307,07989535	5,2209670000
409	03/06/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	850.000,00	3.234,74890329	262,7715552000
396	03/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	480.000,00	150.012,66313144	3,1997298760
418	05/06/2024	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	0,00	1.775.384,10	49.307,22629424	36,0065701000
419	05/06/2024	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	0,00	1.779.323,34	49.416,62966115	36,0065701000
420	05/06/2024	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	0,00	3.486.772,52	96.837,11917898	36,0065701000
407	05/06/2024	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	0,00	5.793.047,01	168.162,45740989	34,4491101000
408	05/06/2024	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	0,00	1.497.504,07	43.470,03640016	34,4491101000
402	07/06/2024	SANTANDER FI IRF-M TITULOS PUBLICOS RF	7.166.015,52	0,00	210.154,99340028	34,0987164000
403	10/06/2024	SANTANDER RF ATIVO FIC	7.166.015,52	0,00	429.767,02461616	16,6741865000
411	10/06/2024	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1.500.000,00	0,00	86.244,52593057	17,3924082000
401	13/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	200.000,00	0,00	38.181,66684358	5,2381160000
400	25/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	40.000,00	7.611,36666275	5,2552980000
412	27/06/2024	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	750.000,00	42.888,40114928	17,4872455000
Total			16.032.031,04	16.652.031,04		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.796.408,80

Value-At-Risk: 1,85%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,38	0,68		0,39	-0,39	0,25	156.738.007,80	76,50
Artigo 8º	13,12	6,41		1,46	0,02	1,04	48.149.374,39	23,50
ILHA SOLTEIRA		1,85		1,85			204.887.382,19	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,68%

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	0,05	0,01	-0,44	-0,99	6.339.395,79	3,09
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,72	0,91	0,02	0,01	-0,24	0,37	7.327.316,19	3,58
BB PREV RF IRF M	3,60	1,36	0,01	0,01	-0,31	-0,32	2.806.282,68	1,37
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,71	0,91	0,02	0,01	-0,24	0,37	7.385.909,41	3,60
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,32	3,00	0,03	0,05	-0,48	-2,25	2.688.060,58	1,31
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,00	2,15	0,05	0,02	-0,45	-1,00	6.329.305,64	3,09
SANTANDER FI IRF-M TITULOS PUBLICOS RF	3,62	1,38	0,04	0,02	-0,30	-0,31	7.184.794,42	3,51
SANTANDER RF ATIVO FIC	1,71	0,76	0,02	0,76	-0,37	0,16	7.187.243,34	3,51
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	1,71	0,91	0,03	0,00	-0,24	0,37	9.312.833,95	4,55
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	4,00	2,15	0,12	0,01	-0,44	-0,99	16.480.500,47	8,04
Sub-total	2,93	1,46	0,39		-0,40	-0,40	73.041.642,47	35,65

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,04	0,02	0,00	0,02	0,02	0,79	19.449.558,83	9,49
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,04	-0,00	0,04	0,98	0,83	20.800.793,75	10,15
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,02	0,81	0,82	31.759.179,68	15,50
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	0,01	0,00	0,00	-119,43	0,71	131.480,56	0,06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,07	0,03	-0,00	0,03	0,42	0,82	11.555.352,51	5,64
Sub-total	0,03	0,02	0,00		0,95	0,82	83.696.365,33	40,85

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,41%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	12,19	6,68	0,13	1,79	-0,01	0,65	4.193.944,83	2,05
BB AÇÕES DIVIDENDOS	12,01	6,36	0,11	1,99	0,07	1,59	3.751.393,19	1,83
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	12,54	6,07	0,08	0,33	0,06	1,55	2.739.207,31	1,34
BRADESCO F I A SELECTION	15,33	7,72	0,14	3,26	-0,06	-0,13	3.931.399,05	1,92
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	17,77	8,77	0,18	3,20	-0,05	-0,04	4.716.315,74	2,30
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	12,36	5,84	0,33	0,04	0,06	1,53	12.036.539,82	5,87
FIA BRASIL IBX-50	11,83	5,94	0,27	0,76	0,07	1,58	9.794.744,61	4,78
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,06	9,49	0,11	0,15	-0,06	-0,44	2.569.724,06	1,25
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	13,19	6,21	0,10	1,37	0,02	1,11	3.433.301,86	1,68
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	12,62	5,81	0,03	1,34	0,06	1,60	982.803,92	0,48
Sub-total	13,12	6,41	1,46		0,02	1,04	48.149.374,39	23,50

(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 (%)