



LDB
EMPRESAS

ILHA SOLTEIRA
JUNHO 2023



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 30.06.2023.

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 75,65%

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	5,28	0,74	2,37	11,28	6.168.880,52	3,11	6.493.608.770,37	0,09
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,41	0,23	1,03	6,99	6.786.466,84	3,42	5.638.426.224,35	0,12
BB	BB	BB PREV RF IRF M	3,42	0,29	2,09	9,44	2.538.979,09	1,28	4.459.933.733,33	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,39	0,22	1,03	7,00	6.839.112,12	3,45	8.254.253.931,25	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,26	1,10	3,30	14,47	2.726.534,81	1,37	1.220.487.574,87	0,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,35	0,73	2,35	11,24	6.152.526,91	3,10	4.240.209.456,14	0,15
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,40	0,22	1,03	6,92	15.171.091,55	7,65	1.128.559.610,31	1,34
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	5,32	0,74	2,37	11,22	23.073.425,75	11,63	369.070.369,54	6,25
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,16	0,52	1,84	9,31	69.457.017,59	35,02		

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	0,08	0,05	1,09	6,44	21.180.121,46	10,68	14.982.085.274,92	0,14
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,04	1,13	6,53	23.243.414,69	11,72	8.773.662.957,45	0,26
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,05	1,12	6,42	29.625.236,84	14,94	15.331.819.820,88	0,19
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,02	0,05	0,99	5,64	118.888,29	0,06	743.796.291,54	0,02
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,08	0,05	1,15	6,37	6.427.801,83	3,24	3.021.387.375,69	0,21
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,56	0,05	1,12	6,68	80.595.463,11	40,64		
Renda Fixa			3,26	0,27	1,45	8,11	150.052.480,70	75,65		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

24,35%

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	20,21	-0,39	8,37	6,56	4.092.188,33	2,06	326.744.018,15	1,25
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	19,05	0,08	7,90	7,28	3.539.483,82	1,78	592.169.733,93	0,60
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21,16	-0,25	8,88	6,51	2.607.828,58	1,31	810.368.157,20	0,32
BRAM	BEM	BRADERCO F I A SELECTION	20,82	0,31	8,01	5,57	4.256.627,79	2,15	468.779.708,09	0,91
BRAM	BEM	BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	25,56	0,79	6,48	4,22	5.447.270,31	2,75	759.747.191,78	0,72
BRAM	BRADERCO	BRADERCO FIA IBOVESPA PLUS	20,99	-0,26	9,05	7,69	11.475.505,04	5,79	324.216.474,05	3,54
CAIXA DTVM	CEF	FIA BRASIL IBX-50	20,75	-0,08	8,14	5,47	9.460.303,76	4,77	651.428.973,06	1,45
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	26,49	1,08	8,03	13,04	2.938.553,06	1,48	675.053.112,68	0,44
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	20,01	-0,01	8,06	7,26	3.443.076,76	1,74	391.223.289,46	0,88
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	20,85	-0,10	8,70	2,47	1.025.011,31	0,52	96.815.725,21	1,06
Sub-total Artigo 8º I			20,97	0,06	8,20	6,63	48.285.848,76	24,35		
Renda Variável			20,97	0,06	8,20	6,63	48.285.848,76	24,35		
Total			6,83	0,22	3,02	7,83	198.338.329,46	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	69.457.017,59	35,02					100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	80.595.463,11	40,64					65,00
	Total Renda Fixa	150.052.480,70	75,65					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	48.285.848,76	24,35					35,00
	Total Renda Variável	48.285.848,76	24,35					35,00
Total		198.338.329,46	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	1,84 171,24	9,31 143,25	5,13 162,94	9,31 143,25	11,80 87,17	1.252.148,30	7.191.207,13
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,12 104,17	6,68 102,81	3,29 104,43	6,68 102,81	11,29 83,38	884.113,05	4.076.835,61
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	8,20 -0,81	6,63 -0,98	15,21 -0,69	6,63 -0,98	16,68 -3,15	3.657.359,06	3.003.800,46
ILHA SOLTEIRA (Total)						5.793.620,41	14.271.843,20

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	6.025.941,67	0,00	0,00	0,00	6.168.880,52	142.938,85	1.005.704,78
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	6.717.218,10	0,00	0,00	0,00	6.786.466,84	69.248,74	720.658,67
BB PREV RF IRF M	2.486.934,41	0,00	0,00	0,00	2.538.979,09	52.044,68	219.089,92
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.769.283,43	0,00	0,00	0,00	6.839.112,12	69.828,69	656.742,89
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.639.526,52	0,00	0,00	0,00	2.726.534,81	87.008,29	378.205,50
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.011.059,55	0,00	0,00	0,00	6.152.526,91	141.467,36	896.252,49
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	117.725,02	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	15.016.606,51	0,00	0,00	0,00	15.171.091,55	154.485,04	981.658,75
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	22.538.299,10	0,00	0,00	0,00	23.073.425,75	535.126,65	2.327.712,85
	68.322.594,31	0,00	0,00	0,00	69.457.017,59	1.252.148,30	

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	21.301.041,87	0,00	-350.000,00	0,00	21.180.121,46	229.079,59	806.353,91
BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	22.983.141,14	0,00	0,00	0,00	23.243.414,69	260.273,55	993.342,41
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	29.627.660,53	0,00	-330.000,00	0,00	29.625.236,84	327.576,31	1.402.835,73
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	0,00	0,00	0,00	118.888,29	1.163,27	6.344,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	5.381.781,50	1.700.000,00	-720.000,00	0,00	6.427.801,83	66.020,33	268.427,53
	79.293.625,04	1.700.000,00	-1.400.000,00	0,00	80.595.463,11	884.113,05	

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	3.776.016,70	0,00	0,00	0,00	4.092.188,33	316.171,63	252.044,53
BB AÇÕES DIVIDENDOS	3.280.466,11	0,00	0,00	0,00	3.539.483,82	259.017,71	240.275,58
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	2.395.197,01	0,00	0,00	0,00	2.607.828,58	212.631,57	159.432,54
BRADESCO F I A SELECTION	3.940.870,57	0,00	0,00	0,00	4.256.627,79	315.757,22	224.644,71
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	5.115.774,07	0,00	0,00	0,00	5.447.270,31	331.496,24	220.326,03
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	10.522.927,17	0,00	0,00	0,00	11.475.505,04	952.577,87	819.773,56
FIA BRASIL IBX-50	8.748.081,66	0,00	0,00	0,00	9.460.303,76	712.222,10	490.584,63
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	2.720.082,13	0,00	0,00	0,00	2.938.553,06	218.470,93	339.061,41
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	3.186.121,96	0,00	0,00	0,00	3.443.076,76	256.954,80	232.950,33
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	942.952,32	0,00	0,00	0,00	1.025.011,31	82.058,99	24.707,14
	44.628.489,70	0,00	0,00	0,00	48.285.848,76	3.657.359,06	

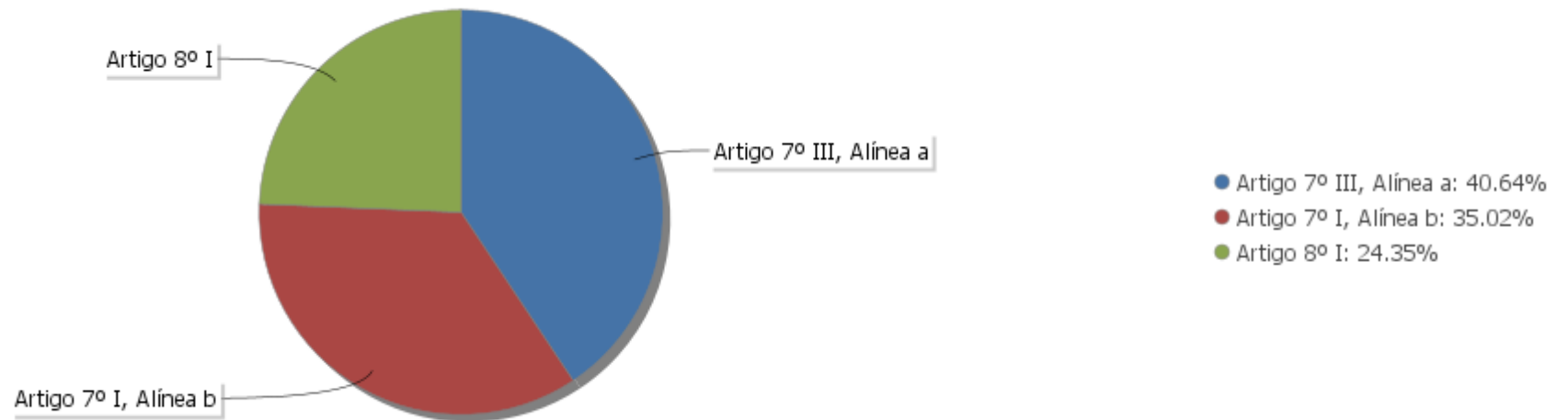
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

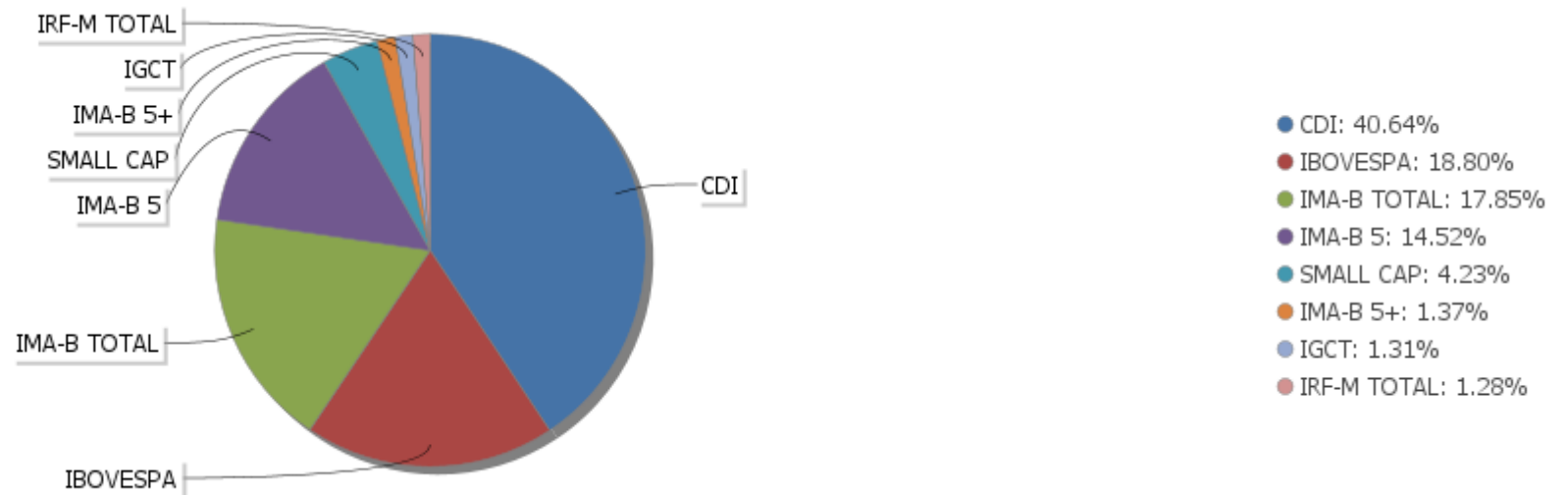
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	198.338.329,46	100,00		198.338.329,46	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00		198.338.329,46	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00		198.338.329,46	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

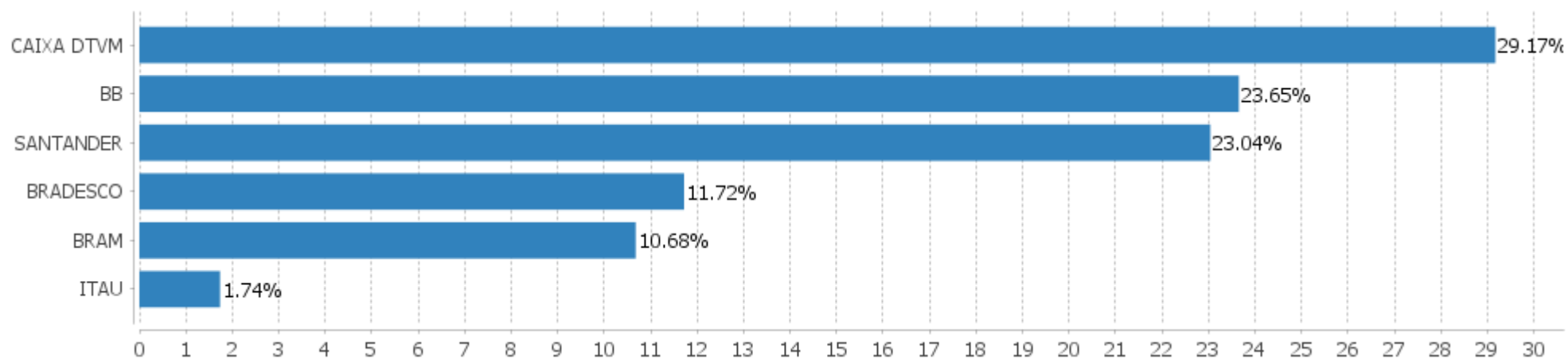


Alocação Por Estratégia



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
2023	1,43	-1,02	0,62	1,33	2,25	3,02							7,83
IPCA + 4,64%	0,93	1,17	1,13	0,94	0,63	0,30							5,19
p.p. indexador	0,50	-2,18	-0,51	0,40	1,62	2,72							2,64
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

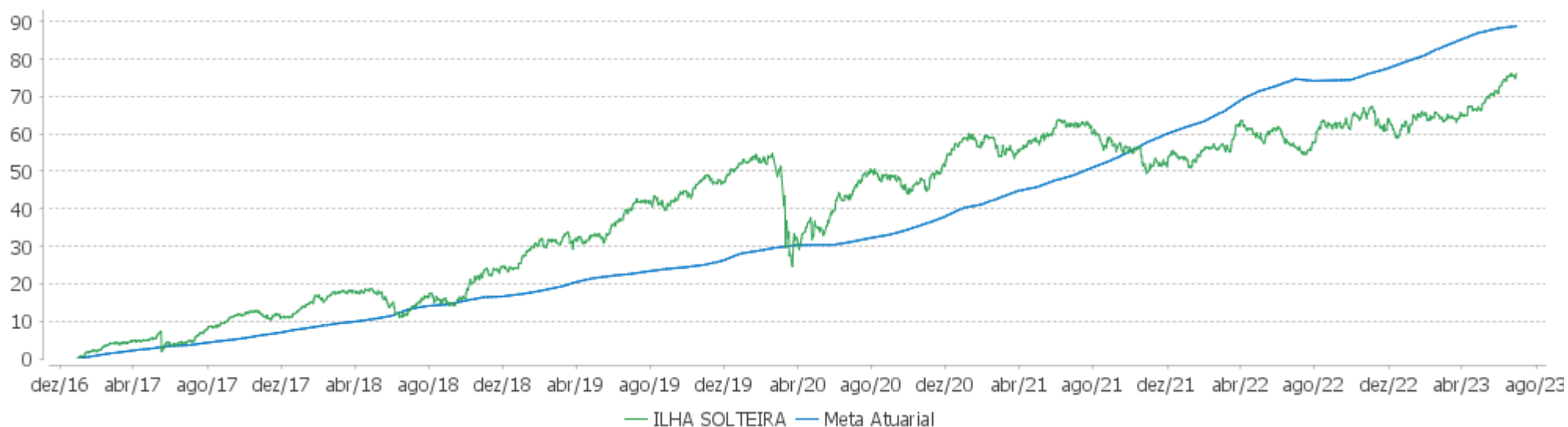
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	41	52,56
Meses abaixo - Meta Atuarial	37	47,44
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	5,90	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-11,70	2020-03

Relatório

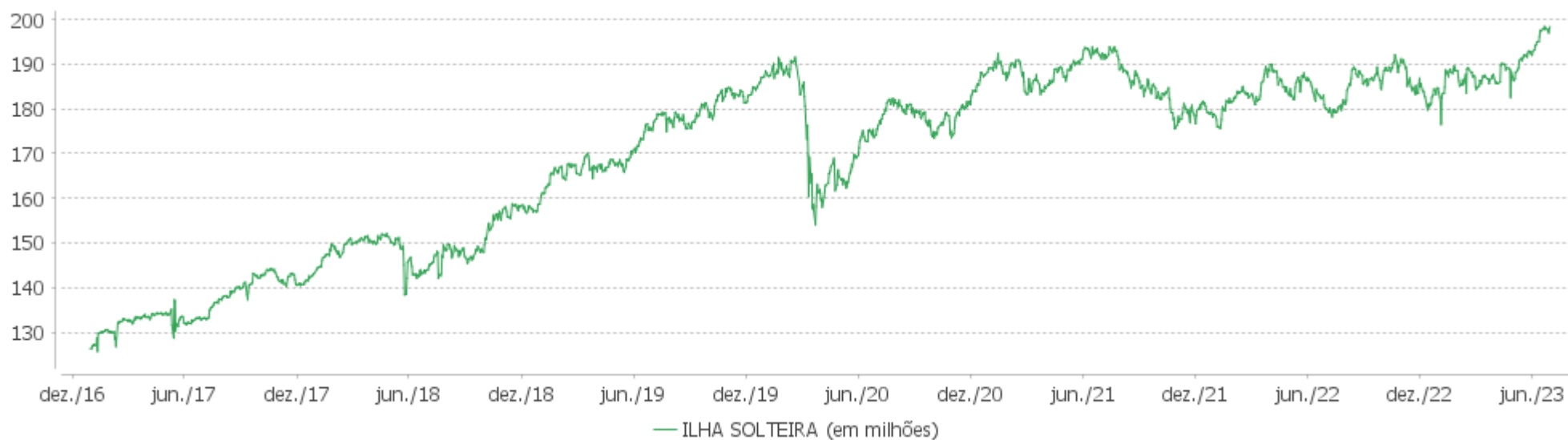
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	6,74	1,87	4,86	4,48
06 meses	7,83	5,19	2,64	5,44
12 meses	12,50	8,01	4,49	6,83
24 meses	8,46	27,03	-18,57	6,92
36 meses	22,43	45,39	-22,96	7,05
48 meses	25,97	57,36	-31,39	9,83
60 meses	56,16	72,30	-16,14	9,39
Desde 30/12/2016	76,07	98,39	-22,32	8,75

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

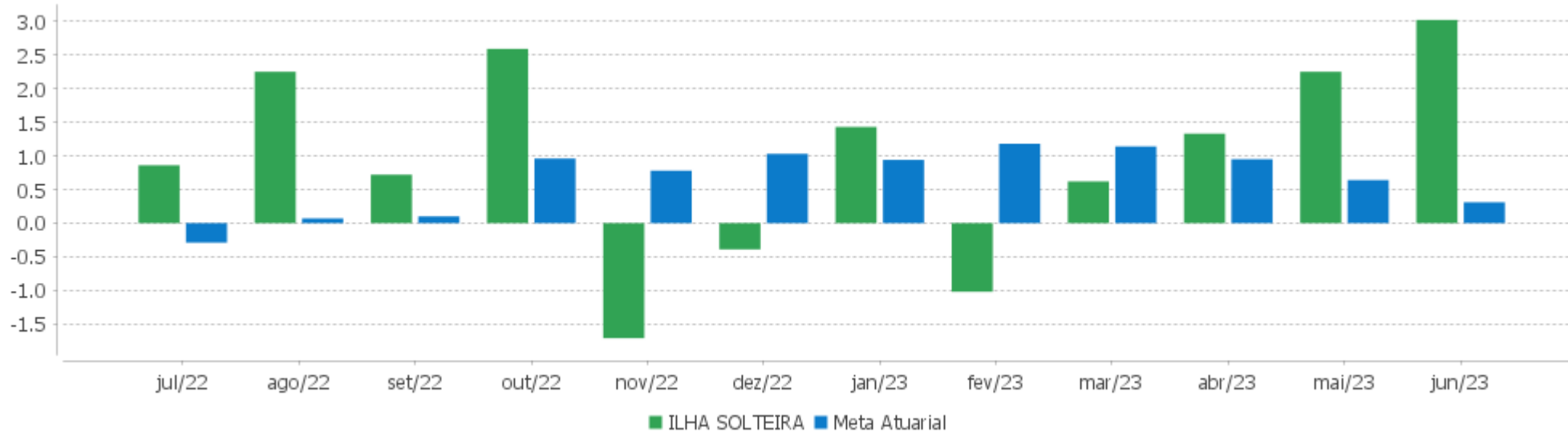


Patrimônio Líquido



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
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,35 -0,04	11,24 -0,12	7,06 -0,04	11,24 -0,12	13,32 -0,21	17,31 -0,50	25,74 -0,82
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	7,00 -0,04	2,57 0,02	7,00 -0,04	10,18 -0,05	21,01 -0,30	28,00 -0,68
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	6,92 -0,12	2,49 -0,05	6,92 -0,12	10,00 -0,23	20,80 -0,51	27,85 -0,83
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	6,99 -0,05	2,56 0,01	6,99 -0,05	10,05 -0,18	20,76 -0,56	27,74 -0,94
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	2,09 -0,03	9,44 -0,18	5,43 -0,08	9,44 -0,18	16,38 -0,36	18,13 -0,66	18,03 -0,93
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,37 -0,02	11,28 -0,09	7,11 0,01	11,28 -0,09	13,29 -0,24	17,23 -0,58	25,61 -0,95
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	3,30 -0,07	14,47 -0,44	10,61 -0,30	14,47 -0,44	15,72 -0,62	12,70 -1,12	22,09 -1,43
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,37 -0,02	11,22 -0,15	7,05 -0,06	11,22 -0,15	13,24 -0,29	17,23 -0,58	25,57 -0,99
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,13 105,64	6,53 100,53	3,22 102,48	6,53 100,53	13,87 102,45	24,53 104,96	27,55 105,26
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,09 101,92	6,44 99,04	3,16 100,55	6,44 99,04	13,54 99,98	23,74 101,59	26,65 101,82
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,12 104,05	6,42 98,84	3,25 103,25	6,42 98,84	13,55 100,07	23,98 102,62	26,71 102,07
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	1,15 107,14	6,37 98,06	3,26 103,54	6,37 98,06	13,60 100,39	24,20 103,57	27,56 105,33
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES % do CDI	0,99 92,18	5,64 86,75	2,77 88,15	5,64 86,75	11,68 86,27	19,63 84,00	21,32 81,48
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,37 -0,63	6,56 -1,05	13,83 -2,07	6,56 -1,05	16,30 -3,53	-10,29 -3,42	19,35 -4,88
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	8,03 -0,14	13,04 -0,22	24,57 -0,60	13,04 -0,22	18,85 -0,94	-28,83 -1,19	-2,28 -3,32
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	8,01 -0,99	5,57 -2,04	14,39 -1,51	5,57 -2,04	19,10 -0,74	-11,84 -4,97	18,98 -5,25
FIA BRASIL IBX-50	8,14	5,47	12,67	5,47	15,97	-12,72	19,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-0,86	-2,14	-3,23	-2,14	-3,86	-5,84	-5,09
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	8,70 -0,30	2,47 -5,14	13,25 -2,65	2,47 -5,14	11,78 -8,05	-18,17 -11,29	2,18 -22,04
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	8,06 -0,94	7,26 -0,35	15,63 -0,27	7,26 -0,35	19,04 -0,79	-11,73 -4,86	14,68 -9,55
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	8,88 -0,16	6,51 -1,00	15,45 -0,67	6,51 -1,00	17,05 -1,81	-11,63 -2,14	19,59 -4,20
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	7,90 -1,11	7,28 -0,33	14,22 -1,69	7,28 -0,33	14,52 -5,32	-7,08 -0,21	14,65 -9,58
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	6,48 -1,69	4,22 -9,05	15,83 -9,33	4,22 -9,05	9,72 -10,07	-24,07 3,57	0,19 -0,86
BRADERCO FIA IBOVESPA PLUS Var. IBOVESPA p.p.	9,05 0,05	7,69 0,08	15,96 0,05	7,69 0,08	19,95 0,12	-6,93 -0,06	23,75 -0,48
ILHA SOLTEIRA Var. IPCA + 4,80% p.p.	3,02 2,72	7,83 2,64	6,74 4,86	7,83 2,64	12,50 4,57	8,46 -17,90	22,43 -20,80
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88

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 FIC FI SELECAO TOP ACOES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
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 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	1,19	6,68	3,22	6,68	13,82	22,00	24,49	31,97	41,51
IRF-M 1+	2,65	11,41	6,89	11,41	18,80	17,59	16,30	30,02	54,96
IRF-M TOTAL	2,12	9,62	5,52	9,62	16,74	18,79	18,96	30,63	51,17
IMA-B 5	1,05	7,04	2,55	7,04	10,23	21,32	28,68	40,02	60,53
IMA-B 5+	3,37	14,91	10,90	14,91	16,34	13,82	23,52	25,96	77,32
IMA-B TOTAL	2,39	11,37	7,10	11,37	13,52	17,81	26,56	32,82	71,02
IMA-GERAL TOTAL	1,74	8,64	4,83	8,64	14,01	20,10	24,37	32,47	53,53
IDKA 2	0,97	6,79	1,99	6,79	9,28	20,32	28,82	40,12	58,67
IDKA 20	5,91	22,33	19,68	22,33	23,20	6,46	19,60	13,99	89,13
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23	16,96	62,29
IBRX 100	8,87	6,59	14,96	6,59	17,60	-9,50	23,38	17,63	65,59
IBRX 50	8,77	4,96	13,79	4,96	17,68	-9,03	25,07	16,40	59,58
SMALL CAP	8,17	13,26	25,16	13,26	19,79	-27,64	1,04	6,25	50,57
Índice Consumo - ICON	9,53	8,38	24,04	8,38	7,60	-42,14	-32,37	-22,91	3,43
Índice Dividendos - IDIV	8,78	9,30	13,95	9,30	17,73	12,91	39,77	39,55	106,18

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	0,69	7,06	2,73	7,06	8,17	-0,23	26,33	90,25	104,62

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,71	10,05	14,28	10,05	12,87	14,54	12,44	20,15	48,47

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,09	4,18	0,15	4,18	5,27	-8,63	14,48	64,05	68,93

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,08	2,87	0,76	2,87	3,16	15,42	25,06	27,72	32,02
INPC	-0,10	2,69	0,79	2,69	3,00	15,28	25,91	28,86	33,13
IGPM	-1,93	-4,46	-4,65	-4,46	-6,86	3,11	39,98	50,22	60,00
SELIC	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,25	4,88	1,72	4,88	7,27	24,82	40,63	49,40	60,53
IPCA + 5,00%	0,33	5,37	1,96	5,37	8,30	27,23	44,71	55,22	68,37
IPCA + 5,50%	0,37	5,62	2,08	5,62	8,81	28,44	46,79	58,20	72,40
IPCA + 5,89%	0,40	5,81	2,17	5,81	9,21	29,39	48,42	60,54	75,60
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88	61,21	76,52
INPC + 4,00%	0,23	4,69	1,75	4,69	7,10	24,66	41,58	50,73	61,88
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89	62,65	78,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
298	01/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	720.000,00	3.089,11609273	233,0763812000
299	01/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	350.000,00	122.543,93952652	2,8561183960
300	01/06/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	200.000,00	43.097,61523656	4,6406280000
301	12/06/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	40.000,00	8.591,88093028	4,6555580000
297	13/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	1.700.000,00	0,00	7.266,23302295	233,9589158000
302	16/06/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	90.000,00	19.290,76433223	4,6654450000
Total			1.700.000,00	1.400.000,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.544.975,90

Value-At-Risk: 2,29%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,54	0,66		0,28	0,25	1,45	150.052.480,70	75,65
Artigo 8º	15,68	8,45		2,02	0,45	8,20	48.285.848,76	24,35
ILHA SOLTEIRA		2,29		2,29			198.338.329,46	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,66%

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	4,52	1,83	0,03	0,04	0,29	2,37	6.168.880,52	3,11
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,89	0,92	0,01	0,03	-0,02	1,03	6.786.466,84	3,42
BB PREV RF IRF M	1,90	1,22	0,01	0,02	0,54	2,09	2.538.979,09	1,28
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,86	0,91	0,01	0,03	-0,02	1,03	6.839.112,12	3,45
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,49	3,31	0,03	0,17	0,34	3,30	2.726.534,81	1,37
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,47	1,86	0,03	0,04	0,29	2,35	6.152.526,91	3,10
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	1,87	0,91	0,03	0,01	-0,02	1,03	15.171.091,55	7,65
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	4,55	1,85	0,12	0,01	0,29	2,37	23.073.425,75	11,63
Sub-total	3,30	1,42	0,28		0,23	1,84	69.457.017,59	35,02

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	0,01	0,02	0,00	0,02	1,37	1,09	21.180.121,46	10,68
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,03	-0,00	0,03	1,21	1,13	23.243.414,69	11,72
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02	0,04	-0,00	0,04	2,02	1,12	29.625.236,84	14,94
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	0,01	0,00	0,01	-56,98	0,99	118.888,29	0,06
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,05	0,05	0,00	0,05	1,51	1,15	6.427.801,83	3,24
Sub-total	0,02	0,02	0,00		2,29	1,12	80.595.463,11	40,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,45%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	15,06	8,25	0,16	1,38	0,48	8,37	4.092.188,33	2,06
BB AÇÕES DIVIDENDOS	14,61	7,86	0,13	2,26	0,47	7,90	3.539.483,82	1,78
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	15,92	8,36	0,11	0,23	0,49	8,88	2.607.828,58	1,31
BRADESCO F I A SELECTION	14,57	8,11	0,17	2,50	0,48	8,01	4.256.627,79	2,15
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	19,12	10,18	0,26	3,22	0,28	6,48	5.447.270,31	2,75
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	15,71	8,61	0,48	0,04	0,51	9,05	11.475.505,04	5,79
FIA BRASIL IBX-50	15,76	8,24	0,38	1,02	0,45	8,14	9.460.303,76	4,77
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	21,01	11,19	0,15	0,18	0,33	8,03	2.938.553,06	1,48
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	14,75	7,59	0,13	1,58	0,47	8,06	3.443.076,76	1,74
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	16,79	8,94	0,04	1,75	0,45	8,70	1.025.011,31	0,52
Sub-total	15,68	8,45	2,02		0,45	8,20	48.285.848,76	24,35

(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 (%)