



LDB
EMPRESAS

IPREMAR
JULHO 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 31.07.2023.

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 92,35%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,545866%)	1,53	0,02	0,45	6,59	4.121.624,84	2,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,593447%)	0,45	0,04	0,46	6,61	2.168.538,28	1,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,775010%)	4,11	0,03	0,47	2,48	8.588.517,04	5,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,044849%)	3,01	0,03	0,49	6,88	2.116.207,68	1,42
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,45	0,03	0,47	6,68	16.994.887,84	11,37

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 IRF M	3,37	0,15	0,78	10,30	5.170.646,46	3,46	2.921.880.225,01	0,18
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,36	0,06	1,06	7,62	3.947.616,00	2,64	7.147.233.323,14	0,06
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,15	0,26	0,73	12,10	6.207.970,39	4,15	4.905.523.474,02	0,13
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,19	0,26	0,78	12,08	950.232,96	0,64	537.765.715,15	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,21	0,26	0,80	12,14	10.105.899,22	6,76	4.916.698.620,80	0,21
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	0,06	1,07	7,73	3.941.794,31	2,64	7.409.323.495,01	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,32	0,12	0,95	8,02	15.368.672,59	10,28	8.226.261.315,96	0,19
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,48	0,09	0,94	7,57	7.962.887,86	5,33	6.277.767.899,83	0,13
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,02	0,38	0,69	15,45	17.540.463,48	11,73	1.449.653.568,31	1,21
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	5,04	0,19	0,80	12,14	4.096.997,03	2,74	1.530.052.591,57	0,27
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,58	0,09	0,92	7,57	5.360.384,12	3,59	5.655.699.960,16	0,09
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,34	0,12	0,95	8,01	4.668.299,51	3,12	5.434.496.212,00	0,09

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BANRISUL	BANRISUL	BANRISUL FOCO IMA G FI RF LP	2,40	0,14	0,93	9,72	1.296.340,41	0,87	600.107.903,56	0,22
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,79	0,20	0,85	10,44	86.618.204,34	57,95		

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				
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,68	0,28	0,76	12,59	2.240.373,20	1,50	436.690.031,12	0,51
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	2,49	0,15	0,96	9,50	790.469,18	0,53	177.650.278,73	0,44
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,33	0,27	0,82	12,21	7.730.638,12	5,17	1.359.618.949,84	0,57
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	5,18	0,26	0,77	12,17	13.016.219,14	8,71	771.342.326,34	1,69
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	0,98	7,02	8.043.113,90	5,38	3.542.574.797,77	0,23
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,02	0,05	0,99	6,68	2.583.624,23	1,73	721.224.783,88	0,36
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			3,93	0,20	0,85	10,62	34.404.437,77	23,02		

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ICLA TRUST	MACROINVEST	SANTOS CREDIT YIELD	0,00	0,00	0,00	0,00	21.820,79	0,01	31.361.299,36	0,07
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			0,00	0,00	0,00	0,00	21.820,79	0,01		
Renda Fixa			3,56	0,18	0,81	10,04	138.039.350,74	92,35		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

7,65%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	18,52	1,43	2,66	11,34	2.323.400,02	1,55	238.987.102,27	0,97
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,63	1,14	2,74	13,14	5.495.471,66	3,68	981.079.847,94	0,56
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21,14	1,51	3,45	10,18	3.618.994,28	2,42	815.496.559,66	0,44
Sub-total Artigo 8º I			19,17	1,32	2,95	11,82	11.437.865,96	7,65		
Renda Variável			19,17	1,32	2,95	11,82	11.437.865,96	7,65		
Total			4,37	0,26	0,97	10,16	149.477.216,70	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 a	Títulos do Tesouro Nacional	16.994.887,84	11,37	0,00	35,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	86.618.204,34	57,95	0,00	29,51	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	34.404.437,77	23,02	0,00	14,98	60,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	21.820,79	0,01	0,00	0,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	138.039.350,74	92,35					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	11.437.865,96	7,65	0,00	0,49	30,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	11.437.865,96	7,65					35,00
Total		149.477.216,70	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 a % do CDI	0,47 43,70	6,68 87,39	2,00 60,55	5,44 84,43	9,38 69,05	79.245,47	737.328,92
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,85 79,57	10,44 136,68	4,71 142,55	9,90 153,60	14,20 104,52	732.541,06	8.272.688,87
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,85 79,56	10,62 138,97	5,19 157,09	10,27 159,33	14,20 104,56	290.788,87	3.245.369,88
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	2,95 -0,32	11,82 0,70	14,43 -2,34	7,52 0,02	16,78 -1,42	327.532,17	1.209.217,30
IPREMAR (Total)						1.430.107,57	13.464.604,97

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150830 (5,545866%)	4.103.000,18	0,00	0,00	0,00	4.121.624,84	18.624,66	256.495,97
NTN-B 150830 (5,593447%)	2.158.662,03	0,00	0,00	0,00	2.168.538,28	9.876,25	135.459,48
NTN-B 150830 (5,775010%)	8.548.162,88	0,00	0,00	0,00	8.588.517,04	40.354,16	208.235,87
NTN-B 150830 (6,044849%)	2.105.817,28	0,00	0,00	0,00	2.116.207,68	10.390,40	137.137,60
					16.994.887,84	79.245,47	

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANRISUL FOCO IMA G FI RF LP	1.284.454,28	0,00	0,00	0,00	1.296.340,41	11.886,13	114.818,53
BB PREV RF IDKA2	7.888.475,64	0,00	0,00	0,00	7.962.887,86	74.412,22	556.506,66
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	6.162.777,79	0,00	0,00	0,00	6.207.970,39	45.192,60	669.879,90
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4.624.361,48	0,00	0,00	0,00	4.668.299,51	43.938,03	346.044,35
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	17.420.452,47	0,00	0,00	0,00	17.540.463,48	120.011,01	2.347.809,88
BB PREV RF IRF M	5.130.642,96	0,00	0,00	0,00	5.170.646,46	40.003,50	482.729,54
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	3.906.267,02	0,00	0,00	0,00	3.947.616,00	41.348,98	199.915,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	942.842,18	0,00	0,00	0,00	950.232,96	7.390,78	102.390,11
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.311.719,17	0,00	0,00	0,00	5.360.384,12	48.664,95	377.427,45
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.223.803,76	0,00	0,00	0,00	15.368.672,59	144.868,83	1.141.309,27
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.025.544,51	0,00	0,00	0,00	10.105.899,22	80.354,71	1.093.682,26
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.900.012,06	0,00	0,00	0,00	3.941.794,31	41.782,25	282.768,93
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	4.064.309,96	0,00	0,00	0,00	4.096.997,03	32.687,07	443.537,46
					86.618.204,34	732.541,06	

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 FLUXO FIC	8.009.710,10	0,00	-45.000,00	0,00	8.043.113,90	78.403,80	625.073,63
BB PREV RF IMA-B	12.916.727,30	0,00	0,00	0,00	13.016.219,14	99.491,84	1.412.402,75
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	782.947,68	0,00	0,00	0,00	790.469,18	7.521,50	68.557,52
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	2.558.389,77	0,00	0,00	0,00	2.583.624,23	25.234,46	161.764,51
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	7.667.490,44	0,00	0,00	0,00	7.730.638,12	63.147,68	840.995,93
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	2.223.383,61	0,00	0,00	0,00	2.240.373,20	16.989,59	250.445,06
					34.404.437,77	290.788,87	

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTOS CREDIT YIELD	21.820,79	0,00	0,00	0,00	21.820,79	0,00	0,00
					21.820,79	0,00	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	3.498.441,94	0,00	0,00	0,00	3.618.994,28	120.552,34	334.433,52
FIA CAIXA DIVIDENDOS	2.263.149,89	0,00	0,00	0,00	2.323.400,02	60.250,13	236.712,02
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.348.741,96	0,00	0,00	0,00	5.495.471,66	146.729,70	638.071,76
					11.437.865,96	327.532,17	

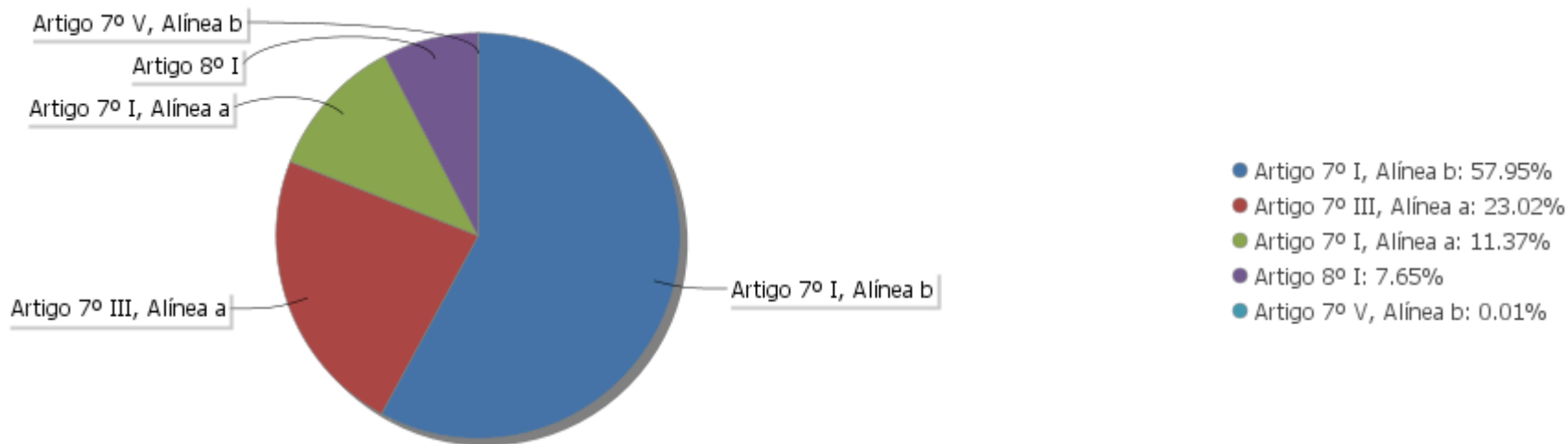
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

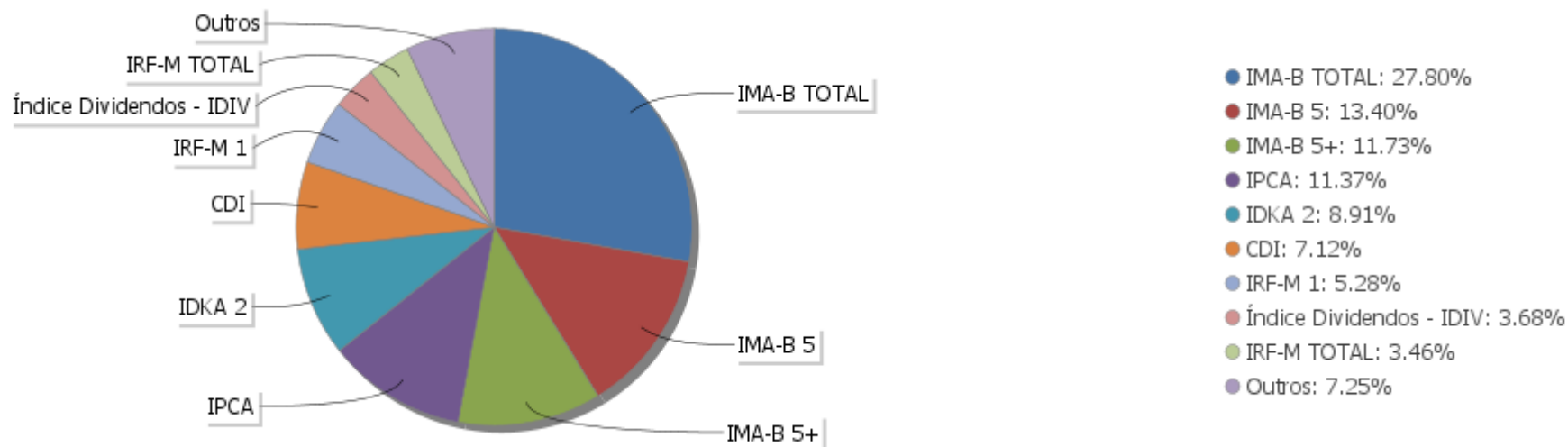
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	126.986.857,20	84,95	126.986.857,20	84,95	
de 31 dias a 365 dias	5.495.471,66	3,68	132.482.328,86	88,63	
acima de 365 dias	16.994.887,84	11,37	149.477.216,70	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

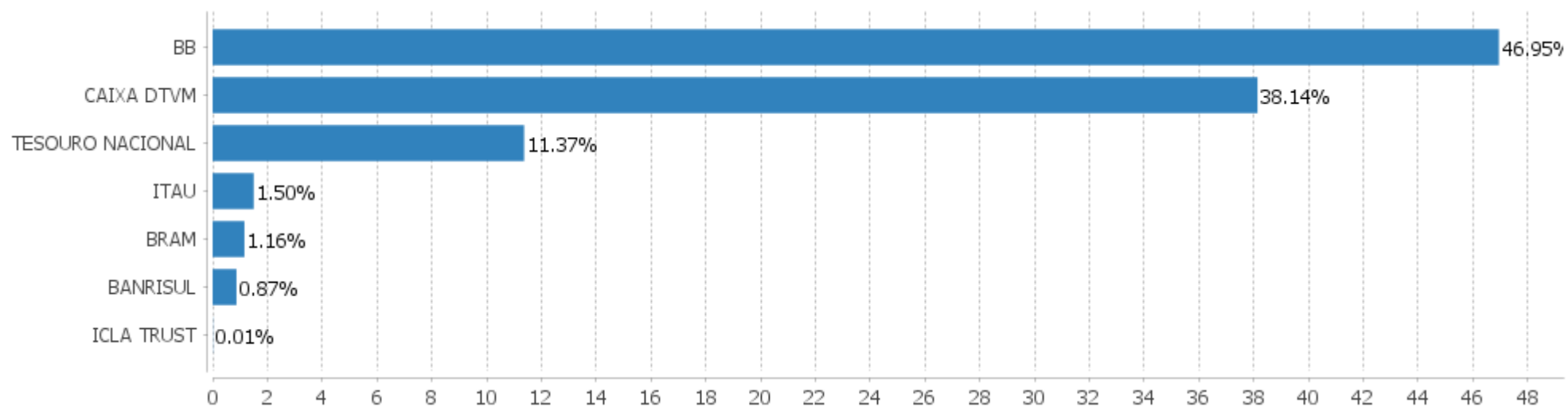


Alocação Por Estratégia



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	0,77	0,51	1,75	1,62	1,91	2,22	0,97						10,16
IPCA + 5,24%	0,98	1,21	1,18	0,98	0,68	0,35	0,55						6,07
p.p. indexador	-0,20	-0,70	0,57	0,64	1,24	1,87	0,42						4,09
2022	0,28	0,52	2,99	-0,02	1,10	-0,96	-0,10	1,34	1,05	1,56	-0,67	0,11	7,37
IPCA + 4,92%	0,94	1,38	2,05	1,43	0,89	1,07	-0,28	0,08	0,11	0,97	0,79	1,04	10,97
p.p. indexador	-0,67	-0,86	0,94	-1,44	0,21	-2,03	0,18	1,26	0,94	0,58	-1,46	-0,93	-3,60
2021	-1,09	-1,64	0,26	0,88	1,45	0,15	-0,69	-0,97	-0,65	-2,60	2,69	0,57	-1,75
INPC + 5,43%	0,69	1,20	1,35	0,80	1,41	1,04	1,49	1,35	1,65	1,59	1,26	1,22	16,12
p.p. indexador	-1,78	-2,84	-1,09	0,08	0,04	-0,90	-2,17	-2,32	-2,30	-4,19	1,42	-0,64	-17,87
2020	0,34	-0,51	-8,23	1,90	1,99	2,11	3,91	-1,72	-1,58	0,10	2,92	4,51	5,22
INPC + 6,00%	0,70	0,59	0,69	0,23	0,21	0,79	0,98	0,85	1,36	1,38	1,42	1,98	11,75
p.p. indexador	-0,36	-1,10	-8,92	1,66	1,78	1,33	2,94	-2,56	-2,94	-1,28	1,51	2,53	-6,53
2019	3,51	0,40	0,47	1,27	2,74	3,16	1,19	-0,11	2,37	2,86	-1,69	2,40	20,09
INPC + 6,00%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,44	0,57	1,01	1,71	10,78
p.p. indexador	2,64	-0,61	-0,74	0,18	2,08	2,71	0,56	-0,74	1,93	2,29	-2,69	0,68	9,31
2018	2,43	0,58	0,89	0,09	-2,37	-0,26	1,91	-0,36	0,27	5,21	0,92	1,41	11,04
INPC + 6,00%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	0,74	0,91	0,21	0,60	9,59
p.p. indexador	1,68	-0,02	0,33	-0,60	-3,28	-2,19	1,15	-0,89	-0,47	4,29	0,70	0,80	1,45

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	34	50,75
Meses abaixo - Meta Atuarial	33	49,25
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	5,21	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-8,23	2020-03

Relatório

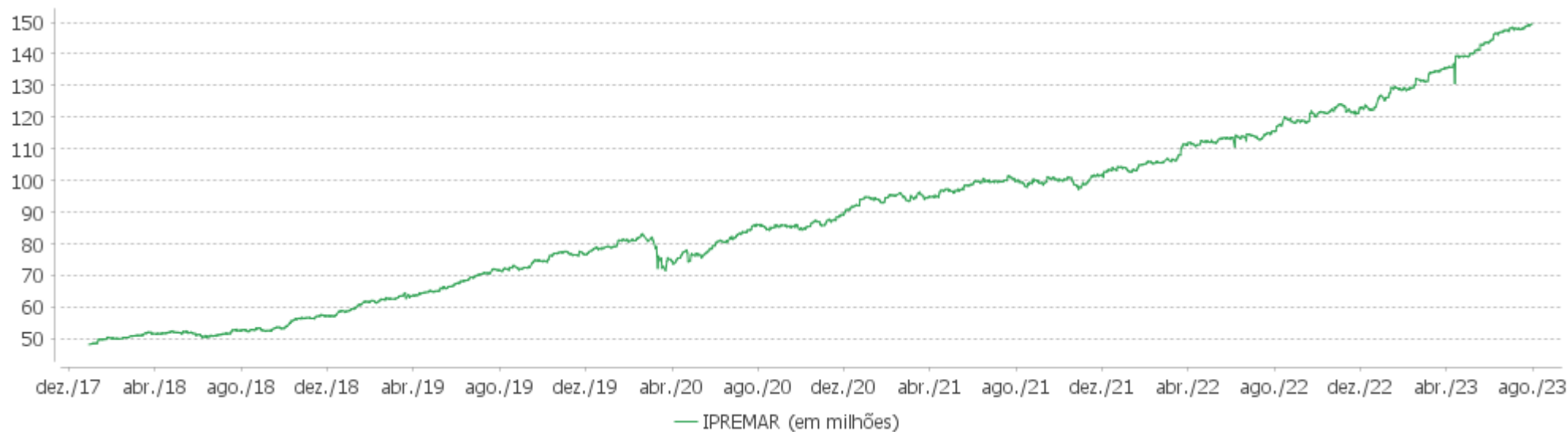
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	5,18	1,58	3,60	2,71
06 meses	9,31	5,04	4,27	2,96
12 meses	13,92	9,28	4,64	4,37
24 meses	17,05	26,25	-9,20	4,66
36 meses	21,03	46,48	-25,46	4,95
48 meses	29,47	59,49	-30,02	7,68
60 meses	57,95	74,32	-16,38	7,14
Desde 29/12/2017	63,05	85,41	-22,36	6,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

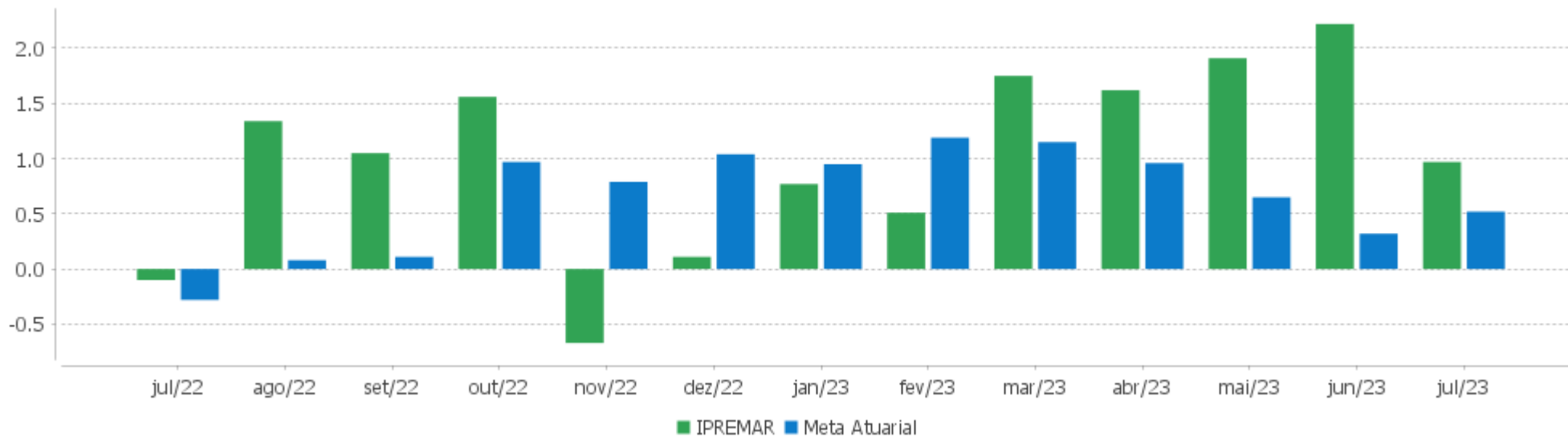


Patrimônio Líquido



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
SANTOS CREDIT YIELD	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4,30	-0,13
% do CDI	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	17,75	-0,47
NTN-B 150830 (6,044849%)	0,49	6,88	2,08	5,61	6,60	18,36	
Var. IPCA p.p.	0,37	3,88	1,81	3,15	2,61	3,90	
NTN-B 150830 (5,593447%)	0,46	6,61	1,97	5,39	9,29	21,05	31,18
Var. IPCA p.p.	0,34	3,62	1,70	2,93	5,30	6,59	6,42
NTN-B 150830 (5,775010%)	0,47	3,70	2,01	2,49	3,37		
Var. IPCA p.p.	0,35	0,70	1,74	0,04	-0,62		
NTN-B 150830 (5,545866%)	0,45	6,59	0,90	5,36	9,24	20,95	31,04
Var. IPCA p.p.	0,33	3,59	0,63	2,91	5,25	6,49	6,28
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,80	12,14	5,79	12,17	15,29	18,72	21,43
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,13	-0,04	-0,09	-0,16	-0,49	-0,79
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,95	8,02	2,64	6,56	11,20	22,15	27,97
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,06	0,02	-0,04	-0,09	-0,32	-0,69
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1,06	7,62	3,38	6,49	13,50	22,42	24,35
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,01	-0,19	-0,06	-0,15	-0,34	-0,66	-1,16
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,95	8,01	2,61	6,54	11,09	21,88	27,72
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,08	-0,01	-0,05	-0,19	-0,59	-0,94
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	0,78	12,08	5,75	12,10	15,11	18,43	21,01
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,19	-0,08	-0,16	-0,35	-0,78	-1,22
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	0,80	12,14	6,40	11,33	17,85	18,64	14,36
Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,02	-0,19	-0,04	-0,20	-0,50	-0,91	-1,19
BB PREV RF IDKA2	0,94	7,57	2,37	6,04	10,71	21,24	28,04
Var. IDKA 2 p.p.	-0,04	-0,27	0,11	-0,26	0,16	-0,49	-0,84
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,92	7,57	2,34	6,08	10,55	20,96	27,56
Var. IDKA 2 p.p.	-0,07	-0,26	0,08	-0,23	0,01	-0,77	-1,33
BB PREV RF IRF M	0,78	10,30	5,13	9,40	15,98	19,65	17,62
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,11	-0,29	-0,17	-0,27	-0,46	-0,76	-1,10
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,73	12,10	5,78	12,11	15,14	18,55	21,24
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,08	-0,17	-0,05	-0,16	-0,32	-0,66	-0,98
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,07	7,73	3,39	6,53	13,63	22,57	24,71
Var. IRF-M 1 p.p.	0,00	-0,09	-0,05	-0,11	-0,21	-0,51	-0,81
BANRISUL FOCO IMA G FI RF LP	0,93	9,72	4,58	8,99	14,79	21,31	22,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,12	-2,55	-1,25	-3,28	-0,66	2,10	0,01
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	0,69 -0,04	15,45 -0,29	8,30 -0,12	16,93 -0,29	18,90 -0,48	14,69 -0,85	14,67 -1,25
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,76 -0,04	12,59 0,32	6,21 0,38	12,66 0,39	14,67 -0,78	17,71 -1,50	20,27 -1,96
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,77 -0,04	12,17 -0,09	5,90 0,06	12,22 -0,04	15,20 -0,26	18,65 -0,56	21,28 -0,94
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,82 0,02	12,21 -0,06	5,87 0,04	12,31 0,04	15,19 -0,27	18,61 -0,59	21,29 -0,93
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,98 91,73	7,02 91,90	3,06 92,50	5,93 91,96	12,47 91,82	21,74 89,64	23,32 85,51
BRADERCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,96 -0,02	9,50 -0,20	4,53 -0,02	8,80 -0,14	14,21 -0,38	20,18 -1,22	22,02 -1,42
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,99 92,01	6,68 87,42	2,97 90,02	5,66 87,88	11,77 86,67	20,50 84,54	22,38 82,04
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	2,74 -0,10	13,14 0,73	13,61 0,80	9,28 3,12	17,20 -1,53	9,32 -8,83	25,60 -9,33
FIA CAIXA DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	2,66 -0,60	11,34 0,22	12,19 -4,57	5,35 -2,15	17,08 -1,12	14,38 14,26	26,93 8,43
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	3,45 -0,07	10,18 -1,11	17,22 -0,39	6,33 -1,08	15,96 -1,77	-4,59 -2,30	14,08 -3,94
IPREMAR Var. IPCA + 4,92% p.p.	0,97 0,42	10,16 4,09	5,18 3,60	9,31 4,27	13,92 4,50	17,05 -9,67	21,03 -24,27
CDI	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27
IBOVESPA	3,27	11,13	16,77	7,50	18,20	0,12	18,49
INPC + 6,00%	0,40	6,09	1,66	5,07	9,71	28,04	49,03
IPCA + 6,00%	0,61	6,51	1,76	5,41	10,21	28,55	48,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BANRISUL FOCO IMA G FI RF LP			D+0	D+0		0,20
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
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	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,30
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+2 du	D+2 du		0,20
BB PREV RF IRF M	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
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,25
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A 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 IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
SANTOS CREDIT YIELD	Não se aplica	Não se aplica	Não se aplica	Não se aplica		2,00

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	1,07	7,81	3,44	6,64	13,84	23,07	25,52	32,43	42,08
IRF-M 1+	0,82	12,33	6,44	11,52	18,36	19,55	15,56	29,44	53,47
IRF-M TOTAL	0,89	10,59	5,29	9,67	16,44	20,41	18,73	30,37	50,29
IMA-B 5	0,97	8,08	2,62	6,60	11,29	22,46	28,66	40,02	59,74
IMA-B 5+	0,73	15,74	8,42	17,22	19,37	15,53	15,93	24,98	73,16
IMA-B TOTAL	0,81	12,27	5,83	12,27	15,46	19,21	22,22	32,19	68,50
IMA-GERAL TOTAL	0,98	9,70	4,55	8,94	14,59	21,41	23,44	32,48	52,87
IDKA 2	0,98	7,84	2,26	6,31	10,55	21,73	28,89	40,07	57,72
IDKA 20	0,76	23,26	14,33	29,18	28,75	8,83	7,52	12,84	82,11
CDI	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27	32,66	41,08

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,27	11,13	16,77	7,50	18,20	0,12	18,49	19,77	53,93
IBRX 100	3,32	10,13	16,52	6,40	16,39	-2,60	17,59	20,13	57,20
IBRX 50	3,70	8,84	16,09	5,28	16,73	-1,88	19,92	20,20	51,93
SMALL CAP	3,12	16,80	26,65	13,48	17,47	-20,79	-4,84	2,63	47,75
Índice Consumo - ICON	2,22	10,79	25,68	7,60	0,74	-37,60	-35,76	-27,95	-0,79
Índice Dividendos - IDIV	2,84	12,41	12,81	6,16	18,72	18,15	34,93	39,66	97,67

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	1,45	8,61	4,36	4,67	1,54	-3,34	27,84	93,91	105,76

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,33	11,51	11,86	13,33	13,61	13,21	16,98	20,22	48,40

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	1,88	6,14	2,36	1,41	1,33	-9,61	16,75	69,84	71,77

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,12	2,99	0,27	2,45	3,99	14,46	24,76	27,64	31,75
INPC	-0,09	2,59	0,17	2,13	3,53	14,01	25,24	28,62	32,68
IGPM	-0,72	-5,15	-4,43	-5,35	-7,72	1,58	35,94	48,54	58,04
SELIC	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27	32,66	41,08

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,45	5,34	1,27	4,43	8,14	23,77	40,25	49,25	60,17
IPCA + 5,00%	0,53	5,93	1,52	4,92	9,17	26,15	44,31	55,05	67,99
IPCA + 5,50%	0,57	6,22	1,64	5,16	9,69	27,35	46,37	58,02	72,01
IPCA + 5,89%	0,60	6,44	1,74	5,35	10,09	28,29	47,99	60,36	75,20
IPCA + 6,00%	0,61	6,51	1,76	5,41	10,21	28,55	48,45	61,03	76,11
INPC + 4,00%	0,24	4,94	1,17	4,10	7,65	23,27	40,79	50,39	61,30
INPC + 6,00%	0,40	6,09	1,66	5,07	9,71	28,04	49,03	62,26	77,35

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150830 (5,545866%)	4.121.624,84	5,545866	4.228.187,61	5,076000	106.562,77
NTN-B 150830 (5,593447%)	2.168.538,28	5,593447	2.230.056,76	5,076000	61.518,48
NTN-B 150830 (5,775010%)	8.588.517,04	5,775010	8.920.227,03	5,076000	331.709,99
NTN-B 150830 (6,044849%)	2.116.207,68	6,044849	2.230.056,76	5,076000	113.849,08

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
211	06/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	45.000,00	17.447,18226822	2,5792130390
	Total		0,00	45.000,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.889.741,79

Value-At-Risk: 1,26%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
IPREMAR		1,26	1,26			149.477.216,70	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,03%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150830 (5,545866%)		0,13	0,00	0,14			4.121.624,84	2,76
NTN-B 150830 (5,593447%)		0,13	0,00	0,10			2.168.538,28	1,45
NTN-B 150830 (5,775010%)		0,12	0,00	0,09			8.588.517,04	5,75
NTN-B 150830 (6,044849%)		0,12	0,00	0,09			2.116.207,68	1,42
Sub-total	0,07	0,10	0,00		-8,71	0,47	16.994.887,84	11,37

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF M		1,18	0,03	0,07			5.170.646,46	3,46
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,16	0,00	0,01			3.947.616,00	2,64
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,65	0,06	0,05			6.207.970,39	4,15
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		1,66	0,01	0,01			950.232,96	0,64
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,53	0,09	0,14			10.105.899,22	6,76
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,16	0,00	0,01			3.941.794,31	2,64
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,77	0,06	0,03			15.368.672,59	10,28
BB PREV RF IDKA2		0,77	0,03	0,19			7.962.887,86	5,33
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,48	0,26	0,06			17.540.463,48	11,73
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		1,74	0,04	0,03			4.096.997,03	2,74
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,83	0,02	0,16			5.360.384,12	3,59
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		0,79	0,02	0,03			4.668.299,51	3,12

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANRISUL FOCO IMA G FI RF LP		0,72	0,01	0,97			1.296.340,41	0,87
Sub-total	2,43	1,21	0,63		-0,09	0,85	86.618.204,34	57,95

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO		1,71	0,02	0,21			2.240.373,20	1,50
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL		0,79	0,00	0,12			790.469,18	0,53
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		1,58	0,07	0,10			7.730.638,12	5,17
BB PREV RF IMA-B		1,68	0,13	0,05			13.016.219,14	8,71
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	0,00	0,01			8.043.113,90	5,38
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,01	-0,00	0,01			2.583.624,23	1,73
Sub-total	2,28	1,12	0,23		-0,10	0,85	34.404.437,77	23,02

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTOS CREDIT YIELD		0,00	0,00	0,00			21.820,79	0,01
Sub-total	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	21.820,79	0,01

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,50%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA DIVIDENDOS		7,20	0,07	2,88			2.323.400,02	1,55
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		7,05	0,18	1,61			5.495.471,66	3,68
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		8,65	0,15	0,41			3.618.994,28	2,42
Sub-total	14,84	7,50	0,40		0,13	2,95	11.437.865,96	7,65