



LDB
EMPRESAS

SÃO JOSÉ DO RIO PARDO
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 88,07%

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 PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	5,92	0,31	0,71	12,57	5.619.493,45	2,16	948.103.613,02	0,59
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	5,90	0,31	0,71	12,57	43.569.610,59	16,73	979.269.585,47	4,45
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,02	0,05	1,06	3,98	39.559.024,24	15,19	27.441.142.566,91	0,14
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,22	0,04	1,06	6,67	14.585.378,01	5,60	3.809.865.990,18	0,38
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,45	0,12	0,89	9,23	46.489.749,90	17,85	5.462.057.088,14	0,85
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,02	0,05	1,04	7,48	19.792.635,14	7,60	10.276.254.687,90	0,19
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,22	0,04	1,06	6,67	43.386.988,29	16,66	3.548.133.366,37	1,22
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,59	0,12	0,94	8,85	213.002.879,62	81,79		

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	BRADESCO	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	4,23	0,13	0,94	10,83	6.224.897,16	2,39	330.992.148,14	1,88
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			4,23	0,13	0,94	10,11	6.224.897,16	2,39		

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				
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	2,19	0,07	0,98	7,72	10.141.680,34	3,89	312.755.409,33	3,24
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			2,19	0,07	0,98	7,72	10.141.680,34	3,89		

Renda Fixa			2,45	0,12	0,94	8,83	229.369.457,12	88,07		
-------------------	--	--	-------------	-------------	-------------	-------------	-----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

8,72%

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	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	21,45	1,32	3,47	11,12	4.746.370,03	1,82	712.927.891,24	0,67
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,63	1,14	2,74	13,14	5.170.085,22	1,99	981.079.847,94	0,53
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	26,18	1,21	2,97	16,40	7.766.246,40	2,98	701.038.285,73	1,11
ITAU	ITAU	ITAÚ PRIVATE AÇÕES INDEX IBOVESPA FIC DE FI	21,03	1,46	3,26	11,36	5.019.295,32	1,93	469.832.415,53	1,07
Sub-total Artigo 8º I			21,72	1,27	3,09	13,39	22.701.996,97	8,72		
Renda Variável			21,72	1,27	3,09	13,39	22.701.996,97	8,72		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,21%

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	22,96	0,17	2,12	16,95	8.369.692,69	3,21	2.066.727.306,72	0,40
Sub-total Artigo 9º III			22,96	0,17	2,12	16,95	8.369.692,69	3,21		
Investimentos no Exterior			22,96	0,17	2,12	16,95	8.369.692,69	3,21		
Total			3,29	0,22	1,16	9,48	260.441.146,78	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	213.002.879,62	81,79	0,00	60,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	6.224.897,16	2,39	0,00	20,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	10.141.680,34	3,89	0,00	5,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	229.369.457,12	88,07					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	22.701.996,97	8,72	0,00	10,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	22.701.996,97	8,72					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	8.369.692,69	3,21	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	8.369.692,69	3,21					10,00
Total		260.441.146,78	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	0,94 87,79	8,85 115,85	3,85 116,54	7,89 122,48	12,76 93,91	1.986.362,16	17.302.044,05
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,94 88,15	10,11 132,37	5,55 168,16	9,25 143,60	16,66 122,61	58.270,40	737.148,29
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,98 91,39	7,72 101,07	2,54 77,01	6,30 97,81	10,98 80,79	98.390,08	726.978,68
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	3,09 -0,18	13,39 2,27	18,96 2,19	9,71 2,21	16,46 -1,74	680.298,94	2.670.867,36
Artigo 9º III % do CDI	2,12 197,37	16,95 221,89	8,55 258,83	12,11 187,96	7,35 54,09	173.414,98	1.213.245,22
SÃO JOSÉ DO RIO PARDO (Total)						2.996.736,56	22.650.283,60

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 PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	5.579.662,77	0,00	0,00	0,00	5.619.493,45	39.830,68	626.746,05
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	42.933.045,89	0,00	0,00	0,00	43.386.988,29	453.942,40	2.712.346,66
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	39.145.735,78	0,00	-171,08	0,00	39.559.024,24	413.459,54	1.511.844,55
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	20.349.915,53	3.610.002,31	-4.373.760,01	0,00	19.792.635,14	206.477,31	1.365.729,39
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.432.777,23	0,00	0,00	0,00	14.585.378,01	152.600,78	911.873,58
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	43.261.058,33	0,00	0,00	0,00	43.569.610,59	308.552,26	4.861.957,26
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	46.078.250,71	0,00	0,00	0,00	46.489.749,90	411.499,19	3.927.389,94
					213.002.879,62	1.986.362,16	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADERCO FI RF IDKA PRE 2	6.166.626,76	0,00	0,00	0,00	6.224.897,16	58.270,40	608.104,76
					6.224.897,16	58.270,40	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	10.043.290,26	0,00	0,00	0,00	10.141.680,34	98.390,08	726.978,68
					10.141.680,34	98.390,08	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.542.267,93	0,00	0,00	0,00	7.766.246,40	223.978,47	1.094.233,94
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	4.521.117,34	65.787,92	0,00	0,00	4.746.370,03	159.464,77	473.225,29
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.965.826,49	65.787,92	0,00	0,00	5.170.085,22	138.470,81	590.236,45
ITAÚ PRIVATE AÇÕES INDEX IBOVESPA FIC DE FI	4.795.122,50	65.787,93	0,00	0,00	5.019.295,32	158.384,89	513.171,68
					22.701.996,97	680.298,94	

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	8.196.277,71	0,00	0,00	0,00	8.369.692,69	173.414,98	1.213.245,22
					8.369.692,69	173.414,98	

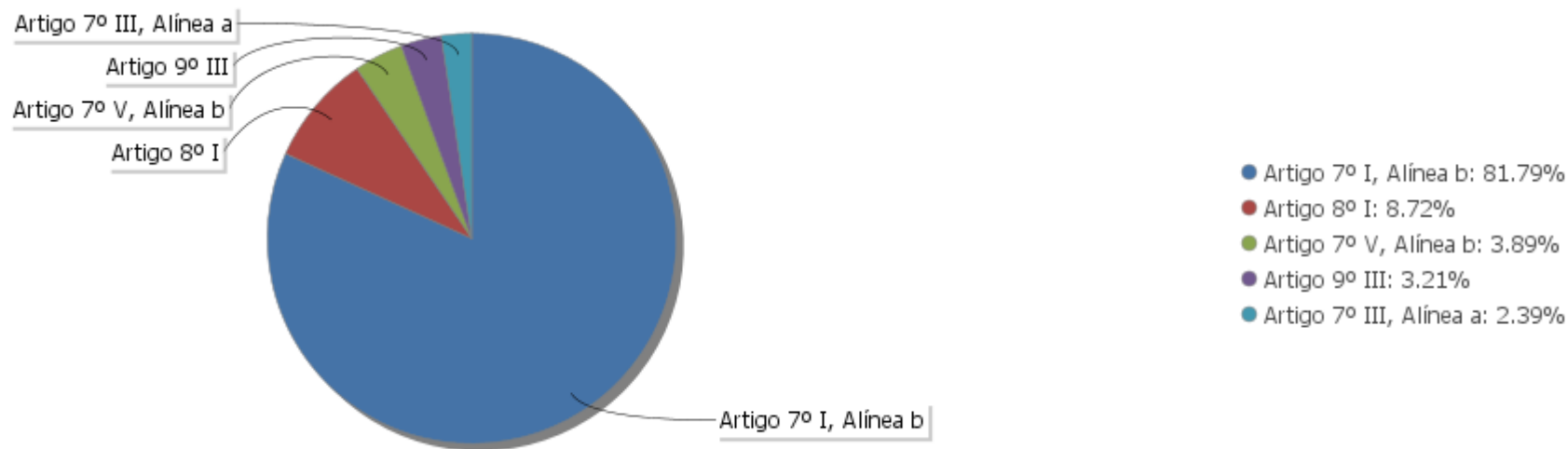
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

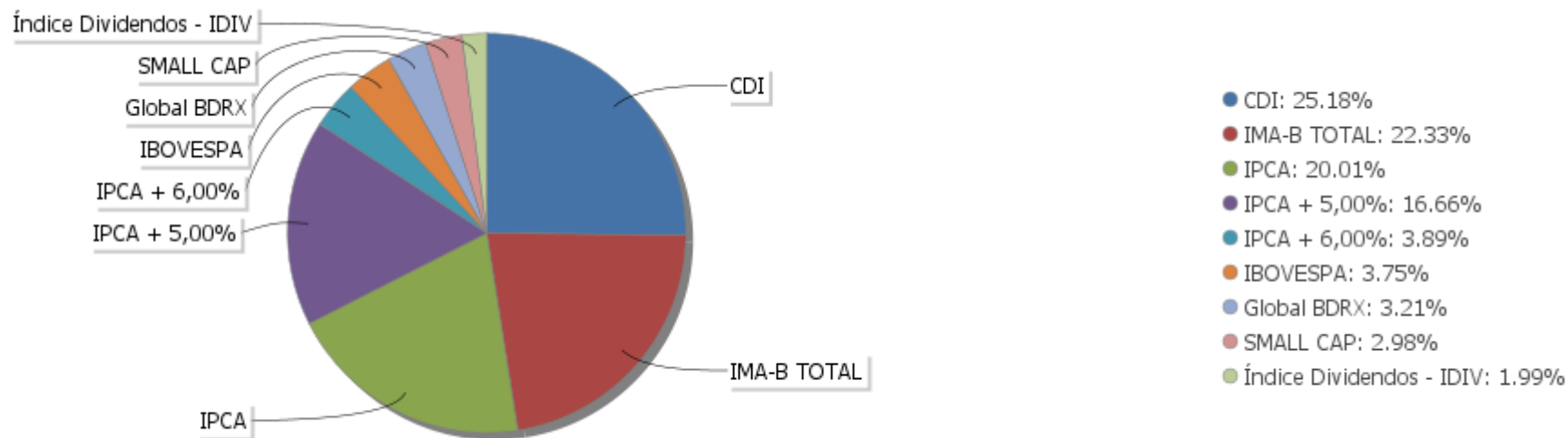
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	133.221.540,85	51,15	133.221.540,85	51,15	
de 31 dias a 365 dias	9.916.455,25	3,81	143.137.996,10	54,96	
acima de 365 dias	117.303.150,68	45,04	260.441.146,78	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

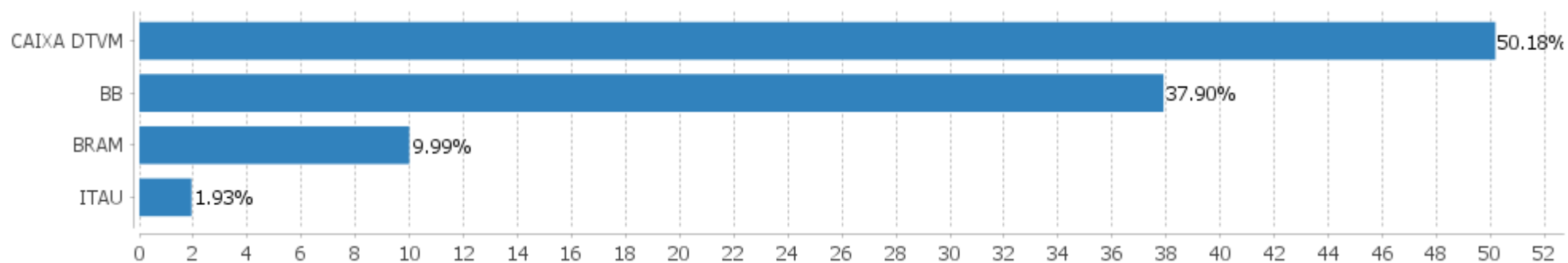


Alocação Por Estratégia



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	1,20	0,39	1,42	1,07	1,86	2,01	1,16						9,48
INPC + 4,90%	0,88	1,11	1,08	0,87	0,78	0,30	0,31						5,46
p.p. indexador	0,32	-0,72	0,34	0,20	1,08	1,71	0,86						4,03
2022	-0,13	0,23	2,12	-0,15	0,74	-0,79	0,56	1,17	0,62	1,66	-0,60	0,44	5,99
INPC + 5,04%	1,08	1,38	2,15	1,42	0,88	1,03	-0,19	0,14	0,09	0,86	0,77	1,12	11,25
p.p. indexador	-1,22	-1,14	-0,03	-1,56	-0,14	-1,82	0,75	1,03	0,53	0,80	-1,38	-0,68	-5,26
2021	-0,57	-1,11	-0,06	0,67	0,80	0,18	-0,47	-0,90	-0,32	-1,91	1,93	0,79	-1,03
INPC + 5,47%	0,69	1,20	1,35	0,81	1,41	1,05	1,49	1,35	1,65	1,59	1,27	1,22	16,16
p.p. indexador	-1,27	-2,31	-1,41	-0,13	-0,61	-0,87	-1,97	-2,25	-1,97	-3,50	0,67	-0,43	-17,19
2020	0,42	0,34	-3,70	1,08	1,50	1,39	2,42	-0,97	-0,96	-0,03	1,53	3,01	6,03
INPC + 5,89%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,97	0,84	1,35	1,37	1,41	1,97	11,63
p.p. indexador	-0,28	-0,24	-4,38	0,86	1,30	0,61	1,45	-1,81	-2,31	-1,40	0,12	1,04	-5,61
2019	1,87	0,46	0,56	1,11	2,30	2,49	1,07	-0,12	2,05	2,15	-1,15	1,33	14,99
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	0,99	-0,54	-0,65	0,02	1,64	2,04	0,44	-0,75	1,61	1,57	-2,15	-0,39	4,21
2018										2,22	0,51	1,15	3,92
INPC + 6,00%										0,91	0,21	0,60	1,74
p.p. indexador										1,31	0,29	0,55	2,18

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	27	46,55
Meses abaixo - Meta Atuarial	31	53,45
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,01	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-3,70	2020-03

Relatório

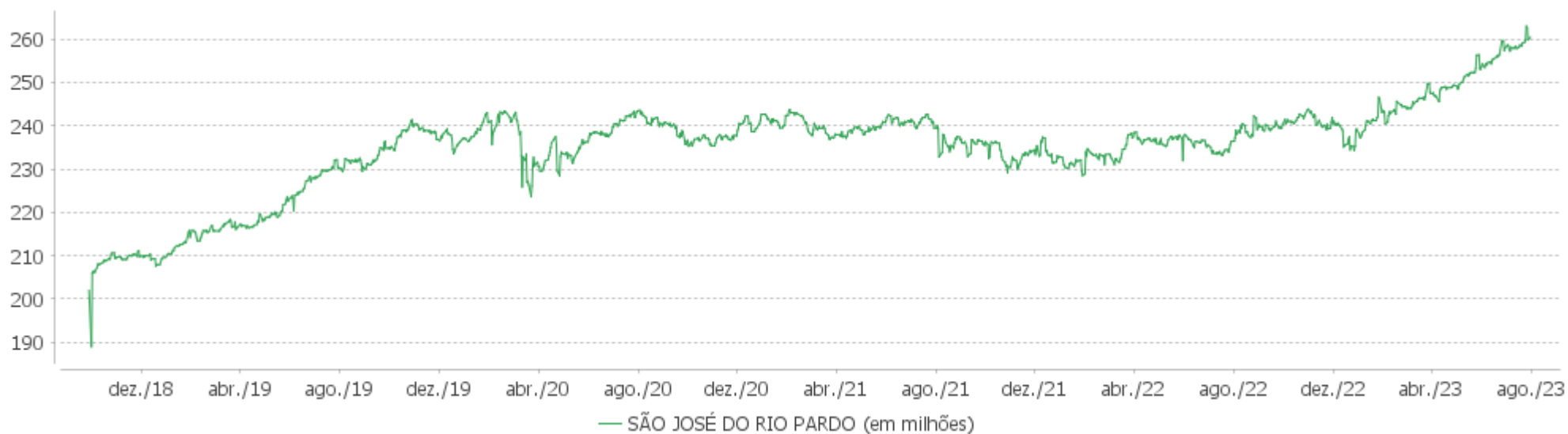
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	5,13	1,39	3,73	2,11
06 meses	8,19	4,54	3,65	2,33
12 meses	13,12	8,64	4,48	3,29
24 meses	15,51	25,86	-10,35	3,61
36 meses	17,79	46,01	-28,22	3,65
48 meses	26,98	58,88	-31,89	5,02
Desde 28/09/2018	45,51	71,46	-25,95	4,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

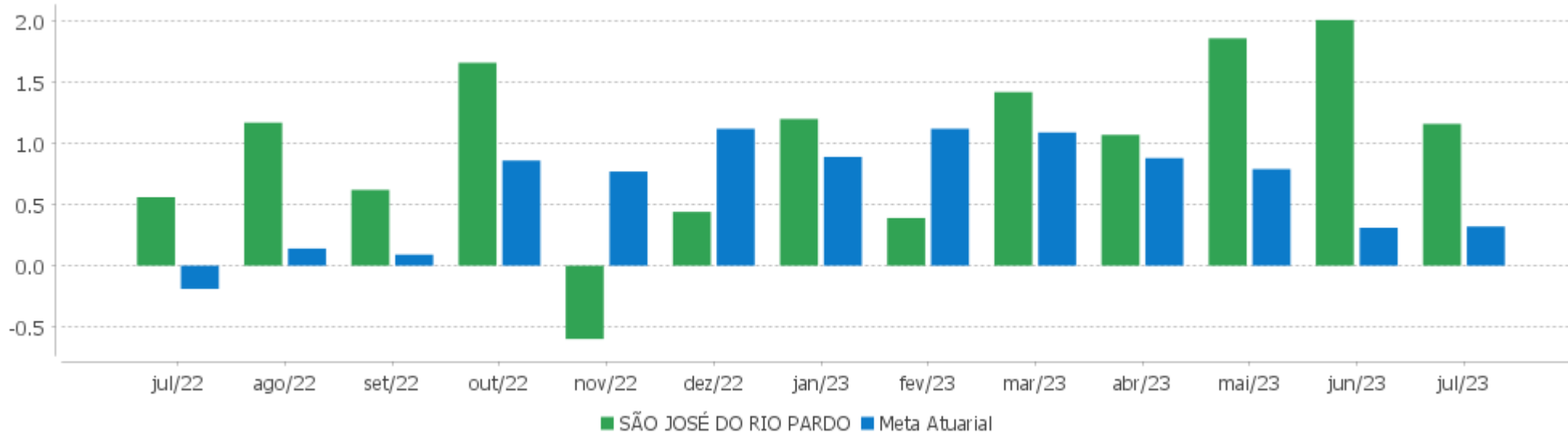


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,98 0,37	7,72 1,22	2,54 0,78	6,30 0,90	10,98 0,77	21,92 -6,63	27,69 -20,77
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,71 -0,10	12,57 0,31	5,84 0,01	12,25 -0,01	15,23 -0,23	19,95 0,74	20,38 -1,84
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,89 0,77	9,23 6,23	4,88 4,61	8,11 5,66	14,71 10,72	20,86 6,40	21,94 -2,81
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA % do CDI	1,04 96,56	7,48 97,86	3,25 98,46	6,31 97,87	13,31 97,97	23,70 97,74	26,29 96,38
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,06 0,25	6,67 -5,60	1,99 -3,84	5,21 -7,06	9,91 -5,54	19,81 0,60	23,23 1,01
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,06 0,53	6,67 0,75	1,99 0,47	5,21 0,29	9,90 0,73		
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	1,06 98,53	7,61 99,61	3,32 100,36	6,42 99,59	13,56 99,79	24,30 100,20	27,11 99,38
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI Var. IPCA p.p.	0,71 0,59	12,57 9,57	5,83 5,56	12,25 9,80	15,21 11,22		
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	0,94 88,15	10,83 141,71	5,55 168,16	9,99 155,04	16,27 119,74	18,26 75,30	15,79 57,88
ITAU PRIVATE AÇÕES INDEX IBOVESPA FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	3,26 -0,01	11,36 0,24	16,85 0,08	7,67 0,17	18,70 0,50	0,76 0,64	19,21 0,72
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	2,97 -0,15	16,40 -0,40	25,91 -0,75	12,68 -0,81	16,58 -0,90	-22,65 -1,87	-7,92 -3,07
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	3,47 0,20	11,12 -0,00	16,28 -0,48	7,70 0,19	13,56 -4,65	-2,35 -2,46	10,42 -8,07
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 INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	2,12 -0,01	16,95 -0,64	8,55 -0,13	12,11 -0,55	7,35 -1,22	-4,52 -1,52	24,72 -4,48
SÃO JOSÉ DO RIO PARDO Var. INPC + 5,04% p.p.	1,16 0,86	9,48 4,03	5,13 3,73	8,19 3,65	13,12 4,54	15,51 -9,90	17,79 -26,67
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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
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
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	D+0	D+0	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BRADERCO FI RF IDKA PRE 2	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	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 DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	D+1 du	D+0	D+21 du	D+23 du		1,72
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
ITAÚ PRIVATE AÇÕES INDEX IBOVESPA FIC DE FI	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du		0,30

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

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
102	05/07/2023	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	113.760,01	7.527,03316919	15,1135258000
105	05/07/2023	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	1.270.000,00	84.030,68991353	15,1135258000
112	05/07/2023	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	450.002,31	0,00	29.774,80674959	15,1135258000
103	07/07/2023	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	130.000,00	0,00	8.593,19456668	15,1282505000
114	10/07/2023	ITAÚ PRIVATE AÇÕES INDEX IBOVESPA FIC DE FI	65.787,93	0,00	2.682,61008436	24,5238510000
99	11/07/2023	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	65.787,92	0,00	36.350,24588578	1,8098342500
100	11/07/2023	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	65.787,92	0,00	28.232,51596822	2,3302181100
106	11/07/2023	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	50.000,00	0,00	3.301,75558505	15,1434589000
107	17/07/2023	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	50.000,00	3.295,47969596	15,1722980000
108	26/07/2023	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	2.980.000,00	0,00	195.735,93855678	15,2245930000
104	28/07/2023	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	40.000,00	2.624,72027700	15,2397192000
109	28/07/2023	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	291.332,36	19.116,64881594	15,2397192000
110	28/07/2023	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	126.358,84	8.291,41523815	15,2397192000
111	28/07/2023	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	2.398.616,18	157.392,41310955	15,2397192000
113	28/07/2023	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	83.692,62	5.491,74291873	15,2397192000
83	31/07/2023	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	171,08	53,23626888	3,2135986160
Total			3.807.366,08	4.373.931,09		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 2.842.709,66

Value-At-Risk: 1,09%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SÃO JOSÉ DO RIO PARDO		1,09	1,09			260.441.146,78	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,67%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI		1,77	0,03	1,77			5.619.493,45	2,16
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF		1,78	0,21	0,51			43.569.610,59	16,73
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO		0,01	0,00	0,01			39.559.024,24	15,19
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,70	0,02	1,47			14.585.378,01	5,60
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,80	0,09	0,82			46.489.749,90	17,85
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA		0,01	0,00	0,01			19.792.635,14	7,60
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,70	0,05	0,71			43.386.988,29	16,66
Sub-total	1,36	0,66	0,40		-0,10	0,94	213.002.879,62	81,79

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2		1,42	0,02	1,42			6.224.897,16	2,39
Sub-total	2,28	1,42	0,02		-0,06	0,94	6.224.897,16	2,39

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI		0,66	0,02	0,66			10.141.680,34	3,89
Sub-total	1,12	0,66	0,02		-0,08	0,98	10.141.680,34	3,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,76%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS		9,03	0,14	1,28			4.746.370,03	1,82
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		7,05	0,11	1,61			5.170.085,22	1,99
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		10,64	0,27	0,18			7.766.246,40	2,98
ITAÚ PRIVATE AÇÕES INDEX IBOVESPA FIC DE FI		8,90	0,14	0,04			5.019.295,32	1,93
Sub-total	15,68	8,76	0,66		0,13	3,09	22.701.996,97	8,72

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,85%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,85	-0,01	0,55			8.369.692,69	3,21
Sub-total	11,58	6,85	-0,01		0,09	2,12	8.369.692,69	3,21