



LDB
EMPRESAS

OUROESTE
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

96,46%

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 150535 (5,825000%)	0,47	0,02	0,46	6,24	3.065.779,73	3,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,840000%)	0,47	0,02	0,46	6,25	5.153.999,08	5,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,870000%)	0,47	0,02	0,47	6,26	4.543.957,32	4,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,127000%)	0,47	0,02	0,49	6,39	5.158.791,86	5,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,100000%)	0,47	0,02	0,40	5,88	2.711.644,70	2,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,580000%)	0,47	0,02	0,44	6,12	6.379.403,18	6,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,040000%)	0,47	0,02	0,48	6,35	5.206.933,19	5,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (7,080000%)	4,24	0,03	0,56	0,99	2.724.406,25	2,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (7,600000%)	0,47	0,02	0,60	7,12	622.523,67	0,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,150000%)	0,47	0,01	0,41	5,91	2.362.003,24	2,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,671000%)	0,47	0,02	0,45	6,17	3.162.117,98	3,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,270000%)	3,08	0,02	0,50	6,46	3.087.131,68	3,33
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,55	0,02	0,47	6,24	44.178.691,88	47,62

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,38	0,07	1,16	6,49	5.757.277,80	6,21	6.781.214.720,11	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,37	0,07	1,16	6,59	11.757.198,94	12,67	7.342.301.496,88	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,43	0,35	2,10	8,26	4.067.513,05	4,38	5.348.206.988,95	0,08
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,81	0,13	1,33	6,87	21.581.989,79	23,26		

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 FLUXO FIC	0,02	0,05	1,00	5,98	12.166.071,22	13,11	4.278.810.513,26	0,28
GENIAL	RJI	TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	1,40	-0,00	-0,23	-1,14	164.277,38	0,18	65.773.970,76	0,25
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,42	0,23	1,03	6,94	11.131.314,86	12,00	963.196.862,82	1,16
RJI	RJI	TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,59	0,02	0,41	2,66	201.164,08	0,22	55.828.357,30	0,36
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,55	0,13	1,00	6,41	23.662.827,54	25,50		

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GENIAL	RJI	INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
GENIAL	RJI	INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	1,70	-0,53	-0,53	-3,16	71.701,02	0,08	6.470.520,89	1,11
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			1,70	-0,53	-0,53	-3,16	71.701,02	0,08		
Renda Fixa			0,86	0,07	0,82	6,42	89.495.210,23	96,46		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

1,89%

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 DIVIDENDOS	19,05	0,08	7,90	7,28	248.866,38	0,27	592.169.733,93	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	20,29	0,68	8,89	8,06	1.500.968,29	1,62	653.548.024,61	0,23
Sub-total Artigo 8º I			16,55	0,60	8,73	11,52	1.749.834,67	1,89		
Renda Variável			16,55	0,60	8,73	11,52	1.749.834,67	1,89		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,57%

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				
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	21,99	0,17	1,38	7,15	1.453.519,55	1,57	646.477.527,53	0,22
Sub-total Artigo 9º III			21,99	0,17	1,38	7,15	1.453.519,55	1,57		
Investimentos no Exterior			21,99	0,17	1,38	7,15	1.453.519,55	1,57		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,09%

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GRAPHEN	RJI	FIP MULTIESTRATÉGIA PUMA	0,76	-0,10	-0,10	-0,59	80.132,30	0,09	3.673.296,33	2,18
Sub-total Artigo 10º II			0,76	-0,10	-0,10	-0,59	80.132,30	0,09		
Investimentos Estruturados			0,76	-0,10	-0,10	-0,59	80.132,30	0,09		
Total			1,08	0,09	0,98	6,56	92.778.696,75	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 a	Títulos do Tesouro Nacional	44.178.691,88	47,62	0,00	52,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	21.581.989,79	23,26	0,00	17,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	23.662.827,54	25,50	0,00	23,01	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	71.701,02	0,08	0,00	0,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	89.495.210,23	96,46					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	1.749.834,67	1,89	0,00	3,88	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	1.749.834,67	1,89					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	1.453.519,55	1,57	0,00	2,50	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	1.453.519,55	1,57					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º II	Fundo de Participação	80.132,30	0,09	0,00	0,11	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	80.132,30	0,09					15,00
Total		92.778.696,75	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 43,58	6,24 96,08	2,49 79,31	6,24 96,08	9,27 68,42	205.440,55	2.607.532,83
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,33 124,44	6,87 105,71	3,46 110,01	6,87 105,71	10,76 79,46	286.863,45	1.430.429,25
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,00 93,38	6,41 98,67	2,68 85,09	6,41 98,67	10,16 75,00	232.348,62	1.342.208,01
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,53 -49,34	-3,16 -48,62	-1,67 -53,02	-3,16 -48,62	-4,39 -32,40	-381,27	-2.361,30
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	8,73 -0,27	11,52 3,91	16,56 0,66	11,52 3,91	18,49 -1,35	153.607,54	244.281,33
Artigo 9º III % do CDI	1,38 129,09	7,15 110,05	3,82 121,34	7,15 110,05	9,33 68,89	19.839,90	97.016,76
Artigo 10º II % do CDI	-0,10 -9,32	-0,59 -9,06	-0,29 -9,22	-0,59 -9,06	-1,76 -13,02	-80,17	-474,57
OUROESTE (Total)						897.638,62	5.718.632,31

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 150535 (5,825000%)	3.051.696,71	0,00	0,00	0,00	3.065.779,73	14.083,02	184.537,53
NTN-B 150535 (5,840000%)	5.130.258,59	0,00	0,00	0,00	5.153.999,08	23.740,49	310.590,44
NTN-B 150535 (5,870000%)	4.522.925,25	0,00	0,00	0,00	4.543.957,32	21.032,07	274.451,45
NTN-B 150535 (6,127000%)	5.133.876,03	0,00	0,00	0,00	5.158.791,86	24.915,83	317.660,22
NTN-B 150824 (5,100000%)	2.700.736,36	0,00	0,00	0,00	2.711.644,70	10.908,34	151.857,04
NTN-B 150824 (5,580000%)	6.351.322,99	0,00	0,00	0,00	6.379.403,18	28.080,19	370.873,34
NTN-B 150824 (6,040000%)	5.182.139,77	0,00	0,00	0,00	5.206.933,19	24.793,42	313.285,37
NTN-B 150824 (7,080000%)	2.709.237,51	0,00	0,00	0,00	2.724.406,25	15.168,74	26.601,47
NTN-B 150824 (7,600000%)	618.805,54	0,00	0,00	0,00	622.523,67	3.718,13	41.685,54
NTN-B 150830 (5,150000%)	2.352.403,86	0,00	0,00	0,00	2.362.003,24	9.599,38	132.773,39

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150832 (5,671000%)	3.147.973,31	0,00	0,00	0,00	3.162.117,98	14.144,67	185.077,12
NTN-B 150840 (6,270000%)	3.071.875,41	0,00	0,00	0,00	3.087.131,68	15.256,27	188.902,91
					44.178.691,88	205.440,55	

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 IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	5.679.335,86	12.009,88	0,00	0,00	5.757.277,80	65.932,06	346.431,77
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.931.037,33	0,00	-310.922,35	0,00	11.757.198,94	137.083,96	773.635,62
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3.983.665,62	0,00	0,00	0,00	4.067.513,05	83.847,43	310.361,86
					21.581.989,79	286.863,45	

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	11.178.930,21	1.448.971,04	-580.140,26	0,00	12.166.071,22	118.310,23	616.663,13
BRANCO INST FIC FI RF IMA-B 5	11.017.724,71	0,00	0,00	0,00	11.131.314,86	113.590,15	722.225,38
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	200.340,25	0,00	0,00	0,00	201.164,08	823,83	5.214,55
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	164.652,97	0,00	0,00	0,00	164.277,38	-375,59	-1.895,05
					23.662.827,54	232.348,62	

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	72.082,29	0,00	0,00	0,00	71.701,02	-381,27	-2.361,30
					71.701,02	-381,27	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS	368.993,79	0,00	-151.238,26	0,00	248.866,38	31.110,85	29.002,69

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	1.378.471,60	0,00	0,00	0,00	1.500.968,29	122.496,69	111.904,22
					1.749.834,67	153.607,54	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	1.433.679,65	0,00	0,00	0,00	1.453.519,55	19.839,90	97.016,76
					1.453.519,55	19.839,90	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIP MULTISTRATÉGIA PUMA	80.212,47	0,00	0,00	0,00	80.132,30	-80,17	-474,57
					80.132,30	-80,17	

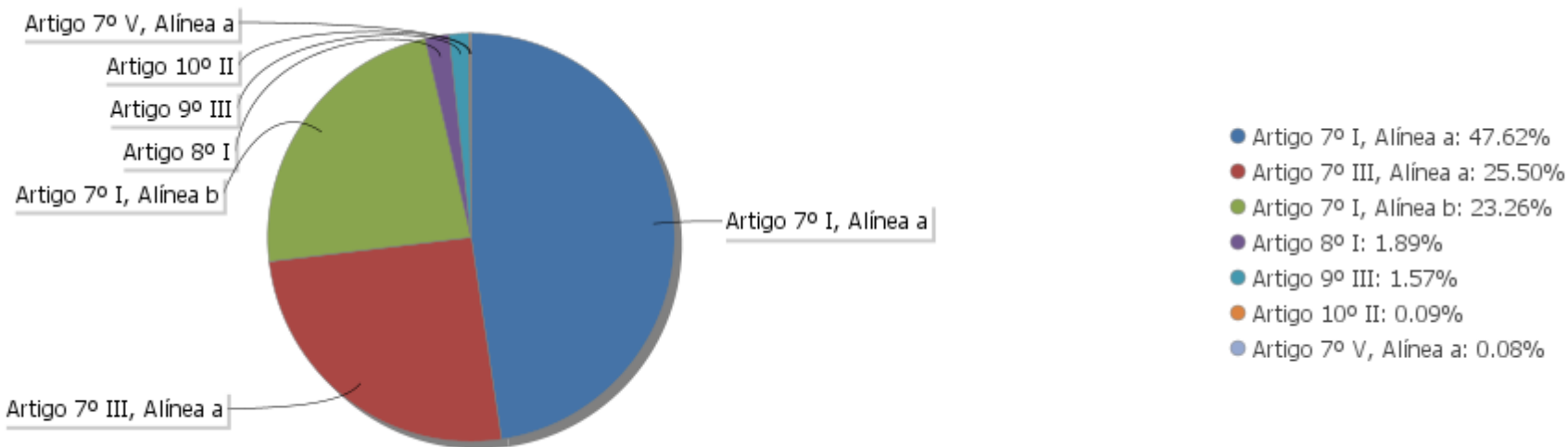
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

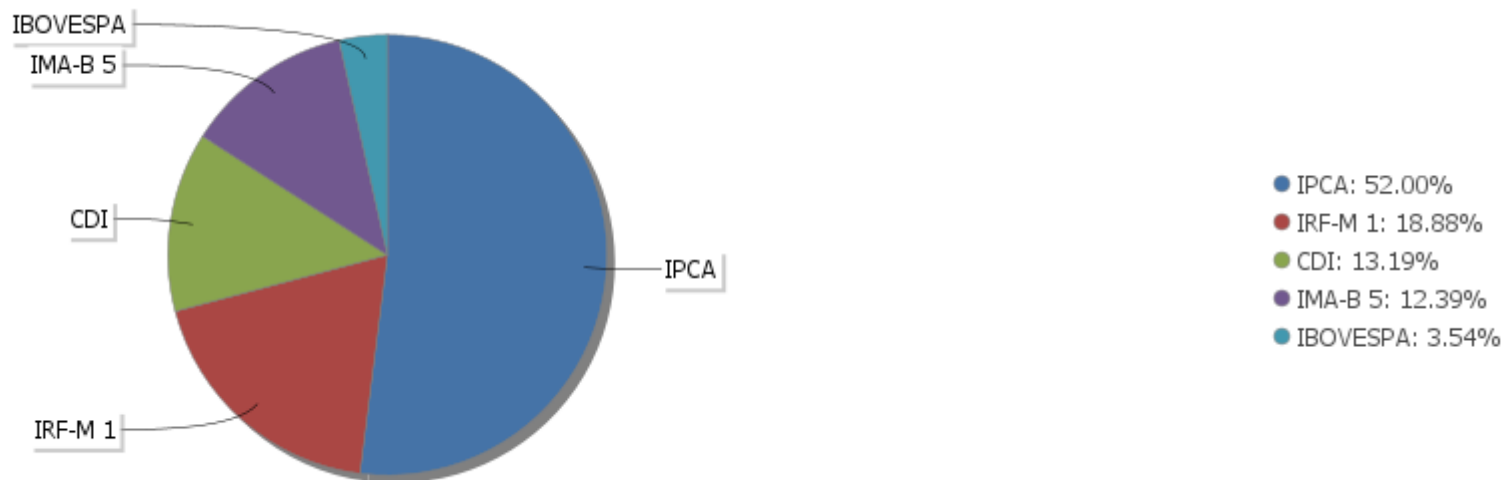
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	46.733.595,12	50,37	46.733.595,12	50,37	
de 31 dias a 365 dias	1.500.968,29	1,62	48.234.563,41	51,99	
acima de 365 dias	44.544.133,34	48,01	92.778.696,75	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

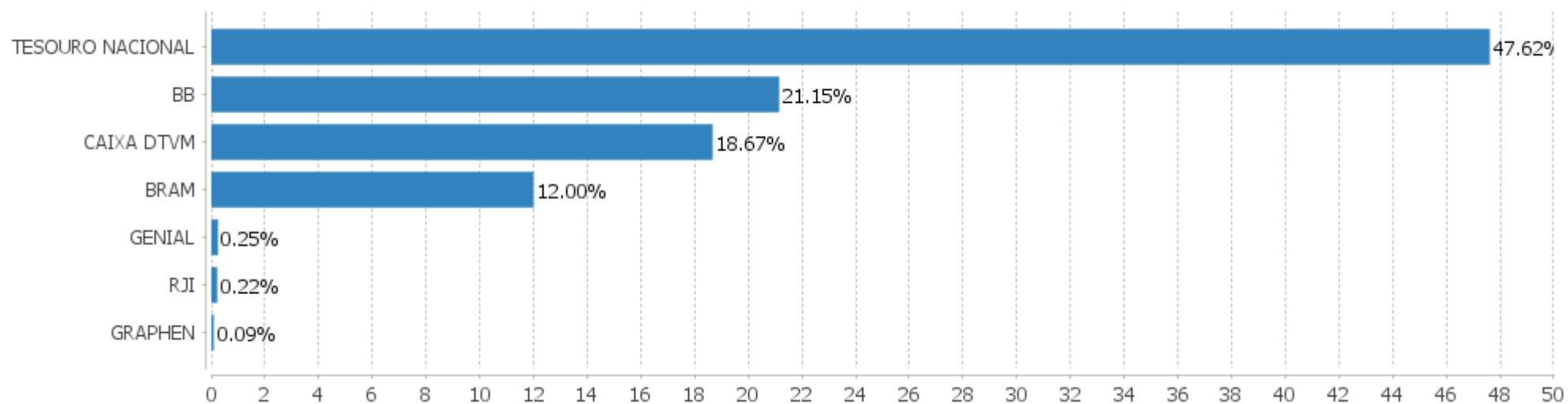


Alocação Por Estratégia



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	1,29	0,84	1,25	0,88	1,15	0,98							6,56
IPCA + 4,89%	0,95	1,18	1,15	0,95	0,65	0,32							5,32
p.p. indexador	0,34	-0,35	0,10	-0,07	0,50	0,66							1,24
2022	0,11	0,64	2,27	0,77	1,03	0,17	0,43	0,16	0,15	1,14	0,56	0,72	8,44
IPCA + 4,88%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,28	0,07	0,11	0,97	0,79	1,04	10,93
p.p. indexador	-0,83	-0,73	0,23	-0,65	0,14	-0,91	0,72	0,08	0,05	0,17	-0,23	-0,32	-2,48
2021	-0,66	-1,03	0,48	0,98	0,90	0,21	-0,40	-0,51	-0,09	-1,29	1,68	0,99	1,23
IPCA + 5,43%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,97	1,43	1,34	1,61	1,68	1,37	1,22	16,01
p.p. indexador	-1,33	-2,27	-0,94	0,24	-0,37	-0,77	-1,83	-1,85	-1,69	-2,97	0,31	-0,23	-14,78

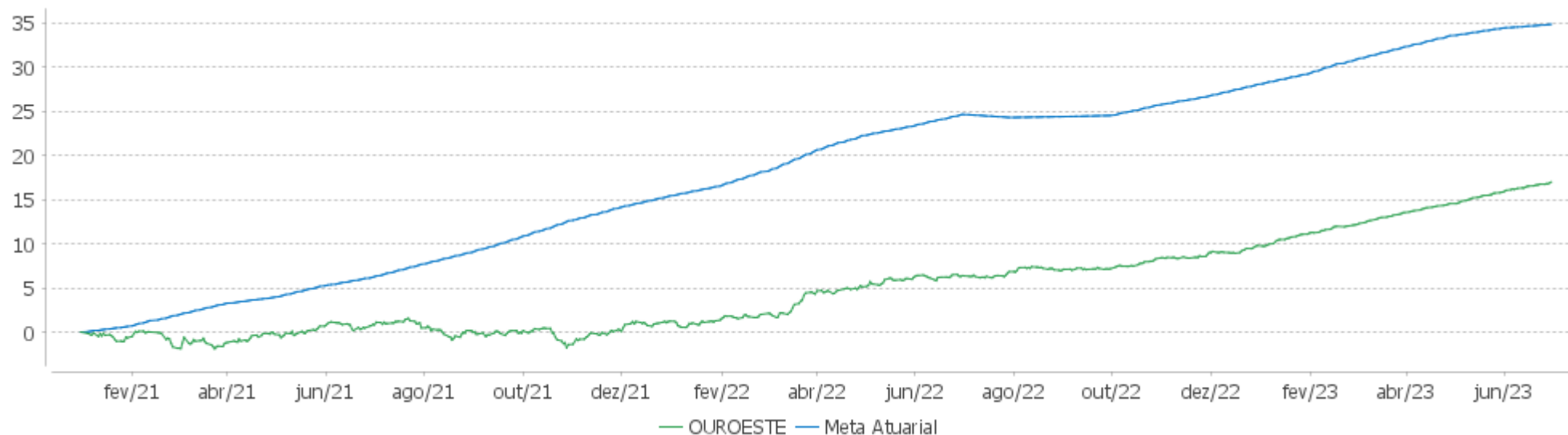
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	12	40,00	03 meses	3,04	1,93	1,11	0,47
Meses abaixo - Meta Atuarial	18	60,00	06 meses	6,56	5,32	1,24	0,59
			12 meses	9,96	8,18	1,78	1,08
			24 meses	15,96	27,28	-11,32	2,20
Maior rentabilidade da Carteira	2,27	2022-03	Desde 31/12/2020	16,98	35,53	-18,55	2,54
Menor rentabilidade da Carteira	-1,29	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

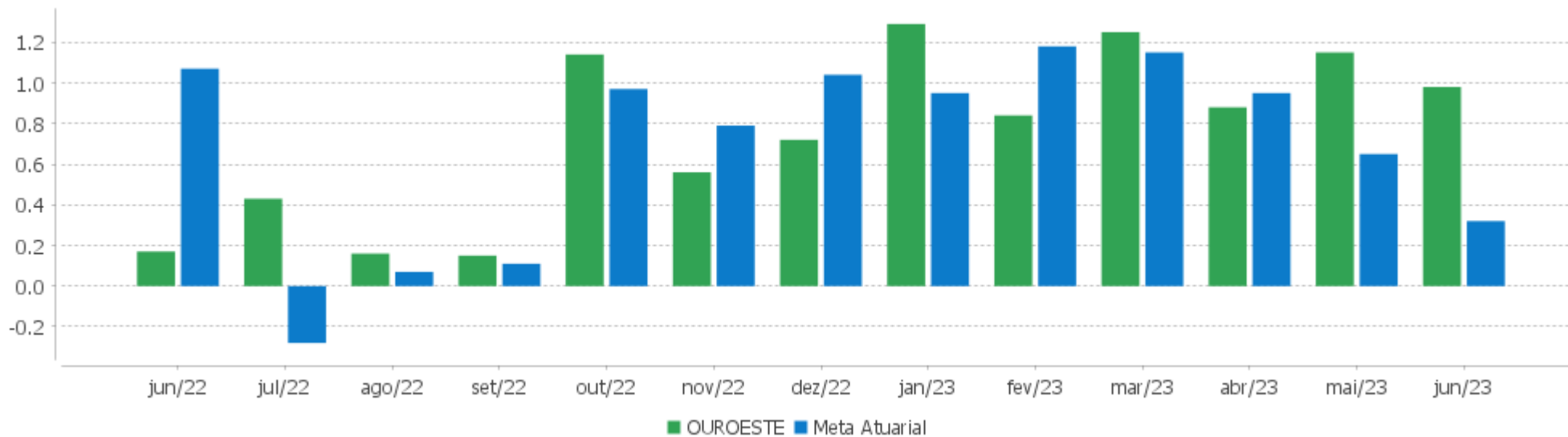


Patrimônio Líquido



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
NTN-B 150535 (5,870000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,26 3,39	2,50 1,74	6,26 3,39	9,58 6,42	26,02 10,60	36,30 11,24
NTN-B 150830 (5,150000%) Var. IPCA p.p.	0,41 0,49	5,91 3,04	2,33 1,57	5,91 3,04	8,84 5,68	24,47 9,04	34,06 9,00
NTN-B 150824 (6,040000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,56	6,35 3,48	2,54 1,78	6,35 3,48	9,76 6,60	22,75 7,32	32,86 7,80
NTN-B 150840 (6,270000%) Var. IPCA p.p.	0,50 0,58	6,46 3,59	2,59 1,83	6,46 3,59	6,75 3,59	19,46 4,04	29,37 4,31
NTN-B 150832 (5,671000%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,53	6,17 3,30	2,45 1,69	6,17 3,30	9,38 6,22	22,08 6,66	31,89 6,84
NTN-B 150535 (5,840000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,25 3,38	2,49 1,73	6,25 3,38	9,55 6,39	22,40 6,97	32,36 7,30
NTN-B 150824 (7,600000%) Var. IPCA p.p.	0,60 0,68	7,12 4,24	2,90 2,14	7,12 4,24	11,37 8,20	33,96 18,54	51,24 26,18
NTN-B 150824 (5,100000%) Var. IPCA p.p.	0,40 0,48	5,88 3,01	2,32 1,56	5,88 3,01	8,79 5,63	24,24 8,81	33,51 8,45
NTN-B 150824 (5,580000%) Var. IPCA p.p.	0,44 0,52	6,12 3,25	2,43 1,67	6,12 3,25	9,28 6,12	21,77 6,34	31,34 6,28
NTN-B 150824 (7,080000%) Var. IPCA p.p.	0,56 0,64	3,76 0,89	2,79 2,03	3,76 0,89	4,46 1,30		
NTN-B 150535 (6,127000%) Var. IPCA p.p.	0,49 0,57	6,39 3,52	2,56 1,80	6,39 3,52	9,85 6,69	22,88 7,46	33,04 7,98
NTN-B 150535 (5,825000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,24 3,37	2,49 1,73	6,24 3,37	9,54 6,37	25,93 10,51	36,17 11,11
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,16 -0,03	6,49 -0,18	3,14 -0,08	6,49 -0,18	13,48 -0,34	21,33 -0,67	23,34 -1,15
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	2,10 2,18	8,26 5,39	4,86 4,09	8,26 5,39	14,59 11,43	18,86 3,44	22,05 -3,01
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,16 -0,03	6,59 -0,09	3,15 -0,07	6,59 -0,09	13,58 -0,24	21,47 -0,53	23,68 -0,80
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	-0,53	-3,16	-1,67	-3,16	-4,39	-24,64	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-49,34	-48,62	-53,02	-48,62	-32,40	-105,42	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	6,94 -0,10	2,52 -0,02	6,94 -0,10	9,94 -0,29	20,35 -0,97	26,59 -2,09
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-0,23 -1,28	-1,14 -8,18	-0,65 -3,19	-1,14 -8,18	-0,38 -10,61	-4,23 -25,54	-65,36 -94,03
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	1,00 93,03	5,98 92,01	2,90 92,23	5,98 92,01	12,44 91,84	20,85 89,21	22,25 85,01
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,41 -0,64	2,66 -4,38	1,28 -1,26	2,66 -4,38	4,16 -6,06	6,19 -15,13	-19,08 -47,76
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
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	8,89 -0,12	8,06 0,44	17,13 1,23	8,06 0,44	15,45 -4,39	-16,81 -9,94	6,36 -17,87
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	1,38 -7,62	7,15 -0,46	3,82 -12,09	7,15 -0,46	9,33 -10,50	-2,81 4,06	19,35 -4,88
FIP MULTISTRATÉGIA PUMA Var. IBOVESPA p.p.	-0,10 -9,10	-0,59 -8,20	-0,29 -16,20	-0,59 -8,20	-1,76 -21,60	-3,23 3,65	
OUROESTE Var. IPCA + 4,88% p.p.	0,98 0,66	6,56 1,24	3,04 1,11	6,56 1,24	9,96 1,78	15,96 -11,00	
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 DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,60
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	D+1 du	D+0	D+23 du	D+25 du		1,50
FIP MULTIESTRATÉGIA PUMA						
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	D+0	D+0				
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	Não se aplica	Não se aplica				
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1 du	D+0	D+1470	D+1471		0,35
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1 du	D+0	D+1470	D+1471		0,70

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

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (5,825000%)	3.065.779,73	5,825000	3.219.722,51	5,229500	153.942,78
NTN-B 150535 (5,840000%)	5.153.999,08	5,840000	5.419.422,75	5,229500	265.423,67
NTN-B 150535 (5,870000%)	4.543.957,32	5,870000	4.789.669,86	5,229500	245.712,54
NTN-B 150535 (6,127000%)	5.158.791,86	6,127000	5.552.469,13	5,229500	393.677,27
NTN-B 150824 (5,100000%)	2.711.644,70	5,100000	2.649.283,20	7,388100	-62.361,50
NTN-B 150824 (5,580000%)	6.379.403,18	5,580000	6.263.454,48	7,388100	-115.948,70
NTN-B 150824 (6,040000%)	5.206.933,19	6,040000	5.136.365,40	7,388100	-70.567,79
NTN-B 150824 (7,080000%)	2.724.406,25	7,080000	2.715.827,21	7,388100	-8.579,04
NTN-B 150824 (7,600000%)	622.523,67	7,600000	623.850,05	7,388100	1.326,38
NTN-B 150830 (5,150000%)	2.362.003,24	5,150000	2.364.393,93	5,132700	2.390,69
NTN-B 150832 (5,671000%)	3.162.117,98	5,671000	3.268.556,90	5,176900	106.438,92
NTN-B 150840 (6,270000%)	3.087.131,68	6,270000	3.383.509,48	5,371900	296.377,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
409	01/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	105.906,65	41.528,10598285	2,5502403130
424	01/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	71.584,59	0,00	28.069,74293100	2,5502403130
428	01/06/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	12.009,88	0,00	3.648,38227718	3,2918370630
425	02/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	8.046,68	0,00	3.153,77190923	2,5514464050
426	02/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	22.730,04	0,00	8.908,68801100	2,5514464050
421	05/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	41.468,38	0,00	16.245,16884494	2,5526592180
419	06/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	691.388,89	0,00	270.724,27117712	2,5538489290
422	06/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	8.046,68	0,00	3.150,80500989	2,5538489290
432	06/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.477,51	578,54244400	2,5538489290
417	07/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	32.667,40	0,00	12.785,48206800	2,5550385840
435	07/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	75.959,16	23.972,16471420	3,1686400000
431	13/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	484,34	189,29477000	2,5586549460
414	14/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.505,62	2.541,41124425	2,5598454460
418	14/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.101,50	0,00	820,94800031	2,5598454460
430	15/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.761,46	3.811,51651200	2,5610436080
420	16/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.728,54	1.064,88563600	2,5622845370
413	20/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	281.798,90	0,00	109.872,87754700	2,5647721830
415	20/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	300,00	116,96945300	2,5647721830
436	20/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	31.345,21	9.850,41726600	3,1821200000
438	21/06/2023	BB AÇÕES DIVIDENDOS	0,00	151.238,26	8.321,57116878	18,1742434130
423	22/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	83.655,07	0,00	32.586,54571457	2,5671659320
429	22/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.090,50	424,78750100	2,5671659320
433	26/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	63,80	0,00	24,82909182	2,5695663970
410	27/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	442.185,17	172.004,47356707	2,5707771480
427	27/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.700,47	3.773,36091100	2,5707771480
412	28/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	19.170,00	0,00	7.453,42054800	2,5719734820
437	28/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	203.617,98	63.794,99037700	3,1917550000
411	29/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	151.238,26	0,00	58.774,49107328	2,5731955690

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
434	30/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	35.010,85	0,00	13.599,57858200	2,5744069780
Total			1.460.980,92	1.042.300,87		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 224.830,38

Value-At-Risk: 0,24%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
OUROESTE		0,24		0,24			92.778.696,75	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,16%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,825000%)		0,13	0,00	0,12			3.065.779,73	3,30
NTN-B 150535 (5,840000%)		0,13	0,00	0,12			5.153.999,08	5,56
NTN-B 150535 (5,870000%)		0,13	0,00	0,12			4.543.957,32	4,90
NTN-B 150535 (6,127000%)		0,13	0,00	0,12			5.158.791,86	5,56
NTN-B 150824 (5,100000%)		0,13	0,00	0,12			2.711.644,70	2,92
NTN-B 150824 (5,580000%)		0,13	0,00	0,12			6.379.403,18	6,88
NTN-B 150824 (6,040000%)		0,13	0,00	0,12			5.206.933,19	5,61
NTN-B 150824 (7,080000%)		0,22	-0,00	0,26			2.724.406,25	2,94
NTN-B 150824 (7,600000%)		0,13	0,00	0,12			622.523,67	0,67
NTN-B 150830 (5,150000%)		0,14	0,00	0,12			2.362.003,24	2,55
NTN-B 150832 (5,671000%)		0,13	0,00	0,12			3.162.117,98	3,41
NTN-B 150840 (6,270000%)		0,13	0,00	0,12			3.087.131,68	3,33
Sub-total	0,37	0,13	0,01		-1,65	0,47	44.178.691,88	47,62

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,21	0,01	0,01			5.757.277,80	6,21
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,22	0,02	0,01			11.757.198,94	12,67
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,55	0,01	0,59			4.067.513,05	4,38
Sub-total	0,50	0,24	0,04		0,53	1,33	21.581.989,79	23,26

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	0,00	0,01			12.166.071,22	13,11
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5		0,34	-0,00	0,98			164.277,38	0,18
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5		0,80	0,06	0,13			11.131.314,86	12,00
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5		0,12	0,00	0,90			201.164,08	0,22
Sub-total	0,90	0,38	0,06		-0,08	1,00	23.662.827,54	25,50

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC		0,14	0,00	0,14			71.701,02	0,08
Sub-total	1,84	0,14	0,00		-0,87	-0,53	71.701,02	0,08

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,24%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS		7,86	0,01	2,26			248.866,38	0,27
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		8,36	0,10	2,95			1.500.968,29	1,62
Sub-total	15,51	8,24	0,11		0,49	8,73	1.749.834,67	1,89

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,70%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I		6,70	0,02	11,28			1.453.519,55	1,57
Sub-total	14,11	6,70	0,02		0,02	1,38	1.453.519,55	1,57

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,02%

Artigo 10º II

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIP MULTISTRATÉGIA PUMA		0,02	0,00	8,61			80.132,30	0,09
Sub-total	0,35	0,02	0,00		-3,38	-0,10	80.132,30	0,09