



LDB
EMPRESAS

OSASCO - CONSOLIDADO
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 **91,78%**

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 150545	9,40	1,24	3,77	15,84	16.879.824,65	2,29
TESOURO NACIONAL	LTN 01012024 (6,030000%)	0,00	0,02	0,49	2,92	5.856.025,12	0,79
TESOURO NACIONAL	LTN 01012024 (6,100000%)	0,00	0,02	0,49	2,96	5.862.830,47	0,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,930000%)	0,47	0,01	0,39	5,80	28.439.784,42	3,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,742000%)	0,47	0,02	0,45	6,20	43.190.729,61	5,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,200000%)	0,47	0,01	0,33	5,44	28.587.206,07	3,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730001%)	0,47	0,02	0,45	6,19	44.942.011,20	6,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,740002%)	0,47	0,02	0,45	6,20	43.703.618,96	5,93
TESOURO NACIONAL	NTN-F 2029 (12,000000%)	0,00	0,04	0,95	5,73	5.454.807,68	0,74
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,75	0,11	0,69	6,54	222.916.838,18	30,23

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 2024 FI	1,17	0,06	0,72	0,72	10.072.029,72	1,37	2.310.416.906,99	0,44
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,60	0,17	1,02	6,56	14.406.900,59	1,95	6.483.473.627,64	0,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,70	0,17	1,04	6,60	4.070.809,62	0,55	5.947.143.642,03	0,07

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

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 IMA-B 5 LP FIC FI	2,41	0,23	1,03	6,99	8.669.268,14	1,18	5.638.426.224,35	0,15
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,43	0,35	2,10	8,26	31.871.220,78	4,32	5.348.206.988,95	0,60
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,02	0,05	1,07	6,41	50.827.660,86	6,89	5.492.803.682,31	0,93
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,62	0,16	1,34	7,03	119.917.889,71	16,26		

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				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,05	1,12	6,42	109.943.676,65	14,91	15.331.819.820,88	0,72
QUELUZ	RJI	BRA1 FI RENDA FIXA	0,71	-0,01	0,49	3,50	183.728,00	0,02	3.618.317,10	5,08
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	1,09	6,44	129.605.443,61	17,58	14.982.085.274,92	0,87
VERITAS	RJI	TMJ IMA-B FI RF	20,12	0,01	2,28	6,45	883.650,12	0,12	53.575.004,21	1,65
GENIAL	RJI	TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	1,40	-0,00	-0,23	-1,14	915.513,29	0,12	65.773.970,76	1,39
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,42	0,23	1,03	6,94	23.963.253,53	3,25	963.196.862,82	2,49
VERITAS	RJI	FI BARCELONA RENDA FIXA	35,28	-0,74	0,29	6,92	375.490,96	0,05	25.302.624,51	1,48
GENIAL	PLANNER	FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	3,01	0,04	-0,50	1,77	438.134,84	0,06	15.411.902,47	2,84
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,04	1,13	6,53	60.999.899,55	8,27	8.773.662.957,45	0,70
VERITAS	RJI	MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA	1,39	-0,18	-3,65	-17,73	32.567,75	0,00	998.532,60	3,26
RJI	RJI	TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,59	0,02	0,41	2,66	1.121.081,84	0,15	55.828.357,30	2,01
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,36	0,06	1,10	6,46	328.462.440,14	44,54		

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				
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	0,98	-0,38	-0,38	-1,05	3.332.953,35	0,45	73.748.729,23	4,52
QUELUZ	PLANNER	ILLUMINATI FIDC	8,81	0,00	-3,78	-14,00	1.272.794,14	0,17	67.924.325,30	1,87
GENIAL	RJI	INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	1,70	-0,53	-0,53	-3,16	313.714,49	0,04	6.470.520,89	4,85
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			2,93	-0,29	-1,36	-5,14	4.919.461,98	0,67		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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				
GENIAL	GENIAL	PIATÁ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	64,87	0,25	-0,32	-0,83	561.554,82	0,08	22.535.381,50	2,49
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			64,87	0,25	-0,32	-0,83	561.554,82	0,08		
Renda Fixa			0,66	0,09	0,98	6,48	676.778.184,83	91,78		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

3,50%

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	18,46	-0,36	8,54	8,46	4.015.700,22	0,54	234.456.759,31	1,71
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	23,05	0,65	9,29	18,66	5.702.963,75	0,77	215.229.189,08	2,65
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	21,05	0,73	9,39	6,66	3.039.440,64	0,41	1.451.994.845,07	0,21
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	26,49	1,08	8,03	13,04	3.871.301,10	0,53	675.053.112,68	0,57
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	19,56	0,89	9,77	13,72	3.216.848,78	0,44	611.430.231,25	0,53
SAFRA	SAFRA	SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES	21,82	-0,10	8,13	8,00	5.932.925,00	0,80	158.470.749,80	3,74
Sub-total Artigo 8º I			20,94	0,42	8,79	11,57	25.779.179,49	3,50		
Renda Variável			20,94	0,42	8,79	11,57	25.779.179,49	3,50		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,97%

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	23,77	0,25	0,47	14,53	7.505.867,93	1,02	2.036.420.590,68	0,37
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	22,24	-0,24	-0,06	7,46	7.056.368,99	0,96	726.616.425,21	0,97
Sub-total Artigo 9º III			22,69	0,01	0,21	10,99	14.562.236,92	1,97		
Investimentos no Exterior			22,69	0,01	0,21	10,99	14.562.236,92	1,97		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,84%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ARENA CAPITAL	REAG	WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP	7,46	-0,08	-0,08	-1,64	374.747,43	0,05	42.321.290,14	0,89
QUELUZ	RJI	FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO	15,20	-0,01	0,06	-16,00	3.285.751,58	0,45	142.518.134,51	2,31
Sub-total Artigo 10º I			14,14	-0,01	0,05	5,60	3.660.499,01	0,50		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
A5	PLANNER	W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	7,23	-0,15	-0,15	-0,87	8.795.866,26	1,19	123.688.251,61	7,11
QUELUZ	BNY MELLON	BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	0,20	-0,06	-0,06	-0,33	1.122.352,33	0,15	27.614.114,87	4,06
Sub-total Artigo 10º II			6,47	-0,14	-0,14	-0,80	9.918.218,59	1,35		
Investimentos Estruturados			11,55	-0,10	-0,09	4,07	13.578.717,60	1,84		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,91%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GRAPHEN	RJI	HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	5,37	5,43	5,44	5,83	6.261.829,93	0,85	79.160.383,16	7,91
QUELUZ	RJI	ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	0,90	-0,15	-0,15	-1,54	60.821,64	0,01	143.398.814,69	0,04
VERITAS	RJI	SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	2,64	-0,24	-0,24	-0,72	356.225,38	0,05	71.557.817,65	0,50
Sub-total Artigo 11º			4,98	5,06	5,07	5,38	6.678.876,95	0,91		
Fundos Imobiliários			4,98	5,06	5,07	5,38	6.678.876,95	0,91		
Total			1,91	0,14	1,23	6,74	737.377.195,79	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	368.657,19
Sub-total Disponibilidades Financeiras	368.657,19
Total	737.745.852,98

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	222.916.838,18	30,23	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	119.917.889,71	16,26	0,00	8,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	328.462.440,14	44,54	0,00	17,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	4.919.461,98	0,67	0,00	1,00	1,40	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	561.554,82	0,08	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	676.778.184,83	91,78					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	25.779.179,49	3,50	0,00	3,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	25.779.179,49	3,50					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	14.562.236,92	1,97	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	14.562.236,92	1,97					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	3.660.499,01	0,50	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	9.918.218,59	1,35	0,00	1,50	2,40	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	13.578.717,60	1,84					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	6.678.876,95	0,91	0,00	1,00	1,45	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	6.678.876,95	0,91					5,00
Total		737.377.195,79	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	0,69 64,17	6,54 100,67	3,05 97,11	6,54 100,67	9,72 71,78	1.522.936,00	13.853.116,01
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,34 124,65	7,03 108,14	3,37 107,21	7,03 108,14	11,27 83,23	1.543.951,05	6.923.910,91
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,10 102,24	6,46 99,34	3,13 99,34	6,46 99,34	12,74 94,11	3.684.175,00	17.504.572,56
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-1,36 -126,82	-5,14 -79,11	-3,41 -108,26	-5,14 -79,11	-6,77 -49,99	-69.122,26	-272.865,87
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	-0,32 -30,13	-0,83 -12,72	-0,11 -3,40	-0,83 -12,72	-3,68 -27,17	-1.819,43	-4.679,09
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	8,79 -0,22	11,57 3,96	18,32 2,41	11,57 3,96	19,05 -0,79	2.081.858,60	2.673.866,52
Artigo 9º III % do CDI	0,21 19,81	10,99 169,11	4,04 128,41	10,99 169,11	10,01 73,88	30.864,85	1.441.909,23
Artigo 10º I % do CDI	0,05 4,68	5,60 86,21	0,58 18,32	5,60 86,21	12,48 92,17	1.909,47	2.555.067,37
Artigo 10º II % do CDI	-0,14 -12,69	-0,80 -12,39	-0,40 -12,62	-0,80 -12,39	-7,64 -56,44	-13.513,69	-80.479,24
Artigo 11º % do CDI	5,07 472,93	5,38 82,82	5,17 164,36	5,38 82,82	6,31 46,59	322.261,99	341.293,68
OSASCO - CONSOLIDADO (Total)						9.103.501,58	44.935.712,08

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\$)
LTN 01012024 (6,030000%)	5.827.521,28	0,00	0,00	0,00	5.856.025,12	28.503,84	166.312,04
LTN 01012024 (6,100000%)	5.833.972,64	0,00	0,00	0,00	5.862.830,47	28.857,83	168.354,89
NTN-B 150545	16.267.236,00	0,00	0,00	0,00	16.879.824,65	612.588,65	2.350.461,40
NTN-B 150545 (4,930000%)	28.329.195,84	0,00	0,00	0,00	28.439.784,42	110.588,58	1.593.164,86
NTN-B 150555 (5,742000%)	42.995.124,80	0,00	0,00	0,00	43.190.729,61	195.604,81	2.582.333,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150840 (4,200000%)	28.492.611,15	0,00	0,00	0,00	28.587.206,07	94.594,92	1.483.607,73
NTN-B 150850 (5,730001%)	44.738.903,02	0,00	0,00	0,00	44.942.011,20	203.108,18	2.641.871,22
NTN-B 150850 (5,740002%)	43.505.802,79	0,00	0,00	0,00	43.703.618,96	197.816,17	2.571.026,67
NTN-F 2029 (12,000000%)	5.403.534,66	0,00	0,00	0,00	5.454.807,68	51.273,02	295.983,75
					222.916.838,18	1.522.936,00	

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 IDKA2	14.261.504,26	0,00	0,00	0,00	14.406.900,59	145.396,33	887.181,69
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	8.580.807,41	0,00	0,00	0,00	8.669.268,14	88.460,73	566.357,26
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,00	10.000.000,00	0,00	0,00	10.072.029,72	72.029,72	72.029,72
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.028.778,72	0,00	0,00	0,00	4.070.809,62	42.030,90	251.957,88
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	31.214.229,55	0,00	0,00	0,00	31.871.220,78	656.991,23	2.431.857,31
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	50.288.618,72	0,00	0,00	0,00	50.827.660,86	539.042,14	2.499.852,05
					119.917.889,71	1.543.951,05	

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	145.418.378,46	48.302.710,39	-65.698.770,94	0,00	129.605.443,61	1.583.125,70	9.538.206,51
BRA1 FI RENDA FIXA	238.457,16	0,00	0,00	55.854,91	183.728,00	1.125,75	9.093,27
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	45.365.677,00	15.000.000,00	0,00	0,00	60.999.899,55	634.222,55	2.060.759,41
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5	23.718.719,12	0,00	0,00	0,00	23.963.253,53	244.534,41	1.554.791,17
FI BARCELONA RENDA FIXA	374.399,20	0,00	0,00	0,00	375.490,96	1.091,76	24.311,21
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	104.473.477,97	4.269.020,18	0,00	0,00	109.943.676,65	1.201.178,50	4.241.315,63
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	440.320,46	0,00	0,00	0,00	438.134,84	-2.185,62	7.609,05
MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA	33.801,91	0,00	0,00	0,00	32.567,75	-1.234,16	-7.611,76
TMJ IMA-B FI RF	921.560,01	0,00	0,00	57.727,95	883.650,12	19.818,06	57.598,51
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1.116.490,65	0,00	0,00	0,00	1.121.081,84	4.591,19	29.060,56
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	917.606,43	0,00	0,00	0,00	915.513,29	-2.093,14	-10.561,00

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					328.462.440,14	3.684.175,00	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ILLUMINATI FIDC	1.449.364,61	0,00	0,00	121.799,68	1.272.794,14	-54.770,79	-227.060,28
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	315.382,63	0,00	0,00	0,00	313.714,49	-1.668,14	-10.331,40
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	3.345.636,68	0,00	0,00	0,00	3.332.953,35	-12.683,33	-35.474,19
					4.919.461,98	-69.122,26	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
PIATÃ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	563.374,25	0,00	0,00	0,00	561.554,82	-1.819,43	-4.679,09
					561.554,82	-1.819,43	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	2.778.653,96	0,00	0,00	0,00	3.039.440,64	260.786,68	189.664,51
FIA CAIXA DIVIDENDOS	3.699.678,10	0,00	0,00	0,00	4.015.700,22	316.022,12	313.111,41
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	5.218.088,32	0,00	0,00	0,00	5.702.963,75	484.875,43	896.701,00
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	3.583.483,69	0,00	0,00	0,00	3.871.301,10	287.817,41	446.685,40
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	2.930.422,91	0,00	0,00	0,00	3.216.848,78	286.425,87	388.078,03
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES	5.486.993,91	0,00	0,00	0,00	5.932.925,00	445.931,09	439.626,17
					25.779.179,49	2.081.858,60	

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	7.470.897,35	0,00	0,00	0,00	7.505.867,93	34.970,58	952.240,59
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	7.060.474,72	0,00	0,00	0,00	7.056.368,99	-4.105,73	489.668,64

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					14.562.236,92	30.864,85	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO	3.352.703,39	0,00	0,00	69.164,91	3.285.751,58	2.213,10	-639.008,52
WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP	375.051,06	0,00	0,00	0,00	374.747,43	-303,63	-6.255,74
					3.660.499,01	1.909,47	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	1.122.980,29	0,00	0,00	0,00	1.122.352,33	-627,96	-3.660,48
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	8.808.751,99	0,00	0,00	0,00	8.795.866,26	-12.885,73	-76.818,76
					9.918.218,59	-13.513,69	

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	5.938.627,29	0,00	0,00	0,00	0,00	6.261.829,93	323.202,64	345.023,04
SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	357.073,90	0,00	0,00	0,00	0,00	356.225,38	-848,52	-2.778,37
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	60.913,77	0,00	0,00	0,00	0,00	60.821,64	-92,13	-950,99
						6.678.876,95	322.261,99	

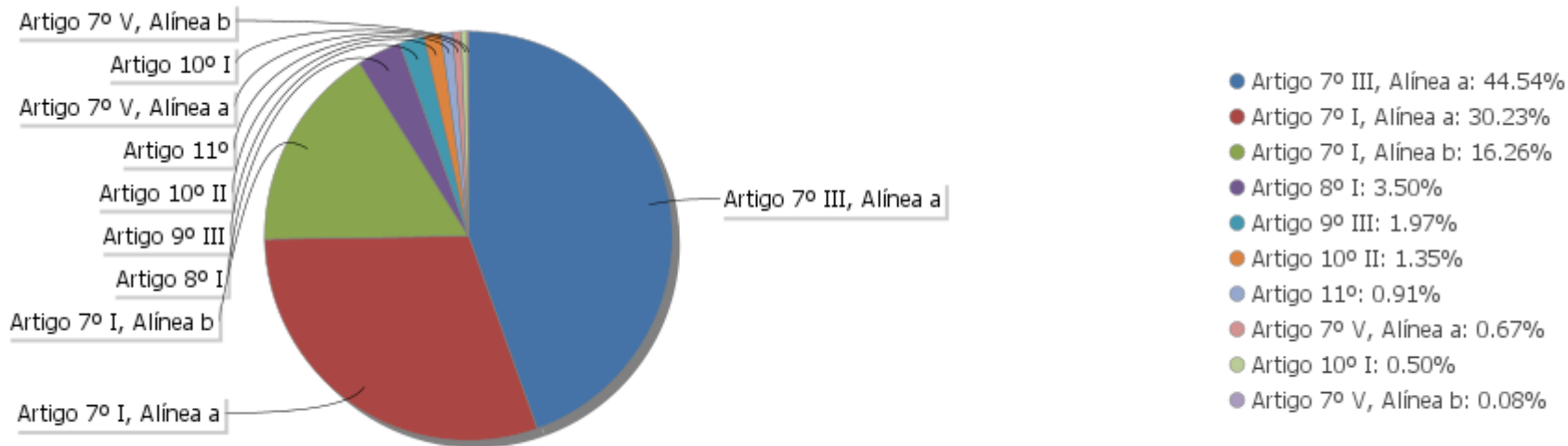
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

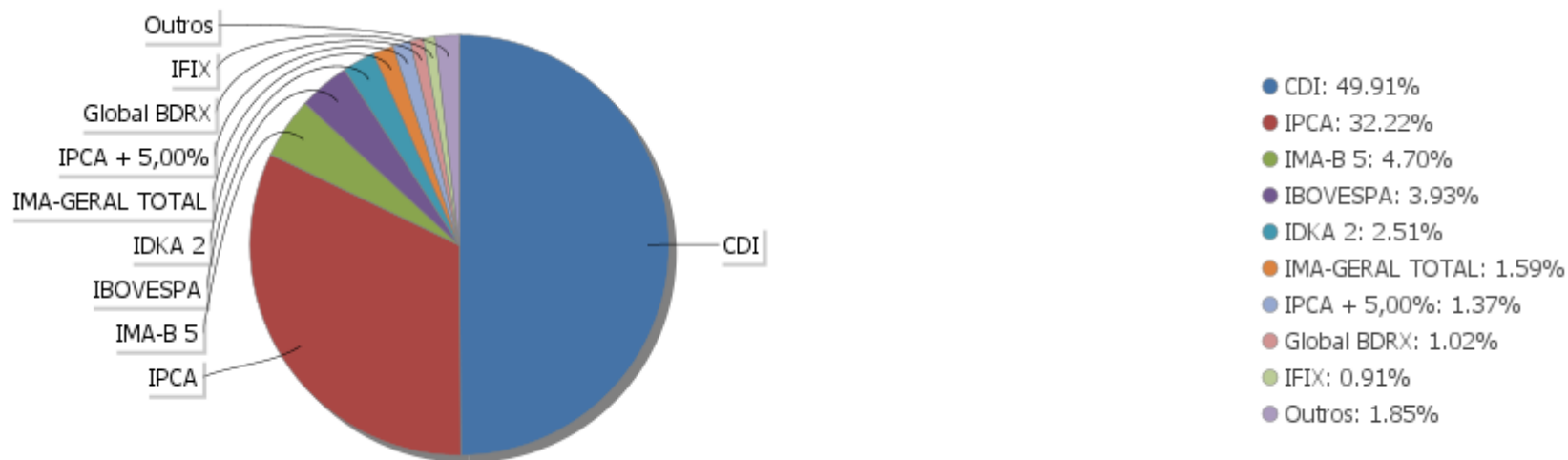
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	491.843.050,84	66,70	491.843.050,84	66,70	
de 31 dias a 365 dias	14.758.296,23	2,00	506.601.347,07	68,70	
acima de 365 dias	230.775.848,72	31,30	737.377.195,79	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

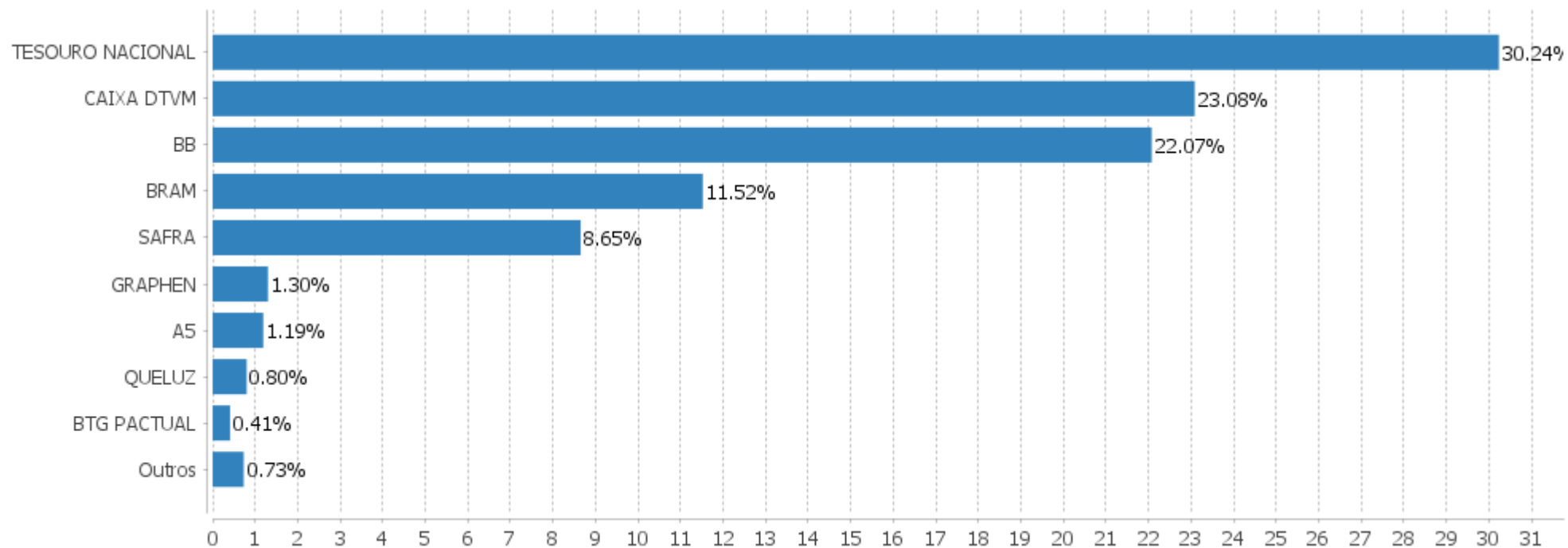


Alocação Por Estratégia



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	1,37	0,47	1,28	0,98	1,24	1,23							6,74
IPCA + 4,99%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,66	0,33							5,37
p.p. indexador	0,41	-0,72	0,12	0,02	0,58	0,91							1,38
2022	-0,24	0,09	1,80	-0,53	0,90	-0,52	1,28	0,41	-0,30	1,57	0,78	0,25	5,61
IPCA + 4,95%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,89	1,08	-0,28	0,08	0,11	0,98	0,80	1,05	11,00
p.p. indexador	-1,18	-1,28	-0,25	-1,96	0,01	-1,59	1,56	0,33	-0,42	0,59	-0,02	-0,80	-5,40
2021									-0,22	-0,44	1,12	1,14	1,59
IPCA + 5,45%									1,61	1,68	1,38	1,22	6,01
p.p. indexador									-1,83	-2,12	-0,26	-0,08	-4,42

Performance Sobre a Meta Atuarial

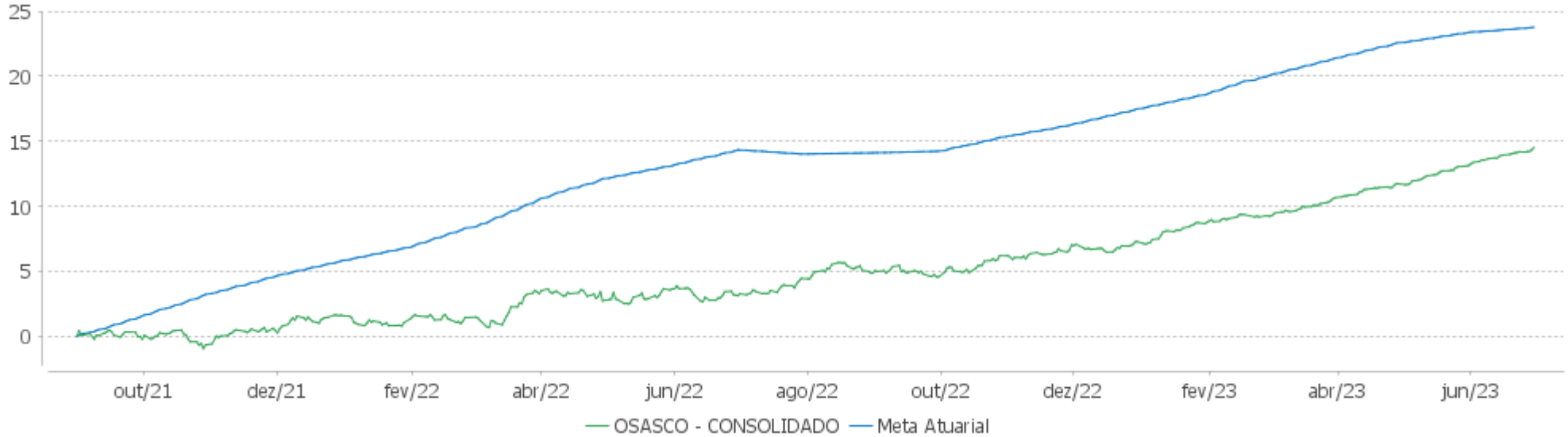
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	9	40,91	03 meses	3,48	1,96	1,53	0,86
Meses abaixo - Meta Atuarial	13	59,09	06 meses	6,74	5,37	1,38	1,14
			12 meses	11,05	8,27	2,78	1,91
			24 meses				
Desde 31/08/2021				14,52	23,99	-9,47	2,64

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,80	2022-03
Menor rentabilidade da Carteira	-0,53	2022-04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

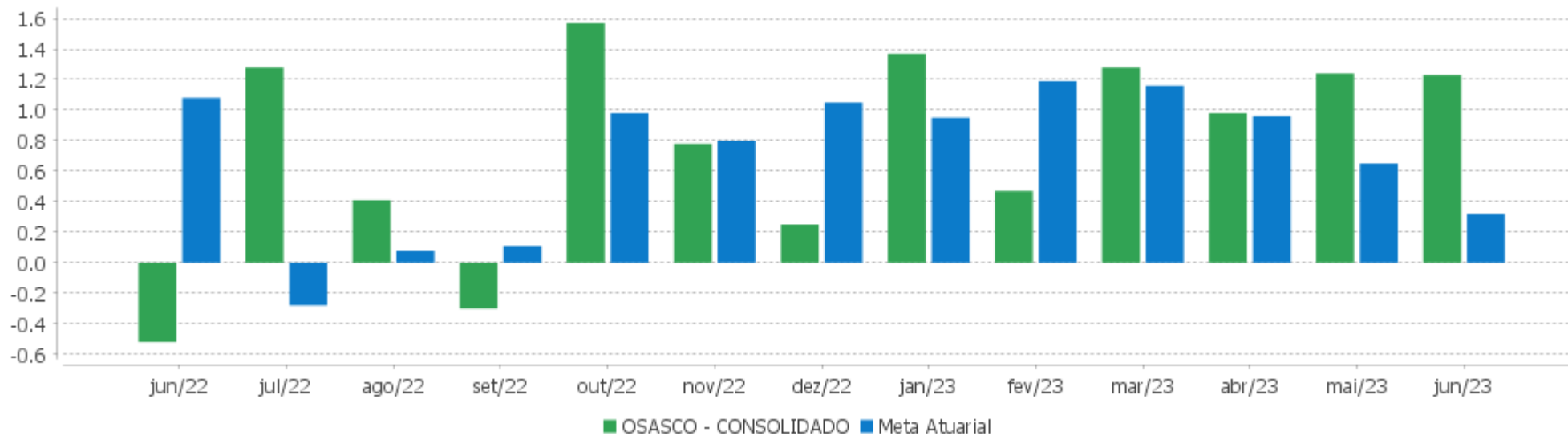


Patrimônio Líquido



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
PIATÃ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO % do CDI	-0,32 -30,13	-0,83 -12,72	-0,11 -3,40	-0,83 -12,72	-3,68 -27,17	-61,72 -264,12	-62,52 -238,92
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	3,77 3,85	15,84 12,97	12,54 11,78	15,84 12,97	17,40 14,24	11,97 -3,45	23,48 -1,58
NTN-B 150555 (5,742000%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,53	6,20 3,33	2,47 1,71	6,20 3,33	9,45 6,29	22,33 6,91	32,34 7,28
NTN-B 150545 (4,930000%) Var. IPCA p.p.	0,39 0,47	5,80 2,93	2,28 1,52	5,80 2,93	8,61 5,45	27,41 11,99	37,50 12,44
LTN 01012024 (6,030000%) Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,49 -1,25	2,92 -5,71	1,43 -3,40	2,92 -5,71	6,01 -8,01	12,40 -7,71	19,15 -5,22
NTN-F 2029 (12,000000%) Var. SELIC p.p.	0,95 -0,12	5,73 -0,76	2,78 -0,36	5,73 -0,76	11,95 -1,59	18,99 -4,38	19,90 -6,27
NTN-B 150840 (4,200000%) Var. IPCA p.p.	0,33 0,41	5,44 2,57	2,11 1,34	5,44 2,57	7,86 4,70	22,70 7,28	31,96 6,90
LTN 01012024 (6,100000%) Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,49 -1,24	2,96 -5,68	1,44 -3,39	2,96 -5,68	6,08 -7,94	12,55 -7,56	19,38 -4,98
NTN-B 150850 (5,730001%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,53	6,19 3,32	2,47 1,71	6,19 3,32	9,44 6,28	22,30 6,88	32,29 7,23
NTN-B 150850 (5,740002%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,53	6,20 3,33	2,47 1,71	6,20 3,33	9,45 6,29	22,32 6,89	32,31 7,25
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,02 0,05	6,56 -0,22	2,10 0,11	6,56 -0,22	9,43 0,15	20,20 -0,12	27,87 -0,96
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
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
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,04 0,07	6,60 -0,19	2,14 0,15	6,60 -0,19	9,23 -0,05	19,78 -0,54	27,45 -1,38
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,94 0,61	0,71 -0,01					
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI % do CDI	1,07 99,99	6,41 98,70	3,10 98,70	6,41 98,70	13,44 99,24	23,26 99,52	25,67 98,10
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	-0,38	-1,05	-0,99	-1,05	-0,38	3,64	-0,37

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-35,36	-16,21	-31,47	-16,21	-2,80	15,59	-1,42
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	-0,53	-3,16	-1,67	-3,16	-4,39	-24,64	
% do CDI	-49,34	-48,62	-53,02	-48,62	-32,40	-105,42	
ILLUMINATI FIDC	-3,78	-14,00	-9,05	-14,00	-18,95	-27,65	-26,17
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-4,19	-19,86	-11,24	-19,86	-28,27	-57,31	-75,04
MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA	-3,65	-17,73	-10,24	-17,73	-26,69	-53,77	-97,67
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-6,04	-29,09	-17,34	-29,09	-40,21	-71,58	-124,22
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	-0,50	1,77	0,38	1,77	3,02	13,78	3,51
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,89	-9,60	-6,72	-9,60	-10,50	-4,03	-23,05
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5	1,03	6,94	2,52	6,94	9,94	20,35	26,59
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,10	-0,02	-0,10	-0,29	-0,97	-2,09
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1,13	6,53	3,22	6,53	13,87	24,53	27,55
% do CDI	105,64	100,53	102,48	100,53	102,45	104,96	105,26
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1,09	6,44	3,16	6,44	13,54	23,74	26,65
% do CDI	101,92	99,04	100,55	99,04	99,98	101,59	101,82
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	-0,23	-1,14	-0,65	-1,14	-0,38	-4,23	-65,36
Var. IMA-B 5 p.p.	-1,28	-8,18	-3,19	-8,18	-10,61	-25,54	-94,03
FI BARCELONA RENDA FIXA	0,29	6,92	0,81	6,92	-25,20	-43,81	-44,16
% do CDI	27,20	106,53	25,70	106,53	-186,07	-187,48	-168,75
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,12	6,42	3,25	6,42	13,55	23,98	26,71
% do CDI	104,05	98,84	103,25	98,84	100,07	102,62	102,07
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,41	2,66	1,28	2,66	4,16	6,19	-19,08
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,64	-4,38	-1,26	-4,38	-6,06	-15,13	-47,76
BRA1 FI RENDA FIXA	0,49	3,50	1,51	3,50	6,25	10,53	8,38
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,91	-7,86	-5,59	-7,86	-7,28	-7,28	-18,18
TMJ IMA-B FI RF	2,28	6,45	3,41	6,45	31,16	-7,46	-39,03
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,11	-4,91	-3,69	-4,91	17,64	-25,27	-65,59
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	9,39	6,66	15,10	6,66	17,15	-33,62	-18,39
Var. IBOVESPA p.p.	0,38	-0,96	-0,81	-0,96	-2,69	-26,74	-42,61
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	9,77	13,72	19,95	13,72	20,91	2,63	46,63
Var. IBOVESPA p.p.	0,77	6,11	4,04	6,11	1,08	9,50	22,40
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	9,29	18,66	21,94	18,66	27,17	12,37	38,13
Var. IBOVESPA p.p.	0,29	11,05	6,03	11,05	7,34	19,24	13,90
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	8,03	13,04	24,57	13,04	18,85	-28,83	-2,28
Var. SMALL CAP p.p.	-0,14	-0,22	-0,60	-0,22	-0,94	-1,19	-3,32
FIA CAIXA DIVIDENDOS	8,54	8,46	13,30	8,46	16,15	7,61	29,17

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

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.	-0,46	0,85	-2,60	0,85	-3,68	14,48	4,94
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	8,13 -0,87	8,00 0,39	15,50 -0,40	8,00 0,39	14,08 -5,75	-28,45 -21,58	-0,57 -24,80
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	0,47 -0,02	14,53 -0,61	5,60 -0,29	14,53 -0,61	13,40 -1,04	-1,43 -2,02	24,43 -4,32
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	-0,06 -9,06	7,46 -0,15	2,43 -13,48	7,46 -0,15	6,61 -13,23	-9,35 -2,48	17,08 -7,15
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO % do CDI	0,06 6,05	-16,00 -246,22	-1,49 -47,31	-16,00 -246,22	-17,67 -130,46	-20,84 -89,18	-16,79 -64,16
WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP Var. IPCA + 7,00% p.p.	-0,08 -0,57	-1,64 -7,99	-0,64 -3,07	-1,64 -7,99	-2,33 -12,68	-22,96 -55,08	-21,53 -74,64
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA % do CDI	-0,15 -13,65	-0,87 -13,32	-0,43 -13,56	-0,87 -13,32	-8,46 -62,49	-9,80 -41,92	-8,96 -34,22
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,06 -0,46	-0,33 -6,19	-0,16 -2,36	-0,33 -6,19	-0,68 -10,01	-1,61 -31,27	-3,26 -52,14
SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII Var. IFIX p.p.	-0,24 -4,95	-0,72 -10,77	-0,50 -14,78	-0,72 -10,77	2,92 -9,94	1,62 -12,92	35,09 22,65
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO Var. IFIX p.p.	5,48 0,77	5,87 -4,18	5,61 -8,67	5,87 -4,18	6,62 -6,24	10,57 -3,97	11,77 -0,67
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII Var. IFIX p.p.	-0,15 -4,86	-1,54 -11,59	-0,49 -14,78	-1,54 -11,59	-2,44 -15,31	-33,52 -48,05	-34,25 -46,69
OSASCO - CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,95% p.p.	1,23 0,91	6,74 1,38	3,48 1,53	6,74 1,38	11,05 2,76		
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 PREV RF IDKA2	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 REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BRA1 FI RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1440	D+1445		1,30
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRANCO INST FIC FI RF IMA-B 5	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	Não se aplica	Não se aplica				
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)		3,00
FI BARCELONA RENDA FIXA	D+0	D+0	D+0 ou D+1260 (isento de taxa de resgate)	D+1 du ou D+1261 (isento de taxa de resgate)		0,00
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A 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
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	D+0	D+0	D+30 ou D+1440 (isento de taxa de resgate)	D+31 ou D+1441 (isento de taxa de resgate)	Adicionalmente à remuneração prevista no caput deste Artigo, o FUNDO, com base em seu resultado, pagará a GESTORA, a título de performance ("Prêmio"), o equivalente a 20% (vinte por cento) da valorização da cota do FUNDO que, em cada	1,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO	D+1 du	D+0	D+90 ou D+1440 (isento de taxa de resgate)	D+91 ou D+1441 (isento de taxa de resgate)	semestre civil, exceder o índiceIMA-B.	1,50
FIA CAIXA DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
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 FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	D+1 du	D+0	D+13 du	D+15 du		2,00
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Não se aplica	Não se aplica				
ILLUMINATI FIDC	D+0	D+0				
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	Não se aplica	Não se aplica				
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	D+0	D+0				
MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1370	D+1371		1,50
PIATÃ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+0	D+0	D+0 ou D+1080 (isento de taxa de resgate)	D+1 du ou D+1081 (isento de taxa de resgate)		1,40
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES			D+1 du	D+3 du		2,00
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI			D+0	D+0		0,10
SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	Não se aplica	Não se aplica				
TMJ IMA-B FI RF	D+0	D+0	D+30 ou D+1460 du (isento de taxa de resgate)	D+31 ou D+1461 du (isento de taxa de resgate)		0,80
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
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	Não se aplica	Não se aplica				
WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP	D+0	D+0	D+1460	D+1520		1,00

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	Não se aplica	Não se aplica				

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\$)
LTN 01012024 (6,030000%)	5.856.025,12	6,030000	5.677.847,79	12,789100	-178.177,33
LTN 01012024 (6,100000%)	5.862.830,47	6,100000	5.686.322,18	12,789100	-176.508,29
NTN-B 150545 (4,930000%)	28.439.784,42	4,930000	26.652.354,74	5,459700	-1.787.429,68
NTN-B 150555 (5,742000%)	43.190.729,61	5,742000	45.004.575,37	5,452600	1.813.845,76
NTN-B 150840 (4,200000%)	28.587.206,07	4,200000	25.229.897,60	5,371900	-3.357.308,47
NTN-B 150850 (5,730001%)	44.942.011,20	5,730001	46.569.303,35	5,459000	1.627.292,15
NTN-B 150850 (5,740002%)	43.703.618,96	5,740002	45.344.988,66	5,459000	1.641.369,70
NTN-F 2029 (12,000000%)	5.454.807,68	12,000000	5.756.637,70	10,549700	301.830,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3882	01/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	276.249,53	96.722,01628200	2,8561183960
3883	01/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	12.983.752,52	0,00	4.545.943,38182300	2,8561183960
3884	01/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	40.617,31	14.221,15765820	2,8561183960
3885	01/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	13.058.551,04	0,00	4.572.132,25414203	2,8561183960
3886	02/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.448.267,62	0,00	506.806,79879427	2,8576325800
3887	02/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	807.656,09	282.631,18766700	2,8576325800
3888	02/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	53.990,81	0,00	18.893,54508900	2,8576325800
3889	02/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	111.501,30	0,00	39.018,76706600	2,8576325800
3890	02/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	807.656,09	282.631,18766700	2,8576325800
3891	05/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	135.000,00	47.217,68087620	2,8590984880
3892	05/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000.000,00	3.497.605,99082900	2,8590984880
3893	05/06/2023	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	10.000.000,00	0,00	650.568,87300000	15,3711627000
3894	05/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	10.078.664,15	0,00	3.525.119,61105972	2,8590984880
3895	06/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	197.076,78	68.894,09703900	2,8605757020
3896	06/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000.000,00	3.495.799,81155835	2,8605757020
3897	06/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.315.378,04	459.829,83043600	2,8605757020
3898	06/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	57.727,96	0,00	20.180,53916800	2,8605757020
3899	06/06/2023	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	10.000.000,00	0,00	10.000.896,69039816	0,9999103390
3900	06/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.752.739,26	3.758.942,38788441	2,8605757020
3901	07/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	55.664,00	19.449,01624595	2,8620470720
3902	07/06/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.269.020,18	0,00	917.921,19891200	4,6507480000
3903	14/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	212.027,43	73.930,14259800	2,8679429330
3904	14/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	121.799,69	0,00	42.469,35620598	2,8679429330
3905	14/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	433.103,10	151.015,24337100	2,8679429330
3906	14/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	9.031.160,47	3.149.002,85012052	2,8679429330
3907	15/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	66.117,97	23.042,05490500	2,8694476370
3908	16/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	42.974,40	14.968,51751300	2,8709857180
3909	19/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000.000,00	1.740.636,93879800	2,8725117160

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3910	19/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	69.164,92	0,00	24.078,20292420	2,8725117160
3911	19/06/2023	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	5.000.000,00	0,00	323.689,32100000	15,4469106000
3912	19/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	115.989,16	40.379,00327923	2,8725117160
3913	20/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	340.137,03	0,00	118.350,36740276	2,8739837270
3914	20/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	38.635,18	13.443,07542073	2,8739837270
3915	22/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	47.756,51	16.599,85163911	2,8769239050
3916	22/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	287.710,14	100.006,16961100	2,8769239050
3917	23/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	55.854,92	0,00	19.404,80702700	2,8784063620
3918	27/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	9.923.298,43	0,00	3.444.008,16396800	2,8813225630
3919	29/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.702.136,24	590.136,32790500	2,8843102170
3920	29/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	38.285,94	13.273,86346113	2,8843102170
3921	29/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	13.673.549,13	4.740.665,22020000	2,8843102170
3922	29/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	621.288,17	215.402,68669374	2,8843102170
Total			77.571.730,57	65.698.770,94		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 2.774.779,53

Value-At-Risk: 0,38%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
OSASCO - CONSOLIDADO		0,38	0,38			737.377.195,79	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,18%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545		3,85	0,06	3,86			16.879.824,65	2,29
LTN 01012024 (6,030000%)		0,00	0,00	0,83			5.856.025,12	0,79
LTN 01012024 (6,100000%)		0,00	-0,00	0,83			5.862.830,47	0,80
NTN-B 150545 (4,930000%)		0,13	-0,00	0,12			28.439.784,42	3,86
NTN-B 150555 (5,742000%)		0,13	-0,00	0,12			43.190.729,61	5,86
NTN-B 150840 (4,200000%)		0,13	-0,00	0,12			28.587.206,07	3,88
NTN-B 150850 (5,730001%)		0,13	-0,00	0,12			44.942.011,20	6,09
NTN-B 150850 (5,740002%)		0,13	-0,00	0,12			43.703.618,96	5,93
NTN-F 2029 (12,000000%)		0,00	0,00	0,00			5.454.807,68	0,74
Sub-total	0,76	0,32	0,06		-0,51	0,69	222.916.838,18	30,23

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 2024 FI		0,61	0,00	0,67			10.072.029,72	1,37
BB PREV RF IDKA2		0,99	0,01	0,15			14.406.900,59	1,95
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,98	0,00	0,15			4.070.809,62	0,55
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		0,92	0,01	0,03			8.669.268,14	1,18
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,55	0,01	0,59			31.871.220,78	4,32
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI		0,01	-0,00	0,01			50.827.660,86	6,89
Sub-total	0,92	0,36	0,03		0,29	1,34	119.917.889,71	16,26

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,04	-0,00	0,04			109.943.676,65	14,91
BRA1 FI RENDA FIXA		0,19	-0,00	1,87			183.728,00	0,02
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			129.605.443,61	17,58
TMJ IMA-B FI RF		0,69	-0,00	2,03			883.650,12	0,12
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5		0,34	-0,00	0,98			915.513,29	0,12
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5		0,80	0,01	0,13			23.963.253,53	3,25
FI BARCELONA RENDA FIXA		0,16	0,00	0,16			375.490,96	0,05
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B		0,61	0,00	1,83			438.134,84	0,06
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,03			60.999.899,55	8,27
MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA		0,23	-0,00	1,86			32.567,75	0,00
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5		0,12	-0,00	0,90			1.121.081,84	0,15
Sub-total	0,13	0,06	0,01		0,18	1,10	328.462.440,14	44,54

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC		0,07	-0,00	0,07			3.332.953,35	0,45
ILLUMINATI FIDC		0,63	0,00	0,64			1.272.794,14	0,17
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC		0,14	0,00	0,14			313.714,49	0,04
Sub-total	3,82	0,20	0,00		-0,64	-1,36	4.919.461,98	0,67

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PIATÁ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO		0,03	0,00	0,03			561.554,82	0,08
Sub-total	2,19	0,03	0,00		-0,64	-0,32	561.554,82	0,08

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,46%

Artigo 8º I

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA DIVIDENDOS		7,31	0,03	2,83			4.015.700,22	0,54
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA		8,38	0,05	3,87			5.702.963,75	0,77
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		8,98	0,03	3,84			3.039.440,64	0,41
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		11,19	0,05	0,18			3.871.301,10	0,53
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE		8,41	0,03	4,16			3.216.848,78	0,44
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES		9,06	0,06	1,53			5.932.925,00	0,80
Sub-total	16,37	8,46	0,26		0,47	8,79	25.779.179,49	3,50

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,23%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		7,63	0,01	0,62			7.505.867,93	1,02
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		7,14	0,01	11,89			7.056.368,99	0,96
Sub-total	12,75	7,23	0,02		-0,07	0,21	14.562.236,92	1,97

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,08%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP		0,27	0,00	0,30			374.747,43	0,05
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO		0,32	0,00	0,32			3.285.751,58	0,45
Sub-total	0,60	0,29	0,00		-1,70	0,05	3.660.499,01	0,50

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA		0,03	0,00	0,03			8.795.866,26	1,19
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP		0,01	0,00	0,12			1.122.352,33	0,15
Sub-total	0,47	0,03	0,00		-2,56	-0,14	9.918.218,59	1,35

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,24%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO		0,25	0,00	2,16			6.261.829,93	0,85
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII		0,06	0,00	2,20			60.821,64	0,01
SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII		0,04	0,00	2,19			356.225,38	0,05
Sub-total	17,10	0,24	0,00		0,23	5,07	6.678.876,95	0,91