



LIMEIRA - CONSOLIDADO

AGOSTO 2024



Carteira: LIMEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/08/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Titulos do Tesouro Nacional	75.683.551,80	8,75	0,00	8,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Titulos Públicos	384.605.429,62	44,47	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	271.536.271,72	31,40	0,00	30,00	60,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.625.809,35	0,19	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	7.963.416,24	0,92	0,00	2,50	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	741.414.478,73	85,72					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	75.106.093,82	8,68	0,00	7,00	30,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	75.106.093,82	8,68					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	16.660.627,39	1,93	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	16.660.627,39	1,93					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	24.435.017,95	2,83	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	4.040.416,89	0,47	0,00	1,50	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	28.475.434,84	3,29					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	3.244.239,51	0,38	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	3.244.239,51	0,38					5,00
Total		864.900.874,29	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	Atribuição Desemp. (%)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,21 59,02	0,21 59,02				102.850,09	0,01	102.850,09
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,70 80,35	3,60 50,72	1,85 71,70	2,64 50,47	7,54 67,26	3.752.408,59	0,45	19.025.381,54
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,87 100,72	7,22 101,73	2,66 102,91	5,28 100,92	11,41 101,79	2.349.383,18	0,28	12.844.197,36
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-3,62 -416,88	-7,39 -104,08	-4,66 -180,26	-6,12 -117,14	-9,19 -81,97	-61.003,23	-0,01	-129.668,72
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,06 122,48	5,05 71,20	2,40 92,66	3,61 69,06	8,38 74,76	111.493,70	0,01	814.258,87
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,83 -0,71	-0,12 -1,48	11,08 -0,31	2,29 -3,12	14,66 -2,85	4.140.699,78	0,49	-184.661,28
Artigo 9º III % do CDI	0,74 85,49	33,12 466,64	11,15 431,51	19,70 376,76	38,11 340,00	351.283,70	0,04	3.101.794,52
Artigo 10º I % do CDI	2,86 329,98	10,35 145,83	6,49 251,25	7,87 150,54	18,08 161,28	794.404,32	0,09	1.529.189,61
Artigo 10º II % do CDI	-0,12 -13,54	-55,14 -776,92	-19,73 -763,40	-20,06 -383,67	-55,39 -494,12	-4.751,14	-0,00	-4.965.548,01
Artigo 11º % do CDI	0,02 1,91	-1,49 -20,96	-1,45 -56,27	-1,50 -28,77	-1,58 -14,07	537,04	0,00	-49.039,06
LIMEIRA - CONSOLIDADO (Total)						11.537.306,03	1,37	32.088.754,92

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 (5,895000%)	0,00	15.500.801,09	0,00	0,00	15.533.029,90	32.228,81	32.228,81
NTN-B 150535 (6,110000%)	0,00	29.685.031,86	0,00	0,00	29.692.151,34	7.119,48	7.119,48
NTN-B 150830 (5,922000%)	0,00	15.199.632,09	0,00	0,00	15.231.367,95	31.735,86	31.735,86
NTN-B 150830 (5,928000%)	0,00	15.195.236,67	0,00	0,00	15.227.002,61	31.765,94	31.765,94
	0,00	75.580.701,71	0,00	0,00	75.683.551,80	102.850,09	

9 de 33

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
2024	0,14	0,27	0,51	-0,67	0,62	0,31	1,29	1,37					3,89
IPCA + 5,01% p.p. indexador	0,85 -0,71	1,20 -0,93	0,55 -0,04	0,81 -1,48	0,87 -0,25	0,60 -0,29	0,83 0,46	0,41 0,96					6,28 -2,39
2023	1,17	0,21	1,00	1,06	1,42	2,05	1,23	0,20	0,23	-0,22	2,79	1,91	13,82
IPCA + 4,86% p.p. indexador	0,95 0,23	1,18 -0,97	1,15 -0,14	0,95 0,11	0,65 0,77	0,32 1,73	0,52 0,72	0,67 -0,46	0,64 -0,41	0,64 -0,85	0,66 2,14	0,94 0,97	9,64 4,17
2022	0,39	0,56	2,51	-0,28	1,03	-1,14	0,58	1,22	0,50	1,91	-0,88	0,32	6,87
IPCA + 5,04% p.p. indexador	0,95 -0,56	1,39 -0,82	2,06 0,46	1,44 -1,72	0,90 0,13	1,08 -2,23	0,09 0,85	0,09 1,13	0,12 0,38	0,98 0,92	0,80 -1,69	1,05 -0,74	11,09 -4,23
2021	-0,50	-1,09	0,52	1,07	1,22	0,17	-0,77	-0,76	-0,53	-2,26	1,91	0,86	-0,23
IPCA + 5,47% p.p. indexador	0,67 -1,18	1,24 -2,33	1,42 -0,90	0,73 0,33	1,28 -0,05	0,98 -0,81	1,43 -2,21	1,34 -2,10	1,61 -2,14	1,68 -3,94	1,38 0,54	1,22 -0,36	16,06 -16,29
2020	0,60	-0,35	-5,55	1,29	2,05	1,32	2,19	-0,04	-1,01	-0,16	2,24	2,91	5,34
IPCA + 5,89% p.p. indexador	0,71 -0,11	0,66 -1,01	0,57 -6,12	0,14 1,15	0,07 1,98	0,74 0,58	0,89 1,31	0,72 -0,76	1,12 -2,13	1,34 -1,50	1,35 0,89	1,86 1,05	10,65 -5,31
2019	2,23	0,30	0,51	1,03	1,71	2,00	1,10	-0,02	1,72	1,82	-0,40	1,66	14,50
IPCA + 6,00% p.p. indexador	0,83 1,40	0,90 -0,60	1,19 -0,69	1,06 -0,03	0,64 1,07	0,45 1,55	0,72 0,37	0,62 -0,65	0,45 1,27	0,63 1,19	0,98 -1,38	1,64 0,01	10,59 3,91
2018	1,94	0,39	0,93	0,56	-1,58	-0,01	1,40	-0,08	0,56	2,85	0,55	1,19	8,99
IPCA + 6,00% p.p. indexador	0,80 1,14	0,74 -0,35	0,58 0,35	0,71 -0,14	0,89 -2,47	1,75 -1,76	0,84 0,56	0,44 -0,52	0,92 -0,36	0,96 1,88	0,25 0,30	0,61 0,58	9,92 -0,93
2017	1,42	1,04	0,99	0,49	0,17	-0,90	1,32	0,75	1,09	0,41	-0,14	0,26	7,11
IPCA + 6,00% p.p. indexador	0,89 0,52	0,75 0,29	0,78 0,20	0,56 -0,06	0,62 -0,65	0,26 -1,15	0,73 0,60	0,72 0,03	0,62 0,47	0,91 -0,50	0,74 -0,88	0,91 -0,64	9,05 -1,93

Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	42	45,65	03 meses	3,00	1,85	1,16	2,36
Meses abaixo - Meta Atuarial	50	54,35	06 meses	3,47	4,13	-0,67	2,29
			12 meses	8,84	9,37	-0,53	2,54
			24 meses	20,41	20,01	0,40	2,96
Maior rentabilidade da Carteira	2,91	2020-12	36 meses	26,28	37,25	-10,97	3,39
Menor rentabilidade da Carteira	-5,55	2020-03	48 meses	31,08	58,95	-27,86	3,60
			60 meses	39,27	72,47	-33,20	4,91

16 de 33



LIMEIRA - CONSOLIDADO

SETEMBRO 2024



Carteira: LIMEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Titulos do Tesouro Nacional	82.244.344,43	9,40	0,00	8,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Titulos Públicos	387.581.248,34	44,29	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	263.384.134,49	30,09	0,00	30,00	60,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.616.697,48	0,18	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	7.964.739,88	0,91	0,00	2,50	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	742.791.164,62	84,87					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	77.588.232,66	8,87	0,00	7,00	30,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	77.588.232,66	8,87					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	16.680.206,82	1,91	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	16.680.206,82	1,91					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	30.852.211,01	3,53	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	4.035.677,77	0,46	0,00	1,50	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	34.887.888,78	3,99					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	3.240.358,82	0,37	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	3.240.358,82	0,37					5,00
Total		875.187.851,70	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	Atribuição Desemp. (%)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,68 81,76	0,89 74,92				524.935,24	0,06	627.785,33
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,37 43,96	3,98 49,80	2,42 91,85	2,52 48,14	7,91 71,58	1.397.175,60	0,16	20.422.557,14
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,85 102,05	8,13 101,77	2,71 103,08	5,26 100,69	11,32 102,43	2.248.862,77	0,26	15.093.060,13
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,56 -67,18	-7,91 -98,94	-4,53 -172,09	-6,15 -117,70	-9,24 -83,58	-9.111,87	-0,00	-138.780,59
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,02 1,99	5,07 63,46	2,44 92,66	2,84 54,25	8,10 73,23	1.323,64	0,00	815.582,51
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-3,36 -0,28	-3,48 -1,71	5,86 -0,52	-0,59 -3,49	9,68 -3,41	-2.517.861,16	-0,30	-2.702.522,44
Artigo 9º III % do CDI	-0,11 -13,41	32,97 412,60	0,38 14,51	16,59 317,38	42,85 387,62	19.579,43	0,00	3.121.373,95
Artigo 10º I % do CDI	1,77 212,02	12,30 153,95	6,46 245,61	7,86 150,35	22,05 199,48	584.731,54	0,07	2.113.921,15
Artigo 10º II % do CDI	-0,12 -14,06	-55,19 -690,70	-19,72 -749,54	-20,05 -383,42	-55,38 -500,94	-4.739,12	-0,00	-4.970.287,13
Artigo 11º % do CDI	-0,12 -14,34	-1,61 -20,09	-0,10 -3,95	-1,61 -30,76	-0,51 -4,58	-3.880,69	-0,00	-52.919,75
LIMEIRA - CONSOLIDADO (Total)						2.241.015,38	0,26	34.329.770,30

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 (5,895000%)	15.533.029,90	0,00	0,00	0,00	15.637.590,80	104.560,90	136.789,71
NTN-B 150535 (6,110000%)	29.692.151,34	0,00	0,00	0,00	29.897.149,21	204.997,87	212.117,35
NTN-B 150535 (6,500000%)	0,00	6.035.857,39	0,00	0,00	6.045.453,86	9.596,47	9.596,47
NTN-B 150830 (5,922000%)	15.231.367,95	0,00	0,00	0,00	15.334.239,48	102.871,53	134.607,39
NTN-B 150830 (5,928000%)	15.227.002,61	0,00	0,00	0,00	15.329.911,08	102.908,47	134.674,41

9 de 32

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
2024	0,14	0,27	0,51	-0,67	0,62	0,31	1,29	1,37	0,26				4,16
IPCA + 5,01% p.p. indexador	0,85 -0,71	1,20 -0,93	0,55 -0,04	0,81 -1,48	0,87 -0,25	0,60 -0,29	0,83 0,46	0,41 0,96	0,85 -0,59				7,18 -3,02
2023	1,17	0,21	1,00	1,06	1,42	2,05	1,23	0,20	0,23	-0,22	2,79	1,91	13,82
IPCA + 4,86% p.p. indexador	0,95 0,23	1,18 -0,97	1,15 -0,14	0,95 0,11	0,65 0,77	0,32 1,73	0,52 0,72	0,67 -0,46	0,64 -0,41	0,66 -0,85	0,94 2,14	0,97	9,64 4,17
2022	0,39	0,56	2,51	-0,28	1,03	-1,14	0,58	1,22	0,50	1,91	-0,88	0,32	6,87
IPCA + 5,04% p.p. indexador	0,95 -0,56	1,39 -0,82	2,06 0,46	1,44 -1,72	0,90 0,13	1,08 -2,23	0,09 0,85	0,12 1,13	0,98 0,38	0,80 0,92	1,05 -1,69	1,05 -0,74	11,09 -4,23
2021	-0,50	-1,09	0,52	1,07	1,22	0,17	-0,77	-0,76	-0,53	-2,26	1,91	0,86	-0,23
IPCA + 5,47% p.p. indexador	0,67 -1,18	1,24 -2,33	1,42 -0,90	0,73 0,33	1,28 -0,05	0,98 -0,81	1,43 -2,21	1,34 -2,10	1,61 -2,14	1,68 -3,94	1,38 0,54	1,22 -0,36	16,06 -16,29
2020	0,60	-0,35	-5,55	1,29	2,05	1,32	2,19	-0,04	-1,01	-0,16	2,24	2,91	5,34
IPCA + 5,89% p.p. indexador	0,71 -0,11	0,66 -1,01	0,57 -6,12	0,14 1,15	0,07 1,98	0,74 0,58	0,89 1,31	0,72 -0,76	1,12 -2,13	1,34 -1,50	1,35 0,89	1,86 1,05	10,65 -5,31
2019	2,23	0,30	0,51	1,03	1,71	2,00	1,10	-0,02	1,72	1,82	-0,40	1,66	14,50
IPCA + 6,00% p.p. indexador	0,83 1,40	0,90 -0,60	1,19 -0,69	1,06 -0,03	0,64 1,07	0,45 1,55	0,72 0,37	0,62 -0,65	0,45 1,27	0,63 1,19	0,98 -1,38	1,64 0,01	10,59 3,91
2018	1,94	0,39	0,93	0,56	-1,58	-0,01	1,40	-0,08	0,56	2,85	0,55	1,19	8,99
IPCA + 6,00% p.p. indexador	0,80 1,14	0,74 -0,35	0,58 0,35	0,71 -0,14	0,89 -2,47	1,75 -1,76	0,84 0,56	0,44 -0,52	0,92 -0,36	0,96 1,88	0,25 0,30	0,61 0,58	9,92 -0,93
2017	1,42	1,04	0,99	0,49	0,17	-0,90	1,32	0,75	1,09	0,41	-0,14	0,26	7,11
IPCA + 6,00% p.p. indexador	0,89 0,52	0,75 0,29	0,78 0,20	0,56 -0,06	0,62 -0,65	0,26 -1,15	0,73 0,60	0,72 0,03	0,62 0,47	0,91 -0,50	0,74 -0,88	0,91 -0,64	9,05 -1,93

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	42	45,16
Meses abaixo - Meta Atuarial	51	54,84
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,91	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-5,55	2020-03

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,95	2,10	0,85	2,14
06 meses	3,21	4,44	-1,23	2,31
12 meses	8,88	9,60	-0,72	2,46
24 meses	20,13	20,89	-0,76	2,87
36 meses	27,28	36,22	-8,94	3,31
48 meses	32,77	58,52	-25,75	3,53
60 meses	37,27	73,16	-35,89	4,91

16 de 32