



**LDB**  
EMPRESAS

**LENÇÓIS PAULISTA**  
OUTUBRO 2021



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 29.10.2021.

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

99,02%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,57	-0,62	1,07	8.868.570,10	2,19	161.739.642,12	5,48
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,58	-2,56	-4,97	52.785,57	0,01	437.560.103,51	0,01
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,58	-0,52	1,00	40.227.423,28	9,92	6.857.913.148,95	0,59
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,61	-2,58	-4,98	128.719,84	0,03	6.948.438.281,62	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,59	-2,58	-5,08	13.147.932,41	3,24	609.574.848,27	2,16
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,58	-0,47	1,17	13.574.459,98	3,35	105.867.861,90	12,82
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,58	-0,54	1,05	50.624.305,97	12,49	6.589.712.896,46	0,77
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,58	-0,55	1,01	61.795.635,83	15,24	625.705.942,27	9,88
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,69	-1,24	1,03	48.005.218,91	11,84	10.998.044.937,35	0,44
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,50	-1,25	1,45	62.147.798,07	15,33	9.253.803.912,06	0,67
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	5,59	-2,56	-5,00	781.172,49	0,19	1.083.533.278,18	0,07
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,63</b>	<b>-0,90</b>	<b>0,47</b>	<b>299.354.022,45</b>	<b>73,83</b>		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,14	0,60	3,51	16.910,06	0,00	1.527.024.616,05	0,00
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,11	0,49	3,14	1.394.709,82	0,34	6.213.259.499,94	0,02
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,95	-0,36	1,96	69.179.866,81	17,06	2.956.661.982,44	2,34
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	0,85	-0,55	1,08	31.528.994,49	7,78	777.995.461,61	4,05
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>0,89</b>	<b>-0,37</b>	<b>1,86</b>	<b>102.120.481,18</b>	<b>25,19</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,44</b>	<b>-0,76</b>	<b>0,76</b>	<b>401.474.503,63</b>	<b>99,02</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,98%

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	13,17	7,57	4,95	1.857.674,77	0,46	281.131.662,80	0,66
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,18	7,64	5,70	2.114.080,98	0,52	3.490.527.601,78	0,06
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>11,87</b>	<b>7,61</b>	<b>5,62</b>	<b>3.971.755,75</b>	<b>0,98</b>		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			5,86	7,61	5,62	3.971.755,75	0,98		
Total			1,44	-0,69	0,81	405.446.259,38	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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	299.354.022,45	73,83	60,00	80,00	98,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	102.120.481,18	25,19	2,00	10,00	40,00	0,00	40,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>401.474.503,63</b>	<b>99,02</b>					100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	3.971.755,75	0,98	0,00	1,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>3.971.755,75</b>	<b>0,98</b>					30,00

## 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	-0,90 -186,44	0,47 15,52	-0,26 -19,10	0,36 15,69	2,52 75,87	-2.714.779,69	1.733.687,28
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,37 -77,87	1,86 62,07	0,69 51,10	1,43 62,35	2,21 66,41	-401.750,49	1.299.772,33
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	7,61 14,35	5,62 21,87				280.886,98	201.755,75
<b>LENÇÓIS PAULISTA (Total)</b>						<b>-2.835.643,20</b>	<b>3.235.215,36</b>

## RESULTADO POR ATIVO

## Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IDKA2	61.865.367,70	1.076.320,83	0,00	0,00	62.147.798,07	-793.890,46	802.718,88
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	132.131,75	0,00	0,00	0,00	128.719,84	-3.411,91	-52.673,76
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	40.437.188,13	0,00	0,00	0,00	40.227.423,28	-209.764,85	515.391,81
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	62.134.480,73	0,00	0,00	0,00	61.795.635,83	-338.844,90	621.835,58
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	13.496.274,63	0,00	0,00	0,00	13.147.932,41	-348.342,22	-697.513,33
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	48.609.946,77	0,00	0,00	0,00	48.005.218,91	-604.727,86	474.446,91
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.896.944,35	0,00	0,00	0,00	50.624.305,97	-272.638,38	525.241,06
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	54.169,73	0,00	0,00	0,00	52.785,57	-1.384,16	-64.317,58
ITAU SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	7.160.974,60	1.765.000,00	0,00	0,00	8.868.570,10	-57.404,50	16.529,79
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.638.268,05	0,00	0,00	0,00	13.574.459,98	-63.808,07	155.388,73
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	801.734,87	0,00	0,00	0,00	781.172,49	-20.562,38	-553.622,16
					299.354.022,45	0,00	0,00

## Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.925.246,12	0,00	-2.548.768,24	0,00	1.394.709,82	18.231,94	29.539,24
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	69.426.539,32	0,00	0,00	0,00	69.179.866,81	-246.672,51	1.314.524,34

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	16.809,79	0,00	0,00	0,00	16.910,06	100,27	573,00
SANTANDER RF ATIVO FIC	31.702.404,68	0,00	0,00	0,00	31.528.994,49	-173.410,19	-44.864,25
					102.120.481,18	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	1.726.884,90	0,00	0,00	0,00	1.857.674,77	130.789,87	87.674,77
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.963.983,87	0,00	0,00	0,00	2.114.080,98	150.097,11	114.080,98
					3.971.755,75	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

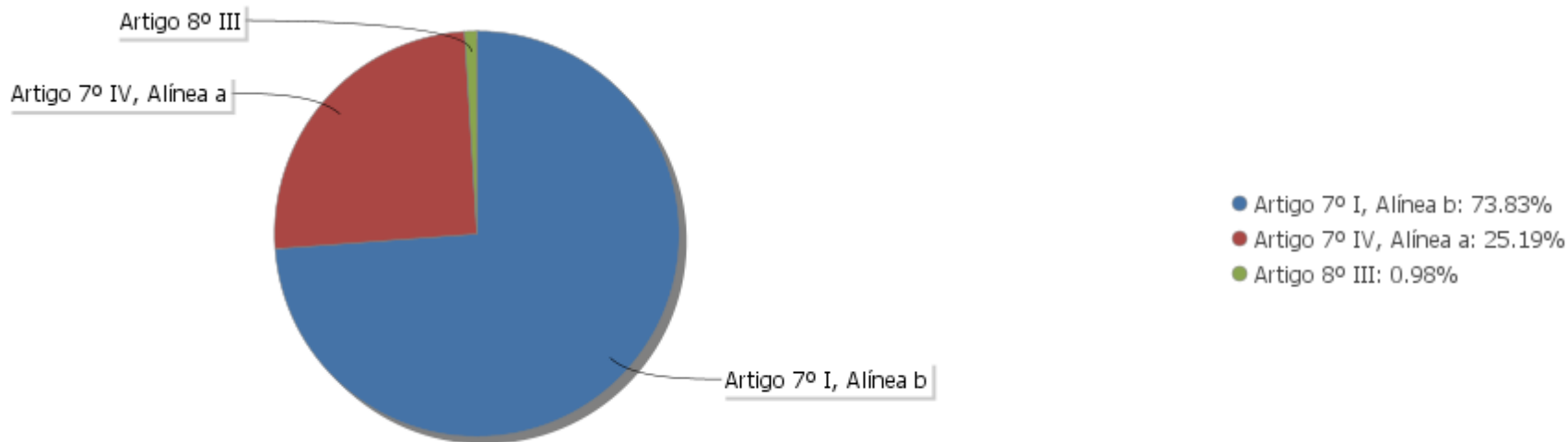
## Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	405.446.259,38	100,00	405.446.259,38	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	405.446.259,38	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	405.446.259,38	100,00

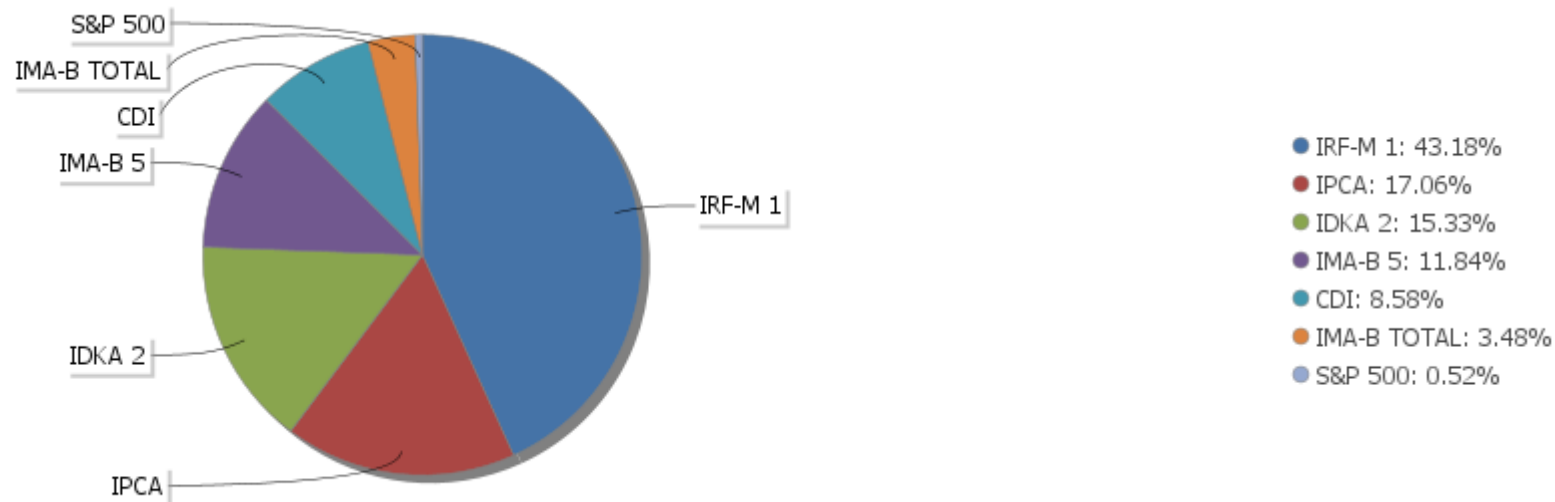


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

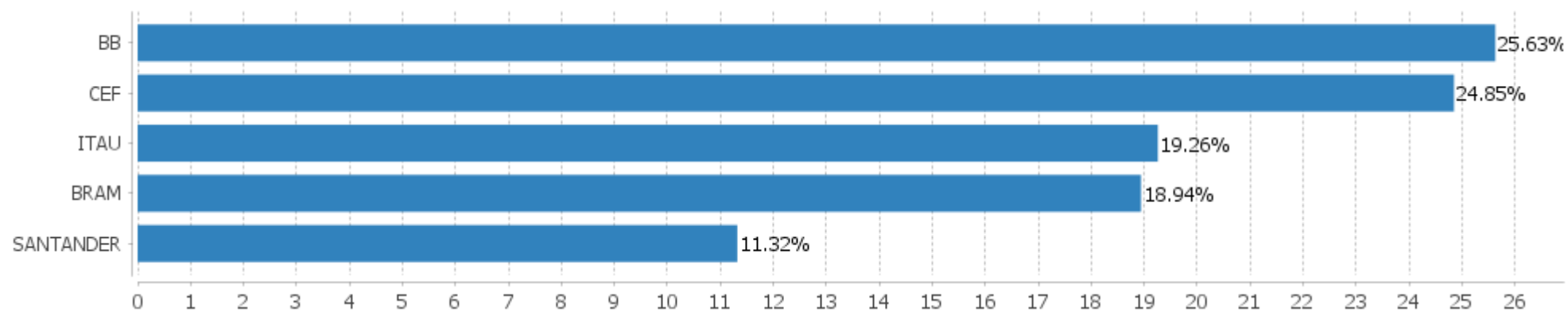


Alocação Por Estratégia



## 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
2021	-0,02	-0,30	0,07	0,41	0,41	0,14	0,08	0,15	0,54	-0,69			0,81
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,67			13,05
p.p. indexador	-0,69	-1,54	-1,35	-0,32	-0,86	-0,83	-1,34	-1,18	-1,06	-2,36			-12,24
2020	0,36	0,42	-0,38	0,41	0,83	0,58	0,66	0,03	-0,19	0,16	0,64	1,09	4,71
IPCA + 6,00%	0,72	0,67	0,58	0,15	0,08	0,75	0,90	0,73	1,13	1,35	1,36	1,87	10,76
p.p. indexador	-0,36	-0,25	-0,96	0,26	0,75	-0,17	-0,23	-0,70	-1,32	-1,19	-0,72	-0,77	-6,05
2019	0,87	0,34	0,50	0,87	1,64	2,45	1,12	-0,16	2,15	2,42	-1,46	1,38	12,76
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	0,04	-0,55	-0,69	-0,19	1,00	2,00	0,40	-0,78	1,70	1,79	-2,43	-0,26	2,17
2018												0,76	0,76
IPCA + 6,00%												0,61	0,61
p.p. indexador												0,15	0,15

**Performance Sobre a Meta Atuarial**

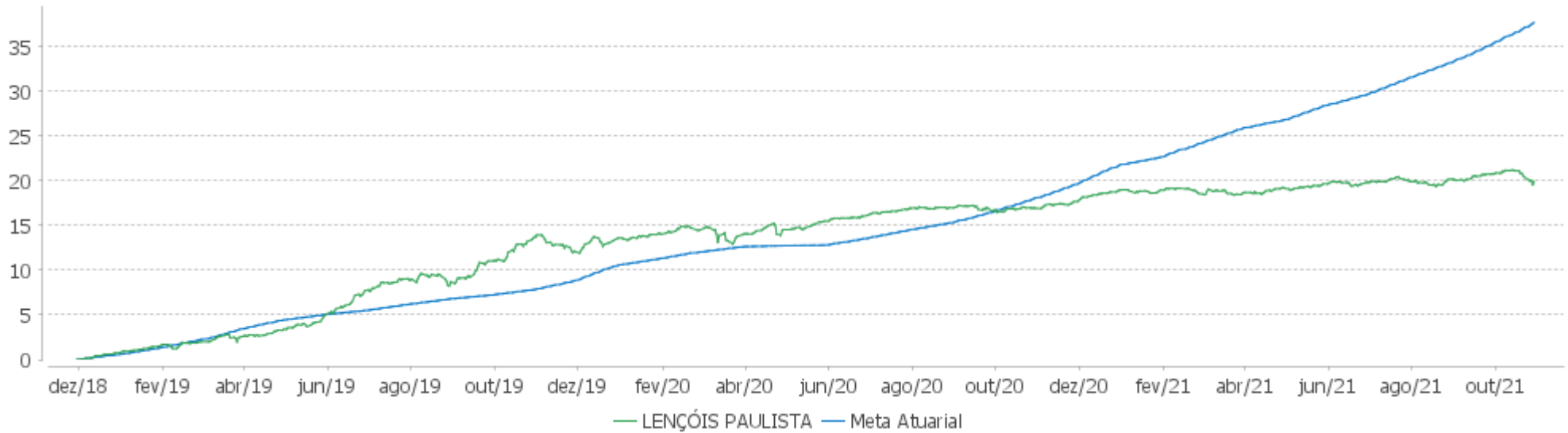
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	9	25,71
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	74,29
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,45	2019-06
Menor rentabilidade da Carteira	-1,46	2019-11

**Relatório**

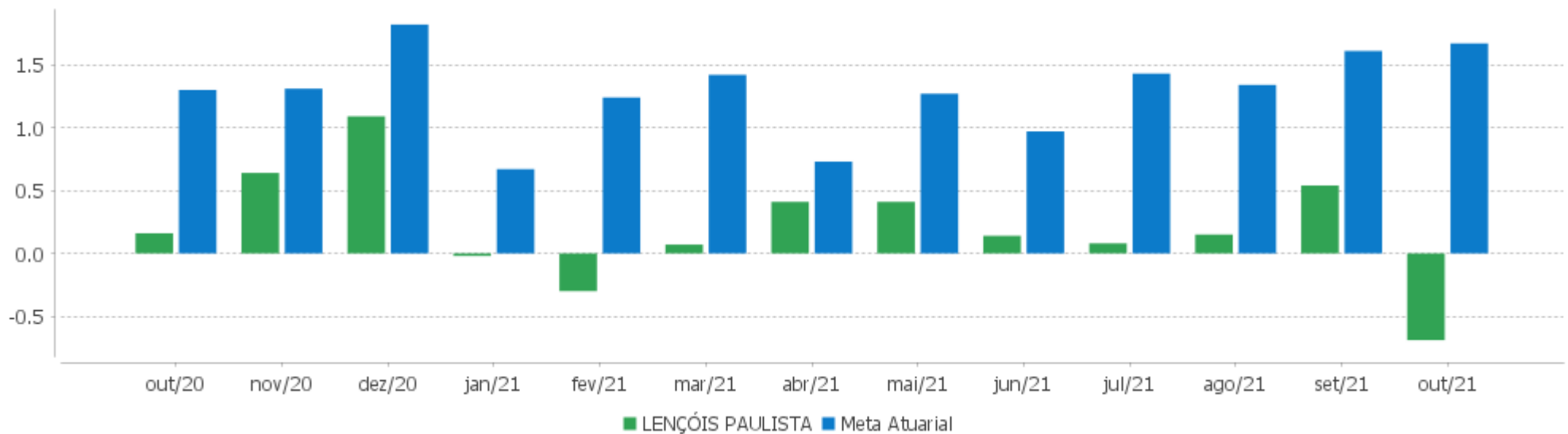
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,01	4,69	-4,68	1,88
06 meses	0,65	8,58	-7,93	1,59
12 meses	2,56	16,72	-14,16	1,44
24 meses	5,46	28,51	-23,05	2,03
Desde 30/11/2018	19,93	39,32	-19,39	2,16

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



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
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	-0,62 -0,08	1,07 -0,17	0,06 -0,17	0,70 -0,13	1,60 -0,18	5,28 -0,63	12,60 -0,87
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,56 -0,01	-4,97 -0,18	-3,78 -0,05	-2,78 -0,11	1,58 -0,25	0,31 -0,50	26,62 -1,15
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-1,24 -0,01	1,03 -0,19	-0,14 -0,05	0,39 -0,10	4,19 -0,24	9,79 -0,60	24,71 -0,90
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	-1,25 0,21	1,45 -0,11	-0,05 0,07	0,61 0,35	4,38 -0,24	10,97 -0,69	23,36 -1,76
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	-0,55 -0,01	1,01 -0,23	0,19 -0,03	0,79 -0,04	1,53 -0,24	5,26 -0,65	12,48 -0,99
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	-0,47 0,07	1,17 -0,06	0,26 0,03	0,83 0,01	1,79 0,02	5,41 -0,50	12,75 -0,72
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	-0,52 0,02	1,00 -0,23	0,18 -0,05	0,70 -0,12	1,52 -0,26	5,24 -0,67	12,47 -1,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	-0,54 0,00	1,05 -0,18	0,18 -0,04	0,71 -0,12	1,55 -0,22	5,47 -0,44	12,78 -0,69
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,58 -0,04	-4,98 -0,20	-3,83 -0,10	-2,83 -0,15	1,60 -0,23	0,29 -0,52	26,82 -0,94
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,58 -0,04	-5,08 -0,30	-3,82 -0,09	-2,84 -0,17	1,46 -0,37	0,11 -0,70	26,44 -1,32
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,56 -0,02	-5,00 -0,22	-3,80 -0,06	-2,80 -0,13	1,55 -0,28	0,01 -0,80	26,44 -1,33
SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI	-0,55 -113,86	1,08 35,94	-0,02 -1,23	0,90 39,26	1,84 55,23	4,42 66,44	20,18 152,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,49 101,77	3,14 104,82	1,40 103,92	2,43 105,81	3,57 107,34	6,36 95,52	12,75 96,06
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,60 124,18	3,51 116,92	1,58 117,48	2,68 116,72	3,96 119,13	6,40 96,19	12,94 97,45
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	-0,36 -1,61	1,96 -6,28	0,79 -2,53	1,51 -4,22	2,27 -8,40	5,61 -9,40	20,03 2,10
BRADERCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	7,57 1.576,57	25,56 852,14	5,89 436,98	11,78 514,05	43,17 1.299,05	50,43 757,90	72,53 546,24
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	7,64	26,45	6,08	12,36	44,33	49,77	73,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. S&P 500 p.p.	-3,27	-6,69	-9,37	-2,67	6,63	-63,90	-84,22
LENÇÓIS PAULISTA	-0,69	0,81	0,01	0,65	2,56	5,46	
Var. IPCA + 5,41% p.p.	-2,36	-12,24	-4,68	-7,93	-14,05	-22,22	
CDI	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28
IBOVESPA	-6,74	-13,04	-15,02	-12,95	10,16	-3,47	18,39
INPC + 6,00%	1,63	13,79	4,79	9,12	17,69	30,64	42,02
IPCA + 6,00%	1,72	13,57	4,83	8,88	17,26	29,10	40,32

## 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	-0,54	1,23	0,23	0,83	1,78	5,91	13,47	21,48	36,42
IRF-M 1+	-3,44	-9,10	-5,21	-5,61	-5,90	-1,54	16,13	28,17	50,67
IRF-M TOTAL	-2,63	-5,50	-3,53	-3,59	-3,30	0,99	15,83	26,75	47,22
IMA-B 5	-1,24	1,22	-0,10	0,49	4,43	10,39	25,61	37,29	55,80
IMA-B 5+	-3,87	-10,25	-7,19	-5,85	-1,01	-6,80	27,68	41,57	63,18
IMA-B TOTAL	-2,54	-4,79	-3,73	-2,67	1,83	0,81	27,76	40,92	61,47
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-1,35	-2,10	-1,67	-0,96	0,67	2,85	17,88	28,05	46,14
IMA-GERAL TOTAL	-1,31	-1,68	-1,71	-0,86	1,05	3,75	19,11	29,71	47,78
IDKA 2	-1,47	1,56	-0,12	0,25	4,62	11,66	25,12	37,32	56,68
IDKA 20	-6,31	-17,52	-13,17	-11,45	-5,06	-17,66	27,75	43,34	67,23
CDI	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28	20,70	34,10

## Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-6,74	-13,04	-15,02	-12,95	10,16	-3,47	18,39	39,29	59,42
IBRX 100	-6,81	-12,40	-16,15	-14,19	10,40	-1,79	22,56	43,44	64,83
IBRX 50	-6,27	-12,20	-16,31	-13,99	11,64	-2,23	17,51	38,33	58,04
SMALL CAP	-12,53	-17,37	-21,28	-20,14	3,62	-2,77	38,93	46,64	90,99
IFIX	-1,47	-6,78	-5,26	-6,48	-3,29	-4,17	19,32	20,19	41,88
Índice Consumo - ICON	-9,73	-20,10	-18,41	-17,11	-8,62	-10,39	29,95	16,52	35,92
Índice Dividendos - IDIV	-4,23	-8,71	-8,99	-7,55	13,78	1,74	41,65	49,00	84,75

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	1,25	8,24	3,32	5,73	10,67	15,01	17,92	23,30	26,63
INPC	1,16	8,45	3,27	5,96	11,08	16,38	19,35	24,13	26,41
IGPM	0,64	16,74	0,66	6,24	21,73	47,21	51,84	68,23	65,87
SELIC	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28	20,71	34,13

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	10,92	33,14	15,45	15,03	37,70	113,67	157,78	207,96	284,24
MSCI ACWI	8,97	25,22	13,38	10,89	32,23	96,53	133,44	158,41	221,64
MSCI World	9,54	28,15	13,97	12,82	35,37	100,32	138,32	168,41	233,05

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,57	11,80	4,33	7,84	15,06	24,32	32,57	44,11	53,90
IPCA + 5,00%	1,64	12,68	4,58	8,36	16,16	26,70	36,41	49,70	61,40
IPCA + 5,50%	1,68	13,13	4,71	8,62	16,71	27,90	38,35	52,55	65,25
IPCA + 5,89%	1,71	13,47	4,80	8,82	17,14	28,84	39,89	54,81	68,31
IPCA + 6,00%	1,72	13,57	4,83	8,88	17,26	29,10	40,32	55,45	69,18
INPC + 4,00%	1,48	12,02	4,29	8,08	15,49	25,80	34,17	45,08	53,62
INPC + 6,00%	1,63	13,79	4,79	9,12	17,69	30,64	42,02	56,50	68,89



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

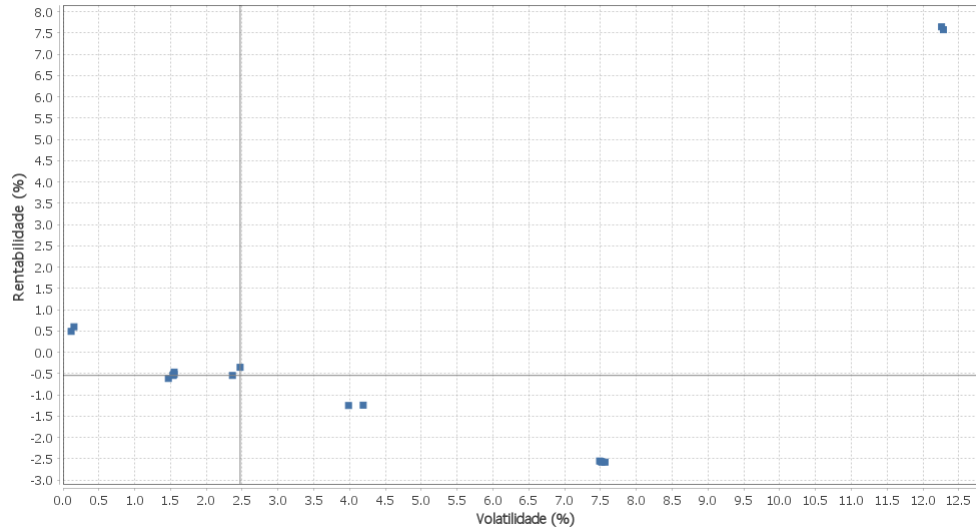
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
50	08/10/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	1.765.000,00	0,00	51.334,30661000	34,3824650000
51	08/10/2021	BB PREV RF IDKA2	207.046,87	0,00	69.351,67617300	2,9854630980
52	08/10/2021	BB PREV RF IDKA2	869.273,96	0,00	291.168,88451300	2,9854630980
53	28/10/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.548.768,24	1.073.956,64622800	2,3732505860

**Total**

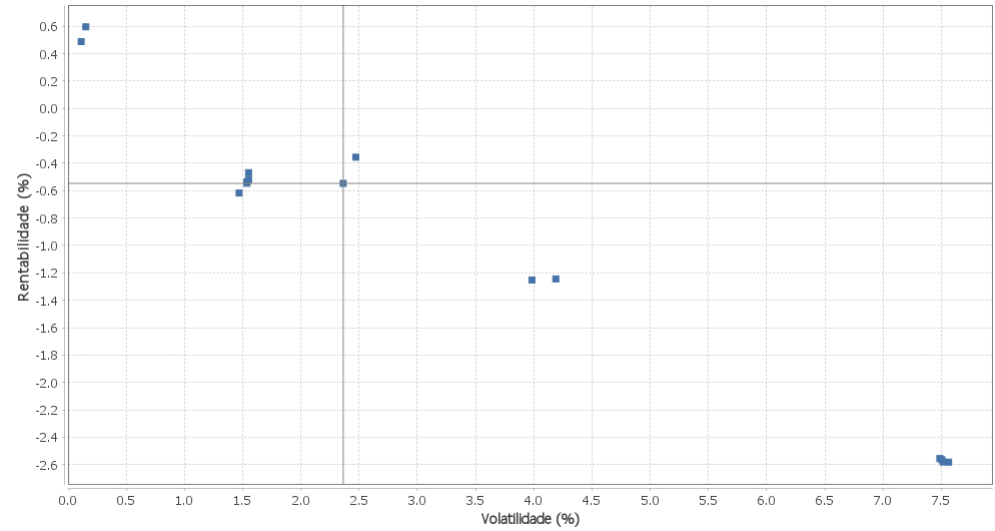
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

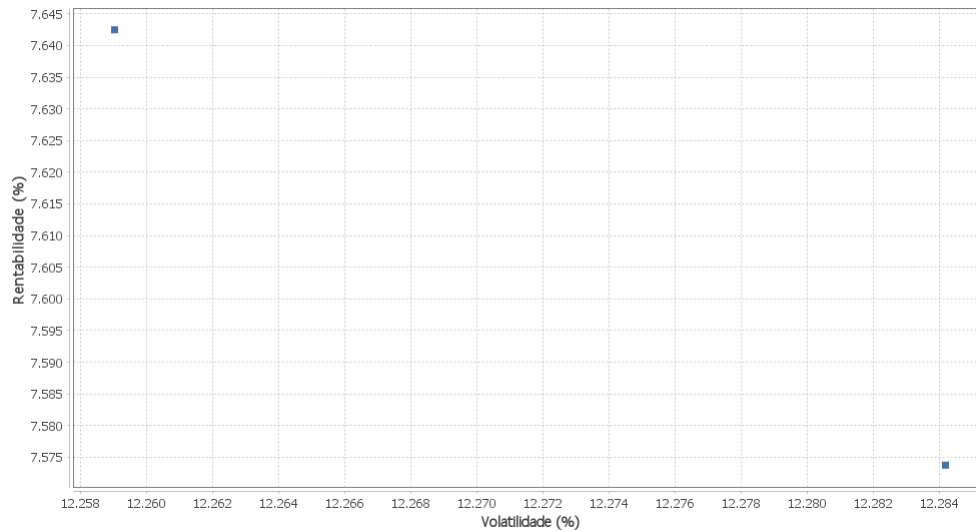
LENÇÓIS PAULISTA - No Mês



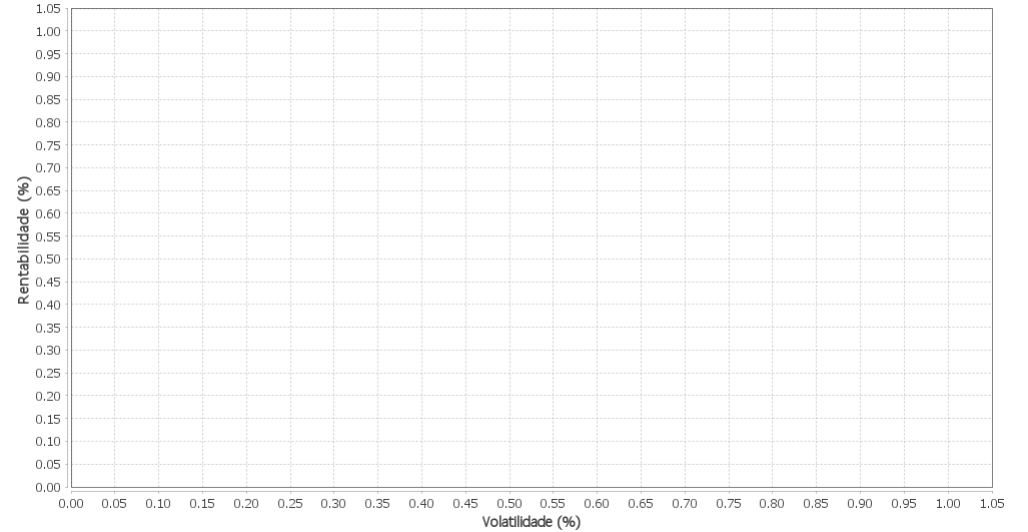
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 3.238.842,81

Value-At-Risk: 0,80%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,11	0,05	0,00	0,08	0,49	1.394.709,82	0,34
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,15	0,04	-0,00	0,76	0,60	16.910,06	0,00
ITAU SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,47	0,54	0,00	-0,75	-0,62	8.868.570,10	2,19
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,54	0,56	0,06	-0,66	-0,54	50.624.305,97	12,49
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	1,54	0,57	0,07	-0,67	-0,55	61.795.635,83	15,24
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,55	0,56	0,02	-0,61	-0,47	13.574.459,98	3,35
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,55	0,56	0,05	-0,64	-0,52	40.227.423,28	9,92
SANTANDER RF ATIVO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	2,36	0,42	0,03	-0,43	-0,55	31.528.994,49	7,78
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	2,47	0,61	0,09	-0,34	-0,36	69.179.866,81	17,06
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	3,98	1,51	0,23	-0,44	-1,25	62.147.798,07	15,33
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,19	1,44	0,17	-0,41	-1,24	48.005.218,91	11,84
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	7,49	2,74	0,00	-0,41	-2,56	52.785,57	0,01
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	Artigo 7º I, Alínea b	7,50	2,75	0,00	-0,41	-2,56	781.172,49	0,19
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	7,52	2,75	0,08	-0,41	-2,58	13.147.932,41	3,24
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,56	2,76	0,00	-0,40	-2,58	128.719,84	0,03
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	12,26	6,50	0,00	0,58	7,64	2.114.080,98	0,52
BRADERCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	Artigo 8º III	12,28	6,51	0,00	0,58	7,57	1.857.674,77	0,46