



**LDB**  
EMPRESAS

**LENÇÓIS PAULISTA**  
DEZEMBRO 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 31.12.2021.

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 99,00%

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	0,64	0,84	2,79	9.020.061,19	2,16	142.521.365,80	6,33
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,75	0,21	-1,49	54.716,37	0,01	393.080.062,36	0,01
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,64	0,84	2,64	37.673.772,67	9,02	6.208.104.156,65	0,61
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,79	0,20	-1,51	133.419,05	0,03	7.081.253.604,41	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,77	0,20	-1,62	13.627.529,04	3,26	597.312.070,50	2,28
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,64	0,84	2,81	13.794.861,86	3,30	103.776.173,39	13,29
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,64	0,85	2,70	51.452.133,49	12,32	6.465.382.741,43	0,80
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,64	0,85	2,66	63.706.852,95	15,25	646.855.202,05	9,85
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,78	0,77	4,31	49.567.392,12	11,87	12.444.051.491,75	0,40
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,61	0,71	4,65	67.366.000,63	16,13	9.277.694.744,55	0,73
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	5,76	0,21	-1,53	809.748,98	0,19	1.006.899.282,32	0,08
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,67</b>	<b>0,77</b>	<b>2,78</b>	<b>307.206.488,35</b>	<b>73,54</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	0,17	0,81	5,00	17.154,65	0,00	1.591.743.360,93	0,00
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,15	0,80	4,62	3.221.288,03	0,77	7.206.695.128,79	0,04
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,10	0,86	4,53	70.923.147,25	16,98	2.626.754.965,66	2,70
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,12	0,77	3,23	32.201.486,00	7,71	671.115.140,75	4,80
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>1,06</b>	<b>0,83</b>	<b>4,28</b>	<b>106.363.075,93</b>	<b>25,46</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,51</b>	<b>0,79</b>	<b>3,10</b>	<b>413.569.564,28</b>	<b>99,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,00%

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	13,35	5,39	9,98	1.946.689,44	0,47	288.809.264,54	0,67
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,38	5,56	11,04	2.220.721,29	0,53	3.768.911.648,33	0,06
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>13,53</b>	<b>5,48</b>	<b>10,83</b>	<b>4.167.410,73</b>	<b>1,00</b>		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			8,72	5,48	10,83	4.167.410,73	1,00		
<b>Total</b>			<b>1,51</b>	<b>0,83</b>	<b>3,18</b>	<b>417.736.975,01</b>	<b>100,00</b>		

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	307.206.488,35	73,54	60,00	80,00	98,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	106.363.075,93	25,46	2,00	10,00	40,00	0,00	40,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>413.569.564,28</b>	<b>99,00</b>					100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	4.167.410,73	1,00	0,00	1,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>4.167.410,73</b>	<b>1,00</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	0,77 101,26	2,78 63,31	1,39 75,47	2,10 68,17	2,78 63,31	2.341.727,72	8.640.333,59
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,83 108,95	4,28 97,46	1,99 108,30	3,26 105,51	4,28 97,46	877.513,41	3.757.367,08
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	5,48 2,63	10,83 26,00	12,91 18,46			216.607,72	397.410,73
<b>LENÇÓIS PAULISTA (Total)</b>						<b>3.435.848,85</b>	<b>12.795.111,40</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	64.753.985,98	2.149.468,41	0,00	0,00	67.366.000,63	462.546,24	2.792.379,79
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	133.148,25	0,00	0,00	0,00	133.419,05	270,80	-47.974,55
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	37.980.592,28	0,00	-625.000,00	0,00	37.673.772,67	318.180,39	1.144.463,26
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	62.276.027,95	900.000,00	0,00	0,00	63.706.852,95	530.825,00	1.633.052,70
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	13.600.255,95	0,00	0,00	0,00	13.627.529,04	27.273,09	-217.916,70
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	49.189.891,56	0,00	0,00	0,00	49.567.392,12	377.500,56	2.036.620,12
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	51.019.209,82	0,00	0,00	0,00	51.452.133,49	432.923,67	1.353.068,58
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	54.604,17	0,00	0,00	0,00	54.716,37	112,20	-62.386,78
ITAU SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	8.945.191,08	0,00	0,00	0,00	9.020.061,19	74.870,11	168.020,88
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.679.304,92	0,00	0,00	0,00	13.794.861,86	115.556,94	375.790,61
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	808.080,26	0,00	0,00	0,00	809.748,98	1.668,72	-525.045,67
					307.206.488,35	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	3.195.757,88	0,00	0,00	0,00	3.221.288,03	25.530,15	71.117,45
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	70.317.865,19	0,00	0,00	0,00	70.923.147,25	605.282,06	3.057.804,78

**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	17.016,57	0,00	0,00	0,00	17.154,65	138,08	817,59
SANTANDER RF ATIVO FIC	31.954.922,88	0,00	0,00	0,00	32.201.486,00	246.563,12	627.627,26
					106.363.075,93	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	1.847.080,48	0,00	0,00	0,00	1.946.689,44	99.608,96	176.689,44
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.103.722,53	0,00	0,00	0,00	2.220.721,29	116.998,76	220.721,29
					4.167.410,73	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

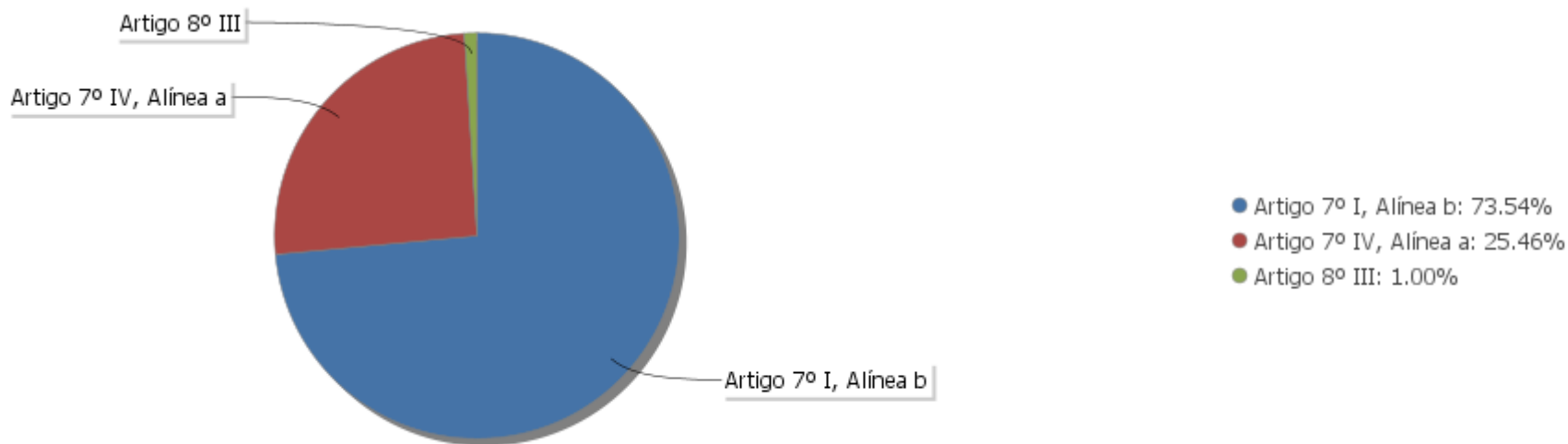
## Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	417.736.975,01	100,00	417.736.975,01	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	417.736.975,01	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	417.736.975,01	100,00

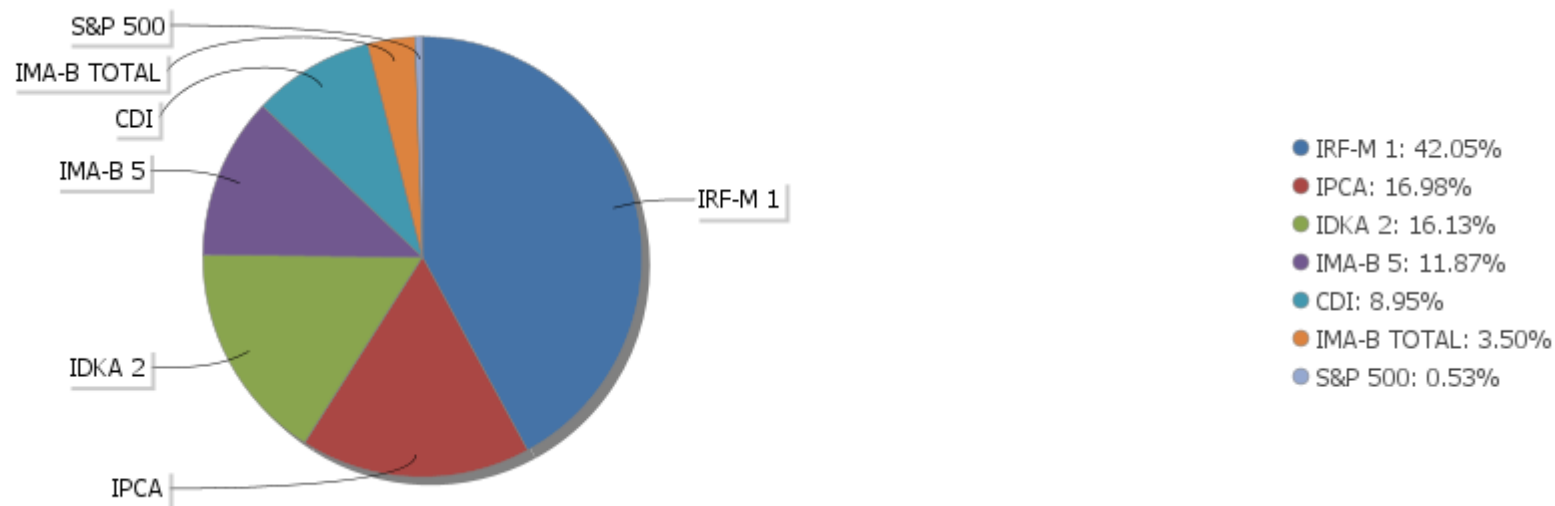


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

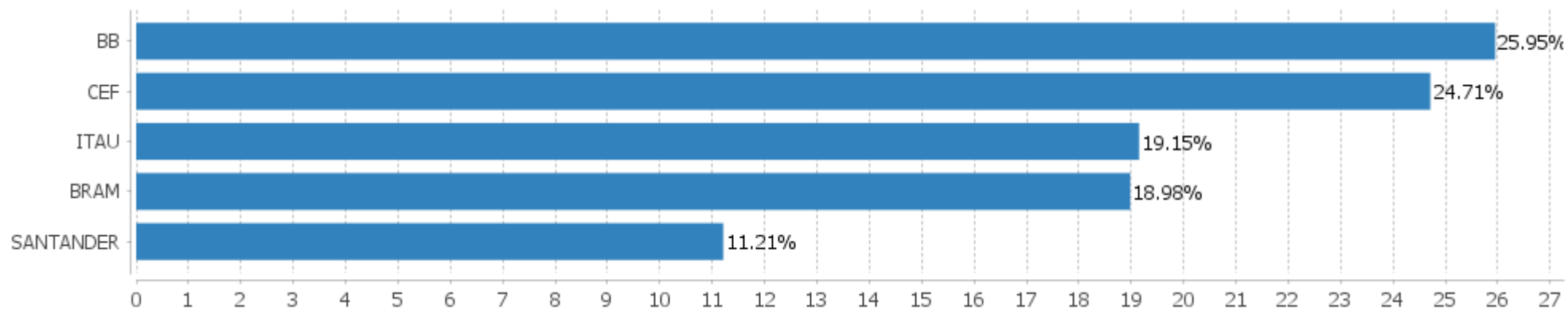


Alocação Por Estratégia



## 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	1,50	0,83	3,18
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,67	1,37	1,22	15,99
p.p. indexador	-0,69	-1,54	-1,35	-0,32	-0,86	-0,83	-1,34	-1,18	-1,06	-2,36	0,13	-0,38	-12,81
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

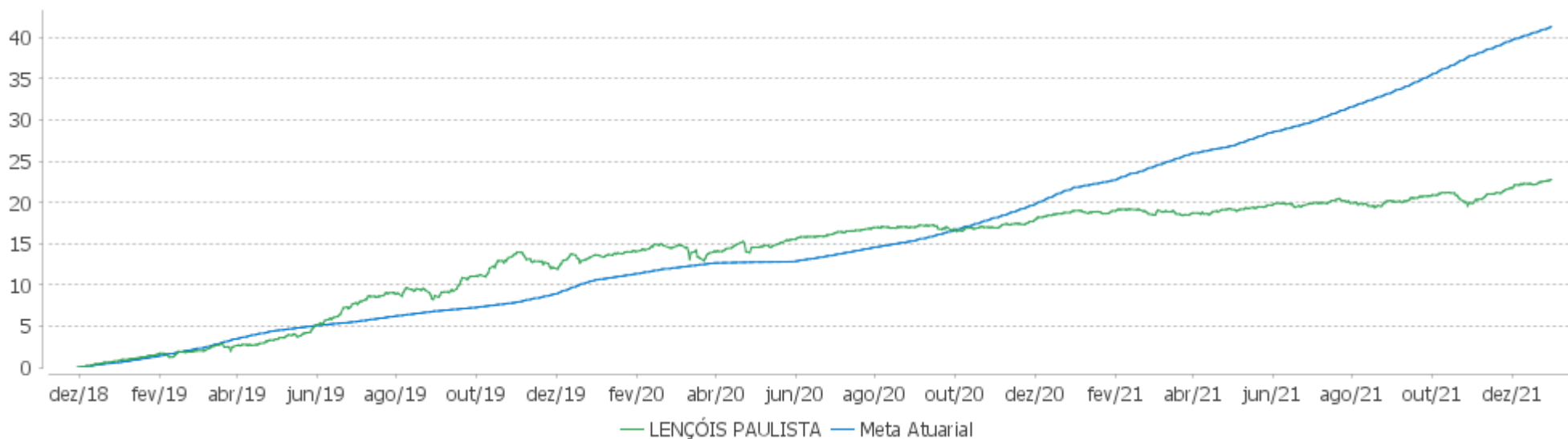
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

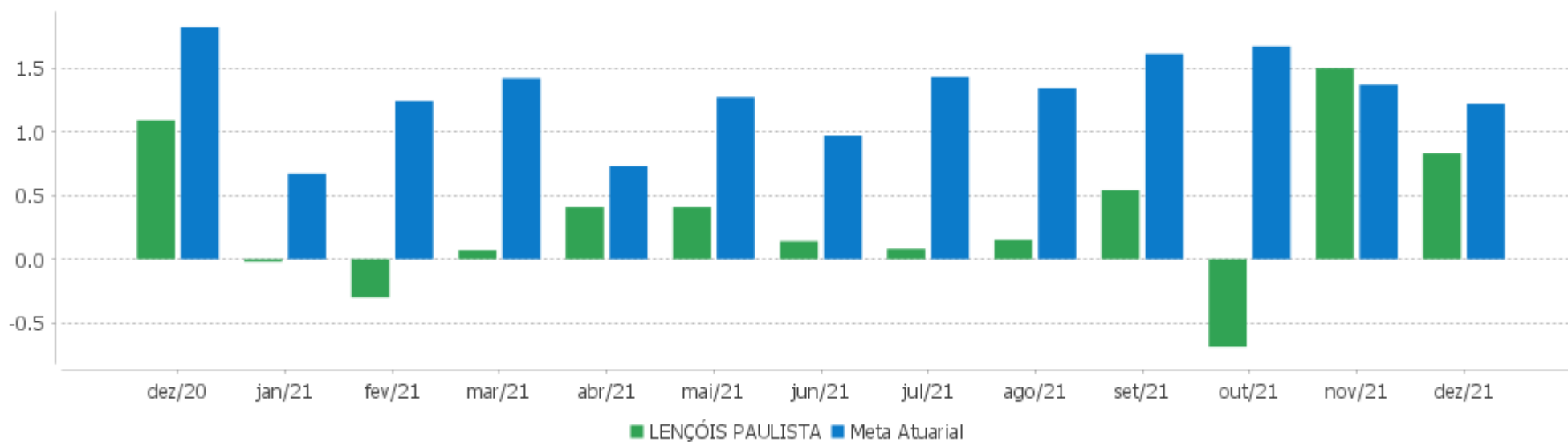
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	10	27,03	03 meses	1,65	4,32	-2,68	1,89
Meses abaixo - Meta Atuarial	27	72,97	06 meses	2,44	8,94	-6,50	1,65
			12 meses	3,18	15,99	-12,81	1,51
			24 meses	8,04	28,47	-20,44	1,88
			36 meses	21,82	42,08	-20,26	2,15
Maior rentabilidade da Carteira	2,45	2019-06	Desde 30/11/2018	22,75	42,95	-20,20	2,12
Menor rentabilidade da Carteira	-1,46	2019-11					

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
SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI	0,77 101,05	3,23 73,58	1,57 85,48	2,40 77,87	3,23 73,58	6,02 82,67	20,54 150,05
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,80 104,63	4,62 105,21	1,93 104,82	3,26 105,62	4,62 105,21	7,13 97,94	13,29 97,07
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,86 0,13	4,53 -5,53	2,16 -0,80	3,49 -2,58	4,53 -5,53	7,52 -7,51	20,33 0,34
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,81 106,27	5,00 113,86	2,05 111,40	3,45 111,68	5,00 113,86	7,21 98,93	13,44 98,18
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,84 -0,04	2,79 -0,13	1,08 -0,05	2,00 -0,09	2,79 -0,13	6,37 -0,51	13,31 -0,79
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,21 -0,02	-1,49 -0,22	1,01 -0,05	-0,65 -0,10	-1,49 -0,22	4,53 -0,53	28,12 -1,05
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,77 -0,02	4,31 -0,25	1,97 -0,06	3,12 -0,12	4,31 -0,25	12,39 -0,58	26,84 -0,99
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,71 -0,12	4,65 -0,33	1,86 0,02	3,18 0,13	4,65 -0,33	12,93 -1,09	25,58 -1,92
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,85 -0,02	2,66 -0,27	1,08 -0,04	2,03 -0,07	2,66 -0,27	6,23 -0,65	13,11 -0,99
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,84 -0,03	2,64 -0,29	1,10 -0,03	1,97 -0,12	2,64 -0,29	6,20 -0,68	13,10 -1,01
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,84 -0,03	2,81 -0,11	1,15 0,02	2,09 -0,01	2,81 -0,11	6,36 -0,52	13,28 -0,82
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,20 -0,02	-1,51 -0,25	0,97 -0,09	-0,70 -0,16	-1,51 -0,25	4,53 -0,53	28,20 -0,97
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,85 -0,03	2,70 -0,23	1,09 -0,04	1,99 -0,11	2,70 -0,23	6,43 -0,45	13,40 -0,70
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,20 -0,02	-1,62 -0,36	0,97 -0,09	-0,72 -0,17	-1,62 -0,36	4,33 -0,73	27,84 -1,33
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,21 -0,02	-1,53 -0,26	1,00 -0,06	-0,67 -0,12	-1,53 -0,26	4,23 -0,83	27,77 -1,40
BRADERCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	5,39 706,27	31,58 718,48	12,73 691,12	13,77 445,93	31,58 718,48	48,27 662,63	93,66 684,30
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,56	32,83	13,07	14,36	32,83	47,69	94,62

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.	1,93	-3,44	-0,45	-9,37	-3,44	-56,56	-79,20
LENÇÓIS PAULISTA	0,83	3,18	1,65	2,44	3,18	8,04	21,82
Var. IPCA + 5,41% p.p.	-0,38	-12,81	-2,68	-6,50	-12,81	-19,72	-18,68
CDI	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69
IBOVESPA	2,85	-11,93	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27
INPC + 6,00%	1,27	16,74	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52
IPCA + 6,00%	1,27	16,64	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87

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	0,00	0,20
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,10
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	D+0	D+0	D+1 du	D+4 du	20.000000000000	1,50
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	1,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,40
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,18
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,18
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,20
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
SANTANDER RF ATIVO FIC	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,40
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,20

## 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	0,88	2,93	1,13	2,10	2,93	6,88	14,10	22,06	35,63
IRF-M 1+	2,29	-4,99	0,93	-1,74	-4,99	3,04	17,72	32,16	54,19
IRF-M TOTAL	1,89	-1,99	0,98	-0,42	-1,99	4,57	17,15	29,72	49,44
IMA-B 5	0,79	4,57	2,03	3,24	4,57	12,97	27,83	40,44	58,11
IMA-B 5+	-0,34	-6,55	0,09	-4,11	-6,55	-1,41	28,53	48,33	67,24
IMA-B TOTAL	0,22	-1,26	1,06	-0,55	-1,26	5,06	29,17	46,04	64,72
IMA-GERAL TOTAL	0,87	0,96	1,34	0,82	0,96	6,35	19,98	32,02	48,95
IDKA 2	0,83	4,97	1,84	3,05	4,97	14,02	27,50	39,94	58,99
IDKA 20	-2,28	-14,50	-2,87	-11,27	-14,50	-12,61	26,07	51,79	70,27
CDI	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	20,99	33,03

## Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	2,85	-11,93	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27	37,20	74,05
IBRX 100	3,14	-11,17	-5,51	-18,37	-11,17	-8,07	22,63	41,54	80,53
IBRX 50	3,76	-10,54	-4,49	-18,01	-10,54	-7,30	19,73	37,12	73,89
SMALL CAP	3,80	-16,20	-11,28	-24,79	-16,20	-16,75	31,71	42,41	112,70
IFIX	8,78	-2,28	3,28	1,81	-2,28	-12,28	19,27	25,98	50,42
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	1,60	-6,41	-1,83	-8,30	-6,41	-7,35	34,49	55,95	95,40



## 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	0,73	10,06	2,96	6,07	10,06	15,03	19,99	24,48	28,15
INPC	0,73	10,16	2,75	5,97	10,16	16,16	21,37	25,53	28,13
IGPM	0,87	17,78	1,54	2,35	17,78	45,04	55,63	67,36	66,49
SELIC	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	21,00	33,06

**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	3,63	36,26	13,52	23,73	36,26	104,25	173,82	200,73	264,52
MSCI ACWI	3,17	25,42	9,15	16,96	25,42	84,89	138,58	148,21	206,39
MSCI World									

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,09	14,45	3,97	8,20	14,45	24,38	34,95	45,56	55,77
IPCA + 5,00%	1,18	15,54	4,22	8,73	15,54	26,77	38,87	51,22	63,36
IPCA + 5,50%	1,22	16,09	4,35	8,99	16,09	27,98	40,86	54,11	67,27
IPCA + 5,89%	1,26	16,52	4,44	9,20	16,52	28,92	42,43	56,40	70,37
IPCA + 6,00%	1,27	16,64	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87	57,04	71,26
INPC + 4,00%	1,09	14,55	3,77	8,10	14,55	25,60	36,50	46,79	55,74
INPC + 6,00%	1,27	16,74	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52	58,37	71,23

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
61	07/12/2021	BB PREV RF IDKA2	410.920,53	0,00	136.251,46873100	3,0158979850
59	10/12/2021	BB PREV RF IDKA2	869.273,96	0,00	288.474,66959700	3,0133458900
62	14/12/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	625.000,00	224.348,73159700	2,7858414690
58	30/12/2021	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	900.000,00	0,00	340.518,65531450	2,6430270000
60	30/12/2021	BB PREV RF IDKA2	869.273,92	0,00	287.436,93807100	3,0242248120
<b>Total</b>						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.341.696,27

Value-At-Risk: 0,80%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LENÇÓIS PAULISTA		0,80	0,80			417.736.975,01	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,80%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,60	0,00	0,82			9.020.061,19	2,16
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI		2,96	0,00	0,01			54.716,37	0,01
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,62	0,05	0,03			37.673.772,67	9,02
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,99	0,00	0,04			133.419,05	0,03
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		2,96	0,08	0,01			13.627.529,04	3,26
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,62	0,02	0,05			13.794.861,86	3,30
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,62	0,06	0,02			51.452.133,49	12,32
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS		0,62	0,08	0,02			63.706.852,95	15,25
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,20	0,14	0,02			49.567.392,12	11,87
BB PREV RF IDKA2		1,37	0,22	0,38			67.366.000,63	16,13
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR		2,96	0,00	0,00			809.748,98	0,19
<b>Sub-total</b>	<b>1,18</b>	<b>0,89</b>	<b>0,65</b>		<b>0,01</b>	<b>0,77</b>	<b>307.206.488,35</b>	<b>73,54</b>

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI		0,06	0,00	0,05			17.154,65	0,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,05	0,00	0,03			3.221.288,03	0,77
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		0,61	0,10	0,63			70.923.147,25	16,98
SANTANDER RF ATIVO FIC		0,57	0,04	0,57			32.201.486,00	7,71
<b>Sub-total</b>	<b>0,67</b>	<b>0,56</b>	<b>0,14</b>		<b>0,10</b>	<b>0,83</b>	<b>106.363.075,93</b>	<b>25,46</b>

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 6,48%

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		6,48	0,00	6,48			1.946.689,44	0,47
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,48	0,00	5,81			2.220.721,29	0,53
<b>Sub-total</b>	16,50	6,48	0,01		0,29	5,48	4.167.410,73	1,00