



**LDB**  
EMPRESAS

**LENÇÓIS PAULISTA**  
JANEIRO 2022



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 31.01.2022.

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

99,05%

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	0,67	0,64	0,64	9.077.388,21	2,18	143.407.509,52	6,33
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,67	-0,75	-0,75	54.308,20	0,01	320.131.317,42	0,02
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,68	0,61	0,61	37.905.109,05	9,10	5.049.727.685,75	0,75
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,71	-0,77	-0,77	132.394,55	0,03	6.778.952.570,88	0,00
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,68	-0,76	-0,76	13.523.745,00	3,25	591.516.478,08	2,29
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,67	0,65	0,65	13.884.272,86	3,33	104.195.653,99	13,33
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,67	0,61	0,61	51.765.475,89	12,42	6.296.869.255,71	0,82
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,68	0,62	0,62	64.099.719,97	15,38	654.984.418,79	9,79
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,77	0,09	0,09	49.612.190,06	11,91	12.040.160.059,77	0,41
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,62	0,01	0,01	64.980.188,65	15,60	9.258.989.052,65	0,70
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	5,68	-0,76	-0,76	803.620,75	0,19	992.957.009,73	0,08
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,66</b>	<b>0,33</b>	<b>0,33</b>	<b>305.838.413,19</b>	<b>73,40</b>		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos 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	0,18	0,80	0,80	17.291,23	0,00	1.520.814.282,19	0,00
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,78	0,78	3.246.522,24	0,78	7.223.462.787,00	0,04
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,12	0,52	0,52	71.293.624,67	17,11	2.545.578.020,48	2,80
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,15	0,32	0,32	32.306.052,26	7,75	672.709.797,31	4,80
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,84</b>	<b>0,47</b>	<b>0,47</b>	<b>106.863.490,40</b>	<b>25,65</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,51</b>	<b>0,37</b>	<b>0,37</b>	<b>412.701.903,59</b>	<b>99,05</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,95%

Artigo 10º I (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	13,57	-5,35	-5,35	1.842.619,14	0,44	265.081.661,91	0,70
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,60	-5,30	-5,30	2.102.959,51	0,50	3.506.862.313,47	0,06
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>18,08</b>	<b>-5,32</b>	<b>-5,32</b>	<b>3.945.578,65</b>	<b>0,95</b>		
Investimentos Estruturados			18,08	-5,32	-5,32	3.945.578,65	0,95		
Total			1,50	0,31	0,31	416.647.482,24	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	305.838.413,19	73,40	0,00	73,83	80,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	106.863.490,40	25,65	0,00	10,00	60,00	0,00	60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>412.701.903,59</b>	<b>99,05</b>					100,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	3.945.578,65	0,95	0,00	1,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>3.945.578,65</b>	<b>0,95</b>					15,00

## 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	0,33 45,62	0,33 45,62	2,65 126,28	2,38 68,61	3,18 63,55	1.027.454,27	1.027.454,27
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,47 64,25	0,47 64,25				500.414,47	500.414,47
Artigo 10º I % do CDI	-5,32 -726,91	-5,32 -726,91				-221.832,08	-221.832,08
<b>LENÇÓIS PAULISTA (Total)</b>						<b>1.306.036,66</b>	<b>1.306.036,66</b>

## RESULTADO POR ATIVO

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	67.366.000,63	206.200,75	-2.601.730,18	0,00	64.980.188,65	9.717,45	9.717,45
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	133.419,05	0,00	0,00	0,00	132.394,55	-1.024,50	-1.024,50
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	37.673.772,67	0,00	0,00	0,00	37.905.109,05	231.336,38	231.336,38
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	63.706.852,95	0,00	0,00	0,00	64.099.719,97	392.867,02	392.867,02
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	13.627.529,04	0,00	0,00	0,00	13.523.745,00	-103.784,04	-103.784,04
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	49.567.392,12	0,00	0,00	0,00	49.612.190,06	44.797,94	44.797,94
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	51.452.133,49	0,00	0,00	0,00	51.765.475,89	313.342,40	313.342,40
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	54.716,37	0,00	0,00	0,00	54.308,20	-408,17	-408,17
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	9.020.061,19	0,00	0,00	0,00	9.077.388,21	57.327,02	57.327,02
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.794.861,86	0,00	0,00	0,00	13.884.272,86	89.411,00	89.411,00
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	809.748,98	0,00	0,00	0,00	803.620,75	-6.128,23	-6.128,23
					305.838.413,19	0,00	0,00

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	3.221.288,03	0,00	0,00	0,00	3.246.522,24	25.234,21	25.234,21
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	70.923.147,25	0,00	0,00	0,00	71.293.624,67	370.477,42	370.477,42

**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	17.154,65	0,00	0,00	0,00	17.291,23	136,58	136,58
SANTANDER RF ATIVO FIC	32.201.486,00	0,00	0,00	0,00	32.306.052,26	104.566,26	104.566,26
					106.863.490,40	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	1.946.689,44	0,00	0,00	0,00	1.842.619,14	-104.070,30	-104.070,30
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.220.721,29	0,00	0,00	0,00	2.102.959,51	-117.761,78	-117.761,78
					3.945.578,65	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

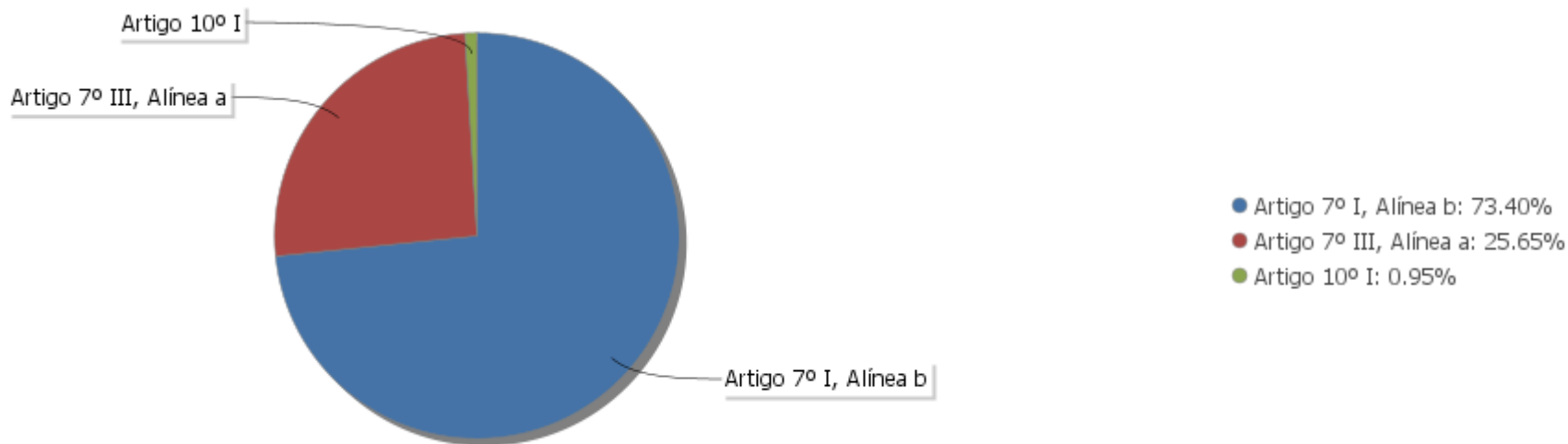
## Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	416.647.482,24	100,00	416.647.482,24	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	416.647.482,24	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	416.647.482,24	100,00

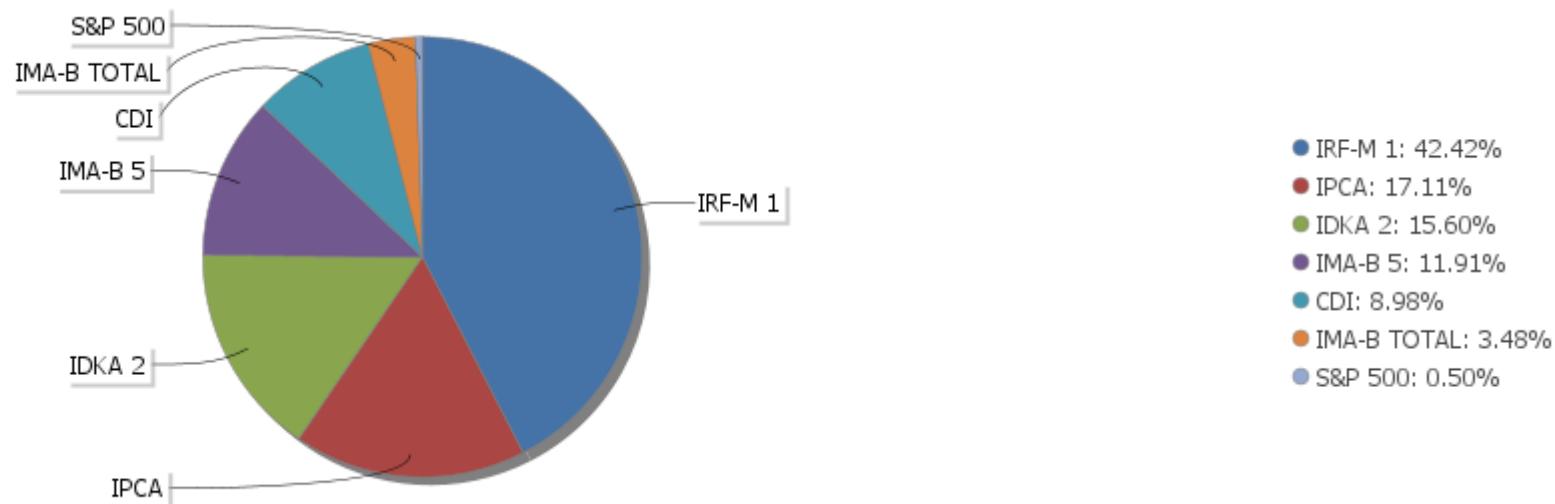


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

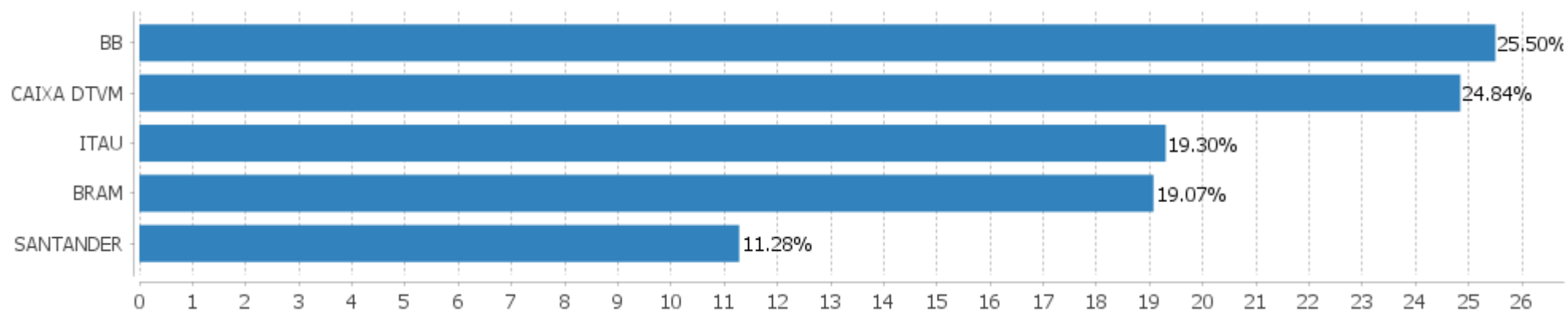


Alocação Por Estratégia



## 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
2022	0,31												0,31
IPCA + 4,87%	0,94												0,94
p.p. indexador	-0,63												-0,63
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

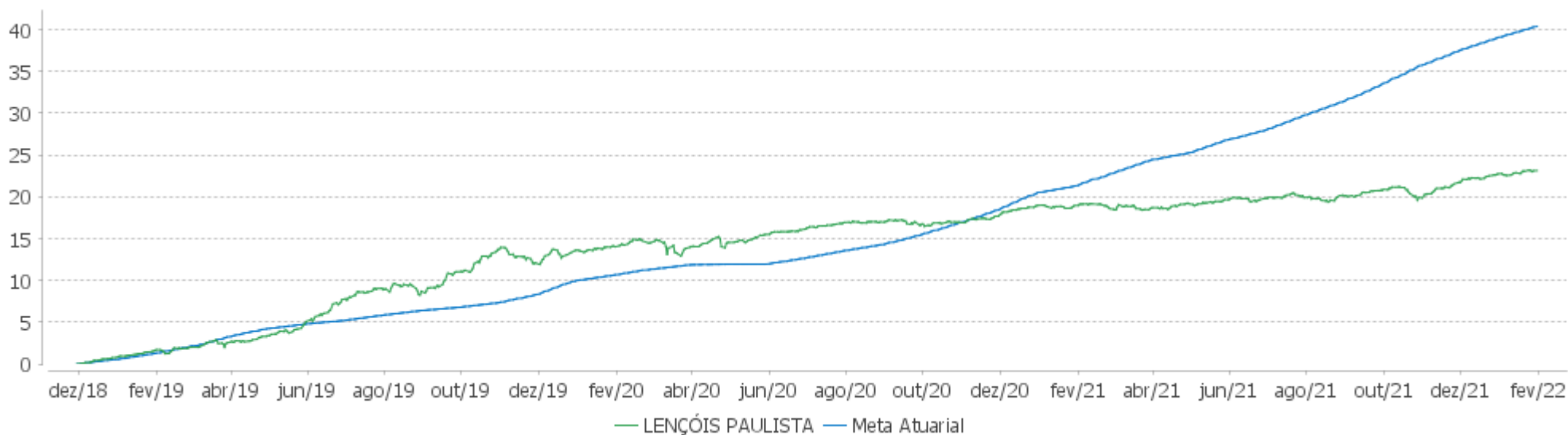
**Performance Sobre a Meta Atuarial**

**Relatório**

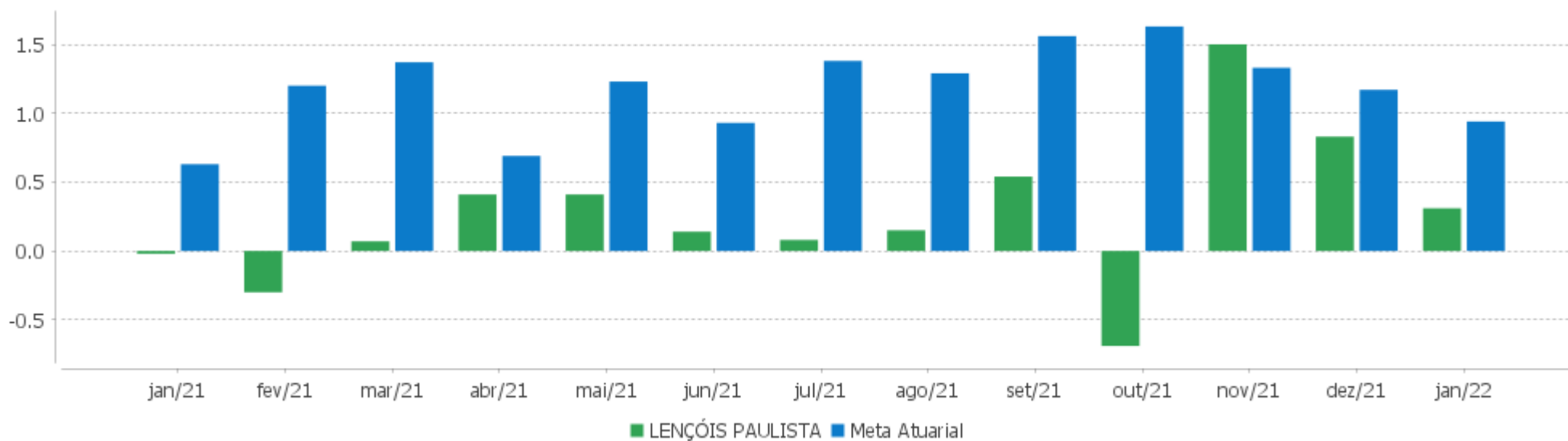
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	10	26,32	03 meses	2,67	3,57	-0,90	1,30
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	73,68	06 meses	2,68	8,42	-5,74	1,64
			12 meses	3,52	16,30	-12,78	1,50
			24 meses	7,98	28,75	-20,77	1,88
			36 meses	21,15	42,23	-21,09	2,16
Maior rentabilidade da Carteira	2,45	2019-06	Desde 30/11/2018	23,14	44,30	-21,16	2,10
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	0,32 44,34	0,32 44,34	2,46 117,53	2,45 70,45	3,54 70,70	6,00 78,33	18,63 134,01
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,78 106,98	0,78 106,98	2,23 106,30	3,66 105,41	5,27 105,34	7,60 99,12	13,57 97,62
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,80 108,73	0,80 108,73	2,25 107,49	3,87 111,52	5,65 112,86	7,66 99,90	13,72 98,68
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,52 -0,02	0,52 -0,02	3,06 0,82	3,87 -1,76	4,93 -5,44	7,72 -7,70	18,15 -2,10
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,64 0,01	0,64 0,01	2,35 0,04	2,42 -0,13	3,38 -0,14	6,59 -0,49	13,42 -0,74
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,75 -0,01	-0,75 -0,01	2,88 -0,05	-1,01 -0,10	-1,36 -0,21	3,50 -0,52	21,90 -0,96
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,09 -0,02	0,09 -0,02	3,35 -0,08	3,20 -0,12	4,32 -0,25	11,89 -0,59	25,04 -1,00
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,01 -0,04	0,01 -0,04	3,16 -0,25	3,11 -0,18	4,47 -0,40	12,51 -0,97	24,08 -1,89
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,62 -0,01	0,62 -0,01	2,26 -0,05	2,46 -0,08	3,26 -0,27	6,44 -0,64	13,18 -0,98
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,65 0,02	0,65 0,02	2,28 -0,03	2,55 0,00	3,43 -0,10	6,60 -0,48	13,38 -0,78
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,61 -0,01	0,61 -0,01	2,25 -0,06	2,43 -0,11	3,24 -0,29	6,41 -0,67	13,14 -1,02
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,61 -0,02	0,61 -0,02	2,25 -0,06	2,44 -0,10	3,30 -0,23	6,63 -0,45	13,45 -0,71
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,77 -0,03	-0,77 -0,03	2,85 -0,08	-1,09 -0,18	-1,42 -0,27	3,46 -0,56	21,90 -0,96
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,76 -0,03	-0,76 -0,03	2,86 -0,08	-1,07 -0,17	-1,50 -0,35	3,29 -0,73	21,60 -1,26
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,76 -0,02	-0,76 -0,02	2,87 -0,06	-1,03 -0,12	-1,41 -0,26	3,20 -0,82	21,54 -1,32
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	-5,35 -730,05	-5,35 -730,05	-0,81 -38,65	5,04 144,95	24,86 496,97	39,94 521,12	70,31 505,78
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-5,30	-5,30	-0,53	5,52	25,85	39,39	71,27

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.	3,74	3,74	6,39	-1,95	6,91	-36,27	-73,70
LENÇÓIS PAULISTA	0,31	0,31	2,67	2,68	3,52	7,98	21,15
Var. IPCA + 4,87% p.p.	-0,63	-0,63	-0,81	-5,51	-12,23	-18,87	-17,49
CDI	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90
IBOVESPA	6,98	6,98	8,35	-7,93	-2,54	-1,42	15,14
INPC + 6,00%	1,16	1,16	3,78	8,75	17,24	31,05	44,93
IPCA + 6,00%	1,03	1,03	3,76	8,77	17,00	29,59	43,15

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 TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	D+0	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,18
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,18
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
SANTANDER RF ATIVO FIC	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	D+0	D+0	D+0	D+1 du		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	0,63	0,63	2,31	2,54	3,53	7,08	14,16	22,11	34,75
IRF-M 1+	-0,50	-0,50	4,01	-1,41	-4,13	1,40	15,16	29,50	49,44
IRF-M TOTAL	-0,08	-0,08	3,63	-0,03	-1,28	3,58	15,45	27,96	45,98
IMA-B 5	0,11	0,11	3,42	3,32	4,57	12,47	26,04	38,75	56,48
IMA-B 5+	-1,61	-1,61	2,45	-4,92	-6,47	-3,03	18,62	39,06	60,95
IMA-B TOTAL	-0,73	-0,73	2,94	-0,91	-1,15	4,02	22,86	40,20	60,52
IMA-GERAL TOTAL	0,21	0,21	2,90	1,13	1,42	5,98	17,98	30,01	46,61
IDKA 2	0,05	0,05	3,41	3,29	4,87	13,47	25,98	38,94	57,36
IDKA 20	-2,92	-2,92	0,64	-12,61	-14,59	-13,99	10,19	35,73	59,77
CDI	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90	21,17	32,56

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,98	6,98	8,35	-7,93	-2,54	-1,42	15,14	32,07	73,41
IBRX 100	6,87	6,87	8,36	-9,14	-2,11	-0,51	18,37	36,58	79,96
IBRX 50	7,65	7,65	9,69	-8,20	-0,93	1,71	16,71	32,14	74,76
SMALL CAP	3,42	3,42	4,89	-17,43	-10,25	-14,29	24,49	41,16	97,42
IFIX	-0,99	-0,99	3,78	-1,67	-3,56	-9,76	15,24	21,52	43,53
Índice Consumo - ICON			-5,43	-22,83	-23,46	-26,51	5,30	5,50	37,84
Índice Dividendos - IDIV	7,47	7,47	10,17	0,27	5,96	1,18	28,50	52,53	93,40



**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	0,54	0,54	2,24	5,63	10,38	15,41	20,25	24,79	28,35
INPC	0,67	0,67	2,26	5,61	10,60	16,72	21,74	26,09	28,45
IGPM	1,82	1,82	2,72	3,40	16,91	46,97	58,45	69,12	68,43
SELIC	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90	21,18	32,59

**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	-9,05	-9,05	-6,91	7,47	18,94	75,67	144,98	170,90	239,48
MSCI ACWI	-8,76	-8,76	-8,61	3,62	9,17	61,14	114,25	124,36	183,76
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%	0,87	0,87	3,26	7,73	14,79	24,77	35,22	45,90	55,99
IPCA + 5,00%	0,95	0,95	3,51	8,26	15,90	27,17	39,15	51,57	63,59
IPCA + 5,50%	0,99	0,99	3,64	8,51	16,45	28,37	41,14	54,46	67,50
IPCA + 5,89%	1,02	1,02	3,73	8,72	16,88	29,32	42,71	56,75	70,61
IPCA + 6,00%	1,03	1,03	3,76	8,77	17,00	29,59	43,15	57,40	71,49
INPC + 4,00%	1,00	1,00	3,28	7,71	15,02	26,18	36,90	47,41	56,11
INPC + 6,00%	1,16	1,16	3,78	8,75	17,24	31,05	44,93	59,03	71,61

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
63	10/01/2022	BB PREV RF IDKA2	206.200,75	0,00	68.339,10065800	3,0173172900
64	28/01/2022	BB PREV RF IDKA2	0,00	2.601.730,18	858.949,18153800	3,0289686933

**Total**

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.166.320,63

Value-At-Risk: 0,76%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LENÇÓIS PAULISTA		0,76	0,76			416.647.482,24	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,76%

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		0,61	0,00	0,83			9.077.388,21	2,18
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI		2,15	0,00	0,01			54.308,20	0,01
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,63	0,05	0,03			37.905.109,05	9,10
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,14	0,00	0,03			132.394,55	0,03
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		2,15	0,06	0,01			13.523.745,00	3,25
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,63	0,02	0,04			13.884.272,86	3,33
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,63	0,07	0,02			51.765.475,89	12,42
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS		0,63	0,08	0,02			64.099.719,97	15,38
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,06	0,12	0,01			49.612.190,06	11,91
BB PREV RF IDKA2		1,36	0,20	0,38			64.980.188,65	15,60
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR		2,15	0,00	0,00			803.620,75	0,19
<b>Sub-total</b>	1,29	0,84	0,61		-0,31	0,33	305.838.413,19	73,40

Artigo 7º III, 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		0,05	-0,00	0,04			17.291,23	0,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,05	0,00	0,03			3.246.522,24	0,78
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		0,59	0,09	0,61			71.293.624,67	17,11
SANTANDER RF ATIVO FIC		0,65	0,05	0,64			32.306.052,26	7,75
<b>Sub-total</b>	0,84	0,57	0,14		-0,31	0,47	106.863.490,40	25,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 8,18%

Artigo 10º I

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		8,02	0,00	8,02			1.842.619,14	0,44
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		8,33	0,01	5,87			2.102.959,51	0,50
<b>Sub-total</b>	18,08	8,18	0,01		-0,33	-5,32	3.945.578,65	0,95