



LDB
EMPRESAS

LENÇÓIS PAULISTA
ABRIL 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 29.04.2022.

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

100,00%

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	0,73	0,72	2,99	9.290.210,71	2,15	144.052.799,83	6,45
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,49	0,81	3,65	56.715,22	0,01	244.969.307,96	0,02
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,73	0,70	2,94	171.905,62	0,04	4.963.381.608,10	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,53	0,80	3,59	138.208,94	0,03	6.560.550.656,04	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,50	0,84	3,63	14.122.812,33	3,27	559.104.372,67	2,53
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,73	0,63	2,92	787.456,16	0,18	91.156.943,17	0,86
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,73	0,72	2,96	49.975.599,46	11,56	5.550.599.804,03	0,90
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,73	0,68	2,95	64.437.597,22	14,91	608.624.110,32	10,59
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,64	1,54	5,35	54.453.913,19	12,60	11.887.667.806,21	0,46
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,56	1,48	5,36	73.539.816,28	17,01	9.105.588.612,67	0,81
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	5,50	0,81	3,65	2.827.853,53	0,65	871.820.329,99	0,32
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,31	2,23	4,95	39.879.024,74	9,23	2.006.763.440,73	1,99
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,16	0,78	3,43	73.357.667,87	16,97	2.728.342.512,21	2,69
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,58	1,14	4,16	383.038.781,27	88,62		

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 RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,19	0,83	3,45	15.102.895,02	3,49	1.995.090.212,08	0,76
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	0,78	3,37	992.222,61	0,23	9.511.719.590,81	0,01
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,20	0,77	2,74	33.082.637,10	7,65	454.064.635,62	7,29
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,87	0,78	2,80	49.177.754,73	11,38		
Renda Fixa			1,49	1,10	4,04	432.216.536,00	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Total

1,49

1,10

3,99

432.216.536,00

100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	383.038.781,27	88,62	60,00	80,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	49.177.754,73	11,38	10,00	10,00	65,00	0,00	65,00
	Total Renda Fixa	432.216.536,00	100,00					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 b % do CDI	1,14 136,17	4,16 126,81	3,78 149,31	6,56 140,23	6,94 98,11	4.369.322,70	15.793.759,32
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,78 93,42	2,80 85,35	2,42 95,84			344.457,15	1.030.745,92
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	-5,65 -172,18	-0,34 -13,49			0,00	-194.067,26
LENÇÓIS PAULISTA (Total)						4.713.779,85	16.630.437,98

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	71.373.746,06	1.096.423,84	0,00	0,00	73.539.816,28	1.069.646,38	3.646.022,69
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	137.107,07	0,00	0,00	0,00	138.208,94	1.101,87	4.789,89
BB PREV RF IPCA	39.009.633,11	0,00	0,00	0,00	39.879.024,74	869.391,63	1.879.024,74
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	403.631,10	0,00	-233.248,20	0,00	171.905,62	1.522,72	500.560,13
BRDESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	67.004.015,41	0,00	-3.019.606,75	0,00	64.437.597,22	453.188,56	1.914.105,77
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	14.005.497,04	0,00	0,00	0,00	14.122.812,33	117.315,29	495.283,29
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	53.630.259,50	0,00	0,00	0,00	54.453.913,19	823.653,69	2.749.422,85
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	49.616.622,08	0,00	0,00	0,00	49.975.599,46	358.977,38	1.497.182,12
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	72.792.634,04	0,00	0,00	0,00	73.357.667,87	565.033,83	2.434.520,62
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	56.261,89	0,00	0,00	0,00	56.715,22	453,33	1.998,85
ITAU SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	9.223.380,05	0,00	0,00	0,00	9.290.210,71	66.830,66	270.149,52
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.755.607,69	0,00	-15.000.000,00	0,00	787.456,16	31.848,47	367.594,30
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	832.494,64	1.985.000,00	0,00	0,00	2.827.853,53	10.358,89	33.104,55
					383.038.781,27	0,00	0,00

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	632.306,32	353.248,20	0,00	0,00	992.222,61	6.668,09	63.854,45
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	17.600,56	15.000.000,00	0,00	0,00	15.102.895,02	85.294,46	85.740,37
SANTANDER RF ATIVO FIC	32.830.142,50	0,00	0,00	0,00	33.082.637,10	252.494,60	881.151,10
					49.177.754,73	0,00	0,00

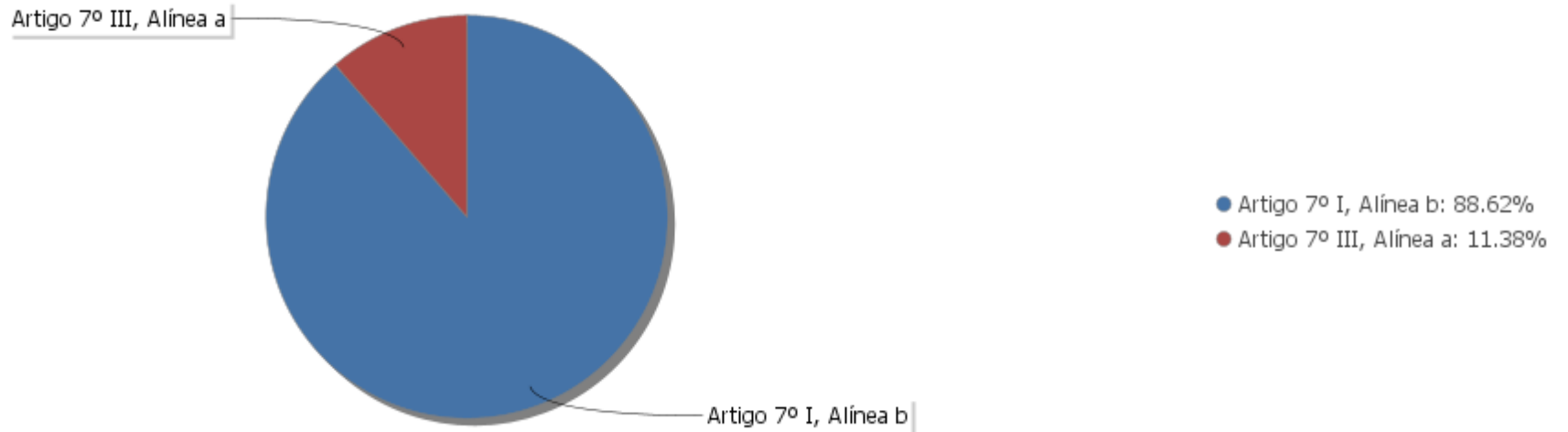
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

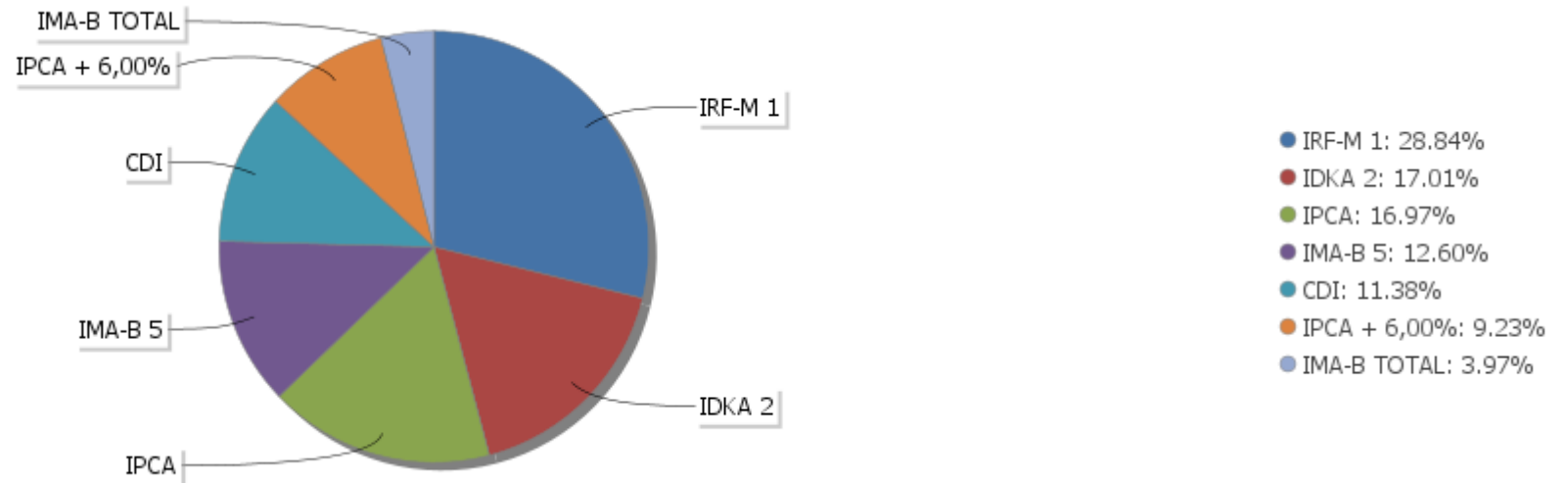
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	392.337.511,26	90,77	392.337.511,26	90,77
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	392.337.511,26	90,77
acima de 365 dias	39.879.024,74	9,23	432.216.536,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

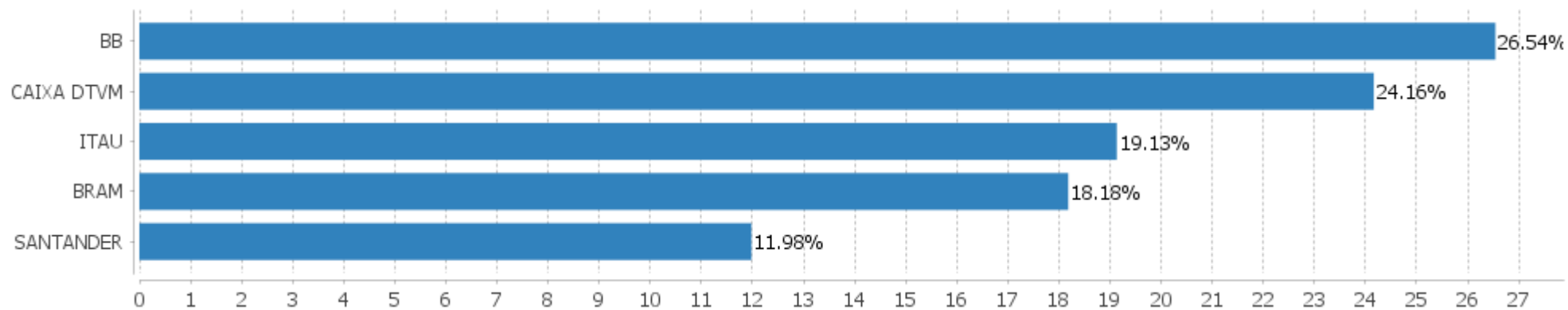


Alocação Por Estratégia



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	0,89	1,63	1,10									3,99
IPCA + 4,87%	0,94	1,37	2,04	1,42									5,90
p.p. indexador	-0,63	-0,48	-0,41	-0,32									-1,91
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

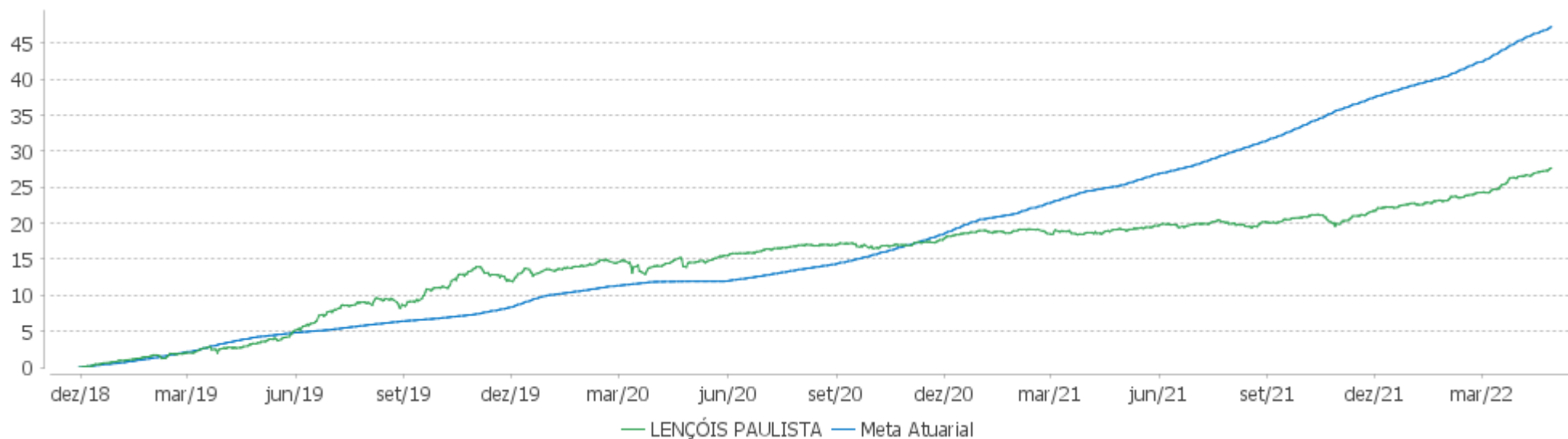
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	10	24,39
Meses abaixo - Meta Atuarial	31	75,61
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,45	2019-06
Menor rentabilidade da Carteira	-1,46	2019-11

Relatório

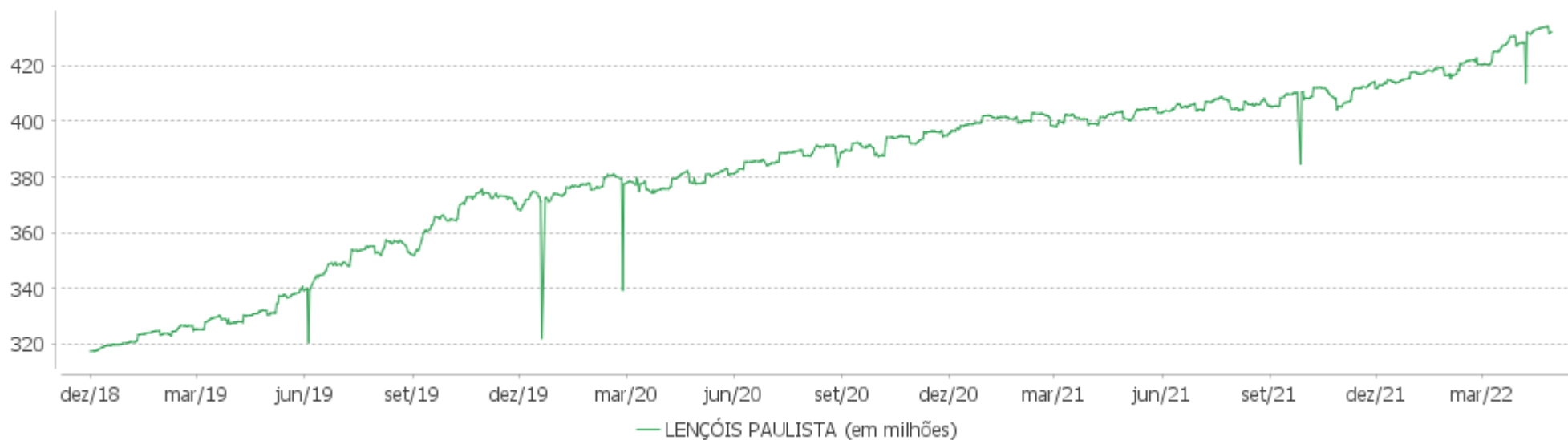
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,66	4,92	-1,25	1,26
06 meses	6,43	8,66	-2,23	1,29
12 meses	7,12	17,98	-10,86	1,49
24 meses	11,44	33,21	-21,77	1,38
36 meses	23,46	44,62	-21,16	2,12
Desde 30/11/2018	27,65	51,39	-23,74	2,06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

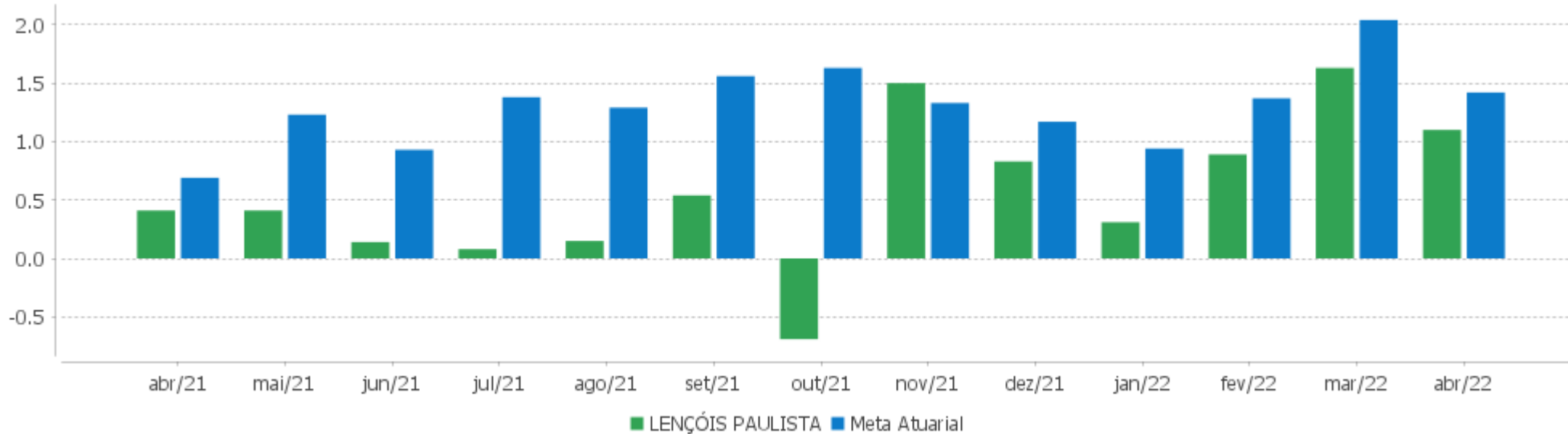


Patrimônio Líquido



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
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,72 -0,02	2,99 -0,05	2,34 -0,05	4,75 -0,01	5,49 -0,14	7,65 -0,44	14,46 -0,77
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,54 -0,02	5,35 -0,08	5,26 -0,05	8,78 -0,14	9,20 -0,25	18,62 -0,59	28,55 -1,00
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,70 -0,05	2,95 -0,09	2,32 -0,08	4,62 -0,14	5,36 -0,27	7,41 -0,69	14,19 -1,04
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,78 -0,28	3,43 -0,86	2,90 -0,84	6,04 -0,01	7,64 -4,49	9,81 -9,90	19,90 -2,68
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,84 0,01	3,63 -0,09	4,43 -0,06	7,41 -0,15	4,36 -0,33	14,05 -0,75	23,80 -1,27
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,81 -0,03	3,65 -0,07	4,43 -0,06	7,44 -0,12	4,46 -0,23	14,17 -0,63	24,12 -0,95
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,48 -0,02	5,36 -0,09	5,35 -0,04	8,68 -0,31	9,34 0,07	19,39 -0,16	27,68 -2,17
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	2,23 0,72	6,24 -0,03	6,14 0,96	9,06 -0,08	10,09 -8,74	20,14 -14,27	33,30 -12,63
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,68 -0,07	2,95 -0,09	2,32 -0,08	4,63 -0,13	5,46 -0,18	7,46 -0,64	14,22 -1,01
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,63 -0,12	2,92 -0,12	2,26 -0,14	4,59 -0,17	5,46 -0,17	7,54 -0,56	14,35 -0,88
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,72 -0,02	2,96 -0,09	2,33 -0,07	4,64 -0,13	5,38 -0,25	7,62 -0,48	14,49 -0,74
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,80 -0,03	3,59 -0,14	4,39 -0,10	7,37 -0,19	4,34 -0,35	14,13 -0,68	24,07 -0,99
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,81 -0,02	3,65 -0,08	4,44 -0,06	7,44 -0,13	4,43 -0,26	14,16 -0,64	23,72 -1,34
SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI	0,77 92,18	2,74 83,45	2,40 95,08	4,93 105,33	5,87 82,96	7,69 81,96	18,90 125,43
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,78 93,74	3,37 102,74	2,57 101,47	4,85 103,71	7,39 104,48	9,81 104,61	14,81 98,27
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,83 99,40	3,45 105,22	2,63 104,14	4,95 105,73	7,75 109,56	10,19 108,71	14,98 99,40
LENÇÓIS PAULISTA	1,10	3,99	3,66	6,43	7,12	11,44	23,46

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 4,87% p.p.	-0,32	-1,91	-1,25	-2,13	-10,45	-20,14	-17,87
CDI	0,83	3,28	2,53	4,68	7,08	9,38	15,07
IBOVESPA	-10,10	2,91	-3,81	4,23	-9,27	34,00	11,96
INPC + 6,00%	1,48	6,47	5,25	9,23	19,19	35,86	47,59
IPCA + 6,00%	1,50	6,27	5,18	9,14	18,83	34,41	45,93

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 IPCA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
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 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
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
ITAU 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 RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	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	0,75	3,04	2,40	4,76	5,63	8,09	15,23	22,93	33,92
IRF-M 1+	-0,53	0,26	0,76	4,79	-1,08	0,34	14,30	26,22	44,13
IRF-M TOTAL	-0,12	1,23	1,31	4,98	1,22	3,18	15,24	25,96	42,07
IMA-B 5	1,56	5,43	5,31	8,92	9,45	19,21	29,55	42,42	59,01
IMA-B 5+	0,08	1,99	3,65	6,19	-0,03	10,27	19,61	43,70	58,71
IMA-B TOTAL	0,83	3,73	4,49	7,56	4,69	14,81	25,06	44,56	60,36
IMA-GERAL TOTAL	0,54	3,09	2,88	5,86	4,95	9,79	19,09	31,12	45,31
IDKA 2	1,51	5,45	5,39	8,99	9,27	19,55	29,85	42,08	59,55
IDKA 20	-1,21	-0,85	2,14	2,79	-8,97	3,42	9,22	42,00	53,49
CDI	0,83	3,28	2,53	4,68	7,08	9,38	15,07	22,37	32,30

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-10,10	2,91	-3,81	4,23	-9,27	34,00	11,96	25,27	64,94
IBRX 100	-10,11	3,27	-3,37	4,71	-10,15	35,89	15,35	30,27	70,90
IBRX 50	-10,51	3,33	-4,01	5,29	-9,44	38,94	13,39	25,43	65,73
SMALL CAP	-8,36	-2,23	-5,46	-0,84	-20,81	23,46	17,79	30,74	73,22
IFIX	1,19	0,29	1,30	5,13	-1,68	8,04	12,14	20,36	38,18
Índice Consumo - ICON	-14,19		-11,54	-16,34	-30,65	-10,38	-9,46	-1,52	13,09
Índice Dividendos - IDIV	-5,19	9,49	1,87	12,24	3,76	42,18	31,97	56,94	85,91

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	1,06	4,29	3,73	6,05	12,13	19,71	22,58	28,64	32,19
INPC	1,04	4,49	3,80	6,14	12,47	21,00	23,98	30,27	32,47
IGPM	1,41	6,98	5,07	7,93	14,66	51,37	61,49	75,44	78,75
SELIC	0,83	3,28	2,53	4,68	7,08	9,38	15,07	22,37	32,32

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	-5,31	-23,58	-15,98	-21,79	-10,04	28,59	74,88	120,49	166,54
MSCI ACWI	-4,62	-23,67	-16,34	-23,54	-15,21	21,12	55,29	81,22	120,87

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,36	5,62	4,71	8,12	16,60	29,42	37,85	50,40	60,68
IPCA + 5,00%	1,43	5,94	4,95	8,63	17,72	31,90	41,85	56,24	68,52
IPCA + 5,50%	1,47	6,10	5,07	8,89	18,27	33,16	43,88	59,23	72,55
IPCA + 5,89%	1,50	6,23	5,16	9,08	18,71	34,14	45,48	61,58	75,75
IPCA + 6,00%	1,50	6,27	5,18	9,14	18,83	34,41	45,93	62,25	76,66
INPC + 4,00%	1,34	5,82	4,77	8,21	16,95	30,82	39,42	52,30	61,02
INPC + 6,00%	1,48	6,47	5,25	9,23	19,19	35,86	47,59	64,31	77,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
83	07/04/2022	BB PREV RF IDKA2	227.149,90	0,00	72.006,42342300	3,1545782890
84	07/04/2022	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.000.000,00	534.121,38504555	28,0835039000
85	08/04/2022	BB PREV RF IDKA2	869.273,94	0,00	275.254,99305800	3,1580678350
86	08/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	120.000,00	0,00	48.465,98984900	2,4759630490
87	08/04/2022	SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	15.000.000,00	0,00	74.305,47766100	201,8693705000
88	08/04/2022	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	1.985.000,00	0,00	68.044,76874100	29,1719707000
89	11/04/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	233.248,20	81.451,67019600	2,8636392870
90	12/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	233.248,20	0,00	94.130,83294500	2,4779149690
91	27/04/2022	BRAPRESA FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	3.019.606,75	1.110.035,59855170	2,7202792000
Total			18.434.672,04	18.252.854,95		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 2.505.683,07

Value-At-Risk: 0,58%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LENÇÓIS PAULISTA		0,58	0,58			432.216.536,00	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,58%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,31	0,00	0,39			9.290.210,71	2,15
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI		2,02	0,00	0,01			56.715,22	0,01
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,31	0,00	0,01			171.905,62	0,04
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,03	0,00	0,03			138.208,94	0,03
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		2,02	0,06	0,02			14.122.812,33	3,27
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,31	0,00	0,03			787.456,16	0,18
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,31	0,03	0,01			49.975.599,46	11,56
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS		0,31	0,03	0,01			64.437.597,22	14,91
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,04	0,13	0,01			54.453.913,19	12,60
BB PREV RF IDKA2		1,11	0,19	0,21			73.539.816,28	17,01
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR		2,02	0,01	0,01			2.827.853,53	0,65
BB PREV RF IPCA		0,86	0,07	0,83			39.879.024,74	9,23
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		0,29	0,04	0,28			73.357.667,87	16,97
Sub-total	1,18	0,62	0,55		0,26	1,14	383.038.781,27	88,62

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,04	0,00	0,04			15.102.895,02	3,49
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,03	0,00	0,03			992.222,61	0,23
SANTANDER RF ATIVO FIC		0,48	0,03	0,48			33.082.637,10	7,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,48	0,32	0,03		-0,12	0,78	49.177.754,73	11,38