



**LDB**  
EMPRESAS

**LENÇÓIS PAULISTA**  
MAIO 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 31.05.2022.

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	0,74	0,94	3,96	9.377.282,38	2,15	144.009.410,61	6,51
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,45	0,94	4,63	57.250,99	0,01	236.426.228,07	0,02
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,74	0,92	3,89	173.489,89	0,04	5.107.140.425,93	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,48	0,96	4,58	139.535,01	0,03	6.293.749.685,70	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,46	0,90	4,57	14.249.724,19	3,27	562.238.421,06	2,53
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,74	0,96	3,91	795.038,87	0,18	89.893.342,27	0,88
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,74	0,93	3,91	50.439.415,75	11,57	5.274.375.201,05	0,96
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,74	0,94	3,92	65.041.619,65	14,92	603.808.044,28	10,77
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,64	0,76	6,16	54.870.290,23	12,58	12.390.634.636,61	0,44
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,59	0,77	6,17	14.897.486,93	3,42	9.450.283.491,65	0,16
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	5,46	0,94	4,62	2.854.514,73	0,65	883.836.264,31	0,32
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,32	0,51	5,48	99.307.206,75	22,78	2.293.984.372,74	4,33
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,16	0,99	4,45	74.082.655,85	16,99	2.722.459.745,02	2,72
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,57</b>	<b>0,83</b>	<b>5,03</b>	<b>386.285.511,22</b>	<b>88,59</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
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	1,07	4,47	1.123.685,54	0,26	9.967.340.356,95	0,01
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,20	0,82	3,58	33.353.711,19	7,65	438.431.677,35	7,61
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,19	1,10	4,58	15.268.353,02	3,50	2.097.589.788,62	0,73
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,80</b>	<b>0,91</b>	<b>3,73</b>	<b>49.745.749,75</b>	<b>11,41</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,49</b>	<b>0,84</b>	<b>4,92</b>	<b>436.031.260,97</b>	<b>100,00</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Total

1,49

0,84

4,86

436.031.260,97

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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	386.285.511,22	88,59	60,00	80,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	49.745.749,75	11,41	10,00	10,00	65,00	0,00	65,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>436.031.260,97</b>	<b>100,00</b>					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	0,83 80,98	5,03 115,75	3,71 131,77	5,84 113,60	7,36 93,23	3.212.372,97	19.006.132,29
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,91 88,21	3,73 85,95	2,61 92,70			447.995,02	1.478.740,94
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	-5,65 -129,98	0,00 0,00			0,00	-194.067,26
<b>LENÇÓIS PAULISTA (Total)</b>						<b>3.660.367,99</b>	<b>20.290.805,97</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	73.539.816,28	2.779.199,65	-61.868.797,06	0,00	14.897.486,93	447.268,06	4.093.290,75
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	138.208,94	0,00	0,00	0,00	139.535,01	1.326,07	6.115,96
BB PREV RF IPCA	39.879.024,74	61.985.000,00	-2.861.045,61	0,00	99.307.206,75	304.227,62	2.183.252,36
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	171.905,62	0,00	0,00	0,00	173.489,89	1.584,27	502.144,40
BRDESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	64.437.597,22	0,00	0,00	0,00	65.041.619,65	604.022,43	2.518.128,20
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	14.122.812,33	0,00	0,00	0,00	14.249.724,19	126.911,86	622.195,15
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	54.453.913,19	0,00	0,00	0,00	54.870.290,23	416.377,04	3.165.799,89
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	49.975.599,46	0,00	0,00	0,00	50.439.415,75	463.816,29	1.960.998,41
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	73.357.667,87	0,00	0,00	0,00	74.082.655,85	724.987,98	3.159.508,60
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	56.715,22	0,00	0,00	0,00	57.250,99	535,77	2.534,62
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	9.290.210,71	0,00	0,00	0,00	9.377.282,38	87.071,67	357.221,19
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	787.456,16	0,00	0,00	0,00	795.038,87	7.582,71	375.177,01
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	2.827.853,53	0,00	0,00	0,00	2.854.514,73	26.661,20	59.765,75
					386.285.511,22	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	992.222,61	120.000,00	0,00	0,00	1.123.685,54	11.462,93	75.317,38
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	15.102.895,02	0,00	0,00	0,00	15.268.353,02	165.458,00	251.198,37
SANTANDER RF ATIVO FIC	33.082.637,10	0,00	0,00	0,00	33.353.711,19	271.074,09	1.152.225,19
					49.745.749,75	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

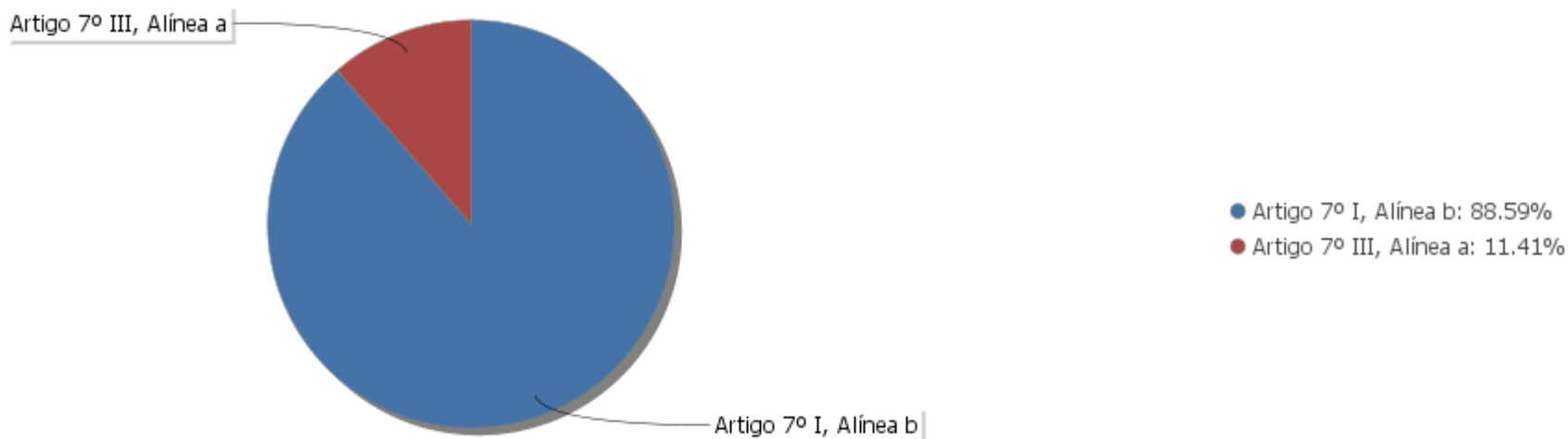
## Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	336.724.054,22	77,22	336.724.054,22	77,22
de 31 a 365 dias	99.307.206,75	22,78	436.031.260,97	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	436.031.260,97	100,00

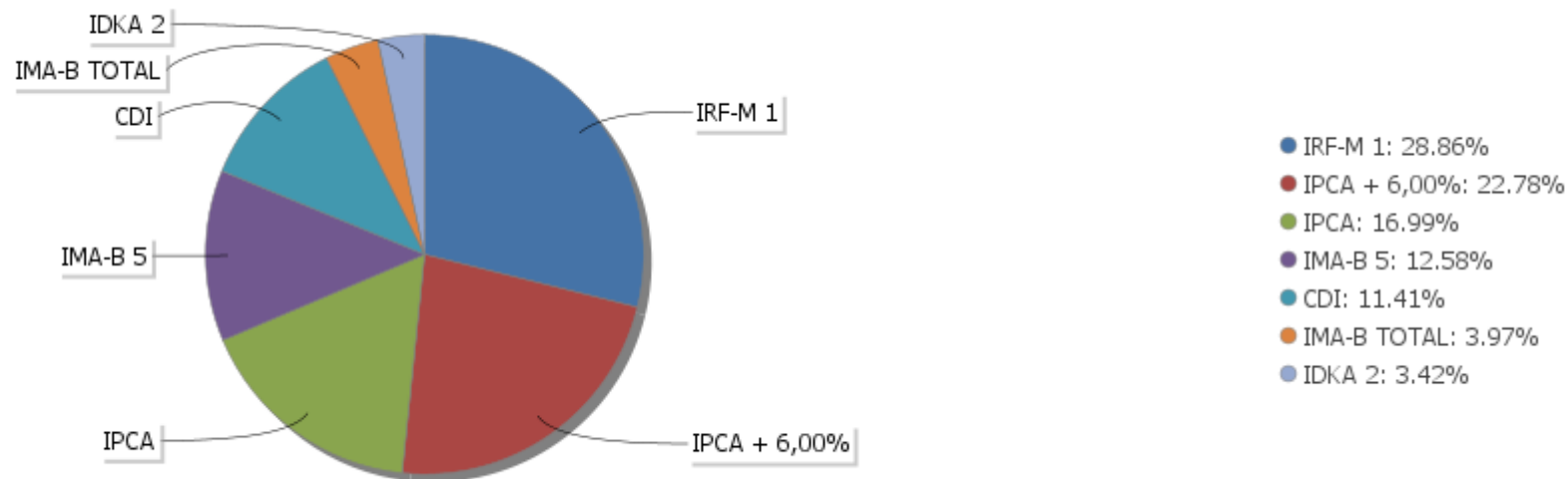


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

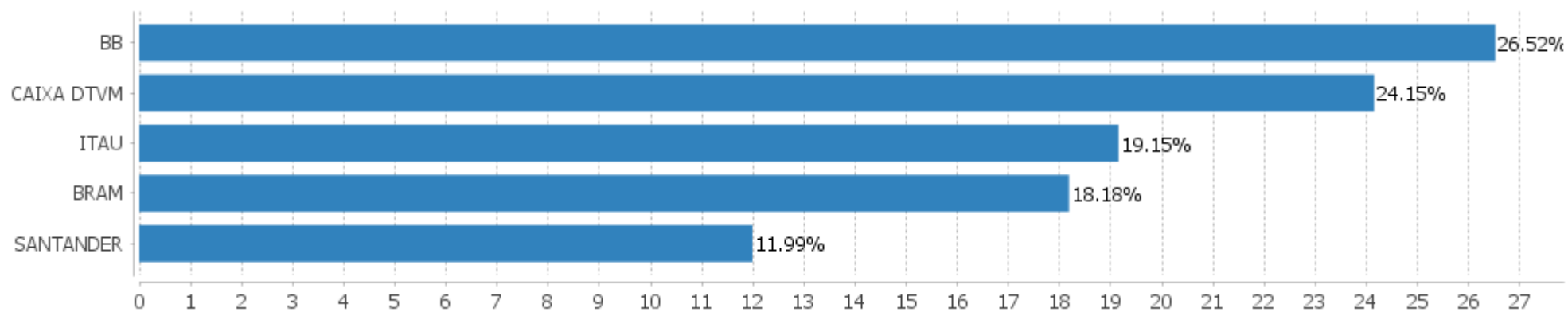


Alocação Por Estratégia



## 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	0,84								4,86
IPCA + 4,87%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89								6,84
p.p. indexador	-0,63	-0,48	-0,41	-0,32	-0,04								-1,98
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

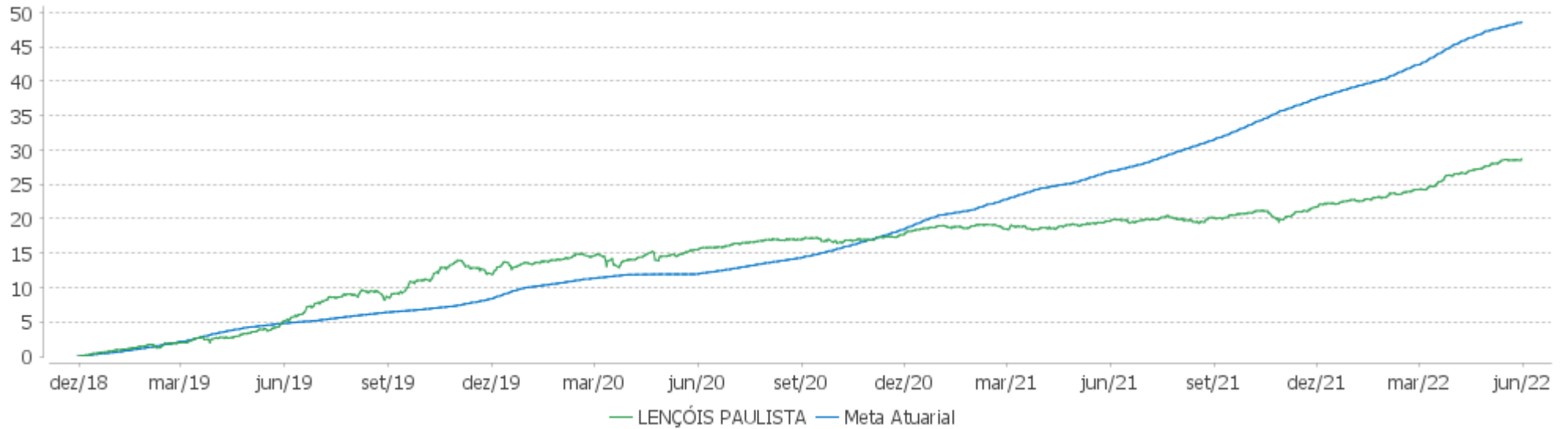
## Performance Sobre a Meta Atuarial

## Relatório

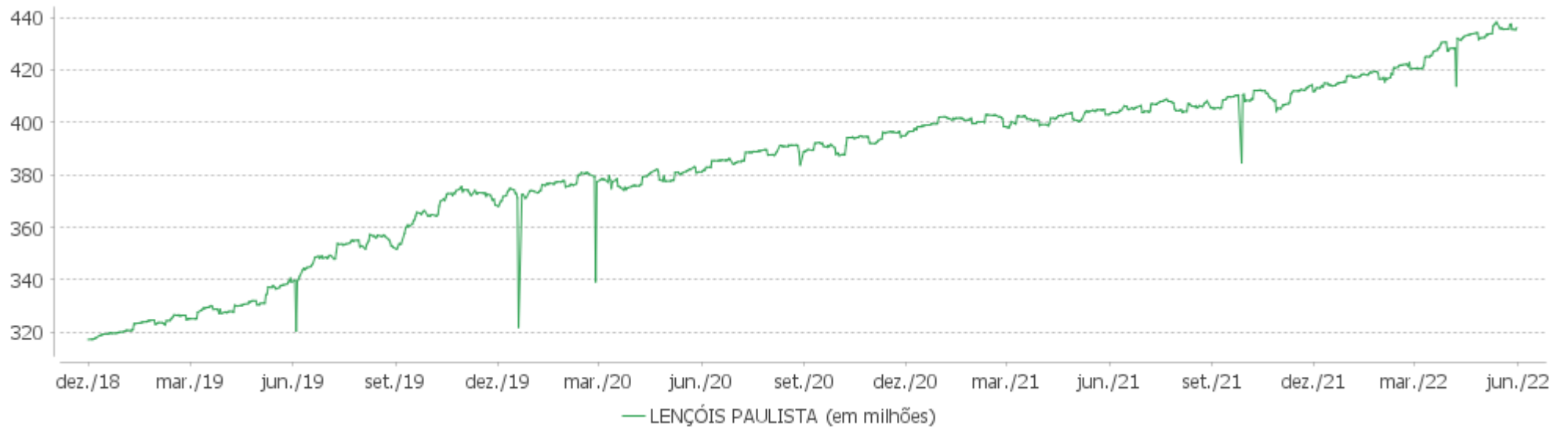
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	10	23,81	03 meses	3,62	4,41	-0,80	1,23
Meses abaixo - Meta Atuarial	32	76,19	06 meses	5,74	8,14	-2,40	1,20
			12 meses	7,58	17,53	-9,95	1,49
			24 meses	11,45	34,28	-22,83	1,37
			36 meses	22,49	44,98	-22,49	2,10
Maior rentabilidade da Carteira	2,45	2019-06	Desde 30/11/2018	28,72	52,73	-24,01	2,04
Menor rentabilidade da Carteira	-1,46	2019-11					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

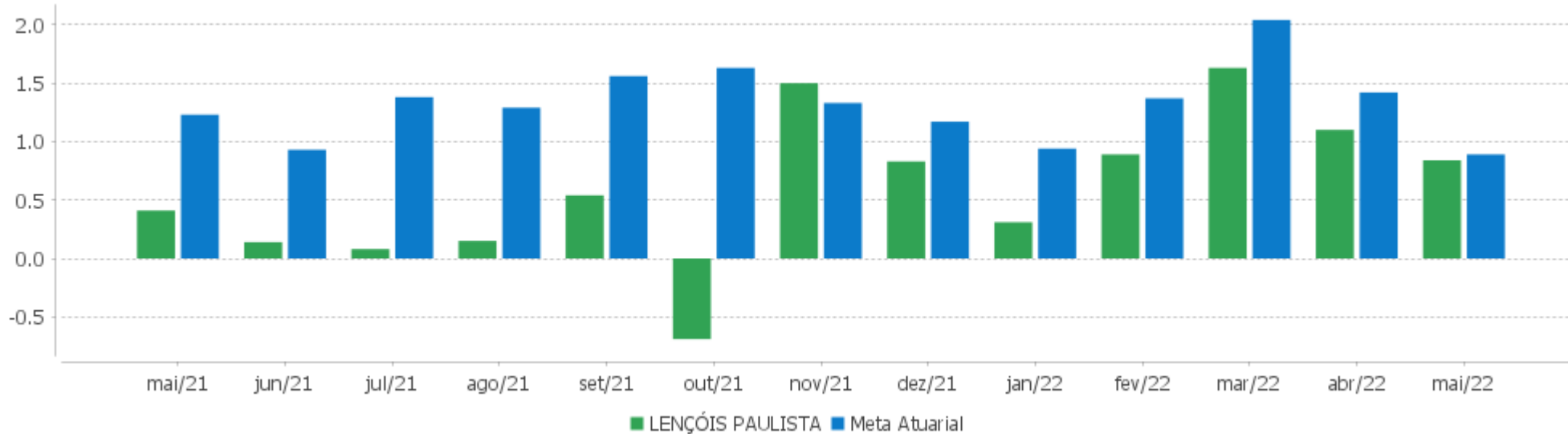


Patrimônio Líquido



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.	0,94 -0,01	3,96 -0,06	2,52 -0,08	4,83 -0,10	6,27 -0,15	8,23 -0,44	14,81 -0,74
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,76 -0,02	6,16 -0,10	4,96 -0,06	6,97 -0,12	9,31 -0,24	17,06 -0,59	27,78 -1,00
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,92 -0,03	3,90 -0,12	2,51 -0,10	4,78 -0,16	6,14 -0,29	7,98 -0,69	14,50 -1,04
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,99 0,52	4,45 -0,33	2,96 -0,22	5,35 -0,20	8,41 -3,32	10,30 -10,43	18,95 -4,05
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,90 -0,07	4,57 -0,16	4,83 -0,10	4,78 -0,19	4,22 -0,37	13,39 -0,79	20,55 -1,26
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,94 -0,02	4,63 -0,09	4,86 -0,07	4,85 -0,12	4,37 -0,23	13,58 -0,60	20,91 -0,90
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,77 -0,08	6,17 -0,17	4,95 -0,02	6,92 -0,30	9,45 0,21	17,95 -0,54	27,46 -1,73
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,51 -0,47	6,78 -0,54	5,23 0,53	7,37 -1,30	9,67 -8,76	17,81 -17,82	31,37 -15,05
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,94 -0,01	3,92 -0,10	2,51 -0,10	4,80 -0,13	6,24 -0,19	8,04 -0,63	14,54 -1,00
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,96 0,01	3,91 -0,11	2,47 -0,13	4,79 -0,14	6,28 -0,15	8,16 -0,51	14,70 -0,84
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,93 -0,02	3,91 -0,11	2,54 -0,07	4,79 -0,14	6,18 -0,25	8,19 -0,48	14,80 -0,74
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,96 -0,01	4,58 -0,14	4,83 -0,10	4,80 -0,17	4,24 -0,35	13,52 -0,66	20,88 -0,93
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,94 -0,02	4,62 -0,10	4,87 -0,06	4,84 -0,12	4,34 -0,26	13,54 -0,64	20,52 -1,28
SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI	0,82 79,47	3,58 82,37	2,51 89,03	4,38 85,15	6,38 80,89	8,05 78,56	17,70 113,25
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,07 103,41	4,47 102,93	2,84 100,83	5,31 103,21	8,23 104,30	10,70 104,45	15,42 98,68
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	1,10 106,26	4,58 105,52	2,91 103,48	5,43 105,67	8,55 108,32	11,16 108,97	15,62 99,95
LENÇÓIS PAULISTA	0,84	4,86	3,62	5,74	7,58	11,45	22,49

## 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.	-0,04	-1,98	-0,80	-2,35	-9,59	-21,30	-19,32
CDI	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63
IBOVESPA	3,22	6,23	-1,58	9,26	-11,78	27,40	14,76
INPC + 6,00%	0,96	7,49	4,75	8,85	18,61	36,88	48,04
IPCA + 6,00%	0,98	7,31	4,69	8,67	18,43	35,62	46,43

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
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADERCO 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	0,95	4,02	2,61	4,93	6,43	8,67	15,54	23,85	33,97
IRF-M 1+	0,39	0,65	0,67	2,95	-0,89	-1,17	12,32	30,13	44,56
IRF-M TOTAL	0,58	1,82	1,31	3,74	1,60	2,33	13,90	29,08	42,46
IMA-B 5	0,78	6,25	5,02	7,09	9,55	17,65	28,78	45,80	60,12
IMA-B 5+	1,16	3,17	4,84	2,82	-0,25	10,41	15,02	52,46	63,45
IMA-B TOTAL	0,96	4,73	4,93	4,96	4,59	14,18	21,81	50,71	63,86
IMA-GERAL TOTAL	0,92	4,04	3,06	4,94	5,26	9,68	18,01	34,24	46,62
IDKA 2	0,85	6,35	4,97	7,23	9,24	18,49	29,19	44,76	60,19
IDKA 20	1,21	0,35	3,98	-1,94	-10,01	4,21	1,84	54,09	61,61
CDI	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63	22,99	32,44

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,22	6,23	-1,58	9,26	-11,78	27,40	14,76	45,08	77,56
IBRX 100	3,23	6,61	-1,68	9,95	-12,43	29,27	17,73	50,94	83,12
IBRX 50	3,30	6,74	-2,55	10,76	-11,91	31,55	16,59	45,38	78,31
SMALL CAP	-1,82	-4,02	-2,10	-0,37	-26,87	15,36	13,41	44,72	71,86
IFIX	0,26	0,56	2,89	9,39	0,14	6,12	10,49	27,39	37,13
Índice Consumo - ICON	-3,02		-12,01	-12,30	-36,86	-19,27	-13,06	7,05	10,44
Índice Dividendos - IDIV	4,26	14,16	8,74	15,99	2,41	41,18	33,41	82,88	105,54

**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	0,47	4,78	3,18	5,55	11,73	20,73	23,00	28,73	32,40
INPC	0,45	4,96	3,23	5,73	11,90	21,85	24,35	30,30	32,59
IGPM	0,52	7,54	3,71	8,47	10,72	51,73	61,61	73,96	81,38
SELIC	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63	23,00	32,46

**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	-3,86	-26,53	-13,29	-23,87	-11,17	18,29	80,18	91,96	149,78
MSCI ACWI	-3,99	-26,71	-14,01	-24,39	-17,07	11,67	59,19	61,99	105,20

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,81	6,48	4,20	7,64	16,20	30,56	38,31	50,52	60,94
IPCA + 5,00%	0,90	6,90	4,45	8,16	17,32	33,08	42,33	56,38	68,79
IPCA + 5,50%	0,94	7,10	4,57	8,41	17,88	34,35	44,37	59,37	72,83
IPCA + 5,89%	0,97	7,26	4,67	8,61	18,31	35,34	45,97	61,73	76,03
IPCA + 6,00%	0,98	7,31	4,69	8,67	18,43	35,62	46,43	62,40	76,94
INPC + 4,00%	0,79	6,66	4,25	7,82	16,37	31,77	39,83	52,36	61,17
INPC + 6,00%	0,96	7,49	4,75	8,85	18,61	36,88	48,04	64,38	77,19

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
92	04/05/2022	BB PREV RF IPCA	60.000.000,00	0,00	21.789.402,93734400	2,7536321290
94	04/05/2022	BB PREV RF IDKA2	0,00	60.000.000,00	18.716.659,29537556	3,2057002830
97	06/05/2022	BB PREV RF IDKA2	227.149,90	0,00	70.932,85354700	3,2023228820
95	10/05/2022	BB PREV RF IDKA2	869.273,94	0,00	271.743,88926200	3,1988720790
98	10/05/2022	BB PREV RF IPCA	1.985.000,00	0,00	720.914,36832800	2,7534476870
101	10/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	120.000,00	0,00	48.048,56089300	2,4974733430
93	16/05/2022	BB PREV RF IPCA	0,00	1.682.775,81	606.765,54446900	2,7733542640
99	16/05/2022	BB PREV RF IPCA	0,00	1.178.269,80	424.853,69261900	2,7733542640
96	25/05/2022	BB PREV RF IDKA2	1.682.775,81	0,00	524.738,39332800	3,2068852430
100	27/05/2022	BB PREV RF IDKA2	0,00	1.868.797,06	583.123,60807400	3,2048043230
<b>Total</b>			<b>64.884.199,65</b>	<b>64.729.842,67</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 2.322.237,36

Value-At-Risk: 0,53%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LENÇÓIS PAULISTA		0,53	0,53			436.031.260,97	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,53%

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		0,30	0,00	0,38			9.377.282,38	2,15
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI		2,07	0,00	0,01			57.250,99	0,01
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,31	0,00	0,01			173.489,89	0,04
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,07	0,00	0,03			139.535,01	0,03
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		2,07	0,06	0,04			14.249.724,19	3,27
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,30	0,00	0,03			795.038,87	0,18
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,31	0,02	0,01			50.439.415,75	11,57
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS		0,31	0,03	0,01			65.041.619,65	14,92
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,08	0,13	0,02			54.870.290,23	12,58
BB PREV RF IDKA2		1,26	0,04	0,25			14.897.486,93	3,42
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR		2,08	0,01	0,01			2.854.514,73	0,65
BB PREV RF IPCA		0,88	0,17	0,85			99.307.206,75	22,78
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		0,29	0,04	0,30			74.082.655,85	16,99
<b>Sub-total</b>	<b>1,17</b>	<b>0,57</b>	<b>0,50</b>		<b>-0,17</b>	<b>0,83</b>	<b>386.285.511,22</b>	<b>88,59</b>

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
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,04	0,00	0,03			1.123.685,54	0,26
SANTANDER RF ATIVO FIC		0,44	0,03	0,44			33.353.711,19	7,65
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,04	-0,00	0,03			15.268.353,02	3,50

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
<b>Sub-total</b>	0,44	0,30	0,03		-0,28	0,91	49.745.749,75	11,41