



LDB
EMPRESAS

LENÇÓIS PAULISTA
DEZEMBRO 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 30.12.2022.

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. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,47	0,05	1,16	11,85	10.088.626,89	2,18	184.221.130,31	5,48
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,34	0,04	-0,21	6,14	58.073,89	0,01	228.060.489,18	0,03
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,48	0,05	1,16	11,72	186.567,10	0,04	6.516.931.621,39	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,32	0,04	-0,22	6,09	141.548,65	0,03	6.078.064.149,48	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,35	0,04	-0,22	6,00	14.445.621,59	3,12	506.172.104,47	2,85
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,48	0,05	1,16	11,86	855.885,50	0,18	87.552.651,26	0,98
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,48	0,05	1,15	11,74	46.070.404,67	9,95	6.557.713.378,25	0,70
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,48	0,05	1,15	11,78	17.172.138,65	3,71	554.964.817,38	3,09
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,60	0,04	0,92	9,67	58.858.976,31	12,71	7.960.289.495,76	0,74
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,82	0,04	1,22	9,32	13.365.994,14	2,89	7.489.389.892,90	0,18
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	5,36	0,04	-0,22	6,11	2.895.117,03	0,63	564.735.869,38	0,51
BB	BB	BB PREV RF IPCA	1,93	0,04	0,95	10,06	100.652.493,00	21,73	3.745.902.538,43	2,69
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,08	0,05	-0,37	7,83	14.205.381,97	3,07	2.189.575.950,42	0,65
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,92	0,04	1,02	1,02	10.101.565,39	2,18	2.756.777.028,75	0,37
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,44	0,04	0,88	10,30	289.098.394,78	62,41		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,13	0,05	1,13	5,78	58.176.874,42	12,56	3.683.074.422,00	1,58
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,09	0,05	1,12	12,59	1.989.829,38	0,43	12.858.761.791,29	0,02
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,47	0,05	0,88	9,28	581.928,09	0,13	331.650.051,41	0,18
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,09	0,05	1,14	12,87	58.246.368,45	12,57	2.966.118.233,61	1,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,05	1,17	5,81	55.122.484,91	11,90	7.627.582.136,16	0,72
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	0,56	0,05	1,14	11,67	174.117.485,25	37,59		
		Renda Fixa	1,14	0,05	0,98	10,94	463.215.880,03	100,00		
		Total	1,14	0,05	0,98	10,88	463.215.880,03	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	289.098.394,78	62,41	60,00	80,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	174.117.485,25	37,59	10,00	10,00	65,00	0,00	65,00
	Total Renda Fixa	463.215.880,03	100,00					100,00
Total		463.215.880,03	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	0,88 78,63	10,30 83,22	2,87 89,58	4,42 66,82	10,30 83,22	2.527.319,08	33.800.346,91
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,14 101,70	11,67 94,36	3,30 103,30	6,81 103,00	11,67 94,36	1.963.723,55	11.735.476,44
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	-5,65 -45,63	0,00 0,00	0,00 0,00	-5,65 -45,63	0,00	-194.067,26
LENÇÓIS PAULISTA (Total)						4.491.042,63	45.341.756,09

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	20.786.273,52	2.414.076,87	-10.000.000,00	0,00	13.365.994,14	165.643,75	4.556.504,74
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	141.858,04	0,00	0,00	0,00	141.548,65	-309,39	8.129,60
BB PREV RF IPCA	99.700.387,16	0,00	0,00	0,00	100.652.493,00	952.105,84	6.457.114,39
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	184.433,06	0,00	0,00	0,00	186.567,10	2.134,04	515.221,61
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,00	10.000.000,00	0,00	0,00	10.101.565,39	101.565,39	101.565,39
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	16.976.310,98	0,00	0,00	0,00	17.172.138,65	195.827,67	4.648.647,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	14.478.174,91	0,00	0,00	0,00	14.445.621,59	-32.553,32	818.092,55
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	58.321.222,57	0,00	0,00	0,00	58.858.976,31	537.753,74	5.009.485,97
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	47.301.144,94	0,00	-1.770.000,00	0,00	46.070.404,67	539.259,73	5.587.676,16
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	14.258.106,32	0,00	0,00	0,00	14.205.381,97	-52.724,35	4.489.594,39
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	58.197,68	0,00	0,00	0,00	58.073,89	-123,79	3.357,52
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	9.973.253,22	0,00	0,00	0,00	10.088.626,89	115.373,67	1.068.565,70
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	846.029,60	0,00	0,00	0,00	855.885,50	9.855,90	436.023,64
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	2.901.606,83	0,00	0,00	0,00	2.895.117,03	-6.489,80	100.368,05
					289.098.394,78	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	1.700.604,86	270.000,00	0,00	0,00	1.989.829,38	19.224,52	181.461,22
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	54.487.239,52	0,00	0,00	0,00	55.122.484,91	635.245,39	2.991.484,91
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	57.527.923,22	0,00	0,00	0,00	58.176.874,42	648.951,20	3.176.874,42
SANTANDER RF ATIVO FIC	576.864,03	0,00	0,00	0,00	581.928,09	5.064,06	1.380.442,09
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	57.591.130,07	0,00	0,00	0,00	58.246.368,45	655.238,38	4.005.213,80
					174.117.485,25	0,00	0,00

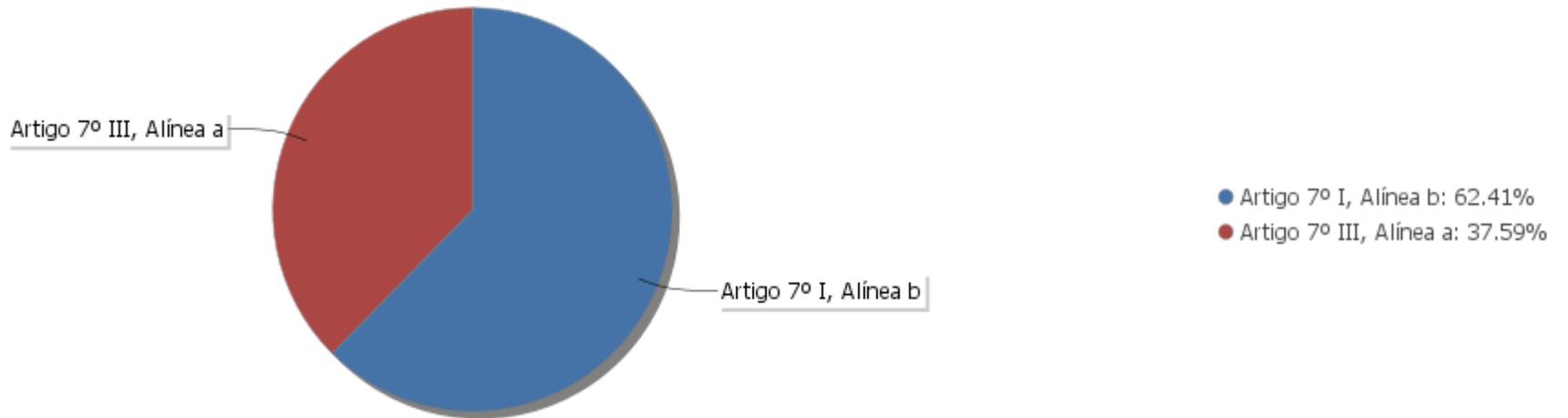
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

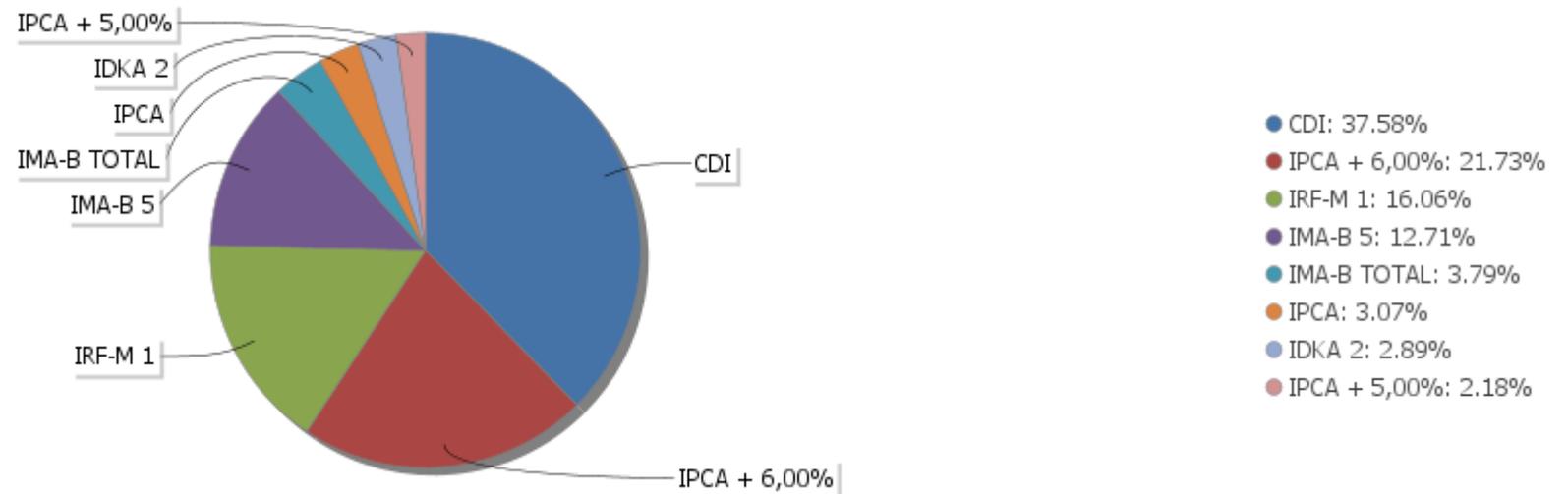
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	352.461.821,64	76,09	352.461.821,64	76,09
de 31 a 365 dias	100.652.493,00	21,73	453.114.314,64	97,82
acima de 365 dias	10.101.565,39	2,18	463.215.880,03	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

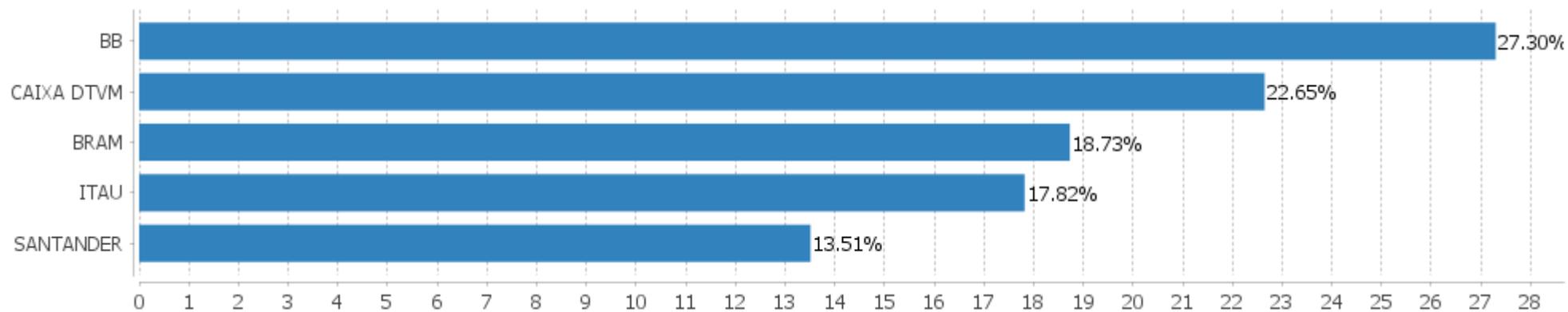


Alocação Por Estratégia



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	0,60	0,52	0,68	0,80	1,44	0,58	0,98	10,88
IPCA + 4,87%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,29	0,07	0,11	0,97	0,79	1,04	10,92
p.p. indexador	-0,63	-0,48	-0,41	-0,32	-0,04	-0,47	0,81	0,61	0,70	0,47	-0,21	-0,06	-0,03
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	14	28,57	03 meses	3,03	2,83	0,21	1,05
Meses abaixo - Meta Atuarial	35	71,43	06 meses	5,11	2,72	2,39	1,02
			12 meses	10,88	10,92	-0,03	1,14
			24 meses	14,41	28,65	-14,25	1,36
			36 meses	19,80	42,50	-22,70	1,68
			48 meses	35,08	57,59	-22,51	1,95
			Desde 30/11/2018	36,11	58,56	-22,45	1,93

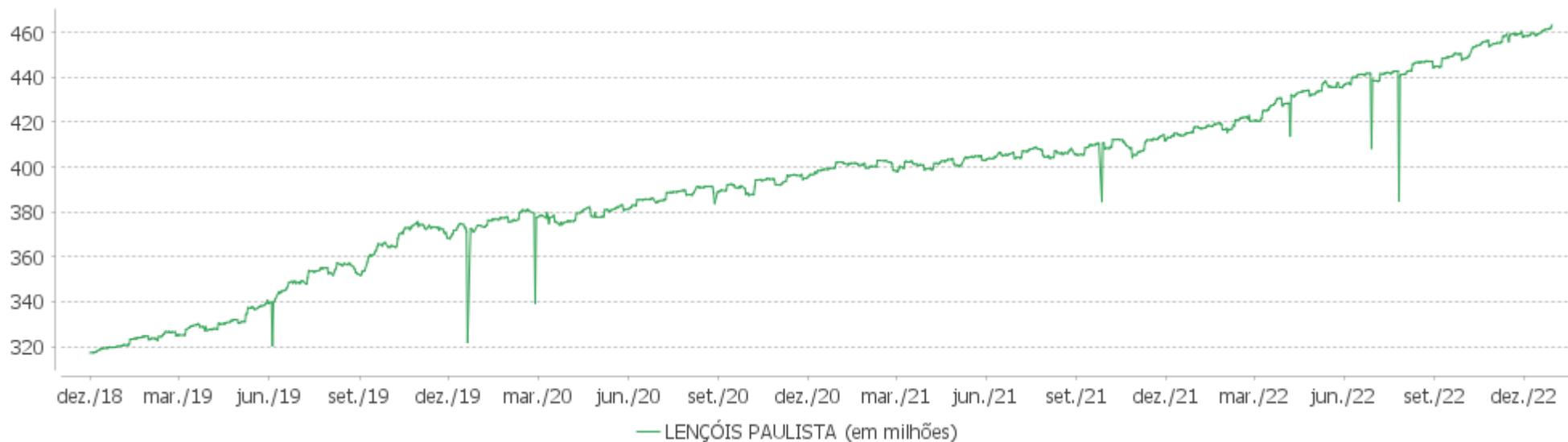
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,45	2019-06
Menor rentabilidade da Carteira	-1,46	2019-11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

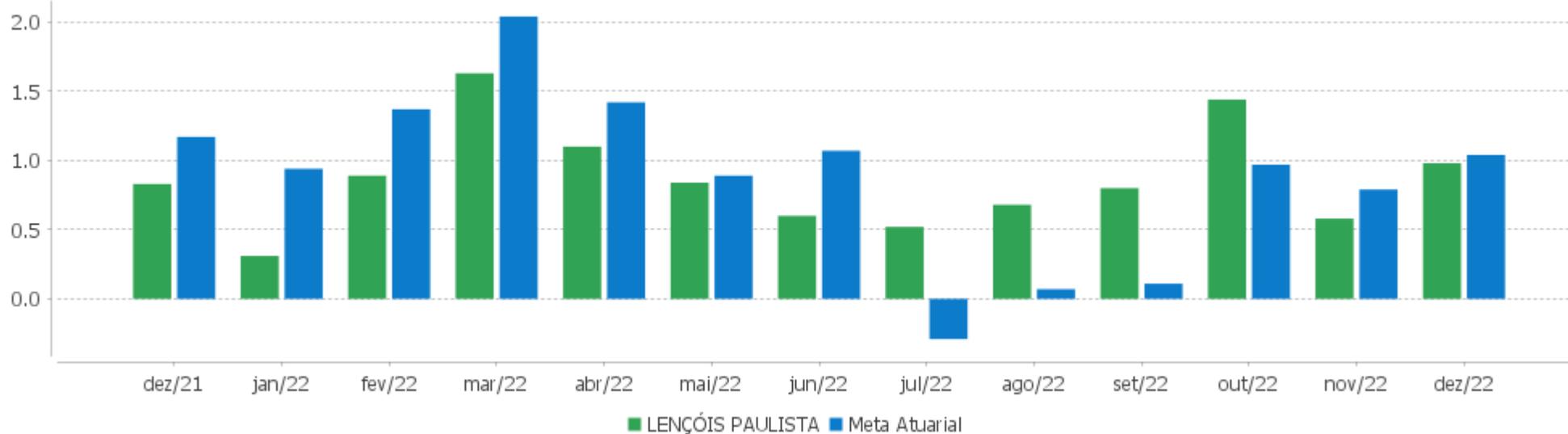


Patrimônio Líquido



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.	1,16 -0,02	11,85 -0,17	3,11 -0,05	6,60 -0,10	11,85 -0,17	14,97 -0,33	18,97 -0,76
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,92 -0,02	9,67 -0,11	2,46 -0,07	2,96 -0,01	9,67 -0,11	14,40 -0,40	23,26 -0,76
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,16 -0,02	11,73 -0,29	3,09 -0,07	6,56 -0,14	11,73 -0,29	14,68 -0,62	18,66 -1,07
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,32 0,27	8,60 -1,66	2,71 -0,15	2,69 -0,09			
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	-0,37 -0,99	7,83 2,04	-0,53 -2,16	2,43 2,14	7,83 2,04	12,71 -3,72	15,94 -5,75
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TÍTULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,22 -0,03	6,00 -0,37	0,15 -0,08	1,77 -0,17	6,00 -0,37	4,29 -0,74	10,59 -1,16
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLAÇÃO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,21 -0,02	6,14 -0,23	0,18 -0,06	1,83 -0,11	6,14 -0,23	4,56 -0,47	10,94 -0,81
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,22 -0,02	9,32 -0,02	2,42 0,17	2,69 0,36	9,32 -0,02	14,40 -0,38	23,46 -1,22
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	1,15 -0,03	11,78 -0,24	3,10 -0,06	6,59 -0,11	11,78 -0,24	14,75 -0,55	18,74 -0,98
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,95 -0,18	11,41 -0,70	3,98 0,88	4,00 0,73	11,41 -0,70	16,36 -14,40	26,43 -18,41
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,16 -0,01	11,86 -0,15	3,12 -0,04	6,65 -0,04	11,86 -0,15	15,01 -0,29	18,98 -0,75
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,22 -0,02	6,09 -0,28	0,17 -0,07	1,80 -0,14	6,09 -0,28	4,49 -0,54	10,90 -0,85
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,15 -0,02	11,74 -0,28	3,09 -0,06	6,56 -0,13	11,74 -0,28	14,76 -0,54	18,92 -0,80
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,22 -0,03	6,11 -0,26	0,17 -0,07	1,81 -0,13	6,11 -0,26	4,49 -0,53	10,60 -1,15
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	1,13 100,42	13,13 106,12	3,32 103,91	6,83 103,32	13,13 106,12	18,83 108,78	21,84 106,21
SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI	0,88 78,15	9,28 74,97	1,99 62,12	4,75 71,82	9,28 74,97	12,81 74,00	15,86 77,13
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1,17	13,00	3,34	6,89	13,00	18,58	21,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	103,79	105,05	104,31	104,19	105,05	107,34	102,67
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1,12	12,59	3,22	6,67	12,59	17,79	20,62
% do CDI	99,92	101,73	100,61	100,91	101,73	102,78	100,29
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	1,14	12,87	3,27	6,79	12,87	18,52	21,01
% do CDI	101,28	104,03	102,22	102,67	104,03	106,98	102,17
LENÇÓIS PAULISTA	0,98	10,88	3,03	5,11	10,88	14,41	19,80
Var. IPCA + 4,87% p.p.	-0,06	-0,03	0,21	2,39	-0,03	-13,59	-20,47
CDI	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56
IBOVESPA	-2,45	4,69	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11
INPC + 6,00%	1,20	12,26	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46
IPCA + 6,00%	1,13	12,11	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83

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
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	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 RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI			D+0	D+0		0,18
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 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
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		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	1,18	12,02	3,16	6,70	12,02	15,30	19,73	27,82	36,73
IRF-M 1+	1,62	7,41	1,10	6,63	7,41	2,06	10,68	26,44	41,95
IRF-M TOTAL	1,48	8,82	1,74	6,49	8,82	6,66	13,80	27,49	41,17
IMA-B 5	0,94	9,78	2,53	2,98	9,78	14,79	24,02	40,34	54,18
IMA-B 5+	-1,19	3,30	-1,72	1,24	3,30	-3,47	1,84	32,76	53,22
IMA-B TOTAL	-0,19	6,37	0,23	1,94	6,37	5,02	11,75	37,40	55,34
IMA-GERAL TOTAL	0,77	9,66	1,73	4,95	9,66	10,71	16,62	31,57	44,78
IDKA 2	1,24	9,34	2,25	2,34	9,34	14,78	24,67	39,41	53,01
IDKA 20	-3,32	-1,92	-5,66	0,71	-1,92	-16,13	-14,29	23,65	48,88
CDI	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,96

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,45	4,69	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11	24,86	43,63
IBRX 100	-2,63	4,02	-0,39	10,33	4,02	-7,61	-4,37	27,56	47,23
IBRX 50	-2,55	5,72	0,38	12,12	5,72	-5,43	-2,00	26,57	44,96
SMALL CAP	-3,01	-15,06	-7,61	5,76	-15,06	-28,82	-29,28	11,87	20,97
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	-1,61	12,65	3,15	7,71	12,65	5,43	4,37	51,51	75,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-7,26	-24,68	3,34	1,04	-24,68	2,63	53,84	106,24	126,51

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,00	2,22	-4,14	2,56	2,22	-0,11	-10,33	21,92	28,78

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-5,43	-25,01	5,58	1,05	-25,01	-5,95	38,64	78,90	86,12

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,62	5,79	1,63	0,28	5,79	16,43	21,69	26,93	31,68
INPC	0,69	5,93	1,55	0,30	5,93	16,70	23,05	28,57	32,98
IGPM	0,45	5,45	-1,09	-2,51	5,45	24,20	52,94	64,11	76,48
SELIC	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,97

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,97	10,00	2,61	2,28	10,00	25,89	36,82	48,44	60,11
IPCA + 5,00%	1,05	11,05	2,86	2,78	11,05	28,31	40,79	54,22	67,93
IPCA + 5,50%	1,09	11,58	2,98	3,03	11,58	29,53	42,80	57,17	71,96
IPCA + 5,89%	1,12	11,99	3,07	3,22	11,99	30,49	44,38	59,51	75,15
IPCA + 6,00%	1,13	12,11	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83	60,17	76,06
INPC + 4,00%	1,04	10,15	2,53	2,31	10,15	26,18	38,35	50,36	61,69
INPC + 6,00%	1,20	12,26	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46	62,24	77,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
146	06/12/2022	BB PREV RF IDKA2	0,00	10.000.000,00	3.053.606,91742200	3,2748157410
149	06/12/2022	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	10.000.000,00	0,00	9.302.030,19218100	1,0750341370
147	09/12/2022	BB PREV RF IDKA2	973.890,50	0,00	296.693,34804200	3,2824817490
153	13/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	855.000,00	287.109,00639600	2,9779630000
150	19/12/2022	BB PREV RF IDKA2	448.533,92	0,00	137.130,12518900	3,2708634910
151	28/12/2022	BB PREV RF IDKA2	17.761,94	0,00	5.378,47905200	3,3024094410
154	28/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	915.000,00	305.455,02620700	2,9955310000
152	29/12/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	270.000,00	0,00	99.632,95624800	2,7099466900
148	30/12/2022	BB PREV RF IDKA2	973.890,51	0,00	294.437,87766900	3,3076264430
Total			12.684.076,87	11.770.000,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 2.375.254,05

Value-At-Risk: 0,51%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LENÇÓIS PAULISTA		0,51	0,51			463.215.880,03	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,51%

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		0,12	-0,00	0,17			10.088.626,89	2,18
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI		2,93	0,00	0,01			58.073,89	0,01
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,12	0,00	0,01			186.567,10	0,04
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,92	0,00	0,05			141.548,65	0,03
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		2,94	0,08	0,00			14.445.621,59	3,12
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,12	0,00	0,02			855.885,50	0,18
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,11	0,01	0,01			46.070.404,67	9,95
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS		0,12	0,00	0,00			17.172.138,65	3,71
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,41	0,17	0,03			58.858.976,31	12,71
BB PREV RF IDKA2		1,48	0,04	0,39			13.365.994,14	2,89
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR		2,94	0,02	0,01			2.895.117,03	0,63
BB PREV RF IPCA		0,89	0,12	0,86			100.652.493,00	21,73
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,94	0,05	1,96			14.205.381,97	3,07
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,31	0,03	1,29			10.101.565,39	2,18
Sub-total	1,27	0,82	0,51		-0,19	0,88	289.098.394,78	62,41

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,01	0,00	0,01			58.176.874,42	12,56
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	0,00	0,01			1.989.829,38	0,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RF ATIVO FIC		0,85	0,00	0,85			581.928,09	0,13
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,01	-0,00	0,01			58.246.368,45	12,57
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,01	0,00	0,01			55.122.484,91	11,90
Sub-total	0,02	0,01	0,00		1,04	1,14	174.117.485,25	37,59