



LDB
EMPRESAS

LENÇÓIS PAULISTA
FEVEREIRO 2023



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 28.02.2023.

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				
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,06	0,05	0,16	0,16	58.289.798,58	12,33	7.525.601.851,71	0,77
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,44	0,10	1,00	2,09	10.299.465,65	2,18	230.132.035,89	4,48
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,58	-0,28	1,26	1,24	30.066.494,23	6,36	233.663.337,49	12,87
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,44	0,04	0,96	2,03	1.680.437,34	0,36	6.481.837.661,08	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,55	-0,28	1,27	1,26	848.534,98	0,18	5.703.776.580,01	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,59	-0,28	1,26	1,23	14.623.425,72	3,09	445.810.378,85	3,28
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,44	0,04	0,97	2,08	3.055.225,90	0,65	92.045.357,87	3,32
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,44	0,04	0,97	2,10	47.037.164,63	9,95	6.896.825.441,61	0,68
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,44	0,04	0,97	2,07	17.527.001,05	3,71	586.814.847,06	2,99
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,64	0,01	1,39	2,78	60.497.956,40	12,80	7.935.684.977,28	0,76
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,88	0,01	1,49	2,95	14.486.685,44	3,06	6.918.204.948,36	0,21
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	5,59	-0,28	1,26	1,23	2.930.655,15	0,62	601.983.104,47	0,49
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	5,62	-0,14	0,92	0,92	982.840,83	0,21	1.512.665.827,89	0,06
BB	BB	BB PREV RF IPCA	1,84	0,08	0,91	2,43	103.097.673,47	21,81	3.864.016.961,46	2,67
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,52	-0,16	1,14	1,65	40.438.026,91	8,55	2.181.457.433,60	1,85
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,85	0,01	1,34	2,75	10.088.701,39	2,13	2.890.200.807,38	0,35
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,48	-0,01	1,08	2,32	415.950.087,67	87,98		

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	0,12	0,00	0,77	1,91	0,00	0,00	4.003.075.067,69	0,00
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,09	0,00	0,69	1,83	0,00	0,00	13.891.144.708,98	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,49	0,03	0,97	1,92	593.086,38	0,13	284.318.131,78	0,21
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,09	0,00	0,69	1,75	0,00	0,00	2.976.038.258,45	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,06	0,05	0,88	2,02	56.233.862,89	11,89	8.371.920.489,79	0,67
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,41	0,05	0,85	1,96	56.826.949,27	12,02		
Renda Fixa			1,11	-0,00	0,99	2,18	472.777.036,94	100,00		
Total			1,11	-0,00	0,99	2,18	472.777.036,94	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	415.950.087,67	87,98	60,00	80,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	56.826.949,27	12,02	10,00	10,00	60,00	0,00	65,00
	Total Renda Fixa	472.777.036,94	100,00					100,00
Total		472.777.036,94	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	1,08 117,98	2,32 113,16	3,23 100,85	5,91 91,67	11,44 88,02	3.305.808,93	6.849.410,62
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,85 92,54	1,96 95,54	3,13 97,72	6,51 100,95	12,63 97,17	1.347.445,81	3.281.684,49
LENÇÓIS PAULISTA (Total)						4.653.254,74	10.131.095,11

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	13.784.392,99	493.247,72	0,00	0,00	14.486.685,44	209.044,73	403.176,62
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	141.533,77	706.748,64	0,00	0,00	848.534,98	252,57	237,69
BB PREV RF IPCA	102.163.016,65	0,00	0,00	0,00	103.097.673,47	934.656,82	2.445.180,47
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	188.539,06	1.487.814,82	0,00	0,00	1.680.437,34	4.083,46	6.055,42
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	10.241.721,78	0,00	-289.890,58	0,00	10.088.701,39	136.870,19	277.026,58
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	17.358.737,31	0,00	0,00	0,00	17.527.001,05	168.263,74	354.862,40
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	14.441.980,62	0,00	0,00	0,00	14.623.425,72	181.445,10	177.804,13
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	59.668.164,46	0,00	0,00	0,00	60.497.956,40	829.791,94	1.638.980,09
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.586.955,37	0,00	0,00	0,00	47.037.164,63	450.209,26	966.759,96
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	973.890,48	0,00	0,00	982.840,83	8.950,35	8.950,35
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	14.276.680,92	26.039.249,29	0,00	0,00	40.438.026,91	122.096,70	193.395,65
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	58.061,62	30.000.000,00	0,00	0,00	30.066.494,23	8.432,61	8.420,34
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	10.197.122,07	0,00	0,00	0,00	10.299.465,65	102.343,58	210.838,76
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	865.216,15	2.170.000,00	0,00	0,00	3.055.225,90	20.009,75	29.340,40
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	2.894.140,66	0,00	0,00	0,00	2.930.655,15	36.514,49	35.538,12
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	58.196.954,94	0,00	0,00	58.289.798,58	92.843,64	92.843,64
					415.950.087,67	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\$)
SANTANDER RF ATIVO FIC	587.365,84	0,00	0,00	0,00	593.086,38	5.720,54	11.158,29
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.957.190,71	223.000,00	-2.194.563,46	0,00	0,00	14.372,75	36.734,08
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	55.744.025,25	0,00	0,00	0,00	56.233.862,89	489.837,64	1.111.377,98
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	58.834.830,14	0,00	-59.271.294,66	0,00	0,00	436.464,52	1.094.420,24
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	57.795.904,58	0,00	-58.196.954,94	0,00	0,00	401.050,36	1.027.993,90
					56.826.949,27	0,00	0,00

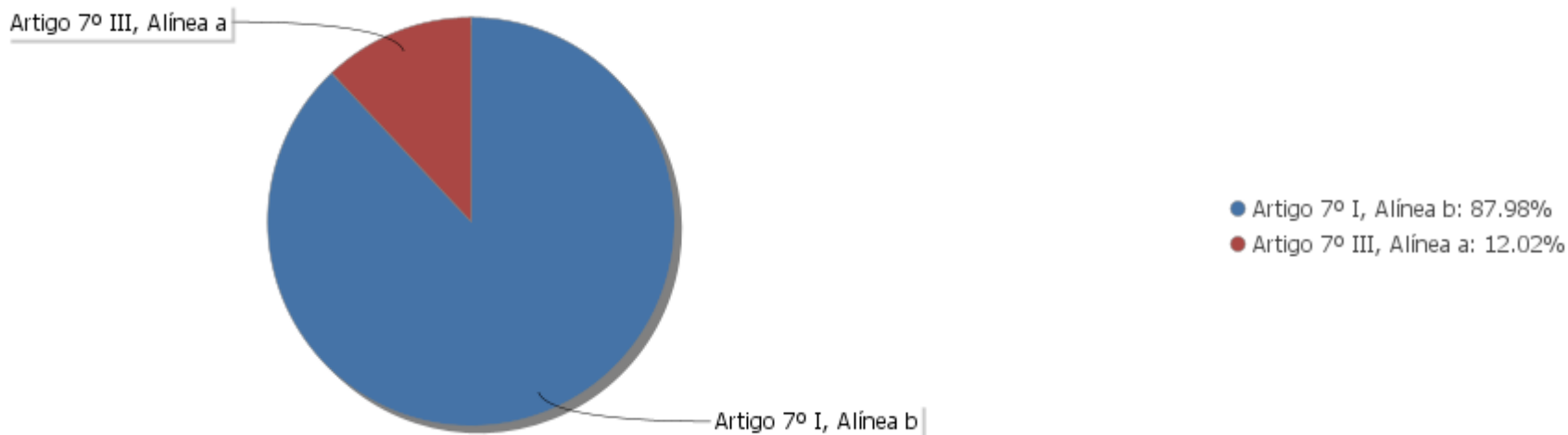
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

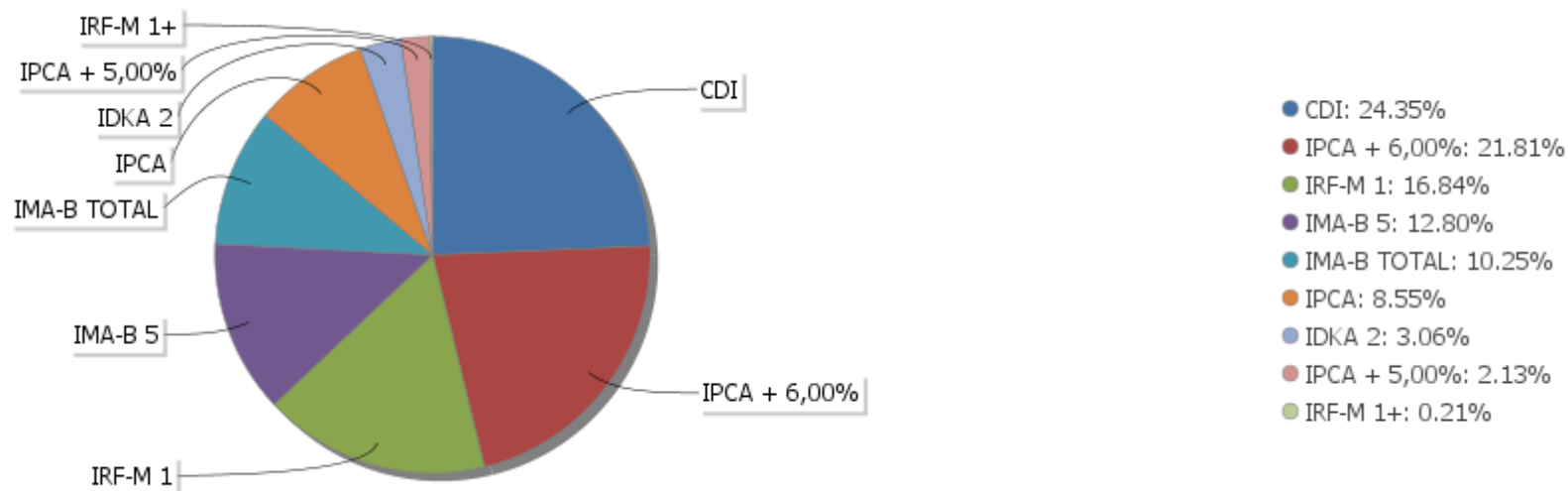
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	359.590.662,08	76,06	359.590.662,08	76,06
de 31 a 365 dias	103.097.673,47	21,81	462.688.335,55	97,87
acima de 365 dias	10.088.701,39	2,13	472.777.036,94	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

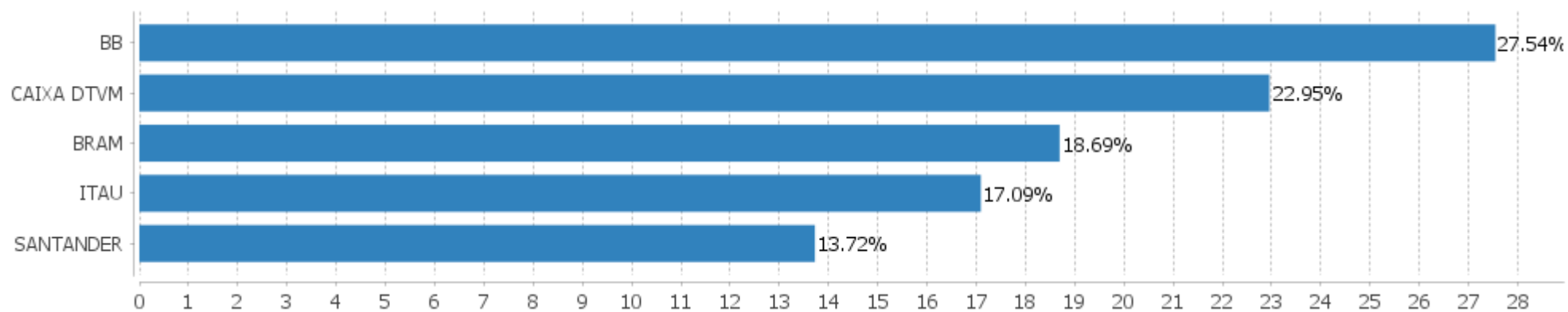


Alocação Por Estratégia



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
2023	1,18	0,99											2,18
IPCA + 4,72%	0,94	1,17											2,12
p.p. indexador	0,24	-0,18											0,06
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

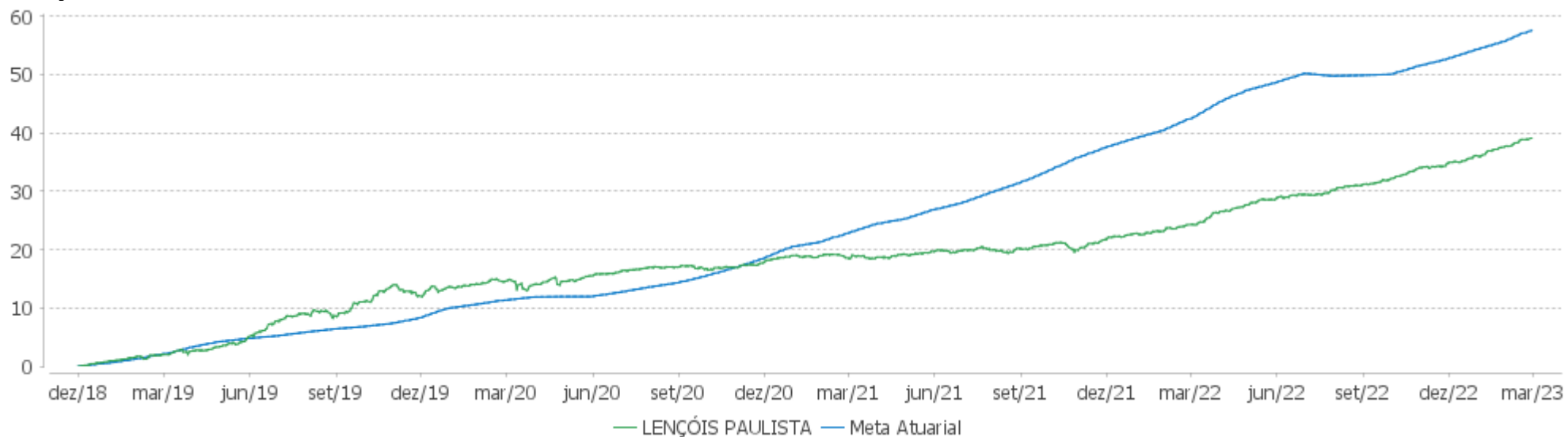
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

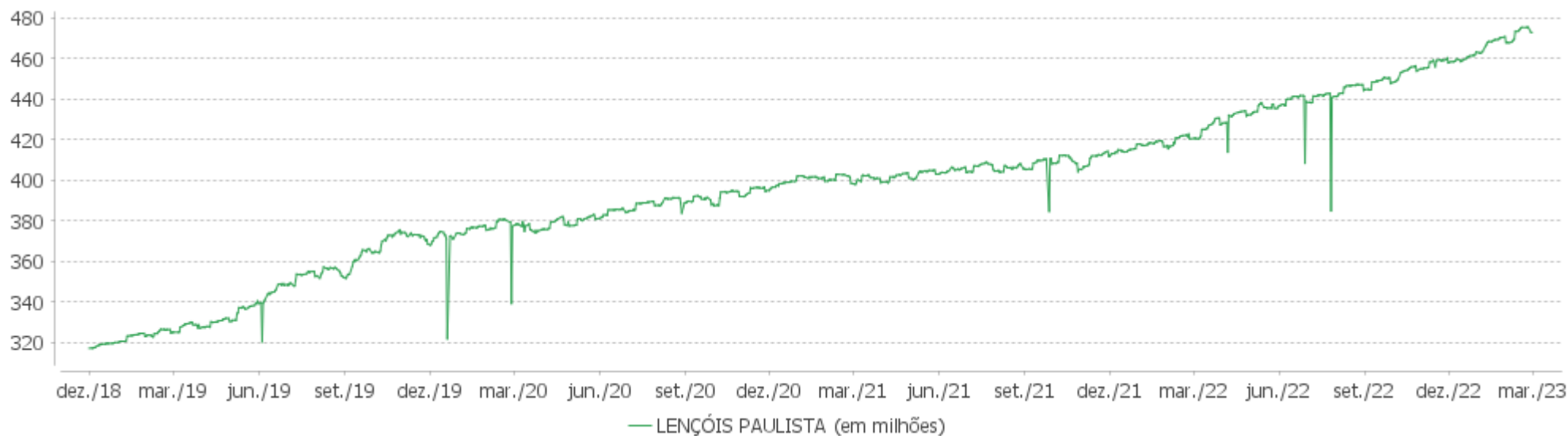
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	15	29,41	03 meses	3,18	3,18	0,00	0,92
Meses abaixo - Meta Atuarial	36	70,59	06 meses	6,12	5,11	1,01	1,01
			12 meses	11,95	10,69	1,26	1,11
			24 meses	17,28	28,91	-11,63	1,34
Maior rentabilidade da Carteira	2,45	2019-06	36 meses	21,46	43,52	-22,06	1,66
Menor rentabilidade da Carteira	-1,46	2019-11	48 meses	36,36	58,19	-21,82	1,95
			Desde 30/11/2018	39,08	61,92	-22,84	1,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

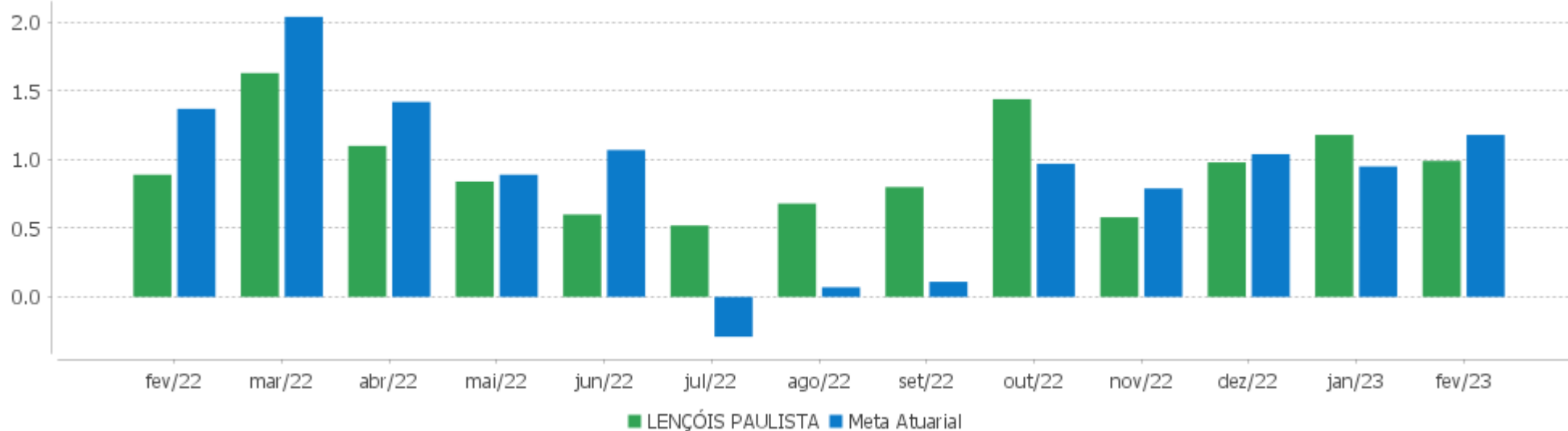


Patrimônio Líquido



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.	1,00 0,02	2,09 -0,00	3,27 -0,03	6,44 -0,05	12,61 -0,20	17,24 -0,37	20,54 -0,69
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,39 -0,02	2,78 -0,04	3,73 -0,06	5,76 -0,11	11,45 -0,12	18,22 -0,40	25,22 -0,79
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,96 -0,02	2,03 -0,06	3,21 -0,09	6,32 -0,17	12,47 -0,34	16,97 -0,65	20,14 -1,10
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,34 0,15	2,75 0,59	4,10 0,87	6,04 0,84	10,88 0,03		
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	1,14 0,30	1,65 0,28	1,27 -0,73	2,66 -0,07	8,03 2,44	14,35 -2,38	17,15 -5,65
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TÍTULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,26 -0,03	1,23 -0,05	1,00 -0,08	2,86 -0,16	7,58 -0,36	8,18 -0,76	11,22 -1,17
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	0,74 -0,05	1,48 -0,04	3,07 -0,09	3,98 -0,27	8,64 -0,43	6,34 -0,88	9,19 -1,05
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLAÇÃO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,26 -0,02	1,24 -0,04	1,03 -0,06	2,90 -0,12	7,69 -0,25	8,45 -0,48	11,57 -0,82
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,49 -0,13	2,95 -0,13	4,20 -0,15	6,00 -0,05	11,25 -0,01	18,21 -0,50	25,82 -1,14
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,91 -0,35	2,43 0,11	3,41 -0,07	6,59 0,90	12,46 0,55	19,86 -11,30	27,66 -18,49
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,97 -0,01	2,07 -0,03	3,24 -0,05	6,38 -0,10	12,55 -0,26	17,10 -0,51	20,27 -0,97
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,97 -0,01	2,08 -0,02	3,26 -0,03	6,42 -0,06	12,60 -0,21	17,36 -0,25	20,51 -0,72
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,97 -0,02	2,10 0,01	3,28 -0,02	6,40 -0,09	12,58 -0,23	17,11 -0,50	20,47 -0,76
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,27 -0,01	1,26 -0,02	1,04 -0,05	2,90 -0,12	7,68 -0,26	8,38 -0,55	11,52 -0,87
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,93 101,07	2,06 100,19	3,17 99,17	6,41 99,54	12,85 98,90	19,26 99,37	21,60 97,23
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,26 -0,02	1,23 -0,05	1,00 -0,08	2,88 -0,14	7,67 -0,28	8,37 -0,56	11,22 -1,17
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,82	1,96	3,11	6,53	13,29	20,83	23,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	89,54	95,64	97,32	101,31	102,25	107,51	105,52
SANTANDER RF ATIVO FIC	0,97	1,92	2,81	5,06	10,22	15,07	17,36
% do CDI	106,08	93,45	87,93	78,46	78,62	77,77	78,18
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,88	2,02	3,21	6,59	13,45	20,58	22,79
% do CDI	95,71	98,27	100,23	102,33	103,47	106,19	102,60
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,85	1,99	3,13	6,42	13,03	19,82	22,25
% do CDI	93,00	96,86	97,93	99,60	100,24	102,28	100,19
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,81	1,87	3,02	6,37	13,14	20,38	22,46
% do CDI	87,91	90,90	94,56	98,90	101,09	105,16	101,12
LENÇÓIS PAULISTA	0,99	2,18	3,18	6,12	11,95	17,28	21,46
Var. IPCA + 4,87% p.p.	-0,18	0,06	0,01	1,06	1,39	-10,73	-19,48
CDI	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21
IBOVESPA	-7,49	-4,38	-6,72	-4,19	-7,26	-4,64	0,73
INPC + 6,00%	1,19	2,17	3,40	5,43	11,77	31,30	47,73
IPCA + 6,00%	1,26	2,32	3,48	5,69	11,91	31,16	46,15

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 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
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	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
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP 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	0,98	2,09	3,30	6,49	12,81	17,61	21,23	29,14	38,03
IRF-M 1+	0,79	1,51	3,16	4,25	9,06	7,22	10,24	25,91	40,07
IRF-M TOTAL	0,86	1,71	3,21	4,93	10,13	10,66	13,99	27,51	40,19
IMA-B 5	1,41	2,82	3,79	5,87	11,57	18,62	26,01	41,34	55,61
IMA-B 5+	1,17	-0,11	-1,30	0,52	4,86	0,42	1,37	23,71	45,02
IMA-B TOTAL	1,28	1,28	1,08	3,02	7,94	8,94	12,38	32,61	51,33
IMA-GERAL TOTAL	1,03	1,74	2,52	4,81	10,51	13,70	17,46	30,71	43,72
IDKA 2	1,62	3,08	4,36	6,05	11,25	18,71	26,96	41,17	55,55
IDKA 20	0,79	-3,83	-7,02	-4,75	-2,27	-14,73	-16,36	6,39	31,39
CDI	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21	29,03	37,30

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-7,49	-4,38	-6,72	-4,19	-7,26	-4,64	0,73	9,78	22,94
IBRX 100	-7,59	-4,34	-6,85	-4,76	-8,23	-5,60	0,93	12,19	26,64
IBRX 50	-7,54	-4,41	-6,85	-3,59	-7,74	-3,34	4,52	11,43	23,50
SMALL CAP	-10,52	-7,90	-10,68	-16,48	-20,21	-30,84	-29,32	-4,09	7,17
Índice Consumo - ICON	-9,78		-12,01	-20,80	-30,44	-45,20	-44,63	-25,38	-25,80
Índice Dividendos - IDIV	-7,55	-2,11	-3,69	-0,84	5,04	14,70	10,65	34,58	57,47

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	-0,54	3,21	-4,28	0,94	-8,25	-1,90	55,57	98,62	134,79

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,45	-2,05	-2,05	-5,64	2,45	-2,71	-5,24	15,36	21,50

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,92	3,71	-1,93	3,17	-8,75	-9,86	42,01	74,04	94,86

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,84	1,37	2,00	2,73	5,60	16,73	22,79	27,71	32,68
INPC	0,77	1,23	1,93	2,47	5,47	16,86	24,12	28,99	34,07
IGPM	-0,06	0,15	0,60	-1,88	1,86	18,28	52,51	62,91	75,30
SELIC	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21	29,03	37,31

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,12	2,01	2,99	4,71	9,80	26,26	38,06	49,31	61,33
IPCA + 5,00%	1,19	2,16	3,23	5,20	10,85	28,69	42,07	55,11	69,21
IPCA + 5,50%	1,23	2,24	3,36	5,45	11,38	29,92	44,10	58,08	73,26
IPCA + 5,89%	1,25	2,30	3,45	5,64	11,79	30,89	45,70	60,42	76,48
IPCA + 6,00%	1,26	2,32	3,48	5,69	11,91	31,16	46,15	61,08	77,39
INPC + 4,00%	1,05	1,87	2,92	4,45	9,67	26,39	39,56	50,81	63,02
INPC + 6,00%	1,19	2,17	3,40	5,43	11,77	31,30	47,73	62,70	79,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
162	07/02/2023	BB PREV RF IDKA2	203.357,14	0,00	60.734,33689030	3,3483059240
168	10/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	223.000,00	0,00	81.060,47274042	2,7510325620
170	10/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	973.890,48	0,00	369.345,32058152	2,6368020000
177	10/02/2023	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.170.000,00	0,00	69.707,31047131	31,1301639000
161	15/02/2023	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,00	289.890,58	260.444,47432082	1,1130609730
160	16/02/2023	BB PREV RF IDKA2	289.890,58	0,00	85.182,82297491	3,4031577010
163	23/02/2023	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	685.185,41	0,00	98.780,93494447	6,9364134930
165	23/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	706.748,64	255.993,00806355	2,7608122790
166	23/02/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.442.420,91	0,00	453.059,81970780	3,1837317000
169	23/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.487.814,82	538.904,73876728	2,7608122790
176	23/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	58.196.954,94	258.215,11565073	225,3816737000
178	23/02/2023	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	58.196.954,94	0,00	1.713.643,14852728	33,9609533000
164	24/02/2023	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	21.563,23	0,00	3.116,53396060	6,9189780290
167	24/02/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	45.393,91	0,00	14.255,86448098	3,1842270990
171	24/02/2023	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,00	30.000.000,01	7.767,83482894	3.862,0800610000
174	24/02/2023	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	30.000.000,00	0,00	734.069,22957966	40,8680800000
172	27/02/2023	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,00	3.232.045,39	836,41791751	3.864,1513080000
173	27/02/2023	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,00	26.039.249,26	6.738,67226837	3.864,1513080000
175	27/02/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	26.039.249,29	0,00	1.258.822,73524541	20,6853980000
Total			120.290.905,89	119.952.703,64		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.819.049,60

Value-At-Risk: 0,81%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LENÇÓIS PAULISTA		0,81	0,81			472.777.036,94	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,81%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI		0,01	0,00	0,01			58.289.798,58	12,33
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,22	0,00	0,30			10.299.465,65	2,18
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI		3,07	0,18	0,01			30.066.494,23	6,36
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,24	0,00	0,03			1.680.437,34	0,36
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		3,04	0,01	0,05			848.534,98	0,18
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		3,07	0,09	0,00			14.623.425,72	3,09
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,22	0,00	0,04			3.055.225,90	0,65
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,23	0,02	0,03			47.037.164,63	9,95
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS		0,24	0,01	0,01			17.527.001,05	3,71
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,35	0,17	0,01			60.497.956,40	12,80
BB PREV RF IDKA2		1,56	0,04	0,35			14.486.685,44	3,06
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR		3,09	0,02	0,02			2.930.655,15	0,62
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		2,56	0,00	0,07			982.840,83	0,21
BB PREV RF IPCA		0,80	0,09	0,80			103.097.673,47	21,81
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,96	0,16	1,96			40.438.026,91	8,55
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,37	0,03	1,36			10.088.701,39	2,13
Sub-total	1,42	0,92	0,81		0,12	1,08	415.950.087,67	87,98

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
SANTANDER RF ATIVO FIC		0,78	0,00	0,78			593.086,38	0,13
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,03			56.233.862,89	11,89
Sub-total	0,10	0,03	0,00		-0,68	0,85	56.826.949,27	12,02