



LDB
EMPRESAS

LENÇÓIS PAULISTA
OUTUBRO 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 31.10.2022.

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	0,51	1,00	9,56	9.882.075,53	2,17	165.400.002,25	5,97
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,08	1,21	7,23	58.673,16	0,01	238.189.235,75	0,02
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,51	0,98	9,44	182.762,30	0,04	6.033.726.634,06	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,07	1,19	7,18	143.001,30	0,03	5.996.659.178,04	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,08	1,20	7,11	14.596.873,44	3,21	539.319.609,79	2,71
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,51	1,01	9,57	838.368,99	0,18	87.248.656,95	0,96
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,51	0,99	9,45	49.979.768,95	10,99	5.646.338.902,14	0,89
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,51	1,00	9,50	16.822.146,43	3,70	545.734.533,05	3,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,43	1,88	9,05	56.363.831,86	12,39	8.449.071.998,91	0,67
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,63	1,85	8,72	16.761.373,36	3,69	7.996.820.457,76	0,21
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	5,08	1,22	7,22	2.925.477,56	0,64	686.363.336,66	0,43
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,01	2,24	8,22	101.887.208,75	22,40	3.736.730.846,68	2,73
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,80	0,88	9,36	14.406.552,68	3,17	2.434.245.468,97	0,59
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,34	1,66	9,00	284.848.114,31	62,63		

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
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,16	1,09	3,49	56.918.058,09	12,51	3.279.050.946,44	1,74
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,12	1,04	10,21	1.553.870,44	0,34	12.427.649.222,70	0,01
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,25	0,88	8,09	575.596,03	0,13	334.163.614,50	0,17
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,12	1,05	10,45	56.994.431,52	12,53	2.800.691.599,83	2,04
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,12	1,07	3,49	53.915.839,33	11,85	7.181.883.753,28	0,75

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	0,61	1,07	9,26	169.957.795,41	37,37		
		Renda Fixa	1,16	1,44	9,23	454.805.909,72	100,00		
		Total	1,17	1,44	9,17	454.805.909,72	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	284.848.114,31	62,63	60,00	80,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	169.957.795,41	37,37	10,00	10,00	65,00	0,00	65,00
	Total Renda Fixa	454.805.909,72	100,00					100,00
Total		454.805.909,72	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	1,66 162,52	9,00 90,02	2,69 81,65	4,65 71,47	11,52 100,22	4.684.680,11	30.398.038,05
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,07 104,77	9,26 92,57	3,43 103,97	6,28 96,55		1.791.153,96	7.975.786,60
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	-5,65 -56,45	0,00 0,00	0,00 0,00		0,00	-194.067,26
LENÇÓIS PAULISTA (Total)						6.475.834,07	38.179.757,39

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	15.261.314,49	1.198.157,46	0,00	0,00	16.761.373,36	301.901,41	4.492.694,07
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	141.314,85	0,00	0,00	0,00	143.001,30	1.686,45	9.582,25
BB PREV RF IPCA	99.652.452,26	0,00	0,00	0,00	101.887.208,75	2.234.756,49	4.763.254,36
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	180.981,79	0,00	0,00	0,00	182.762,30	1.780,51	511.416,81
BRDESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	16.655.870,39	0,00	0,00	0,00	16.822.146,43	166.276,04	4.298.654,98
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	14.423.507,56	0,00	0,00	0,00	14.596.873,44	173.365,88	969.344,40
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	55.326.242,12	0,00	0,00	0,00	56.363.831,86	1.037.589,74	4.659.341,52
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	49.492.268,05	0,00	0,00	0,00	49.979.768,95	487.500,90	4.587.777,72
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	17.392.745,89	0,00	-3.124.128,92	0,00	14.406.552,68	137.935,71	4.690.765,10
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	57.970,14	0,00	0,00	0,00	58.673,16	703,02	3.956,79
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	9.784.463,50	0,00	0,00	0,00	9.882.075,53	97.612,03	862.014,34
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	829.988,36	0,00	0,00	0,00	838.368,99	8.380,63	418.507,13
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	2.890.286,26	0,00	0,00	0,00	2.925.477,56	35.191,30	130.728,58
					284.848.114,31	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	1.408.293,19	130.000,00	0,00	0,00	1.553.870,44	15.577,25	145.502,28
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	53.342.965,76	0,00	0,00	0,00	53.915.839,33	572.873,57	1.784.839,33
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	56.305.661,61	0,00	0,00	0,00	56.918.058,09	612.396,48	1.918.058,09
SANTANDER RF ATIVO FIC	570.592,56	0,00	0,00	0,00	575.596,03	5.003,47	1.374.110,03
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	54.296.128,33	2.113.000,00	0,00	0,00	56.994.431,52	585.303,19	2.753.276,87
					169.957.795,41	0,00	0,00

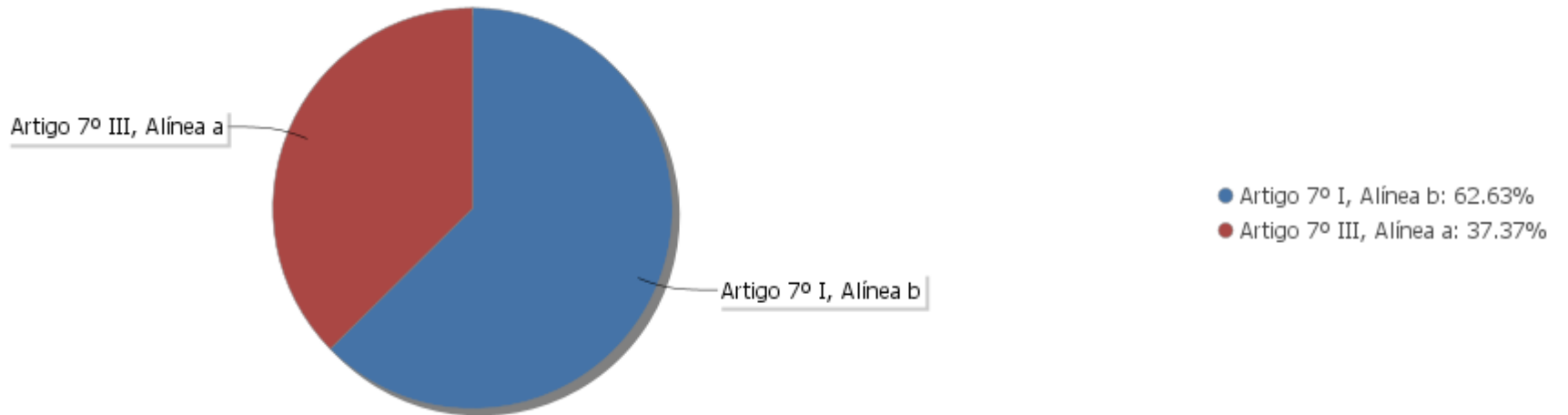
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

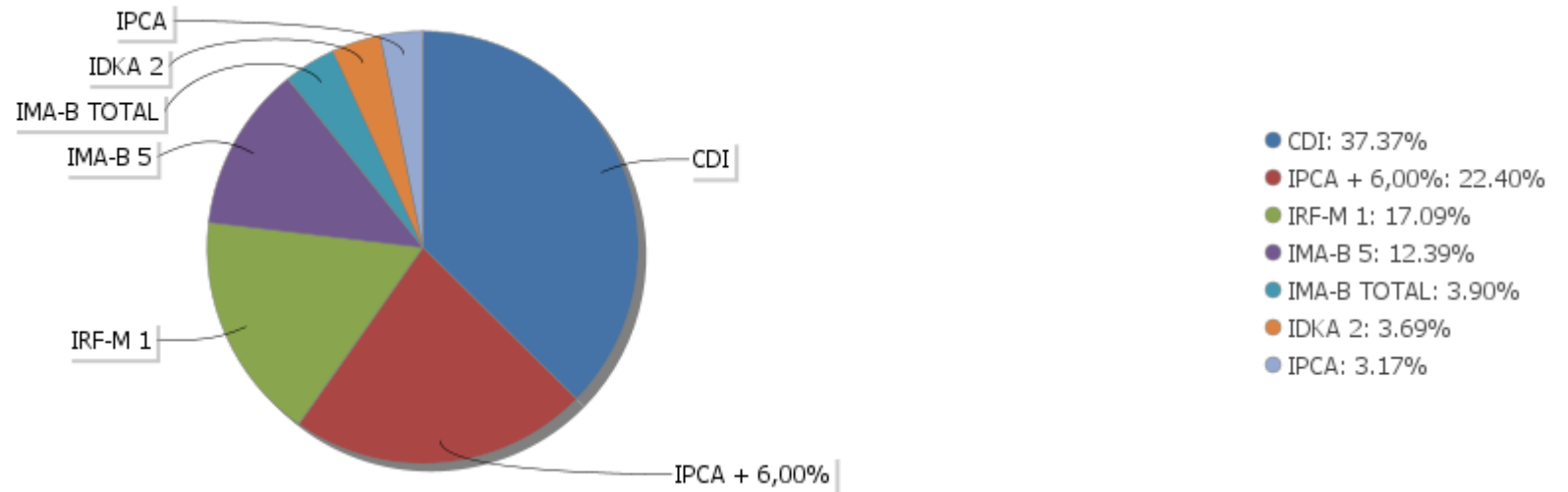
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	352.918.700,97	77,60	352.918.700,97	77,60
de 31 a 365 dias	101.887.208,75	22,40	454.805.909,72	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	454.805.909,72	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

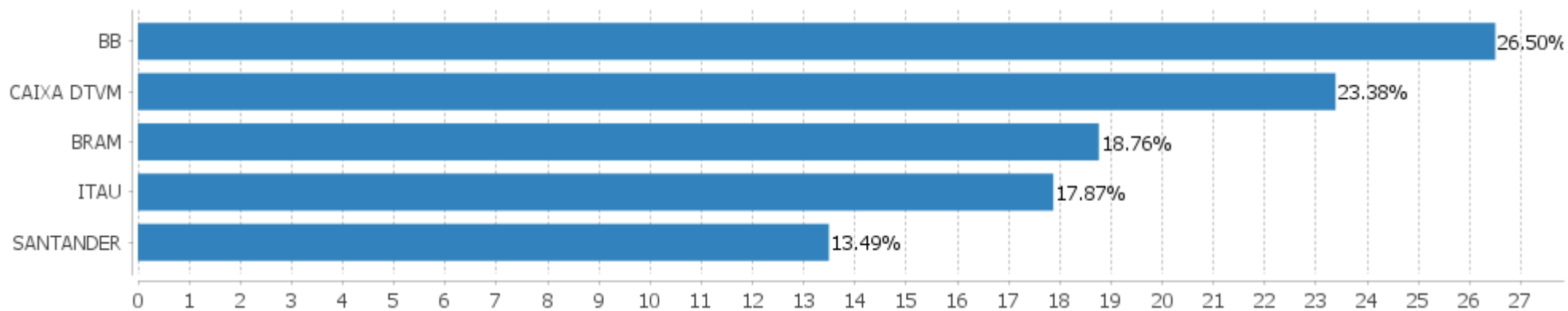


Alocação Por Estratégia



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			9,17
IPCA + 4,87%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,29	0,07	0,11	0,97			8,92
p.p. indexador	-0,63	-0,48	-0,41	-0,32	-0,04	-0,47	0,81	0,61	0,70	0,47			0,26
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

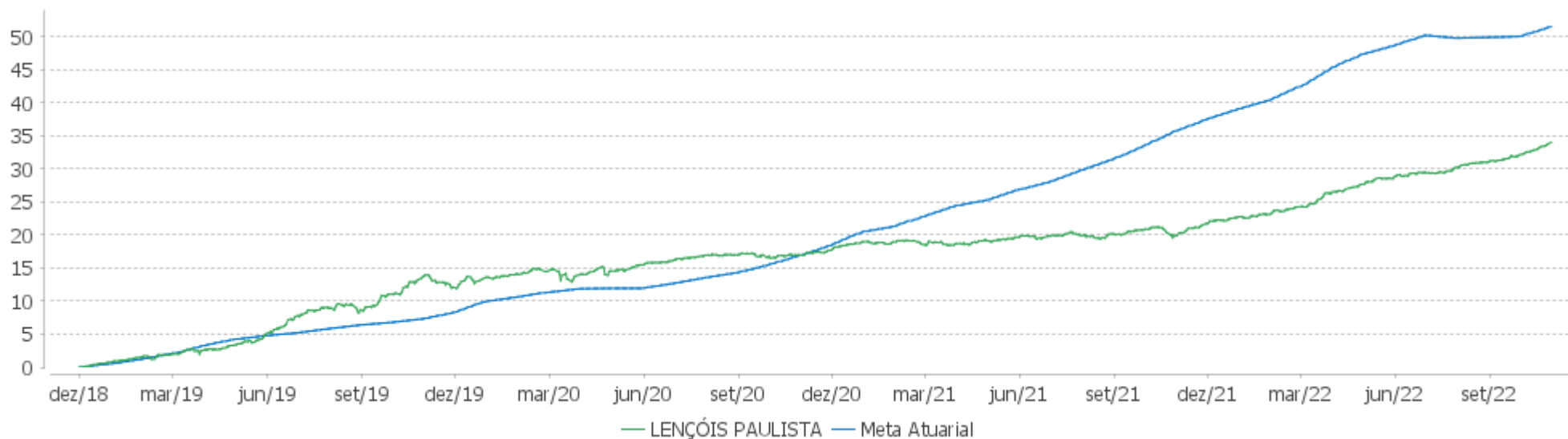
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

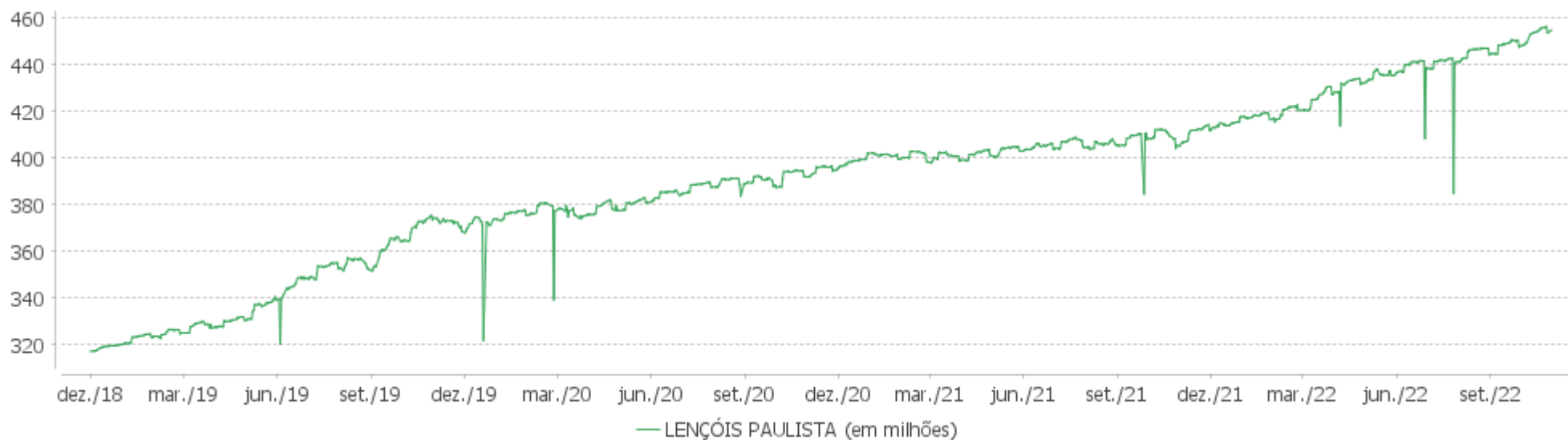
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	14	29,79	03 meses	2,95	1,15	1,80	0,88
Meses abaixo - Meta Atuarial	33	70,21	06 meses	4,99	2,85	2,14	1,04
			12 meses	11,74	11,75	-0,02	1,17
			24 meses	14,60	30,44	-15,84	1,34
			36 meses	17,84	43,62	-25,78	1,81
Maior rentabilidade da Carteira	2,45	2019-06	Desde 30/11/2018	34,01	55,70	-21,69	1,96
Menor rentabilidade da Carteira	-1,46	2019-11					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

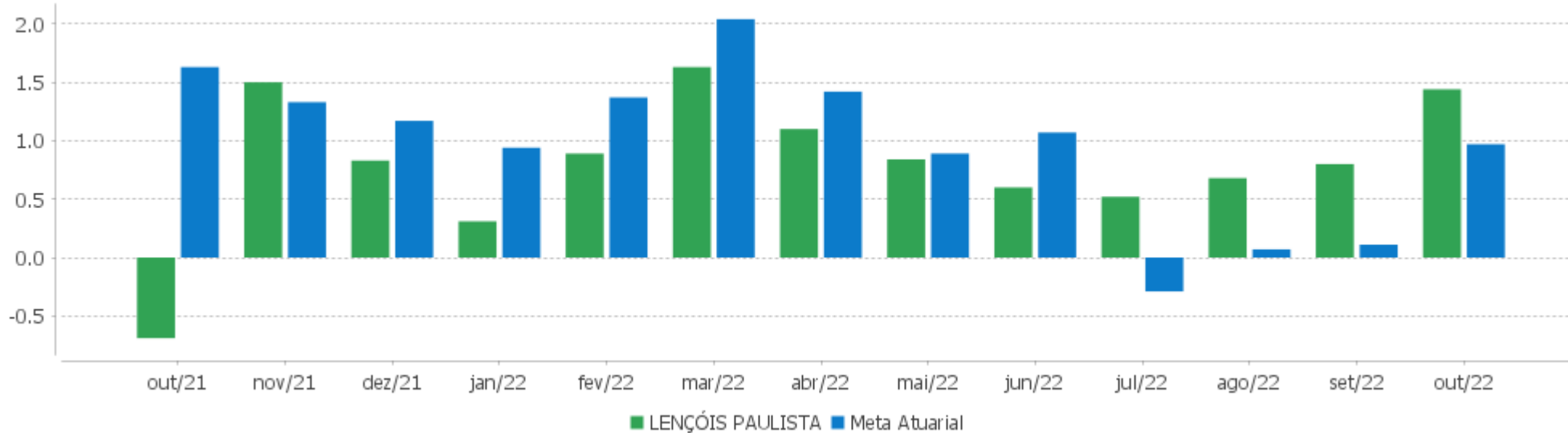


Patrimônio Líquido



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.	1,00 -0,01	9,56 -0,12	3,38 -0,00	6,37 -0,07	11,43 -0,09	13,21 -0,28	17,31 -0,80
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,88 -0,04	9,05 -0,08	2,36 0,01	3,51 0,00	12,60 -0,14	17,31 -0,41	23,62 -0,83
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,98 -0,02	9,45 -0,23	3,31 -0,08	6,32 -0,13	11,23 -0,29	12,92 -0,58	17,06 -1,05
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,88 0,29	9,36 4,65	3,05 3,11	5,73 5,33	12,11 5,64	14,66 -3,17	18,40 -4,05
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,20 -0,03	7,11 -0,32	3,78 -0,08	3,36 -0,21	11,02 -0,38	12,64 -0,80	11,14 -1,16
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,21 -0,02	7,23 -0,20	3,80 -0,06	3,45 -0,12	11,15 -0,25	12,91 -0,53	11,50 -0,81
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,85 0,07	8,72 -0,13	2,35 0,30	3,19 -0,03	12,14 -0,36	17,05 -0,64	24,45 -1,17
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	2,24 1,19	9,55 -0,34	2,18 0,76	3,12 -0,29	12,46 -0,40	18,19 -14,14	25,17 -20,53
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	1,00 -0,00	9,50 -0,18	3,34 -0,04	6,36 -0,08	11,29 -0,22	13,00 -0,50	17,14 -0,97
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,01 0,01	9,57 -0,11	3,39 0,00	6,47 0,02	11,35 -0,16	13,35 -0,15	17,38 -0,73
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,99 -0,02	9,45 -0,23	3,32 -0,07	6,31 -0,13	11,24 -0,27	12,97 -0,52	17,33 -0,78
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,19 -0,04	7,18 -0,25	3,77 -0,10	3,47 -0,10	11,09 -0,31	12,87 -0,57	11,42 -0,88
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,22 -0,01	7,22 -0,20	3,81 -0,05	3,45 -0,12	11,15 -0,26	12,87 -0,57	11,16 -1,15
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	1,09 106,56	10,68 106,81	3,44 104,24	6,88 105,69	12,27 106,78	16,66 109,60	20,01 105,79
SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI	0,88 85,91	8,09 80,86	2,96 89,88	5,21 80,02	10,39 90,43	12,42 81,72	15,27 80,76
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,07 105,22	10,52 105,23	3,44 104,29	6,84 105,03	12,13 105,57	16,28 107,15	19,29 102,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1,04	10,21	3,35	6,62	11,79	15,78	18,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	101,81	102,09	101,70	101,68	102,61	103,83	99,93
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	1,05	10,45	3,41	6,76	12,04	16,48	19,21
% do CDI	102,81	104,43	103,62	103,88	104,79	108,43	101,60
LENÇÓIS PAULISTA	1,44	9,17	2,95	4,99	11,74	14,60	17,84
Var. IPCA + 4,87% p.p.	0,47	0,26	1,80	2,14	0,08	-14,94	-23,28
CDI	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91
IBOVESPA	5,45	10,70	12,48	7,57	12,11	23,51	8,22
INPC + 6,00%	0,94	10,00	1,33	3,32	12,85	32,81	47,43
IPCA + 6,00%	1,06	9,89	1,43	3,41	12,86	32,34	45,71

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 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	1,00	9,68	3,38	6,44	11,52	13,50	18,11	26,53	35,47
IRF-M 1+	0,92	7,22	5,18	6,95	12,08	5,46	10,35	30,15	43,64
IRF-M TOTAL	0,93	7,95	4,44	6,64	11,95	8,26	13,06	29,67	41,90
IMA-B 5	1,91	9,12	2,35	3,50	12,73	17,73	24,45	41,60	54,77
IMA-B 5+	0,65	5,79	5,62	3,73	10,15	9,03	2,65	40,63	55,93
IMA-B TOTAL	1,23	7,43	3,86	3,57	11,40	13,44	12,30	42,33	56,98
IMA-GERAL TOTAL	1,01	8,88	3,72	5,61	11,80	12,98	15,99	33,17	45,02
IDKA 2	1,78	8,84	2,04	3,22	12,50	17,69	25,62	40,76	54,48
IDKA 20	-0,33	3,63	10,36	4,51	7,43	2,00	-11,54	37,24	53,99
CDI	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91	26,30	34,57

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,45	10,70	12,48	7,57	12,11	23,51	8,22	32,73	56,16
IBRX 100	5,57	10,25	12,01	6,76	11,78	23,41	9,78	37,01	60,34
IBRX 50	5,32	10,92	12,53	7,34	13,01	26,17	10,50	32,80	56,33
SMALL CAP	7,30	-1,35	16,81	0,91	0,06	3,68	-2,72	39,01	46,73
IFIX	0,02	6,66	6,30	6,34	11,80	8,12	7,14	33,40	34,37
Índice Consumo - ICON	6,28		12,02	1,65	-14,96	-22,29	-23,79	10,51	-0,91
Índice Dividendos - IDIV	4,03	13,61	6,51	3,76	16,46	32,51	18,49	64,97	73,53

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	0,59	4,70	-0,06	0,39	6,47	17,83	22,45	25,55	31,28
INPC	0,47	4,81	-0,16	0,30	6,46	18,26	23,90	27,06	32,15
IGPM	-0,97	5,58	-2,59	-1,31	6,52	29,66	56,80	61,74	79,20
SELIC	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91	26,30	34,58

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	5,00	-23,47	-5,01	0,15	-21,68	7,85	67,36	101,91	141,21
MSCI ACWI	3,03	-26,82	-6,84	-4,13	-26,70	-3,07	44,06	71,11	89,42

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,90	8,17	0,94	2,41	10,73	27,41	37,65	46,79	59,57
IPCA + 5,00%	0,98	9,03	1,18	2,91	11,79	29,86	41,64	52,49	67,35
IPCA + 5,50%	1,02	9,46	1,31	3,16	12,33	31,10	43,66	55,41	71,35
IPCA + 5,89%	1,05	9,79	1,40	3,35	12,74	32,06	45,25	57,71	74,53
IPCA + 6,00%	1,06	9,89	1,43	3,41	12,86	32,34	45,71	58,36	75,43
INPC + 4,00%	0,78	8,27	0,84	2,32	10,72	27,87	39,28	48,55	60,63
INPC + 6,00%	0,94	10,00	1,33	3,32	12,85	32,81	47,43	60,26	76,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
133	07/10/2022	BB PREV RF IDKA2	224.266,96	0,00	69.226,30752000	3,2396204280
132	10/10/2022	BB PREV RF IDKA2	973.890,50	0,00	300.785,11533500	3,2378281050
134	10/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	130.000,00	0,00	49.336,45723100	2,6349682830
136	10/10/2022	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	2.113.000,00	0,00	9.820,47990800	215,1626010000
135	27/10/2022	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	3.124.128,92	152.345,07720417	20,5069240000
Total			3.441.157,46	3.124.128,92		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.998.912,42

Value-At-Risk: 0,44%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LENÇÓIS PAULISTA		0,44	0,44			454.805.909,72	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,44%

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		0,17	-0,00	0,24			9.882.075,53	2,17
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI		2,45	0,00	0,01			58.673,16	0,01
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,17	0,00	0,01			182.762,30	0,04
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,59	0,00	0,14			143.001,30	0,03
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		2,46	0,06	0,01			14.596.873,44	3,21
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,17	0,00	0,02			838.368,99	0,18
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,17	0,01	0,00			49.979.768,95	10,99
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS		0,17	0,00	0,01			16.822.146,43	3,70
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,16	0,14	0,03			56.363.831,86	12,39
BB PREV RF IDKA2		1,36	0,05	0,45			16.761.373,36	3,69
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR		2,46	0,01	0,01			2.925.477,56	0,64
BB PREV RF IPCA		0,79	0,13	0,75			101.887.208,75	22,40
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,49	0,03	1,50			14.406.552,68	3,17
Sub-total	0,86	0,70	0,44		0,74	1,66	284.848.114,31	62,63

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		0,02	0,00	0,02			56.918.058,09	12,51
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	0,00	0,01			1.553.870,44	0,34
SANTANDER RF ATIVO FIC		0,63	0,00	0,63			575.596,03	0,13

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,01	-0,00	0,01			56.994.431,52	12,53
BRAPRESA FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,01	0,00	0,01			53.915.839,33	11,85
Sub-total	0,02	0,01	0,00		2,40	1,07	169.957.795,41	37,37