



LENÇÓIS PAULISTA
FEVEREIRO 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 25.02.2022.

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

RENTA 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	0,70	0,76	1,40	9.146.420,15	2,18	159.545.310,04	5,73
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,59	0,53	-0,22	54.597,22	0,01	239.259.525,29	0,02
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,70	0,73	1,35	169.243,54	0,04	5.025.689.167,39	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,63	0,53	-0,24	133.100,97	0,03	6.297.272.158,07	0,00
BRAM	BRASESCO	BRASESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,61	0,52	-0,25	13.593.529,68	3,23	586.146.541,58	2,32
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,70	0,75	1,40	15.620.799,57	3,72	107.046.800,86	14,59
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,70	0,72	1,34	52.140.669,99	12,40	5.808.584.551,28	0,90
BRAM	BRASESCO	BRASESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,70	0,75	1,37	66.423.747,20	15,80	657.915.935,27	10,10
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,75	1,05	1,14	52.278.169,70	12,44	11.612.568.005,11	0,45
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,63	1,16	1,17	66.814.260,62	15,89	9.012.864.987,26	0,74
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	5,61	0,53	-0,23	807.859,59	0,19	880.760.697,38	0,09
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,50	0,24	0,24	38.090.905,38	9,06	1.638.119.424,99	2,33
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,66	0,89	1,23	315.273.303,61	74,99		

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 FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,19	0,82	1,62	17.433,19	0,00	1.947.121.660,31	0,00
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,80	1,59	626.271,74	0,15	7.639.104.845,31	0,01
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,15	0,93	1,46	71.955.607,37	17,12	2.413.852.979,92	2,98
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,17	0,72	1,05	32.538.366,04	7,74	540.929.618,66	6,02
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,86	0,86	1,34	105.137.678,34	25,01		

Renda Fixa			1,51	0,88	1,26	420.410.981,95	100,00		
-------------------	--	--	-------------	-------------	-------------	-----------------------	---------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,00%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	14,33	-0,35	-5,67	0,00	0,00	246.662.911,63	0,00
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	14,34	1,62	-3,77	0,00	0,00	3.122.842.560,56	0,00
Sub-total Artigo 10º I			14,29	-0,34	-5,65	0,00	0,00		
Investimentos Estruturados			14,29	-0,34	-5,65	0,00	0,00		
Total			1,51	0,89	1,20	420.410.981,95	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	315.273.303,61	74,99	60,00	80,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	105.137.678,34	25,01	10,00	10,00	65,00	0,00	65,00
	Total Renda Fixa	420.410.981,95	100,00					100,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	0,00	0,00	0,00	1,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	0,00	0,00					15,00

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	0,89 119,11	1,23 82,69	2,01 88,96	3,21 84,14	4,49 79,49	2.761.072,26	3.788.526,53
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,86 114,90	1,34 89,81				920.356,01	1.420.770,48
Artigo 10º I % do CDI	-0,34 -45,52	-5,65 -379,61				27.764,82	-194.067,26
LENÇÓIS PAULISTA (Total)						3.709.193,09	5.015.229,75

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	64.980.188,65	1.075.474,69	0,00	0,00	66.814.260,62	758.597,28	768.314,73
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	132.394,55	0,00	0,00	0,00	133.100,97	706,42	-318,08
BB PREV RF IPCA	0,00	38.000.000,00	0,00	0,00	38.090.905,38	90.905,38	90.905,38
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	37.905.109,05	169.192,27	-38.169.192,27	0,00	169.243,54	264.134,49	495.470,87
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	64.099.719,97	1.836.245,25	0,00	0,00	66.423.747,20	487.781,98	880.649,00
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	13.523.745,00	0,00	0,00	0,00	13.593.529,68	69.784,68	-33.999,36
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	49.612.190,06	2.137.098,22	0,00	0,00	52.278.169,70	528.881,42	573.679,36
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	51.765.475,89	0,00	0,00	0,00	52.140.669,99	375.194,10	688.536,50
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	54.308,20	0,00	0,00	0,00	54.597,22	289,02	-119,15
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	9.077.388,21	0,00	0,00	0,00	9.146.420,15	69.031,94	126.358,96
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.884.272,86	1.625.000,00	0,00	0,00	15.620.799,57	111.526,71	200.937,71
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	803.620,75	0,00	0,00	0,00	807.859,59	4.238,84	-1.889,39
					315.273.303,61	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.246.522,24	0,00	-2.646.168,07	0,00	626.271,74	25.917,57	51.151,78

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	71.293.624,67	0,00	0,00	0,00	71.955.607,37	661.982,70	1.032.460,12
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	17.291,23	0,00	0,00	0,00	17.433,19	141,96	278,54
SANTANDER RF ATIVO FIC	32.306.052,26	0,00	0,00	0,00	32.538.366,04	232.313,78	336.880,04
					105.137.678,34	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	1.842.619,14	0,00	-1.836.245,25	0,00	0,00	-6.373,89	-110.444,19
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.102.959,51	0,00	-2.137.098,22	0,00	0,00	34.138,71	-83.623,07
					0,00	0,00	0,00

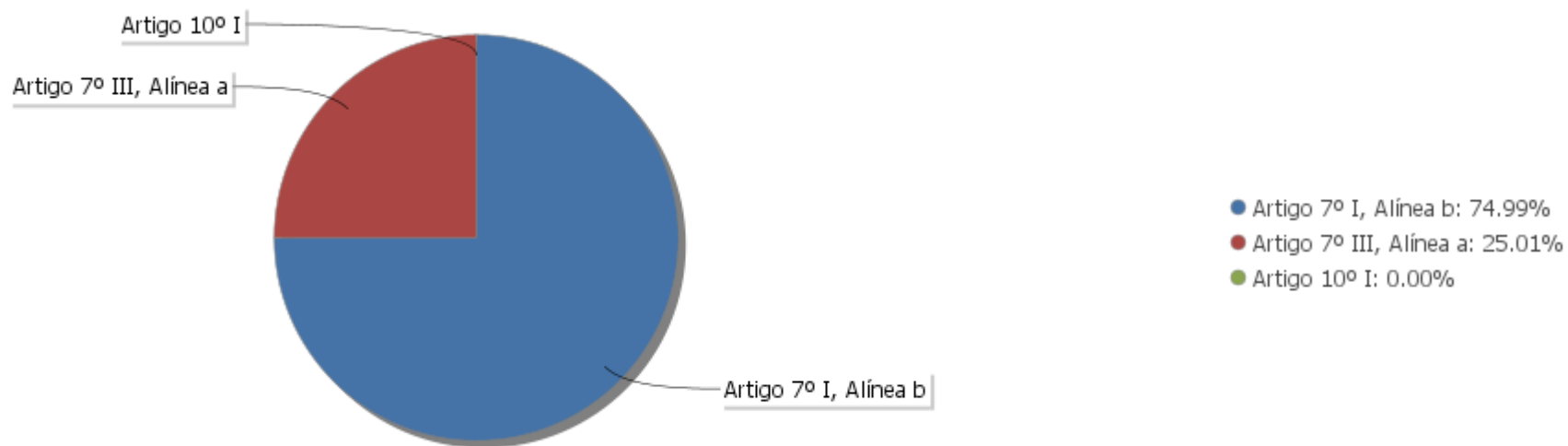
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

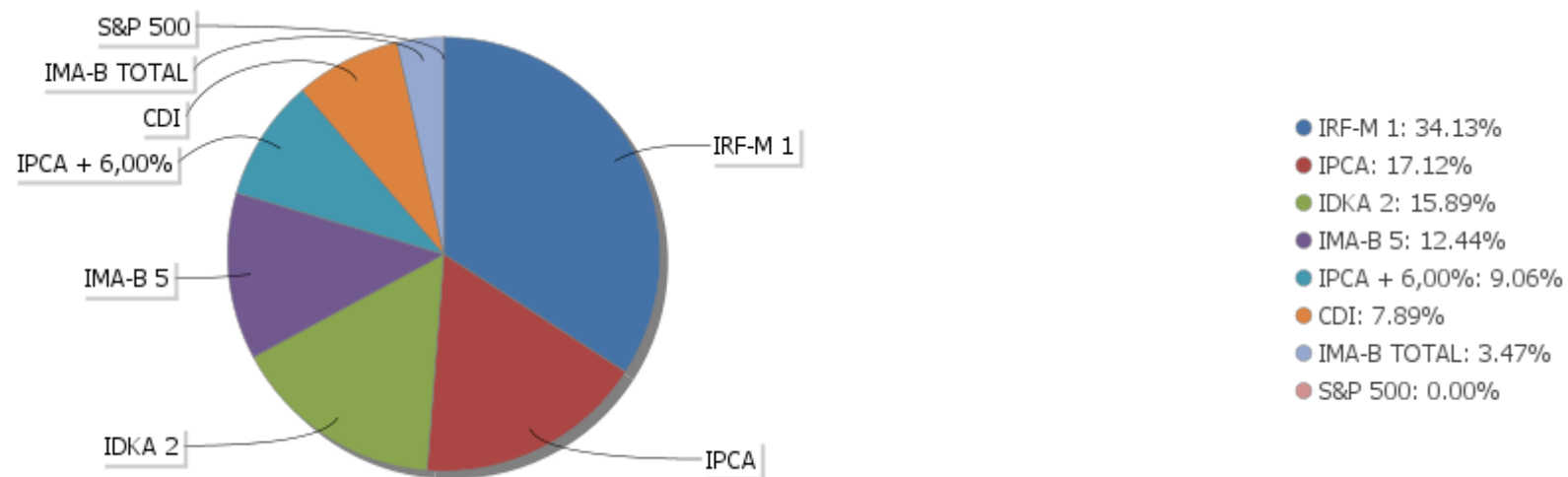
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	382.320.076,57	90,94	382.320.076,57	90,94
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	382.320.076,57	90,94
acima de 365 dias	38.090.905,38	9,06	420.410.981,95	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

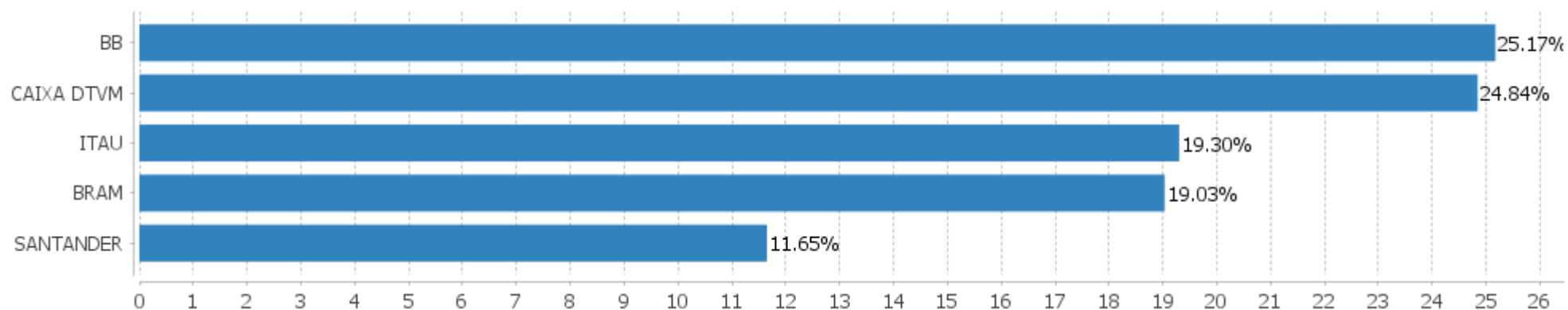


Alocação Por Estratégia



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											1,20
IPCA + 4,87%	0,94	1,37											2,32
p.p. indexador	-0,63	-0,48											-1,12
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

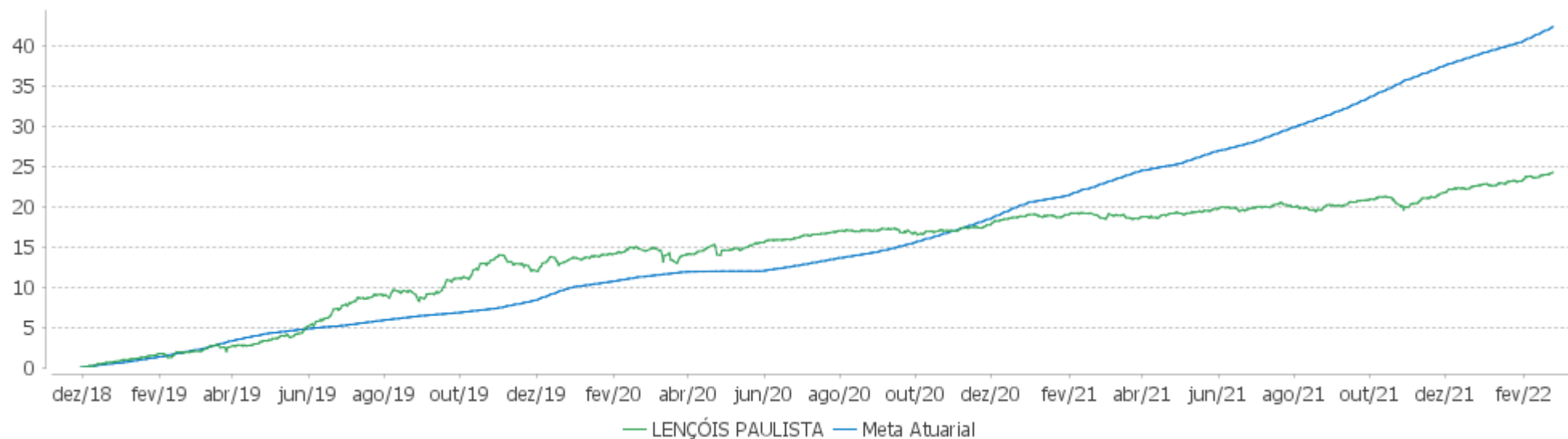
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

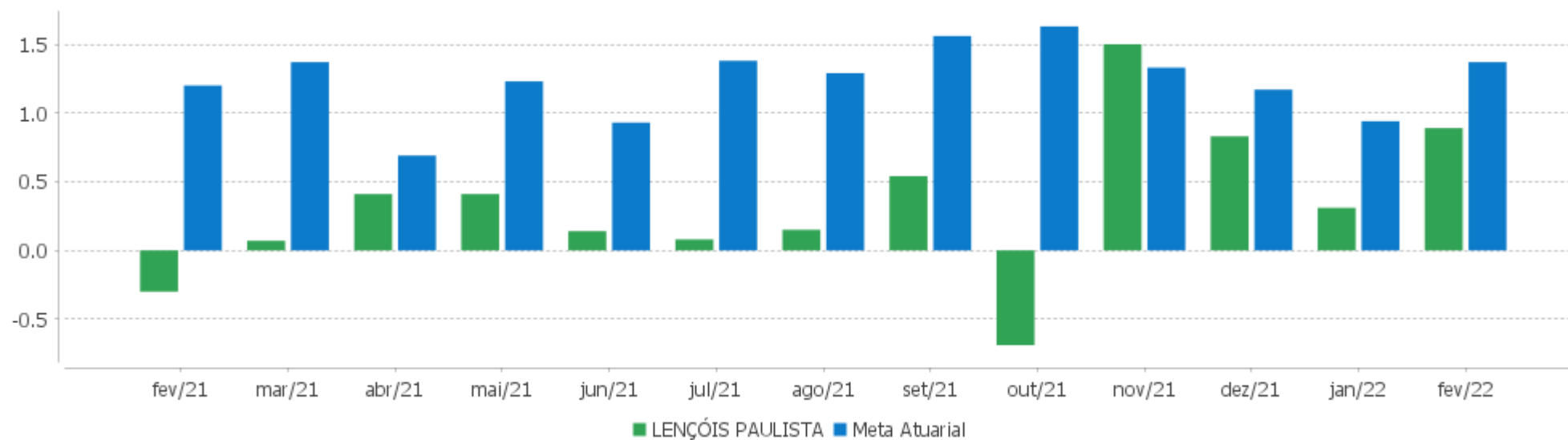
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	10	25,64	03 meses	2,05	3,57	-1,52	1,16
Meses abaixo - Meta Atuarial	29	74,36	06 meses	3,43	8,46	-5,03	1,57
			12 meses	4,75	16,45	-11,70	1,51
			24 meses	8,49	29,65	-21,17	1,87
			36 meses	21,81	42,90	-21,10	2,15
			Desde 30/11/2018	24,23	46,28	-22,05	2,09
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	2,45	2019-06					
Menor rentabilidade da Carteira	-1,46	2019-11					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



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.	0,76 0,02	1,40 0,02	2,25 -0,02	2,90 -0,03	4,12 -0,14	7,05 -0,42	13,74 -0,73
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,53 -0,01	-0,22 -0,02	-0,01 -0,04	0,64 -0,09	0,71 -0,21	3,60 -0,52	21,95 -0,91
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,05 -0,01	1,14 -0,03	1,92 -0,05	4,15 -0,12	6,07 -0,24	12,36 -0,59	25,70 -0,99
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,16 -0,10	1,17 -0,14	1,88 -0,27	4,11 -0,20	6,26 -0,44	13,10 -1,02	24,76 -2,13
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,75 0,00	1,37 -0,01	2,23 -0,03	2,87 -0,06	4,05 -0,21	6,86 -0,61	13,52 -0,95
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,38 -0,07	1,47 -1,03	2,03 -1,76	4,19 -4,66	6,58 -10,63	13,51 -17,09	30,04 -13,91
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,75 0,01	1,40 0,03	2,26 -0,01	2,96 0,03	4,23 -0,03	7,02 -0,44	13,73 -0,75
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,74 -0,01	1,36 -0,02	2,21 -0,05	2,84 -0,09	4,00 -0,26	6,81 -0,65	13,48 -1,00
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,53 -0,01	-0,24 -0,04	-0,04 -0,07	0,58 -0,15	0,65 -0,27	3,56 -0,56	21,95 -0,91
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,72 -0,02	1,34 -0,04	2,20 -0,07	2,83 -0,10	4,03 -0,23	7,01 -0,46	13,76 -0,71
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,52 -0,03	-0,25 -0,06	-0,05 -0,08	0,56 -0,17	0,56 -0,36	3,38 -0,73	21,59 -1,27
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,53 -0,02	-0,23 -0,04	-0,03 -0,06	0,61 -0,12	0,66 -0,27	3,30 -0,82	21,54 -1,32
SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI	0,72 95,93	1,05 70,34	1,83 80,71	2,95 77,44	4,40 77,96	6,48 79,52	18,90 133,15
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,80 106,50	1,59 106,76	2,40 106,07	4,02 105,65	6,01 106,40	8,16 100,10	13,93 98,13
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,93 -0,08	1,46 -0,10	2,33 0,03	4,51 -1,26	5,85 -4,70	8,44 -7,85	18,85 -2,10
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,82 109,53	1,62 109,17	2,45 108,23	4,23 110,98	6,40 113,30	8,24 101,03	14,06 99,09
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	-2,26	-7,48	-2,49	-0,61	18,91	47,89	61,46

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-301,01	-503,03	-110,17	-15,98	334,76	587,34	433,08
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-2,09 4,76	-7,29 7,99	-2,13 10,07	-0,03 3,10	19,98 13,06	47,75 -21,81	62,22 -54,26
LENÇÓIS PAULISTA Var. IPCA + 4,87% p.p.	0,89 -0,48	1,20 -1,12	2,05 -1,47	3,43 -4,85	4,75 -11,19	8,49 -19,35	21,81 -17,60
CDI	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19
IBOVESPA	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	18,37
INPC + 6,00%	1,44	2,62	3,92	8,81	17,47	32,17	45,56
IPCA + 6,00%	1,45	2,50	3,80	8,85	17,20	30,60	43,95

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 MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	D+0	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
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
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
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
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 FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	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	0,74	1,38	2,27	2,93	4,26	7,47	14,48	22,35	34,40
IRF-M 1+	0,48	-0,02	2,26	0,18	-1,69	1,08	15,45	28,42	46,68
IRF-M TOTAL	0,58	0,50	2,40	1,16	0,48	3,51	15,79	27,30	43,94
IMA-B 5	1,06	1,18	1,97	4,26	6,32	12,94	26,68	39,47	55,81
IMA-B 5+	0,01	-1,60	-1,93	-2,75	-4,23	-3,33	17,98	38,31	53,22
IMA-B TOTAL	0,54	-0,19	0,03	0,73	0,92	4,12	22,86	40,19	55,41
IMA-GERAL TOTAL	0,74	0,95	1,83	2,30	2,88	6,29	18,28	30,05	44,43
IDKA 2	1,26	1,31	2,15	4,31	6,70	14,12	26,89	39,82	57,21
IDKA 20	-0,58	-3,49	-5,69	-9,10	-12,75	-14,41	8,86	34,44	45,63
CDI	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19	21,51	32,41

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	18,37	32,56	69,72
IBRX 100	1,46	8,43	11,83	-4,71	2,87	9,99	22,25	38,00	76,75
IBRX 50	1,74	9,53	13,65	-3,21	4,78	13,29	20,78	33,87	72,89
SMALL CAP	-5,19	-1,95	1,77	-18,60	-13,32	-11,41	20,21	34,33	77,03
IFIX	-1,29	-2,27	6,31	-0,32	-5,04	-7,51	12,59	18,59	35,11
Índice Consumo - ICON	-2,51		-0,33	-21,72	-21,21	-20,40	7,27	6,67	33,15
Índice Dividendos - IDIV	-2,32	4,98	6,66	-1,56	9,19	5,34	28,12	49,91	76,56

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	1,01	1,56	2,30	5,77	10,54	16,29	20,94	25,65	29,22
INPC	1,00	1,68	2,42	5,73	10,80	17,68	22,30	27,12	29,42
IGPM	1,83	3,68	4,59	4,61	16,12	49,73	59,94	72,10	71,38
SELIC	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19	21,52	32,43

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	-6,85	-15,28	-12,20	-3,13	6,92	69,56	116,47	155,90	207,13
MSCI ACWI	-6,59	-14,77	-12,07	-5,84	-1,21	55,63	90,73	113,55	160,11

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,31	2,19	3,30	7,83	14,98	25,74	35,98	46,92	57,07
IPCA + 5,00%	1,38	2,35	3,55	8,34	16,09	28,16	39,93	52,64	64,73
IPCA + 5,50%	1,42	2,42	3,68	8,60	16,65	29,37	41,93	55,56	68,67
IPCA + 5,89%	1,45	2,48	3,77	8,79	17,08	30,33	43,50	57,86	71,80
IPCA + 6,00%	1,45	2,50	3,80	8,85	17,20	30,60	43,95	58,52	72,69
INPC + 4,00%	1,30	2,31	3,43	7,79	15,25	27,25	37,51	48,64	57,31
INPC + 6,00%	1,44	2,62	3,92	8,81	17,47	32,17	45,56	60,37	72,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
67	02/02/2022	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	2.137.098,22	1.254.961,01777300	1,7029200000
68	03/02/2022	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.137.098,22	0,00	629.548,91373100	3,3946500000
76	03/02/2022	BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	0,00	1.836.245,25	503.411,66637000	3,6476017000
65	07/02/2022	BB PREV RF IDKA2	206.200,75	0,00	67.619,37844300	3,0494327920
69	08/02/2022	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	1.836.245,25	0,00	687.992,86456350	2,6689888000
66	10/02/2022	BB PREV RF IDKA2	869.273,94	0,00	286.021,76398000	3,0391880950
70	10/02/2022	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.625.000,00	0,00	58.726,83262600	27,6704860000
73	23/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	38.169.192,27	13.468.859,22323000	2,8338845660
75	23/02/2022	BB PREV RF IPCA	36.998.265,19	0,00	14.153.181,96707400	2,6141305380
72	24/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	169.192,27	0,00	59.697,40500200	2,8341645670
74	24/02/2022	BB PREV RF IPCA	1.001.734,81	0,00	382.716,47479700	2,6174332070
71	25/02/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.646.168,07	1.081.639,94603000	2,4464407770
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.481.258,04

Value-At-Risk: 0,83%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LENÇÓIS PAULISTA		0,83	0,83			420.410.981,95	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,83%

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		0,57	0,00	0,75			9.146.420,15	2,18
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI		2,13	0,00	0,00			54.597,22	0,01
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,57	0,00	0,02			169.243,54	0,04
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,14	0,00	0,02			133.100,97	0,03
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		2,13	0,06	0,01			13.593.529,68	3,23
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,57	0,02	0,03			15.620.799,57	3,72
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,57	0,06	0,02			52.140.669,99	12,40
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS		0,57	0,08	0,01			66.423.747,20	15,80
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,17	0,14	0,01			52.278.169,70	12,44
BB PREV RF IDKA2		1,35	0,21	0,37			66.814.260,62	15,89
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR		2,13	0,00	0,00			807.859,59	0,19
BB PREV RF IPCA		1,33	0,11	1,33			38.090.905,38	9,06
Sub-total	1,37	0,92	0,69		0,10	0,89	315.273.303,61	74,99

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI		0,05	0,00	0,04			17.433,19	0,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,06	0,00	0,03			626.271,74	0,15
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		0,59	0,10	0,61			71.955.607,37	17,12
SANTANDER RF ATIVO FIC		0,63	0,04	0,63			32.538.366,04	7,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,87	0,58	0,14		0,13	0,86	105.137.678,34	25,01

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: NaN%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
Sub-total	8,43	NaN	0,00		-0,13	-0,34	0,00	0,00