



LDB
EMPRESAS

ILHA SOLTEIRA
JANEIRO 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 31.01.2023.

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 75,06%

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				
BB	BB	BB PREV RF IRF M	3,70	0,17	0,82	0,82	2.338.838,17	1,24	3.963.755.899,38	0,06
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,46	0,09	-0,01	-0,01	14.161.687,02	7,52	5.926.967.108,44	0,24
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,55	0,09	-0,03	-0,03	12.252.248,05	6,50	3.356.845.685,28	0,36
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,62	0,04	1,37	1,37	9.831.550,16	5,22	7.844.346.137,20	0,13
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,63	0,04	1,38	1,38	14.384.722,95	7,64	808.547.889,81	1,78
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	5,50	0,09	-0,03	-0,03	20.738.716,48	11,01	596.263.701,11	3,48
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,61	0,14	-1,28	-1,28	5.280.021,94	2,80	1.032.465.427,68	0,51
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,06	0,04	0,96	0,96	113.626,05	0,06	945.396.596,99	0,01
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,64	0,04	1,37	1,37	11.217.933,49	5,95	5.664.338.306,58	0,20
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,45	0,08	0,48	0,48	90.319.344,31	47,94		

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				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,08	0,05	1,09	1,09	16.492.369,16	8,75	15.285.936.736,43	0,11
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	5,53	0,13	0,01	0,01	5.493.145,23	2,92	333.421.268,46	1,65
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,07	0,05	1,12	1,12	6.951.013,67	3,69	12.971.898.325,20	0,05
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,65	0,03	1,36	1,36	11.615.684,25	6,17	909.292.349,38	1,28
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,08	0,06	1,05	1,05	4.515.795,06	2,40	3.079.266.604,87	0,15
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,05	1,13	1,13	6.014.912,64	3,19	8.262.735.410,47	0,07
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,95	0,06	0,94	0,94	51.082.920,01	27,12		

Renda Fixa **3,70** **0,07** **0,65** **0,65** **141.402.264,32** **75,06**

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

24,94%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	19,15	0,80	3,72	3,72	3.421.968,74	1,82	600.741.669,30	0,57
BRAM	BEM	BRABESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	26,31	1,43	3,35	3,35	5.402.021,85	2,87	903.340.875,09	0,60
CAIXA DTVM	CEF	FIA BRASIL IBX-50	21,66	0,40	4,79	4,79	9.398.930,58	4,99	665.283.909,82	1,41
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	20,43	0,77	3,36	3,36	3.317.931,02	1,76	479.215.070,36	0,69
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21,51	0,98	3,62	3,62	2.537.039,14	1,35	859.623.591,33	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	27,55	1,70	3,30	3,30	2.685.377,07	1,43	583.745.036,37	0,46
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	20,55	0,81	3,33	3,33	3.967.879,88	2,11	385.813.980,58	1,03
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	21,10	1,04	4,57	4,57	1.046.030,20	0,56	120.089.591,19	0,87
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIA IBOVESPA PLUS	21,27	1,03	3,40	3,40	11.017.904,74	5,85	319.098.773,38	3,45
BRAM	BEM	BRABESCO F I A SELECTION	21,41	1,30	3,93	3,93	4.190.288,34	2,22	462.566.575,32	0,91
Sub-total Artigo 8º I			21,40	0,96	3,76	3,76	46.985.371,56	24,94		
Renda Variável			21,40	0,96	3,76	3,76	46.985.371,56	24,94		
Total			7,27	0,29	1,43	1,43	188.387.635,88	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	90.319.344,31	47,94					100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	51.082.920,01	27,12					65,00
	Total Renda Fixa	141.402.264,32	75,06					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	46.985.371,56	24,94					35,00
	Total Renda Variável	46.985.371,56	24,94					35,00
Total		188.387.635,88	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	0,48 42,68	0,48 42,68	0,00 0,01	3,37 50,18	8,30 64,77	435.808,83	435.808,83
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,94 83,84	0,94 83,84	1,85 55,99	4,99 74,35	10,99 85,78	458.537,22	458.537,22
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	3,76 0,39	3,76 0,39	-4,28 -2,03	8,28 -1,67	-1,30 -2,45	1.703.323,26	1.703.323,26
ILHA SOLTEIRA (Total)						2.597.669,31	2.597.669,31

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 IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	14.163.175,74	0,00	0,00	0,00	14.161.687,02	-1.488,72	-1.488,72
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	11.065.808,17	0,00	0,00	0,00	11.217.933,49	152.125,32	152.125,32
BB PREV RF IRF M	2.319.889,17	0,00	0,00	0,00	2.338.838,17	18.949,00	18.949,00
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	112.543,74	0,00	0,00	0,00	113.626,05	1.082,31	1.082,31
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.882.369,23	0,00	-1.200.000,00	0,00	9.831.550,16	149.180,93	149.180,93
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.348.329,31	0,00	0,00	0,00	5.280.021,94	-68.307,37	-68.307,37
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12.256.274,42	0,00	0,00	0,00	12.252.248,05	-4.026,37	-4.026,37
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	14.189.432,80	0,00	0,00	0,00	14.384.722,95	195.290,15	195.290,15
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	20.745.712,90	0,00	0,00	0,00	20.738.716,48	-6.996,42	-6.996,42
					90.319.344,31	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	6.873.767,55	0,00	0,00	0,00	6.951.013,67	77.246,12	77.246,12
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1.950.072,28	4.700.000,00	-700.000,00	0,00	6.014.912,64	64.840,36	64.840,36
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5	14.474.662,23	0,00	-3.000.000,00	0,00	11.615.684,25	141.022,02	141.022,02
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	7.522.105,32	0,00	-2.000.000,00	0,00	5.493.145,23	-28.960,09	-28.960,09

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	15.439.401,11	1.150.000,00	-265.000,00	0,00	16.492.369,16	167.968,05	167.968,05
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	1.979.374,30	2.500.000,00	0,00	0,00	4.515.795,06	36.420,76	36.420,76
					51.082.920,01	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	3.840.143,80	0,00	0,00	0,00	3.967.879,88	127.736,08	127.736,08
BB AÇÕES DIVIDENDOS	3.299.208,24	0,00	0,00	0,00	3.421.968,74	122.760,50	122.760,50
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	2.448.396,04	0,00	0,00	0,00	2.537.039,14	88.643,10	88.643,10
BRADESCO F I A SELECTION	4.031.983,08	0,00	0,00	0,00	4.190.288,34	158.305,26	158.305,26
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	5.226.944,28	0,00	0,00	0,00	5.402.021,85	175.077,57	175.077,57
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	10.655.731,48	0,00	0,00	0,00	11.017.904,74	362.173,26	362.173,26
FIA BRASIL IBX-50	8.969.719,13	0,00	0,00	0,00	9.398.930,58	429.211,45	429.211,45
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	2.599.491,65	0,00	0,00	0,00	2.685.377,07	85.885,42	85.885,42
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	3.210.126,43	0,00	0,00	0,00	3.317.931,02	107.804,59	107.804,59
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	1.000.304,17	0,00	0,00	0,00	1.046.030,20	45.726,03	45.726,03
					46.985.371,56	0,00	0,00

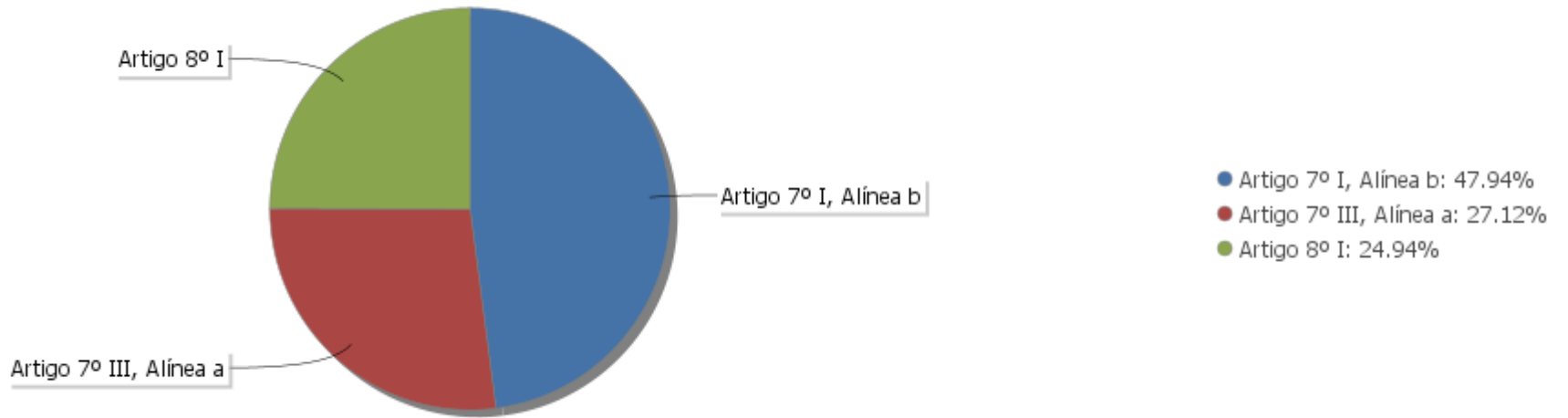
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

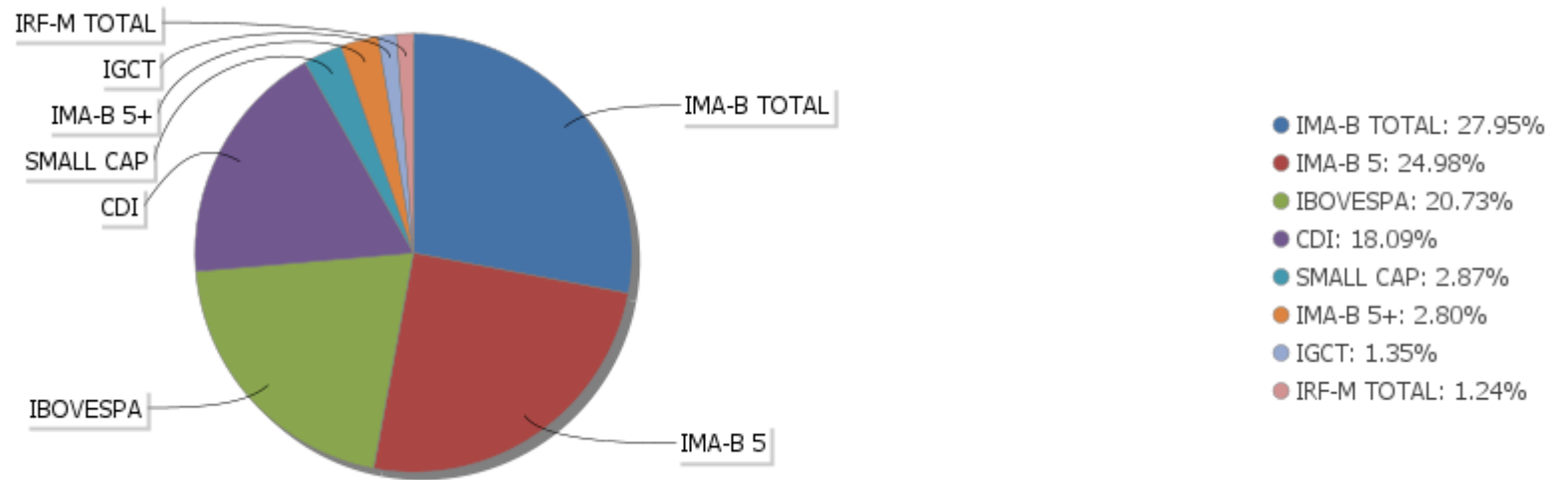
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	188.387.635,88	100,00	188.387.635,88	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	188.387.635,88	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	188.387.635,88	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

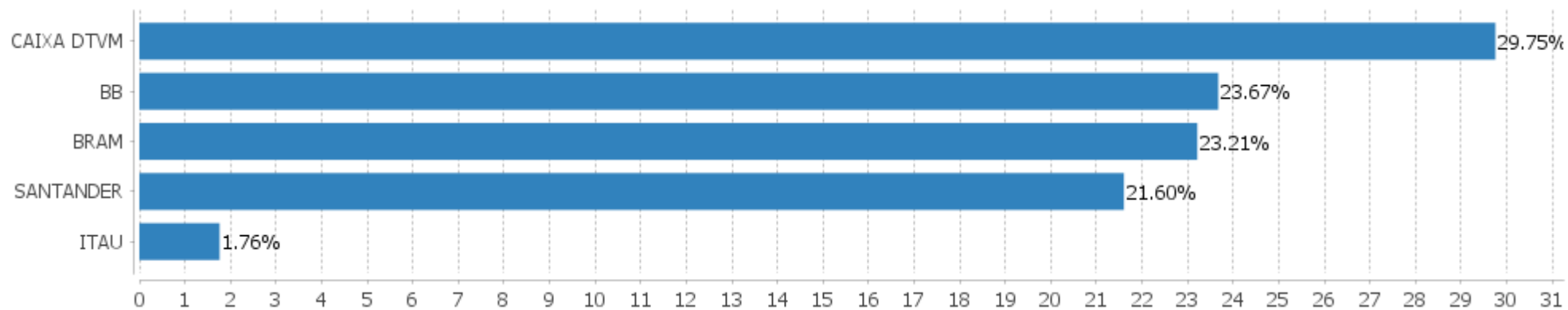


Alocação Por Estratégia



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	1,43												1,43
IPCA + 4,64%	0,93												0,93
p.p. indexador	0,50												0,50
2022	1,34	0,49	3,60	-1,67	1,24	-3,06	0,86	2,25	0,72	2,59	-1,71	-0,39	6,24
IPCA + 4,80%	0,93	1,37	2,04	1,42	0,88	1,06	-0,29	0,07	0,10	0,96	0,78	1,03	10,84
p.p. indexador	0,41	-0,88	1,57	-3,09	0,36	-4,12	1,16	2,18	0,62	1,62	-2,49	-1,42	-4,60
2021	-1,25	-1,72	1,08	1,36	2,39	0,39	-1,37	-1,38	-1,68	-3,56	1,56	1,08	-3,23
IPCA + 5,42%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,68	1,37	1,22	16,00
p.p. indexador	-1,92	-2,97	-0,34	0,63	1,12	-0,58	-2,79	-2,72	-3,29	-5,24	0,19	-0,13	-19,23
2020	0,07	-2,11	-11,70	2,89	2,80	3,28	4,26	-1,48	-1,92	-0,10	4,59	4,91	4,37
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,65
p.p. indexador	-0,64	-2,77	-12,27	2,74	2,73	2,54	3,38	-2,19	-3,04	-1,44	3,24	3,06	-6,28
2019	4,73	-0,18	0,32	1,16	1,98	3,00	1,22	-0,06	2,34	2,42	-0,78	3,49	21,34
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	3,90	-1,08	-0,87	0,10	1,34	2,55	0,50	-0,68	1,90	1,79	-1,75	1,85	10,75
2018	3,56	0,54	0,75	0,28	-3,68	-1,22	3,16	-0,91	0,92	5,90	1,11	0,71	11,33
IPCA + 6,00%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	2,75	-0,20	0,17	-0,43	-4,57	-2,97	2,32	-1,35	-0,00	4,93	0,85	0,09	1,41
2017	1,97	1,97	0,71	0,39	-0,92	0,38	2,98	1,87	1,82	0,02	-0,78	1,65	12,66
IPCA + 6,00%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	1,07	1,22	-0,08	-0,17	-1,75	0,13	2,26	1,15	1,20	-0,89	-1,53	0,75	3,61

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	38	52,05
Meses abaixo - Meta Atuarial	35	47,95
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	5,90	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-11,70	2020-03

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	-0,69	2,77	-3,47	8,80
06 meses	4,92	3,94	0,98	8,27
12 meses	6,32	10,84	-4,51	7,27
24 meses	5,60	28,91	-23,31	7,26
36 meses	8,75	42,58	-33,83	10,91
48 meses	26,09	57,49	-31,40	9,98
60 meses	41,96	73,16	-31,20	9,45
Desde 30/12/2016	65,61	90,34	-24,73	8,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

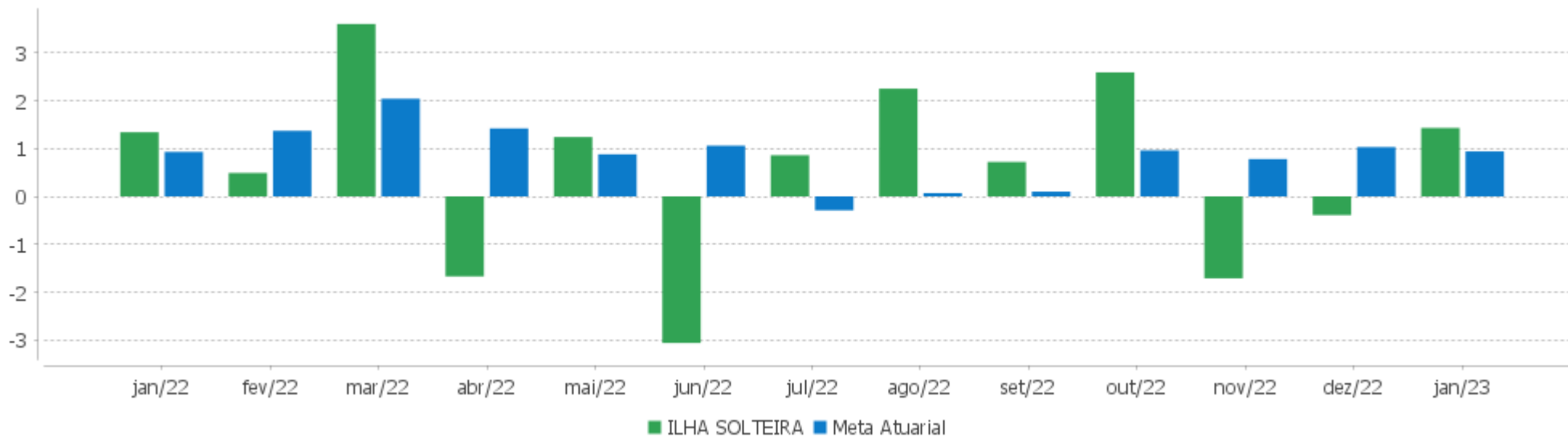


Patrimônio Líquido



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
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03 -0,03	-0,03 -0,03	-1,10 -0,11	2,78 -0,06	6,97 -0,19	5,46 -0,47	10,60 -0,86
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,37 -0,02	1,37 -0,02	1,95 -0,06	4,36 -0,04	11,08 -0,11	15,87 -0,40	24,28 -0,78
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,38 -0,02	1,38 -0,02	1,96 -0,05	4,30 -0,10	10,97 -0,22	15,81 -0,46	24,31 -0,75
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,37 -0,02	1,37 -0,02	1,92 -0,08	4,27 -0,13	10,93 -0,26	15,65 -0,63	24,08 -0,98
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01 -0,01	-0,01 -0,01	-1,03 -0,04	2,70 -0,14	6,90 -0,25	5,39 -0,54	10,60 -0,86
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,82 -0,02	0,82 -0,02	1,56 -0,10	6,01 -0,16	9,61 -0,22	7,83 -0,59	12,85 -0,90
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,28 -0,02	-1,28 -0,02	-3,66 -0,07	1,74 -0,10	3,41 -0,25	-3,75 -0,70	-0,39 -0,91
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,96 85,61	0,96 85,61	2,83 85,82	5,78 86,22	10,97 85,61	15,22 82,47	17,15 79,93
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03 -0,03	-0,03 -0,03	-1,07 -0,08	2,70 -0,14	6,88 -0,27	5,38 -0,54	10,30 -1,16
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,01 0,01	0,01 0,01	-1,14 -0,15	2,67 -0,17	6,75 -0,40	4,56 -1,37	9,71 -1,75
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	1,36 -0,03	1,36 -0,03	1,93 -0,08	4,22 -0,19	10,70 -0,49	14,87 -1,41	23,18 -1,88
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,13 100,38	1,13 100,38	3,39 102,66	6,94 103,53	13,39 104,56	19,73 106,95	22,02 102,64
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,12 100,04	1,12 100,04	3,30 100,03	6,77 100,88	12,97 101,23	18,92 102,53	21,55 100,44
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,09 97,41	1,09 97,41	3,32 100,46	6,79 101,24	13,01 101,60	18,94 102,67	21,56 100,50
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	1,05 93,43	1,05 93,43	3,27 98,98	6,80 101,32	13,16 102,70	19,54 105,91	21,82 101,69
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,33 -0,04	3,33 -0,04	-1,67 0,58	7,26 -2,69	0,34 -0,81	-3,51 -2,09	-7,42 -7,13
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	3,30	3,30	-11,00	3,46	-15,88	-24,90	-30,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-0,06	-0,06	-8,76	-6,49	-17,03	-23,48	-29,92
BRADESCO F I A SELECTION	3,93	3,93	-2,67	10,30	4,30	-5,91	-10,46
Var. IBOVESPA p.p.	0,56	0,56	-0,42	0,35	3,16	-4,48	-10,17
FIA BRASIL IBX-50	4,79	4,79	-3,87	10,25	-0,63	-2,08	-1,88
Var. IBOVESPA p.p.	1,42	1,42	-1,62	0,30	-1,78	-0,66	-1,59
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	4,57	4,57	-3,23	8,85	2,32	-11,61	-18,98
Var. IBOVESPA p.p.	1,20	1,20	-0,98	-1,10	1,17	-10,19	-18,69
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	3,36	3,36	-4,05	9,15	1,54	-7,63	-8,47
Var. IBOVESPA p.p.	-0,01	-0,01	-1,81	-0,80	0,40	-6,20	-8,18
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	3,62	3,62	-3,00	9,06	-0,53	-3,38	-2,91
Var. IGCT p.p.	0,00	0,00	-0,22	-0,55	-0,95	-1,69	-2,70
BB AÇÕES DIVIDENDOS	3,72	3,72	-3,07	7,64	2,92	-2,16	-13,50
Var. IBOVESPA p.p.	0,35	0,35	-0,83	-2,31	1,77	-0,73	-13,21
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	3,40	3,40	-2,14	10,04	1,14	-1,67	-0,85
Var. IBOVESPA p.p.	0,03	0,03	0,11	0,09	-0,00	-0,25	-0,56
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	3,35	3,35	-10,07	2,83	-8,79	-12,16	-17,46
Var. SMALL CAP p.p.	0,43	0,43	1,32	-0,68	6,67	11,97	10,09
ILHA SOLTEIRA	1,43	1,43	-0,69	4,92	6,32	5,60	8,75
Var. IPCA + 4,80% p.p.	0,50	0,50	-3,44	1,05	-4,36	-22,24	-31,05
CDI	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46
IBOVESPA	3,37	3,37	-2,25	9,95	1,15	-1,42	-0,29
INPC + 6,00%	0,97	0,97	3,05	4,42	12,05	31,37	46,85
IPCA + 6,00%	1,04	1,04	3,08	4,55	12,12	31,18	45,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IRF M	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	D+0	D+0	D+0	D+2 du		0,50
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		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 IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA BRASIL IBX-50	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	D+1 du	D+0	D+2 du	D+4 du		1,50
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,10
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	1,10	1,10	3,25	6,75	12,54	16,51	20,51	28,48	37,42
IRF-M 1+	0,72	0,72	0,90	6,13	8,73	4,24	10,25	25,21	40,80
IRF-M TOTAL	0,84	0,84	1,65	6,17	9,82	8,42	13,75	26,79	40,53
IMA-B 5	1,40	1,40	2,01	4,40	11,19	16,27	25,06	40,14	54,28
IMA-B 5+	-1,26	-1,26	-3,59	1,84	3,66	-3,05	0,52	22,96	44,15
IMA-B TOTAL	-0,00	-0,00	-0,99	2,84	7,15	5,93	11,46	31,65	50,23
IMA-GERAL TOTAL	0,70	0,70	1,42	5,19	10,20	11,76	16,79	30,01	43,27
IDKA 2	1,44	1,44	1,90	3,99	10,86	16,26	25,79	39,66	54,03
IDKA 20	-4,58	-4,58	-9,69	-0,34	-3,60	-17,66	-17,08	6,23	30,85
CDI	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46	28,49	36,69

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,37	3,37	-2,25	9,95	1,15	-1,42	-0,29	16,47	33,58
IBRX 100	3,51	3,51	-2,34	9,39	0,75	-1,38	0,24	19,26	37,61
IBRX 50	3,38	3,38	-1,47	10,88	1,52	0,57	3,26	18,48	34,15
SMALL CAP	2,92	2,92	-11,39	3,51	-15,47	-24,13	-27,55	5,24	19,33
Índice Consumo - ICON			-16,42	-6,37	-24,84	-42,47	-44,77	-20,86	-20,70
Índice Dividendos - IDIV	5,89	5,89	5,00	11,84	10,99	17,61	12,30	42,62	69,29

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	3,77	3,77	2,13	-2,99	-14,07	2,21	50,95	110,51	132,79

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,60	-1,60	-5,69	0,25	1,59	-2,03	-8,32	17,07	23,45

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	4,67	4,67	7,25	-0,08	-13,97	-6,09	38,62	84,31	93,01

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,53	0,53	1,57	1,50	5,77	16,75	22,08	27,19	32,00
INPC	0,46	0,46	1,54	1,37	5,71	16,92	23,38	28,69	33,29
IGPM	0,21	0,21	0,09	-2,50	3,79	21,34	52,54	64,45	75,53
SELIC	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46	28,49	36,70

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	0,87	2,58	3,55	10,01	26,28	37,25	48,75	60,49
IPCA + 5,00%	0,96	0,96	2,83	4,05	11,06	28,72	41,24	54,54	68,33
IPCA + 5,50%	1,00	1,00	2,96	4,30	11,59	29,95	43,26	57,50	72,37
IPCA + 5,89%	1,03	1,03	3,06	4,50	12,00	30,91	44,84	59,84	75,57
IPCA + 6,00%	1,04	1,04	3,08	4,55	12,12	31,18	45,29	60,50	76,48
INPC + 4,00%	0,80	0,80	2,55	3,41	9,94	26,46	38,73	50,51	62,06
INPC + 6,00%	0,97	0,97	3,05	4,42	12,05	31,37	46,85	62,40	78,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
243	02/01/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	55.000,00	12.474,27181438	4,4090750000
238	04/01/2023	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	0,00	2.000.000,00	381.423,02063380	5,2435220000
242	04/01/2023	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,00	3.000.000,00	1.297.211,13443010	2,3126536000
239	05/01/2023	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	4.700.000,00	0,00	321.930,28400000	14,5994342000
244	10/01/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	50.000,00	11.304,95082233	4,4228410000
248	11/01/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	2.500.000,00	0,00	11.239,16816514	222,4363906000
245	19/01/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	160.000,00	36.054,37179539	4,4377420000
246	30/01/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.150.000,00	0,00	258.267,24686217	4,4527520000
247	30/01/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.200.000,00	320.584,14706050	3,7431670000
240	31/01/2023	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	481.734,70	32.698,67700000	14,7325440000
241	31/01/2023	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	218.265,30	14.815,18100000	14,7325440000
Total			8.350.000,00	7.165.000,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 7.507.509,39

Value-At-Risk: 3,99%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ILHA SOLTEIRA		3,99	3,99			188.387.635,88	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,71%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF M		1,62	0,02	0,02			2.338.838,17	1,24
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,92	0,19	0,03			14.161.687,02	7,52
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,95	0,16	0,03			12.252.248,05	6,50
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,39	0,06	0,02			9.831.550,16	5,22
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,40	0,08	0,01			14.384.722,95	7,64
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR		2,93	0,27	0,01			20.738.716,48	11,01
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		4,39	0,10	0,05			5.280.021,94	2,80
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,00	-0,00	0,00			113.626,05	0,06
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,40	0,07	0,02			11.217.933,49	5,95
Sub-total	4,73	2,32	0,95		-0,14	0,48	90.319.344,31	47,94

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,02	0,00	0,02			16.492.369,16	8,75
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B		3,05	0,08	0,24			5.493.145,23	2,92
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	0,00	0,01			6.951.013,67	3,69
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5		1,39	0,07	0,03			11.615.684,25	6,17
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,04	-0,00	0,04			4.515.795,06	2,40
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,01	-0,00	0,01			6.014.912,64	3,19
Sub-total	1,37	0,63	0,14		-0,13	0,94	51.082.920,01	27,12

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,91%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS		11,05	0,19	2,47			3.421.968,74	1,82
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		15,18	0,41	2,78			5.402.021,85	2,87
FIA BRASIL IBX-50		12,48	0,60	2,51			9.398.930,58	4,99
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		11,76	0,20	1,76			3.317.931,02	1,76
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		12,14	0,16	0,18			2.537.039,14	1,35
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		15,26	0,20	7,19			2.685.377,07	1,43
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		10,89	0,21	2,65			3.967.879,88	2,11
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES		12,23	0,07	1,84			1.046.030,20	0,56
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS		11,23	0,63	0,05			11.017.904,74	5,85
BRADESCO F I A SELECTION			10,61	0,23	2,04		4.190.288,34	2,22
Sub-total	21,88	11,91	2,89		0,12	3,76	46.985.371,56	24,94