



LENÇÓIS PAULISTA
SETEMBRO 2021



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 30.09.2021.

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

99,10%

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	0,41	0,40	1,69	7.160.974,60	1,76	157.242.286,81	4,55
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,30	-0,15	-2,47	54.169,73	0,01	461.408.407,40	0,01
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,40	0,37	1,53	40.437.188,13	9,91	6.892.529.188,23	0,59
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,33	-0,15	-2,46	132.131,75	0,03	7.233.196.021,39	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,31	-0,16	-2,57	13.496.274,63	3,31	649.147.051,80	2,08
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,51	0,38	1,65	13.638.268,05	3,34	106.301.898,63	12,83
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,38	0,38	1,59	50.896.944,35	12,48	6.805.654.314,46	0,75
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,41	0,39	1,56	62.134.480,73	15,23	665.519.143,94	9,34
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,48	0,98	2,30	48.609.946,77	11,91	11.150.255.278,19	0,44
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,29	1,03	2,73	61.865.367,70	15,16	9.425.482.510,34	0,66
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	5,31	-0,15	-2,50	801.734,87	0,20	1.141.624.055,64	0,07
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,50	0,55	1,37	299.227.481,31	73,34		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de 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	0,24	0,50	2,89	16.809,79	0,00	1.511.125.433,54	0,00
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	0,46	2,64	3.925.246,12	0,96	5.468.058.659,45	0,07
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,68	0,84	2,32	69.426.539,32	17,02	3.094.123.781,71	2,24
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	0,59	0,31	1,63	31.702.404,68	7,77	837.909.050,68	3,78
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,64	0,77	2,24	105.070.999,91	25,75		
Renda Fixa			1,30	0,60	1,53	404.298.481,22	99,10		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,90%

Artigo 8º III (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	13,89	-4,70	-2,44	1.726.884,90	0,42	258.269.045,58	0,67
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,92	-4,64	-1,80	1.963.983,87	0,48	3.166.279.756,52	0,06
Sub-total Artigo 8º III			11,19	-4,67	-1,85	3.690.868,77	0,90		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			4,49	-4,67	-1,85	3.690.868,77	0,90		
Total			1,30	0,54	1,50	407.989.349,99	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	299.227.481,31	73,34	60,00	80,00	98,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	105.070.999,91	25,75	2,00	10,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	404.298.481,22	99,10					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	3.690.868,77	0,90	0,00	1,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	3.690.868,77	0,90					30,00

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	0,55 126,35	1,37 54,78	0,70 57,63	1,75 87,05	3,64 121,55	1.789.534,75	4.448.466,97
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,77 175,00	2,24 89,51	1,24 101,24	1,93 95,58	2,67 89,12	615.016,24	1.701.522,82
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-4,67 1,90	-1,85 8,35				-180.713,20	-79.131,23
LENÇÓIS PAULISTA (Total)						2.223.837,79	6.070.858,56

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IDKA2	60.153.829,01	1.079.658,03	0,00	0,00	61.865.367,70	631.880,66	1.596.609,34
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	2.130.896,21	0,00	-2.000.000,00	0,00	132.131,75	1.235,54	-49.261,85
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	42.829.587,44	0,00	-2.549.291,13	0,00	40.437.188,13	156.891,82	725.156,66
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	61.892.271,52	0,00	0,00	0,00	62.134.480,73	242.209,21	960.680,48
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	13.518.096,79	0,00	0,00	0,00	13.496.274,63	-21.822,16	-349.171,11
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	48.137.684,80	0,00	0,00	0,00	48.609.946,77	472.261,97	1.079.174,77
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.705.177,20	0,00	0,00	0,00	50.896.944,35	191.767,15	797.879,44
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	2.849.237,89	0,00	-2.800.000,00	0,00	54.169,73	4.931,84	-62.933,42
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	4.342.384,13	2.800.000,00	0,00	0,00	7.160.974,60	18.590,47	73.934,29
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.586.475,29	0,00	0,00	0,00	13.638.268,05	51.792,76	219.196,80
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	23.761.939,38	0,00	-23.000.000,00	0,00	801.734,87	39.795,49	-533.059,78
					299.227.481,31	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	187.936,68	3.730.000,00	0,00	0,00	3.925.246,12	7.309,44	11.307,30
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	68.850.315,16	0,00	0,00	0,00	69.426.539,32	576.224,16	1.561.196,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	16.726,10	0,00	0,00	0,00	16.809,79	83,69	472,73
SANTANDER RF ATIVO FIC	8.671.005,73	23.000.000,00	0,00	0,00	31.702.404,68	31.398,95	128.545,94
					105.070.999,91	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	1.812.071,72	0,00	0,00	0,00	1.726.884,90	-85.186,82	-43.115,10
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.059.510,25	0,00	0,00	0,00	1.963.983,87	-95.526,38	-36.016,13
					3.690.868,77	0,00	0,00

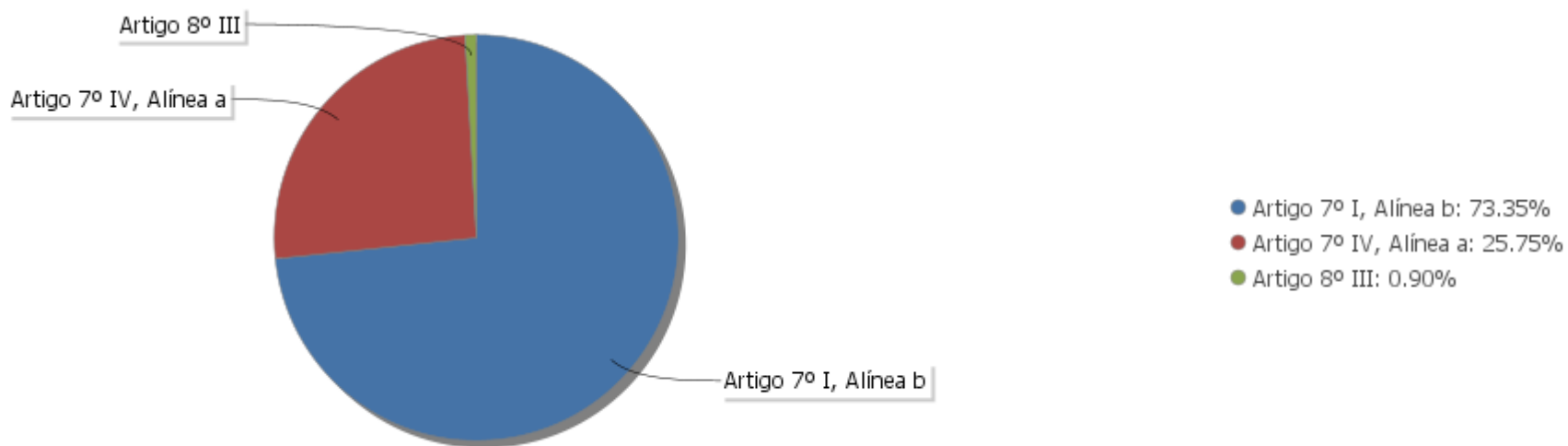
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

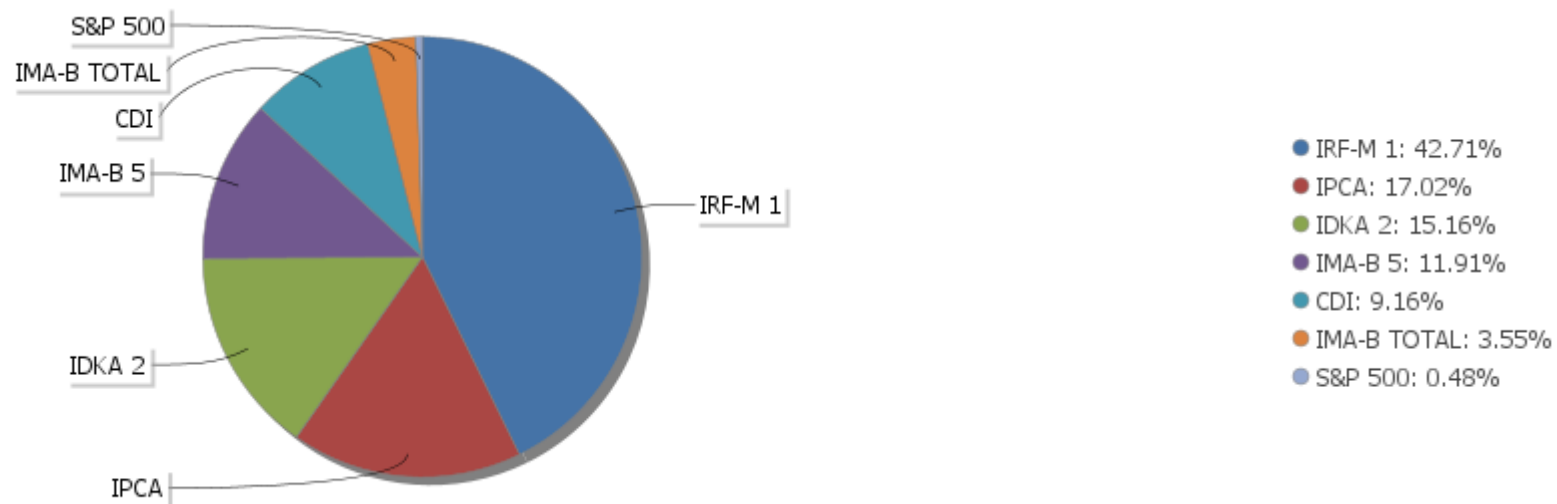
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	407.989.349,99	100,00	407.989.349,99	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	407.989.349,99	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	407.989.349,99	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

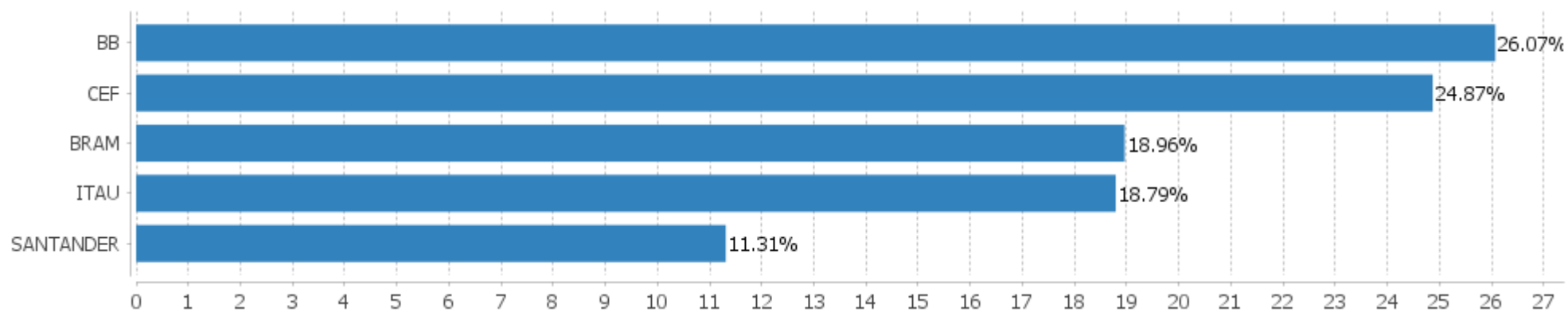


Alocação Por Estratégia



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
2021	-0,02	-0,30	0,07	0,41	0,41	0,14	0,08	0,15	0,54				1,50
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61				11,18
p.p. indexador	-0,69	-1,54	-1,35	-0,32	-0,86	-0,83	-1,34	-1,18	-1,06				-9,68
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

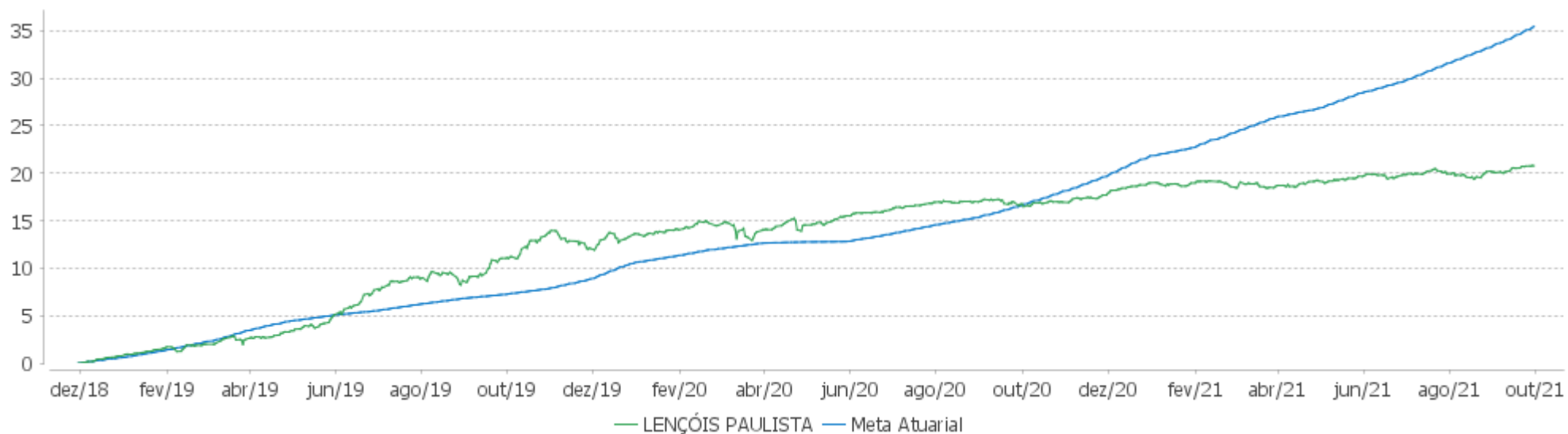
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

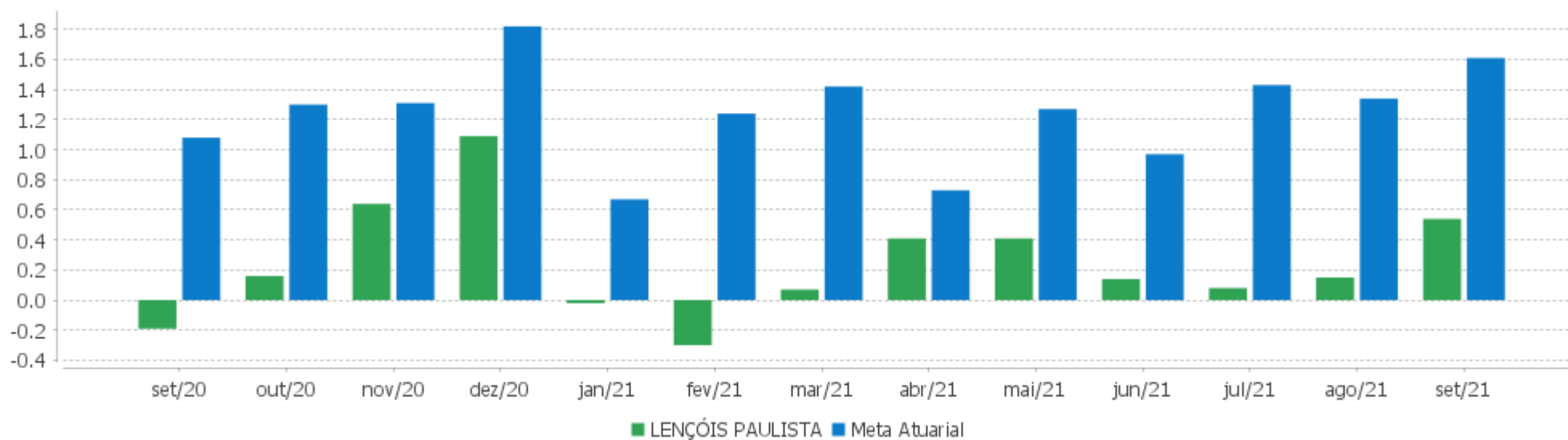
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	9	26,47	03 meses	0,78	4,43	-3,65	1,39
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	73,53	06 meses	1,76	7,57	-5,80	1,34
			12 meses	3,44	16,35	-12,91	1,30
			24 meses	8,76	27,20	-18,44	2,07
Maior rentabilidade da Carteira	2,45	2019-06	Desde 30/11/2018	20,76	37,03	-16,27	2,14
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
SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI	0,31 69,64	1,63 65,17	0,82 66,80	1,63 80,81	2,40 80,19	6,83 102,64	21,45 160,73
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,46 104,77	2,64 105,40	1,31 106,72	2,13 105,74	3,23 107,92	6,30 94,70	12,80 95,91
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,50 114,18	2,89 115,41	1,37 111,87	2,34 116,33	3,53 118,19	6,21 93,33	12,88 96,46
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,84 -0,32	2,32 -4,58	1,30 -1,72	1,98 -2,77	2,72 -7,53	6,51 -7,19	21,07 4,08
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,40 -0,00	1,69 -0,09	0,91 -0,05	1,59 -0,06	2,35 -0,14	6,63 -0,52	14,30 -0,82
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,15 -0,02	-2,47 -0,17	-1,64 -0,05	0,40 -0,12	4,43 -0,28	6,37 -0,54	39,14 -1,32
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,98 -0,02	2,30 -0,19	1,13 -0,05	2,53 -0,11	5,69 -0,26	13,00 -0,62	30,19 -0,93
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,03 -0,06	2,73 -0,34	1,30 0,11	2,74 -0,38	6,05 -0,17	13,77 -0,94	27,54 -1,91
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,39 -0,01	1,56 -0,22	0,94 -0,02	1,54 -0,11	2,24 -0,25	6,47 -0,68	14,11 -1,01
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,37 -0,04	1,53 -0,25	0,87 -0,09	1,47 -0,18	2,16 -0,33	6,42 -0,73	14,11 -1,01
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,38 -0,02	1,65 -0,13	0,93 -0,03	1,59 -0,06	2,42 -0,07	6,54 -0,61	14,34 -0,79
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,38 -0,02	1,59 -0,19	0,89 -0,07	1,54 -0,11	2,25 -0,25	6,68 -0,47	14,44 -0,68
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,15 -0,02	-2,46 -0,16	-1,66 -0,07	0,40 -0,12	4,49 -0,22	6,40 -0,52	39,39 -1,07
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,16 -0,03	-2,57 -0,27	-1,68 -0,09	0,34 -0,18	4,34 -0,37	6,19 -0,73	39,01 -1,45
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,15 -0,02	-2,50 -0,20	-1,65 -0,06	0,38 -0,14	4,42 -0,29	6,07 -0,85	38,99 -1,47
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	-4,70 -1.072,77	16,72 666,93	0,92 75,29	9,55 473,80	30,02 1.003,60	42,82 643,58	49,43 370,33
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-4,64	17,47	1,14	9,99	30,71	42,05	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. S&P 500 p.p.	-5,36	-2,57	-7,86	6,48	7,20	-46,96	
LENÇÓIS PAULISTA	0,54	1,50	0,78	1,76	3,44	8,76	
Var. IPCA + 5,41% p.p.	-1,06	-9,68	-3,65	-5,80	-12,75	-17,55	
CDI	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35
IBOVESPA	-6,57	-6,75	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87
INPC + 6,00%	1,69	11,97	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02
IPCA + 6,00%	1,65	11,65	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28

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	0,40	1,78	0,96	1,65	2,49	7,15	15,12	22,90	38,45
IRF-M 1+	-0,73	-5,87	-2,65	-1,15	-3,14	4,23	25,92	32,64	58,13
IRF-M TOTAL	-0,33	-2,95	-1,39	-0,15	-1,02	5,48	23,23	30,30	53,03
IMA-B 5	1,00	2,48	1,18	2,64	5,95	13,62	31,12	39,68	58,47
IMA-B 5+	-1,26	-6,63	-4,19	-1,61	3,20	1,48	46,98	45,78	70,99
IMA-B TOTAL	-0,13	-2,30	-1,59	0,52	4,71	6,92	40,46	44,04	66,75
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,02	-0,76	-0,42	0,89	2,05	6,02	23,59	29,99	49,60
IMA-GERAL TOTAL	-0,01	-0,38	-0,52	0,96	2,48	6,93	24,87	31,60	51,09
IDKA 2	1,10	3,07	1,18	3,12	6,21	14,71	29,45	40,48	59,67
IDKA 20	-3,03	-11,97	-8,65	-5,13	2,03	-7,04	59,98	49,40	80,44
CDI	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,90	34,86

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-6,57	-6,75	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87	49,38	90,14
IBRX 100	-6,99	-5,99	-13,61	-5,31	17,82	7,71	45,23	53,72	95,90
IBRX 50	-7,47	-6,33	-14,15	-5,58	18,46	6,59	37,53	47,56	87,32
SMALL CAP	-6,43	-5,54	-15,22	-4,70	15,75	13,69	78,82	65,15	133,65
IFIX	-1,24	-5,38	-1,42	-4,61	-2,83	1,17	27,21	22,27	49,54
Índice Consumo - ICON	-5,95	-11,50	-14,34	-7,48	-1,67	-2,69	50,48	25,77	51,19
Índice Dividendos - IDIV	-4,48	-4,67	-6,59	-1,51	19,58	7,85	64,83	56,04	121,60

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	1,16	6,90	3,02	4,75	10,25	13,70	16,99	22,29	25,39
INPC	1,20	7,21	3,13	5,14	10,78	15,09	18,46	23,16	25,17
IGPM	-0,64	16,00	0,80	7,15	24,86	47,25	52,21	67,49	65,07
SELIC	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,91	34,89

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	0,73	20,04	8,99	3,52	23,52	89,01	100,82	193,57	232,88
MSCI ACWI	1,23	14,91	7,16	0,61	21,06	78,00	83,86	150,21	184,12
MSCI World	1,22	16,99	8,36	2,09	22,47	80,14	87,02	158,04	191,94

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,49	10,07	4,07	6,84	14,64	22,96	31,56	42,95	52,39
IPCA + 5,00%	1,57	10,86	4,32	7,36	15,74	25,33	35,38	48,50	59,82
IPCA + 5,50%	1,61	11,26	4,45	7,61	16,29	26,53	37,32	51,33	63,64
IPCA + 5,89%	1,64	11,56	4,55	7,81	16,71	27,46	38,84	53,57	66,67
IPCA + 6,00%	1,65	11,65	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28	54,21	67,53
INPC + 4,00%	1,53	10,39	4,18	7,24	15,20	24,46	33,20	43,97	52,12
INPC + 6,00%	1,69	11,97	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02	55,31	67,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

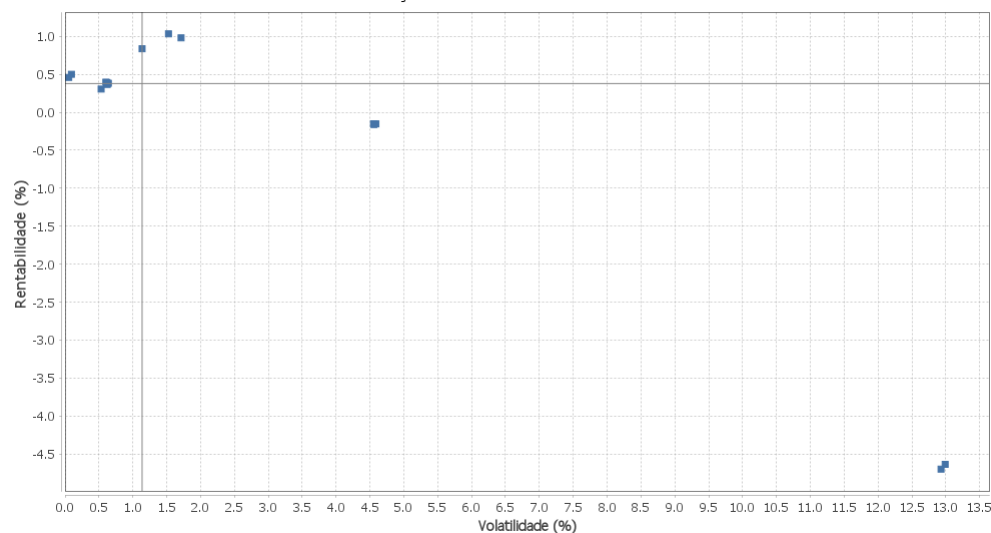
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
38	08/09/2021	BB PREV RF IDKA2	210.384,07	0,00	71.577,81674100	2,9392356400
37	10/09/2021	BB PREV RF IDKA2	869.273,96	0,00	295.343,10193000	2,9432682000
40	10/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.730.000,00	0,00	734.548,73924600	2,3551874880
44	27/09/2021	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	0,00	2.800.000,00	74.098,75014000	37,7874120000
46	27/09/2021	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	0,00	3.898.682,12	139.188,59989400	28,0100678000
47	27/09/2021	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	0,00	15.308.310,38	546.528,85856000	28,0100678000
48	27/09/2021	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	0,00	2.765.231,92	98.722,78588200	28,0100678000
49	27/09/2021	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	0,00	1.027.775,58	36.693,07742400	28,0100678000
39	28/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.000.000,00	0,00	846.954,08025900	2,3614031110
42	28/09/2021	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	2.000.000,00	312.765,49406900	6,3945672970
43	28/09/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	2.800.000,00	0,00	81.586,12281000	34,3195620000
45	28/09/2021	SANTANDER RF ATIVO FIC	23.000.000,00	0,00	1.766.175,47586200	13,0224886000
41	30/09/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	2.549.291,13	921.398,80149200	2,7667619340

Total

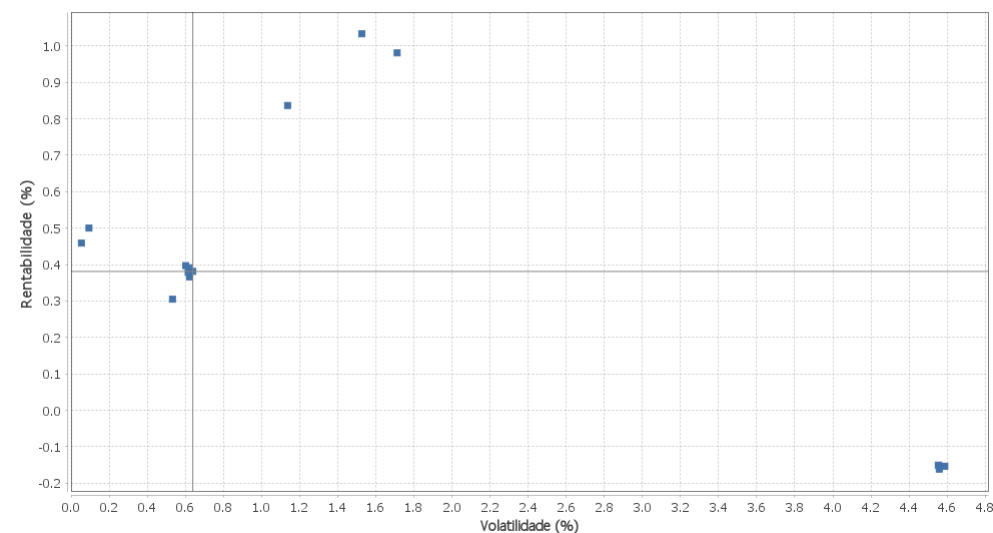
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

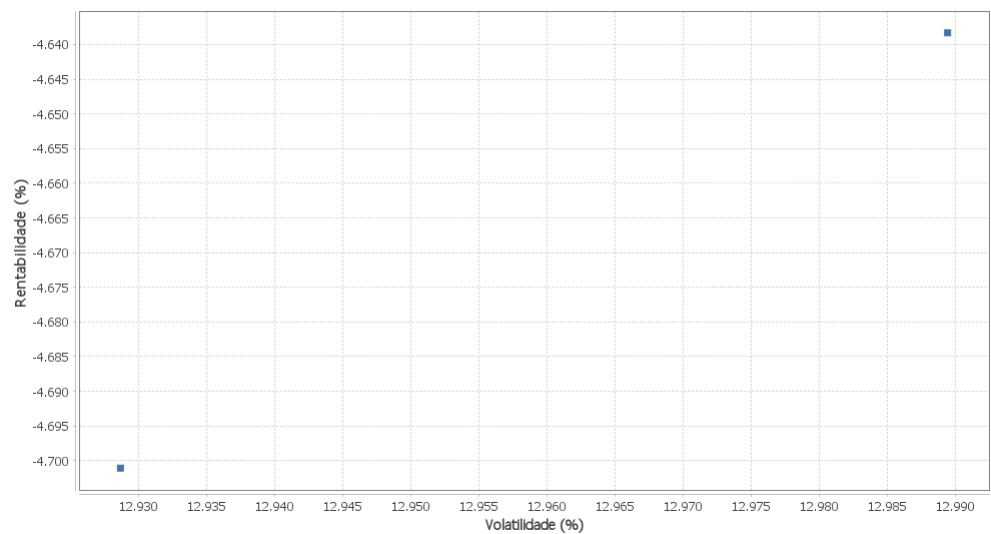
LENÇÓIS PAULISTA - No Mês



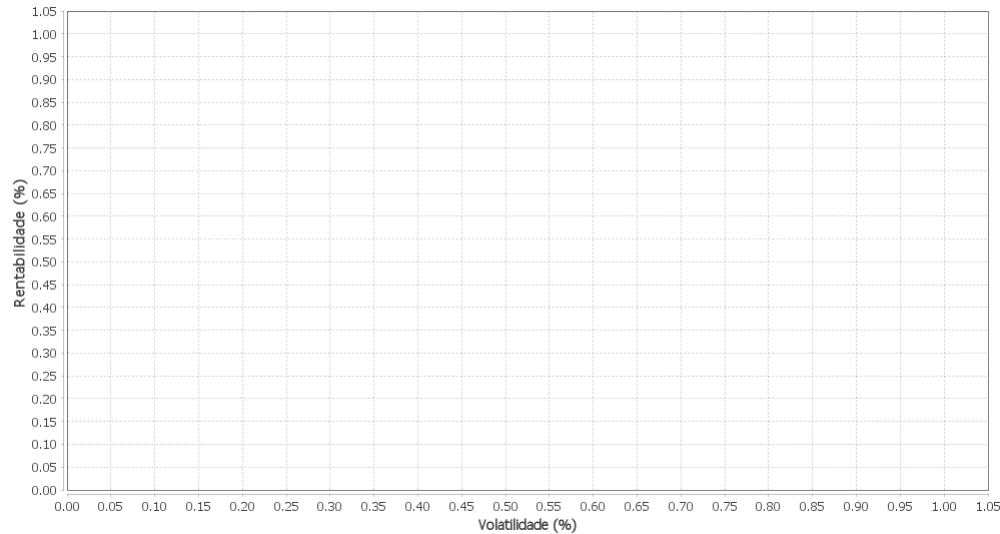
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 2.212.738,94

Value-At-Risk: 0,54%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,03	0,00	0,39	0,46	3.925.246,12	0,96
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,09	0,03	0,00	0,66	0,50	16.809,79	0,00
SANTANDER RF ATIVO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,53	0,29	0,02	-0,25	0,31	31.702.404,68	7,77
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,60	0,18	0,00	-0,07	0,40	7.160.974,60	1,76
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,61	0,18	0,01	-0,10	0,38	50.896.944,35	12,48
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,62	0,19	0,02	-0,08	0,39	62.134.480,73	15,23
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,62	0,18	0,01	-0,12	0,37	40.437.188,13	9,91
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,64	0,18	0,00	-0,09	0,38	13.638.268,05	3,34
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	1,14	0,52	0,07	0,35	0,84	69.426.539,32	17,02
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,53	1,07	0,16	0,39	1,03	61.865.367,70	15,16
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,71	1,23	0,14	0,32	0,98	48.609.946,77	11,91
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	4,55	2,95	0,00	-0,13	-0,15	54.169,73	0,01
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	4,56	2,96	0,09	-0,13	-0,16	13.496.274,63	3,31
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	Artigo 7º I, Alínea b	4,56	2,95	0,01	-0,13	-0,15	801.734,87	0,20
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,59	2,97	0,00	-0,13	-0,15	132.131,75	0,03
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	Artigo 8º III	12,93	6,26	0,01	-0,40	-4,70	1.726.884,90	0,42
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	12,99	6,26	0,01	-0,39	-4,64	1.963.983,87	0,48