



LDB
EMPRESAS

HOLAMBRA
NOVEMBRO 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 30.11.2022.

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

97,78%

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				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,12	0,06	0,98	11,21	5.405.624,93	6,13	19.105.914.614,04	0,03
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,49	0,06	0,91	10,45	11.162.112,13	12,65	6.379.149.625,43	0,17
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,27	0,73	-0,80	6,33	9.521.450,42	10,79	5.638.875.418,33	0,17
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,34	0,74	-0,83	6,45	3.262.013,03	3,70	3.729.245.028,85	0,09
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,49	0,06	0,92	10,50	2.642.776,48	2,99	539.794.422,33	0,49
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,58	0,31	-0,35	8,67	4.135.576,08	4,69	8.271.051.539,34	0,05
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,79	0,34	-0,65	8,01	14.399.360,37	16,32	7.717.989.815,26	0,19
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,33	1,10	-1,25	4,18	2.086.282,46	2,36	847.757.260,13	0,25
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,59	0,31	-0,34	8,56	2.598.312,85	2,94	915.031.881,07	0,28
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,88	0,35	-0,71	1,33	4.053.395,93	4,59	7.588.268.856,59	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,76	0,10	0,09	9,45	1.132.219,62	1,28	5.198.139.831,44	0,02
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,59	0,35	-0,17	8,20	60.399.124,30	68,44		

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				
GRAPHEN	RJI	LME REC IMA B FI RENDA FIXA	1,58	0,20	0,66	6,00	1.558.972,95	1,77	72.189.760,59	2,16
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	5,32	0,73	-0,88	6,24	740.147,67	0,84	559.706.338,36	0,13
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	5,31	0,73	-0,76	6,31	3.446.621,92	3,91	646.609.012,44	0,53
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,10	0,05	1,02	11,34	8.494.813,94	9,63	12.044.835.497,35	0,07
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,61	0,31	-0,36	8,29	537.582,86	0,61	1.065.493.182,20	0,05
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	2,66	0,39	-0,34	7,96	1.103.514,83	1,25	734.939.878,75	0,15
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,11	0,05	0,99	10,84	3.130.388,50	3,55	8.684.113.341,14	0,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11	0,05	1,06	11,70	5.766.485,88	6,53	6.980.496.149,94	0,08
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,14	0,20	0,60	9,91	24.778.528,55	28,08		

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1,25	0,31	0,31	3,19	1.108.099,97	1,26	74.394.580,85	1,49
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			1,25	0,31	0,31	3,19	1.108.099,97	1,26		
Renda Fixa			2,11	0,31	0,06	8,62	86.285.752,82	97,78		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,22%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO FI LP	1,04	0,04	0,44	10,61	1.962.370,06	2,22	308.434.403,84	0,64
Sub-total Artigo 10º I			1,04	0,04	0,44	10,61	1.962.370,06	2,22		
Investimentos Estruturados			1,01	0,04	0,44	10,61	1.962.370,06	2,22		
Total			2,08	0,30	0,07	8,66	88.248.122,88	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	60.399.124,30	68,44	0,00	62,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	24.778.528,55	28,08	0,00	34,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.108.099,97	1,26	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	86.285.752,82	97,78					100,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	1.962.370,06	2,22	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	1.962.370,06	2,22					15,00
Total		88.248.122,88	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	-0,17 -16,41	8,20 73,69	2,19 69,77	3,25 49,95	8,80 73,46	-101.616,66	4.568.687,81
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,60 59,14	9,91 89,06	2,82 89,69	5,28 81,22		148.686,08	2.232.873,16
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,31 30,46	3,19 28,71	0,50 16,02	0,72 11,14		3.434,02	34.291,12
Artigo 10º I % do CDI	0,44 42,84	10,61 95,39	2,96 94,12	5,64 86,80		8.542,38	188.261,46
HOLAMBRA (Total)						59.045,82	7.024.113,55

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	14.494.078,40	0,00	0,00	0,00	14.399.360,37	-94.718,03	1.067.256,82
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	9.598.185,27	0,00	0,00	0,00	9.521.450,42	-76.734,85	749.068,54
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	2.112.635,05	0,00	0,00	0,00	2.086.282,46	-26.352,59	80.259,70
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	10.553.795,90	529.369,27	-20.695,63	0,00	11.162.112,13	99.642,59	1.004.304,73
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	2.618.777,02	0,00	0,00	0,00	2.642.776,48	23.999,46	251.207,16
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.082.187,12	0,00	0,00	0,00	4.053.395,93	-28.791,19	53.395,93
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.150.048,78	0,00	0,00	0,00	4.135.576,08	-14.472,70	121.792,27
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.298.492,20	0,00	-8.948,43	0,00	3.262.013,03	-27.530,74	203.248,40
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.353.288,55	0,00	0,00	0,00	5.405.624,93	52.336,38	567.315,79
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1.574.175,01	0,00	-441.894,27	0,00	1.132.219,62	-61,12	134.634,74
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2.607.246,72	0,00	0,00	0,00	2.598.312,85	-8.933,87	204.924,52
					60.399.124,30	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\$)
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	3.099.603,12	0,00	0,00	0,00	3.130.388,50	30.785,38	306.188,73
BB PREV RF IMA-B	3.472.977,22	0,00	0,00	0,00	3.446.621,92	-26.355,30	204.489,36
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.407.043,98	1.823,48	0,00	0,00	8.494.813,94	85.946,48	864.066,29
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	5.706.013,53	0,00	0,00	0,00	5.766.485,88	60.472,35	603.835,51
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.107.314,02	0,00	0,00	0,00	1.103.514,83	-3.799,19	81.393,54
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	539.534,17	0,00	0,00	0,00	537.582,86	-1.951,31	41.156,11
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	746.748,23	0,00	0,00	0,00	740.147,67	-6.600,56	43.454,23
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	1.548.784,72	0,00	0,00	0,00	1.558.972,95	10.188,23	88.289,39
					24.778.528,55	0,00	0,00

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1.104.665,95	0,00	0,00	0,00	1.108.099,97	3.434,02	34.291,12
					1.108.099,97	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	1.953.827,68	0,00	0,00	0,00	1.962.370,06	8.542,38	188.261,46
					1.962.370,06	0,00	0,00

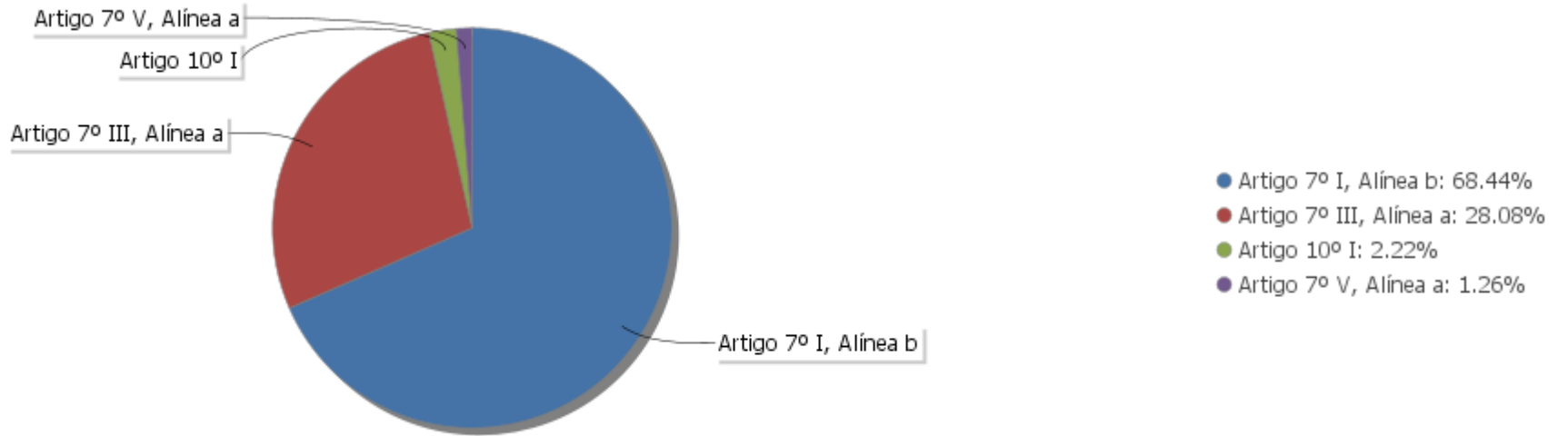
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

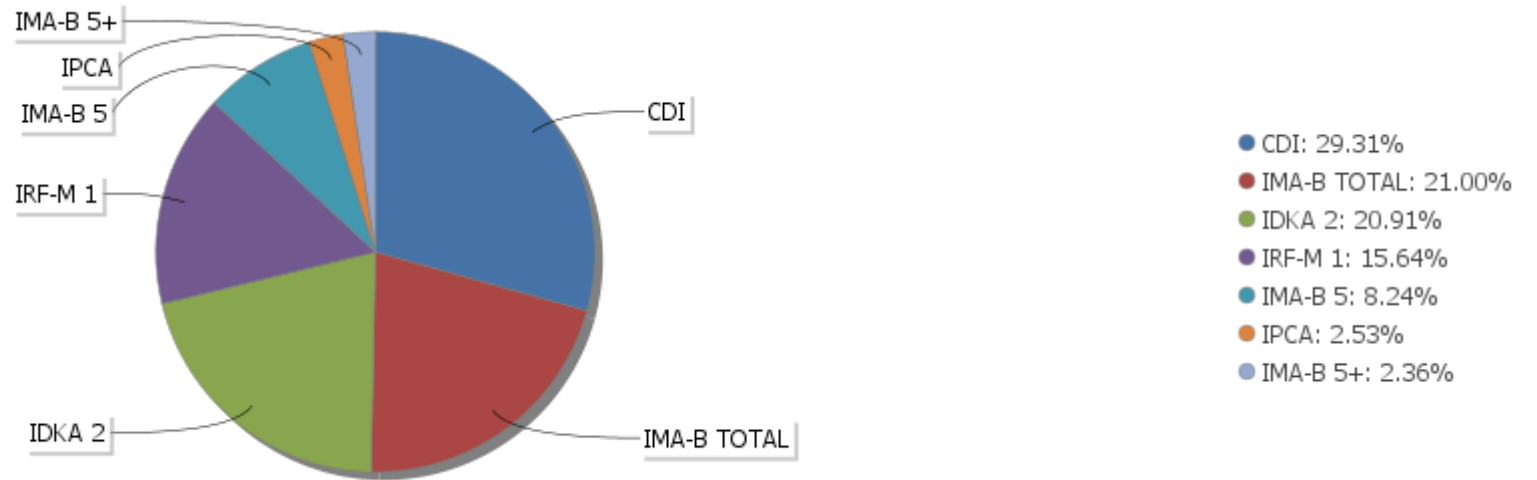
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	86.689.149,93	98,23	86.689.149,93	98,23
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	86.689.149,93	98,23
acima de 365 dias	1.558.972,95	1,77	88.248.122,88	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

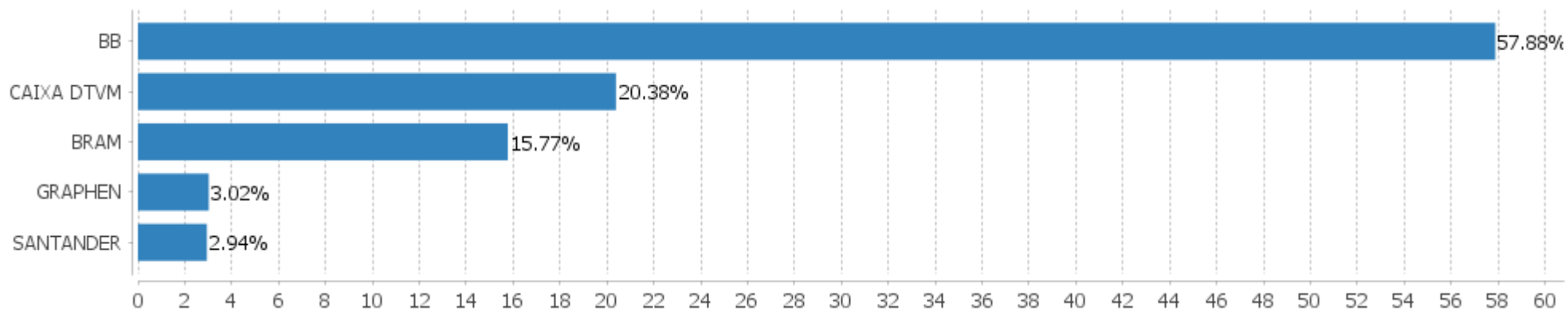


Alocação Por Estratégia



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
2022	0,15	0,76	1,84	0,90	0,93	0,42	0,19	0,82	1,01	1,27	0,07		8,66
IPCA + 5,04%	0,95	1,39	2,06	1,44	0,90	1,08	-0,27	0,09	0,12	0,98	0,80		9,94
p.p. indexador	-0,81	-0,62	-0,22	-0,54	0,03	-0,67	0,47	0,73	0,89	0,29	-0,74		-1,28
2021	-0,40	-0,96	-0,15	0,60	0,73	0,23	-0,18	-0,59	0,19	-0,96	1,83	0,58	0,88
IPCA + 5,89%	0,71	1,27	1,46	0,77	1,31	1,01	1,47	1,38	1,64	1,71	1,41	1,26	16,52
p.p. indexador	-1,10	-2,23	-1,61	-0,17	-0,58	-0,78	-1,65	-1,96	-1,46	-2,67	0,42	-0,68	-15,64
2020	0,34	0,42	-3,58	0,77	1,31	1,28	2,29	-0,74	-0,80	0,16	1,32	2,83	5,58
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	-0,37	-0,24	-4,15	0,63	1,23	0,54	1,41	-1,46	-1,92	-1,18	-0,03	0,98	-5,06
2019	1,30	0,44	0,54	0,92	1,53	1,62	0,95	-0,04	1,82	2,02	-1,07	1,27	11,86
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	0,46	-0,46	-0,65	-0,14	0,89	1,17	0,23	-0,66	1,37	1,39	-2,04	-0,37	1,27
2018	1,05	0,52	0,97	0,44	-0,69	0,36	1,07	1,13	0,63	2,13	0,42	0,91	9,28
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	0,25	-0,22	0,39	-0,26	-1,58	-1,40	0,23	0,69	-0,29	1,17	0,16	0,29	-0,64

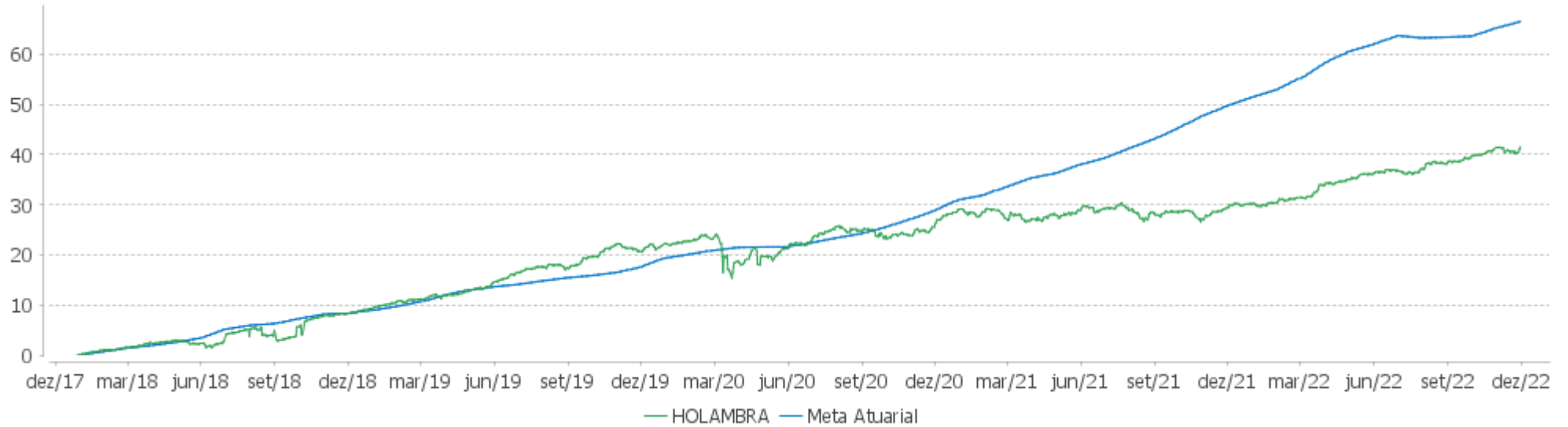
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	24	40,68	03 meses	2,36	1,92	0,45	2,45
Meses abaixo - Meta Atuarial	35	59,32	06 meses	3,83	2,83	1,00	2,28
			12 meses	9,28	11,32	-2,04	2,08
			24 meses	12,72	30,48	-17,76	2,77
Maior rentabilidade da Carteira	2,83	2020-12	36 meses	17,21	44,06	-26,85	4,61
Menor rentabilidade da Carteira	-3,58	2020-03	48 meses	30,63	57,71	-27,07	4,11
			Desde 29/12/2017	41,47	72,29	-30,82	4,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

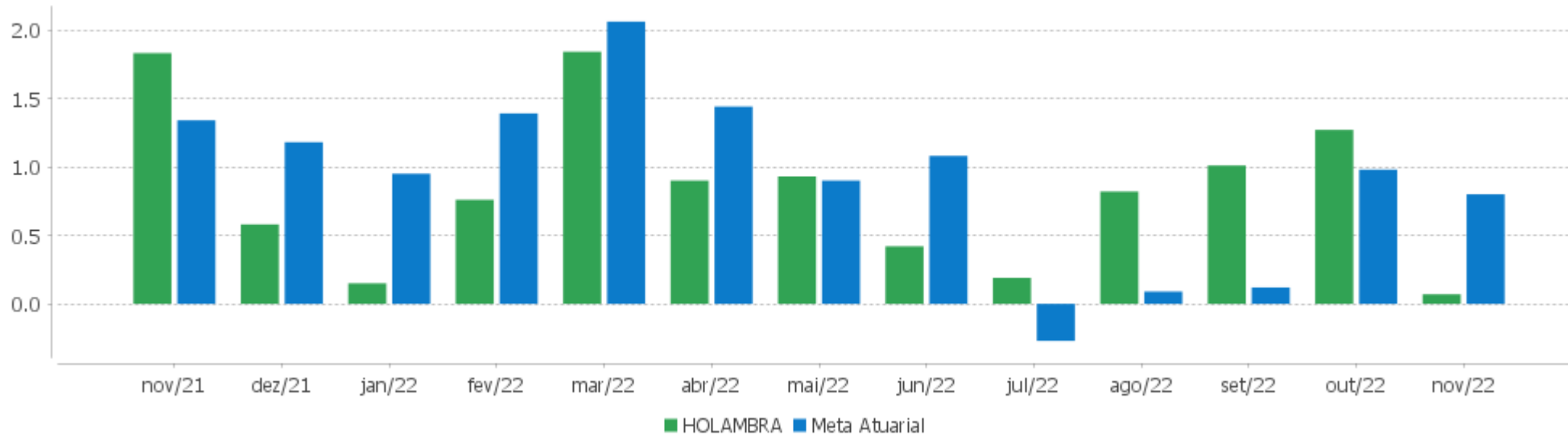


Patrimônio Líquido



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.	-0,83 -0,04	6,45 -0,13	1,84 -0,07	1,72 -0,05	6,67 -0,15	9,89 -0,44	13,38 -0,83
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,35 -0,02	8,67 -0,09	1,95 -0,05	2,36 0,01	9,50 -0,11	15,42 -0,39	23,61 -0,78
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-0,34 -0,01	8,56 -0,20	1,95 -0,05	2,27 -0,09	9,39 -0,22	15,33 -0,47	23,64 -0,74
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	-0,65 0,12	8,01 0,00	1,72 0,10	1,72 0,16	8,77 -0,13	14,75 -0,59	23,38 -1,25
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,92 -0,02	10,50 -0,21	3,04 -0,05	6,34 -0,09	11,45 -0,24	13,81 -0,49	17,85 -0,97
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,91 -0,03	10,45 -0,26	3,01 -0,07	6,31 -0,13	11,39 -0,30	13,72 -0,58	17,77 -1,06
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,09 -0,32	9,45 4,32	2,33 1,62	4,89 4,56	10,36 4,46	10,78 -6,50	17,31 -5,02
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,71 0,07	7,71 -0,29	1,63 0,00	1,45 -0,11	8,49 -0,41	14,60 -0,74	23,13 -1,50
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,80 -0,01	6,33 -0,25	1,84 -0,07	1,66 -0,10	6,54 -0,27	9,78 -0,56	13,34 -0,88
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,98 95,78	11,21 100,75	3,12 99,04	6,47 99,58	12,07 100,83	16,33 100,80	19,33 98,28
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,25 -0,07	4,18 -0,36	1,73 -0,11	1,16 -0,17	3,84 -0,34	4,38 -0,65	4,82 -0,93
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	0,31 30,46	3,19 28,71	0,50 16,02	0,72 11,14	3,33 27,77	2,85 17,57	-2,89 -14,70
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,88 -0,09	6,24 -0,34	1,77 -0,15	1,52 -0,24	6,41 -0,40	8,88 -1,45	12,51 -1,71
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-0,36 -0,03	8,29 -0,47	1,89 -0,11	2,14 -0,22	9,12 -0,49	14,26 -1,55	22,57 -1,82
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,06 103,83	11,70 105,14	3,28 104,40	6,80 104,62	12,60 105,24	17,47 107,84	20,15 102,45
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,76 0,03	6,31 -0,27	1,87 -0,05	1,55 -0,22	6,53 -0,29	9,77 -0,56	13,16 -1,05
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1,02	11,34	3,19	6,57	12,23	16,78	19,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	100,15	101,91	101,32	101,14	102,12	103,57	100,17
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,99	10,84	3,08	6,38	11,65	15,82	18,77
% do CDI	97,31	97,46	97,94	98,18	97,31	97,67	95,42
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	0,66	6,00	2,13	3,01	4,77	2,73	0,09
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,45	-0,57	0,22	1,24	-2,05	-7,60	-14,13
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	-0,34	7,96	2,04	4,07	8,81	10,47	13,78
Var. IPCA p.p.	-0,75	2,83	1,33	3,74	2,91	-6,80	-8,55
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	0,44	10,61	2,96	5,64	11,91	15,78	17,74
% do CDI	42,84	95,39	94,12	86,80	99,44	97,44	90,20
HOLAMBRA	0,07	8,66	2,36	3,83	9,28	12,72	17,21
Var. IPCA + 5,04% p.p.	-0,74	-1,28	0,45	1,00	-1,95	-16,62	-24,45
CDI	1,02	11,12	3,15	6,50	11,97	16,20	19,67
IBOVESPA	-3,06	7,31	2,71	1,02	10,37	3,30	3,93
INPC + 6,00%	0,85	10,93	1,96	3,20	12,33	32,06	47,19
IPCA + 6,00%	0,88	10,85	2,14	3,30	12,25	31,71	45,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	D+0	D+0	D+0	D+4 du		0,60
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 IMA-B	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,30
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+2 du	D+2 du		0,20
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 FEDERAL EXTRA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	D+0	D+0	D+3 du	D+4 du		0,40
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 IDKA IPCA 2A 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
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	D+0	D+0				
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1008 du	D+1009 du	PERÍODO SEMESTRAL,C /VENCIMENTO NO ÚLTIMO DIA ÚTIL DE DEZEMBRO E JUNHO.	0,00
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,10

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	0,94	10,71	3,09	6,43	11,68	14,31	18,83	27,03	35,90
IRF-M 1+	-1,42	5,70	1,06	5,02	8,12	3,49	9,70	26,82	41,73
IRF-M TOTAL	-0,66	7,24	1,66	5,33	9,26	7,16	12,84	27,56	40,85
IMA-B 5	-0,33	8,76	2,00	2,36	9,62	15,81	24,38	40,92	54,10
IMA-B 5+	-1,18	4,54	1,85	1,33	4,19	5,03	5,75	36,89	56,28
IMA-B TOTAL	-0,79	6,58	1,92	1,77	6,82	10,34	14,22	39,94	56,93
IMA-GERAL TOTAL	-0,06	8,82	2,23	4,60	9,76	12,09	16,76	32,09	44,93
IDKA 2	-0,77	8,00	1,63	1,56	8,90	15,34	24,63	39,43	52,89
IDKA 20	-2,10	1,45	2,45	1,09	-0,87	-3,40	-7,85	30,57	55,16
CDI	1,02	11,12	3,15	6,50	11,97	16,20	19,67	26,96	35,17

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,06	7,31	2,71	1,02	10,37	3,30	3,93	25,68	56,29
IBRX 100	-3,11	6,82	2,24	0,20	10,17	3,57	5,35	29,31	60,79
IBRX 50	-2,19	8,48	3,51	1,63	12,57	6,19	7,17	27,14	57,97
SMALL CAP	-11,23	-12,42	-6,49	-8,76	-9,10	-21,09	-17,86	17,77	33,49
Índice Consumo - ICON	-14,29		-9,98	-10,16	-21,20	-38,86	-36,58	-8,99	-11,97
Índice Dividendos - IDIV	0,78	14,50	2,96	0,30	16,33	16,74	16,68	54,99	87,39

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	6,12	-18,79	5,46	10,54	-15,84	11,87	62,81	102,57	150,14

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-4,15	2,23	-3,66	1,66	11,20	2,09	-0,80	24,64	29,56

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,36	-20,71	5,19	8,20	-18,19	1,33	44,64	76,14	102,61

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,41	5,13	0,71	0,33	5,90	17,27	22,33	26,33	31,45
INPC	0,38	5,21	0,53	0,23	5,97	17,59	23,70	27,86	32,41
IGPM	-0,56	4,98	-2,46	-2,38	5,90	24,83	55,45	61,62	77,25
SELIC	1,02	11,12	3,15	6,50	11,97	16,20	19,67	26,96	35,19

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,72	8,95	1,67	2,32	10,14	26,80	37,52	47,70	59,77
IPCA + 5,00%	0,80	9,90	1,91	2,81	11,20	29,24	41,50	53,44	67,57
IPCA + 5,50%	0,84	10,37	2,02	3,05	11,73	30,47	43,52	56,37	71,58
IPCA + 5,89%	0,87	10,75	2,11	3,24	12,14	31,43	45,11	58,69	74,76
IPCA + 6,00%	0,88	10,85	2,14	3,30	12,25	31,71	45,56	59,35	75,66
INPC + 4,00%	0,69	9,02	1,49	2,22	10,21	27,14	39,06	49,49	60,95
INPC + 6,00%	0,85	10,93	1,96	3,20	12,33	32,06	47,19	61,28	76,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
269	10/11/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	508.566,36	0,00	165.671,59055600	3,0697258250
272	10/11/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	15.553,77	5.066,82710000	3,0697258250
273	10/11/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	2.760,00	899,10309800	3,0697258250
275	10/11/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.823,48	0,00	684,54508100	2,6637836570
266	18/11/2022	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	22.122,60	13.444,55587500	1,6454690000
267	28/11/2022	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	419.771,67	254.312,59259900	1,6506130000
268	28/11/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	8.948,43	2.355,05841200	3,7996640000
270	29/11/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	20.802,91	0,00	6.737,33238500	3,0877072420
274	29/11/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	2.381,86	771,40085300	3,0877072420
Total			531.192,75	471.538,33		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.005.273,90

Value-At-Risk: 1,14%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
HOLAMBRA		1,14	1,14			88.248.122,88	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,16%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,02	0,00	0,02			5.405.624,93	6,13
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,17	0,02	0,00			11.162.112,13	12,65
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,88	0,30	0,07			9.521.450,42	10,79
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,98	0,11	0,07			3.262.013,03	3,70
BRANCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS		0,17	0,00	0,01			2.642.776,48	2,99
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,40	0,06	0,03			4.135.576,08	4,69
BB PREV RF IDKA2		1,60	0,24	0,39			14.399.360,37	16,32
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		4,77	0,11	0,08			2.086.282,46	2,36
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,40	0,04	0,01			2.598.312,85	2,94
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,64	0,07	0,43			4.053.395,93	4,59
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,70	0,01	0,73			1.132.219,62	1,28
Sub-total	4,29	1,41	0,96		-0,28	-0,17	60.399.124,30	68,44

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LME REC IMA B FI RENDA FIXA		0,67	0,01	2,62			1.558.972,95	1,77
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B		2,96	0,02	0,20			740.147,67	0,84
BB PREV RF IMA-B		2,88	0,11	0,08			3.446.621,92	3,91
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	0,00	0,01			8.494.813,94	9,63
BRANCO INST FIC FI RF IMA-B 5		1,44	0,01	0,05			537.582,86	0,61

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA		1,39	0,02	1,41			1.103.514,83	1,25
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA		0,01	-0,00	0,01			3.130.388,50	3,55
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,01	0,00	0,01			5.766.485,88	6,53
Sub-total	2,03	0,60	0,17		-0,20	0,60	24.778.528,55	28,08

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC		0,02	0,00	0,02			1.108.099,97	1,26
Sub-total	1,10	0,02	0,00		-0,64	0,31	1.108.099,97	1,26

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,56%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV MULTIMERCADO FI LP		0,56	0,01	0,56			1.962.370,06	2,22
Sub-total	1,64	0,56	0,01		-0,36	0,44	1.962.370,06	2,22