



LDB
EMPRESAS

SÃO JOSÉ DO CALÇADO
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

RENDA FIXA 89,17%

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
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	3,55	0,57	0,44	956.311,91	4,01	4.398.251.592,64	0,02
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	7,42	0,41	-0,54	3.032.092,35	12,71	189.307.422,05	1,60
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,70	0,74	1,36	849.084,27	3,56	5.025.689.167,39	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,63	0,53	-0,24	1.246.286,69	5,22	6.297.272.158,07	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,61	0,53	-0,23	1.170.016,41	4,90	4.318.650.723,31	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,69	0,72	0,76	1.109.712,06	4,65	769.331.691,35	0,14
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,75	1,05	1,14	4.769.010,60	19,99	11.612.568.005,11	0,04
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,81	-0,02	-1,65	799.856,99	3,35	936.801.809,27	0,09
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,75	0,02	-1,60	2.184.077,65	9,16	1.307.933.038,85	0,17
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,96	0,59	0,04	16.116.448,93	67,56		

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
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,35	0,82	1,53	814.425,51	3,41	291.552.370,35	0,28
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,22	0,82	1,61	1.447.988,50	6,07	10.660.917.138,14	0,01
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,80	1,59	2.891.432,60	12,12	7.639.104.845,31	0,04
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,07	0,81	1,59	5.153.846,61	21,61		
Renda Fixa			3,85	0,64	0,41	21.270.295,54	89,17		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

0,81%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,33	-0,71	8,04	192.100,46	0,81	985.463.082,71	0,02
Sub-total Artigo 8º I			17,33	-0,71	8,04	192.100,46	0,81		
Renda Variável			6,24	-0,71	8,04	192.100,46	0,81		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

10,03%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO FI LP	1,26	0,73	1,64	2.391.563,40	10,03	315.747.307,37	0,76
Sub-total Artigo 10º I			1,26	0,73	1,64	2.391.563,40	10,03		
Investimentos Estruturados			0,88	0,73	1,64	2.391.563,40	10,03		
Total			3,60	0,64	0,59	23.853.959,40	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	16.116.448,93	67,56					100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	5.153.846,61	21,61					60,00
	Total Renda Fixa	21.270.295,54	89,17					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	192.100,46	0,81					30,00
	Total Renda Variável	192.100,46	0,81					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	2.391.563,40	10,03					10,00
	Total Investimentos Estruturados	2.391.563,40	10,03					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	0,59 78,68	0,04 2,79	0,46 20,44	0,80 20,93	0,71 12,50	94.497,92	6.696,62
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,81 107,77	1,59 106,58				41.298,50	80.421,80
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,71 -1,60	8,04 0,11				-1.364,71	14.302,69
Artigo 10º I % do CDI	0,73 96,96	1,64 110,03				17.256,95	38.509,82
SÃO JOSÉ DO CALÇADO (Total)						151.688,66	139.930,93

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\$)
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	3.019.730,15	0,00	0,00	0,00	3.032.092,35	12.362,20	-16.439,05
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	1.239.672,14	0,00	0,00	0,00	1.246.286,69	6.614,55	-2.978,40
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	800.024,04	0,00	0,00	0,00	799.856,99	-167,05	-13.406,65
BB PREV RF IRF-M	950.911,68	0,00	0,00	0,00	956.311,91	5.400,23	4.188,40
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	842.870,92	0,00	0,00	0,00	849.084,27	6.213,35	11.357,43
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.183.615,90	0,00	0,00	0,00	2.184.077,65	461,75	-35.460,23
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.101.830,76	0,00	0,00	0,00	1.109.712,06	7.881,30	8.321,49
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.719.413,13	0,00	0,00	0,00	4.769.010,60	49.597,47	53.858,92
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.163.882,29	0,00	0,00	0,00	1.170.016,41	6.134,12	-2.745,29
					16.116.448,93	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\$)
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	807.790,72	0,00	0,00	0,00	814.425,51	6.634,79	12.247,95
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.868.532,60	0,00	0,00	0,00	2.891.432,60	22.900,00	45.196,22

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	1.436.224,79	0,00	0,00	0,00	1.447.988,50	11.763,71	22.977,63
					5.153.846,61	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\$)
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	193.465,17	0,00	0,00	0,00	192.100,46	-1.364,71	14.302,69
					192.100,46	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	2.374.306,45	0,00	0,00	0,00	2.391.563,40	17.256,95	38.509,82
					2.391.563,40	0,00	0,00

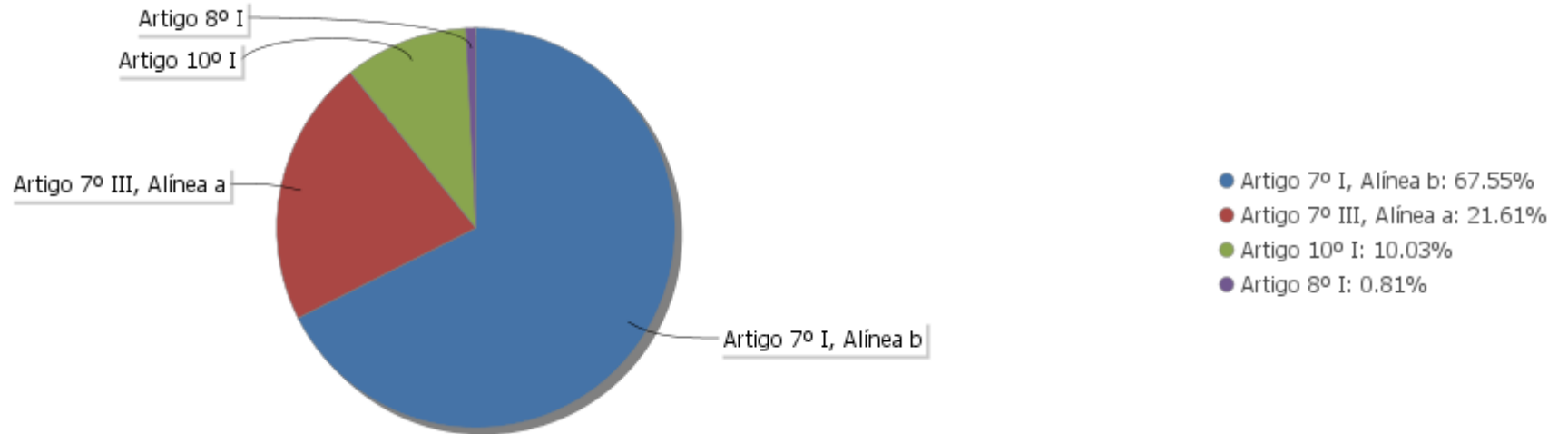
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

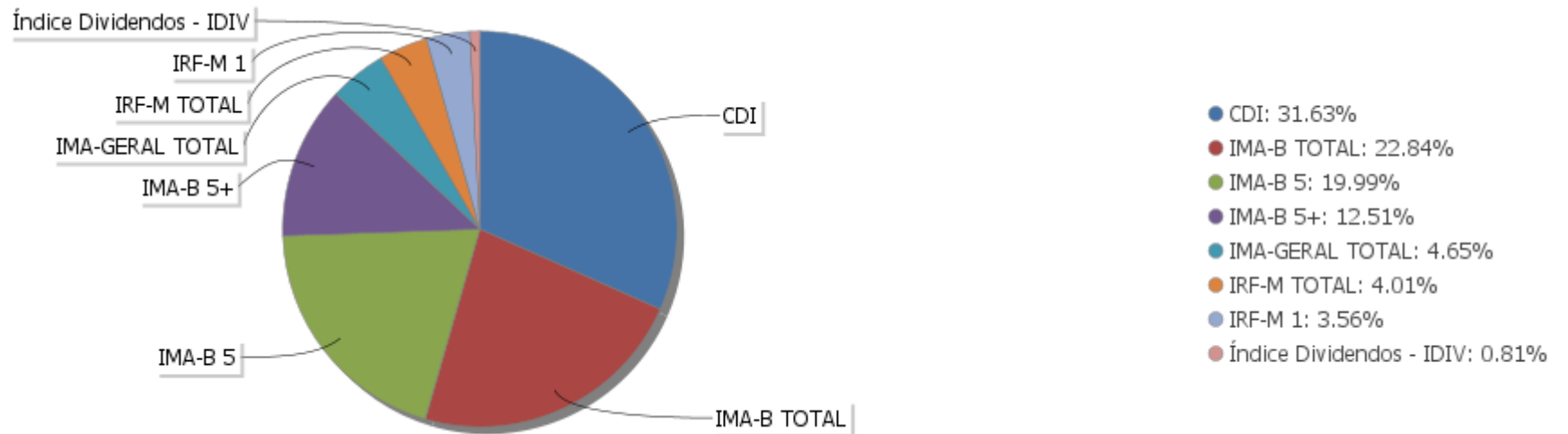
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	23.661.858,94	99,19	23.661.858,94	99,19
de 31 a 365 dias	192.100,46	0,81	23.853.959,40	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	23.853.959,40	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

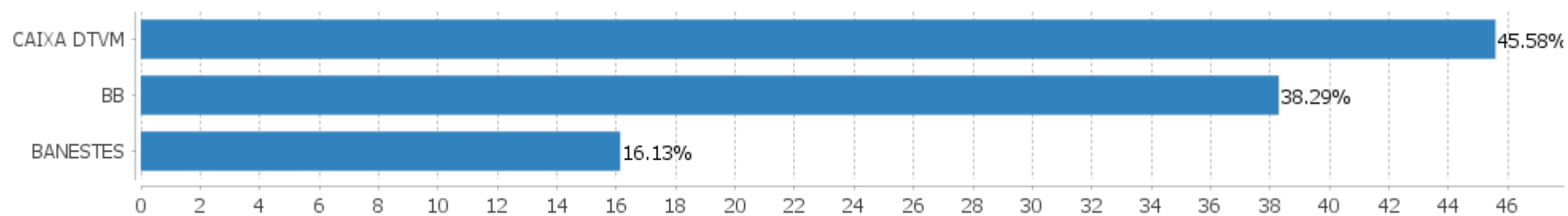


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

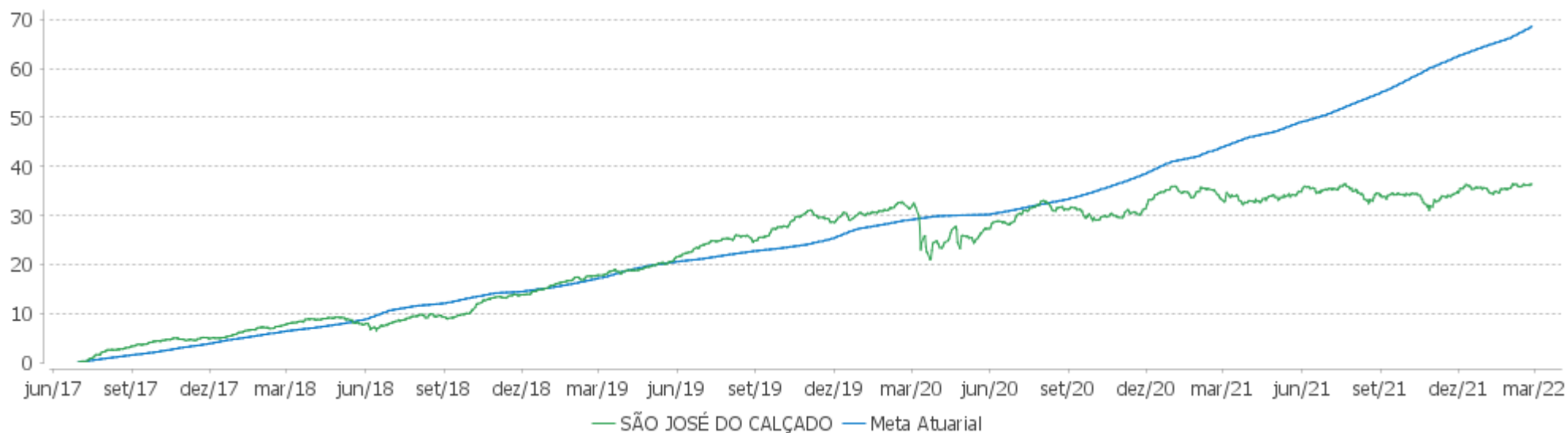
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2022	-0,05	0,64											0,59
IPCA + 6,00%	1,03	1,45											2,50
p.p. indexador	-1,08	-0,81											-1,91
2021	-0,75	-1,11	-0,30	0,59	0,77	0,31	-0,21	-0,62	-0,06	-1,55	2,20	0,56	-0,22
IPCA + 5,89%	0,71	1,27	1,46	0,77	1,31	1,01	1,47	1,38	1,64	1,71	1,41	1,26	16,52
p.p. indexador	-1,46	-2,38	-1,75	-0,18	-0,54	-0,70	-1,67	-2,00	-1,70	-3,26	0,79	-0,69	-16,73
2020	0,38	0,28	-5,06	0,93	1,11	1,35	3,03	-1,27	-1,45	0,21	1,35	3,48	4,12
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	-0,34	-0,38	-5,63	0,78	1,04	0,61	2,15	-1,99	-2,57	-1,13	-0,00	1,62	-6,53
2019	1,69	0,58	0,58	0,93	1,62	1,86	1,17	-0,28	2,24	2,39	-1,54	1,42	13,35
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	0,86	-0,32	-0,61	-0,13	0,98	1,41	0,44	-0,90	1,80	1,76	-2,52	-0,22	2,76
2018	1,43	0,56	1,04	0,30	-1,37	0,23	1,36	-0,11	0,59	3,01	0,46	1,20	9,01
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	0,63	-0,17	0,46	-0,40	-2,26	-1,52	0,52	-0,55	-0,33	2,05	0,21	0,58	-0,91
2017							2,16	1,05	1,03	0,38	0,12	0,76	5,61
IPCA + 6,00%							0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	4,73
p.p. indexador							1,44	0,33	0,41	-0,53	-0,63	-0,15	0,89

Performance Sobre a Meta Atuarial
Relatório

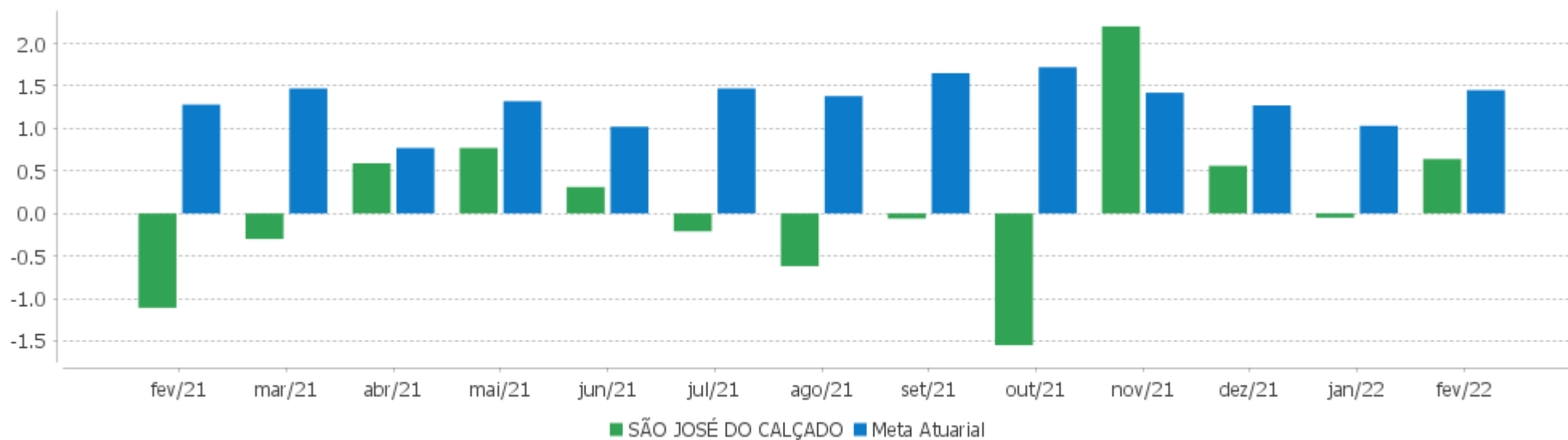
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	21	37,50	03 meses	1,16	3,79	-2,63	2,51
Meses abaixo - Meta Atuarial	35	62,50	06 meses	1,72	8,81	-7,09	3,43
			12 meses	2,27	17,10	-14,84	3,60
			24 meses	3,83	30,35	-26,52	5,45
Maior rentabilidade da Carteira	3,48	2020-12	36 meses	15,83	43,65	-27,82	4,64
Menor rentabilidade da Carteira	-5,06	2020-03	48 meses	26,60	58,19	-31,59	4,16
			Desde 30/06/2017	36,38	68,23	-31,84	3,88

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
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,53 -0,02	-0,23 -0,04	-0,03 -0,06	0,61 -0,12	0,65 -0,27	3,48 -0,63	21,73 -1,13
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,41 -0,14	-0,54 -0,35	-0,47 -0,50	-1,33 -2,06	-2,91 -3,84	-8,26 -12,38	13,17 -9,69
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 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
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,57 -0,02	0,44 -0,06	2,32 -0,07	1,00 -0,16	0,13 -0,35	2,89 -0,62	14,85 -0,94
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,72 -0,03	0,76 -0,20	1,70 -0,13	2,08 -0,22	2,42 -0,46	5,00 -1,28	16,34 -1,94
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	0,02 0,01	-1,60 -0,00	-1,93 -0,00	-2,98 -0,23	-4,67 -0,43	-3,94 -0,61	16,68 -1,31
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,02 -0,03	-1,65 -0,05	-1,97 -0,04	-2,92 -0,17	-4,52 -0,28	-4,01 -0,68	17,00 -0,99
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,82 109,58	1,53 102,66	2,27 100,36	3,95 103,80	6,27 111,08	5,81 71,24	11,44 80,63
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
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,82 109,27	1,61 108,41	2,38 105,17	4,08 107,18	6,03 106,73	8,15 99,97	13,91 98,05
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,71 1,61	8,04 3,06	7,69 1,03	-2,49 -0,93	5,01 -4,18	4,82 -0,51	25,65 -2,47
BB PREV MULTIMERCADO FI LP % do CDI	0,73 96,96	1,64 110,03	2,83 124,91	3,63 95,27	5,65 100,03	7,03 86,18	15,41 108,58
SÃO JOSÉ DO CALÇADO Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,64 -0,81	0,59 -1,91	1,16 -2,64	1,72 -7,13	2,27 -14,94	3,83 -26,77	15,83 -28,12
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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
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
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	D+0	D+0	D+0	D+4 du		0,60
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+2 du	D+2 du		0,20
BB PREV RF IRF-M	D+0	D+0	D+1 du	D+1 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
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL 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
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72

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
	Total					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 324.507,52

Value-At-Risk: 1,36%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SÃO JOSÉ DO CALÇADO		1,36	1,36			23.853.959,40	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,46%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M		1,77	0,06	0,02			956.311,91	4,01
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B		2,40	0,30	0,35			3.032.092,35	12,71
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,57	0,01	0,02			849.084,27	3,56
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,14	0,11	0,02			1.246.286,69	5,22
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,15	0,10	0,03			1.170.016,41	4,90
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,21	0,06	0,10			1.109.712,06	4,65
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,17	0,21	0,01			4.769.010,60	19,99
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		3,60	0,12	0,08			799.856,99	3,35
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		3,56	0,32	0,08			2.184.077,65	9,16
Sub-total	3,19	1,92	1,29		-0,05	0,59	16.116.448,93	67,56

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI		0,07	0,00	0,06			814.425,51	3,41
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,07	0,00	0,06			1.447.988,50	6,07
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,06	0,00	0,03			2.891.432,60	12,12
Sub-total	0,06	0,06	0,00		1,04	0,81	5.153.846,61	21,61

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,66%

Artigo 10º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV MULTIMERCADO FI LP		0,66	0,03	0,65			2.391.563,40	10,03
Sub-total	0,74	0,66	0,03		-0,03	0,73	2.391.563,40	10,03

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,37%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		9,37	0,03	2,51			192.100,46	0,81
Sub-total	10,92	9,37	0,03		-0,13	-0,71	192.100,46	0,81