



DORES DO RIO PRETO
4º TRIMESTRE 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 30.12.2022.

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

83,21%

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	Trim.				
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	5,47	0,04	-0,13	0,24	1.198.122,47	5,70	160.999.611,99	0,74
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,40	0,04	-0,24	0,10	4.053.938,42	19,30	3.466.339.701,42	0,12
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,48	0,05	1,15	3,09	316.181,14	1,51	6.557.713.378,25	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,60	0,04	0,92	2,46	3.725.140,04	17,73	7.960.289.495,76	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,64	0,05	1,44	1,76	1.908.191,72	9,08	1.018.108.144,60	0,19
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,35	0,05	1,18	3,12	441.103,04	2,10	345.169.436,09	0,13
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,90	0,04	0,48	1,25	11.642.676,83	55,43		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	5,35	0,04	-0,25	0,15	1.916.941,64	9,13	181.768.415,38	1,05
BANESTES	BANESTES	BANESTES VALORES FIC FI RF REFERENCIADO DI	0,13	0,05	0,05	0,05	894.622,49	4,26	525.306.646,95	0,17
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,13	0,05	1,05	3,08	37.183,68	0,18	304.007.413,59	0,01
BRAM	BRADERCO	BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,05	1,17	3,34	1.392.612,72	6,63	7.627.582.136,16	0,02
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			4,02	0,05	0,36	1,50	4.241.360,53	20,19		

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BRADERCO	BRADERCO	CDB - BBDC - BANCO BRADERCO SA.	3,60	1,17	1,17	3,20	827,13	0,00		
BRADERCO	BRADERCO	CDB - BBDC - BANCO BRADERCO SA	3,56	1,17	1,17	3,20	1.593.684,33	7,59		
Sub-total Artigo 7º IV			3,56	1,17	1,17	3,20	1.594.511,46	7,59		
Renda Fixa			3,71	0,15	0,51	1,47	17.478.548,82	83,21		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

16,79%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	23,38	-0,00	-3,03	-3,90	498.474,11	2,37	142.932.888,12	0,35
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	19,23	-0,01	-2,48	-0,85	2.352.730,13	11,20	506.643.009,29	0,46
BANESTES	BANESTES	BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	19,09	-0,00	-0,82	3,09	676.263,27	3,22	12.509.508,20	5,41
Sub-total Artigo 8º I			18,77	-0,01	-2,24	-0,57	3.527.467,51	16,79		
Renda Variável			18,77	-0,01	-2,24	-0,57	3.527.467,51	16,79		
Total			5,64	0,12	0,03	1,11	21.006.016,33	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	57.269,52
Sub-total Disponibilidades Financeiras	57.269,52
Total	21.063.285,85

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	11.642.676,83	55,43	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	4.241.360,53	20,19	0,00	10,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	1.594.511,46	7,59	0,00	0,00	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Fixa	17.478.548,82	83,21					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	3.527.467,51	16,79	0,00	20,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	3.527.467,51	16,79					30,00
Total		21.006.016,33	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,48 42,45	1,25 39,01	1,25 39,01	3,14 47,50	7,88 63,72	51.842,99	144.291,15
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,36 31,77	1,50 46,78	1,50 46,78	3,28 49,61	7,60 61,39	12.251,57	49.954,95
Artigo 7º IV % do CDI	1,17 104,57	3,20 100,00	3,20 100,00			18.512,82	49.414,24
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-2,24 0,20	-0,57 -0,29	-0,57 -0,29	7,39 -3,97	2,32 -2,37	-80.995,71	-20.116,45
DORES DO RIO PRETO (Total)						1.611,67	223.543,89

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	1.616.842,00	0,00	-411.924,12	0,00	1.198.122,47	-6.795,41	1.474,56
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	286.895,84	150.738,51	0,00	0,00	441.103,04	3.468,69	6.960,72
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.689.238,15	1.876,46	0,00	0,00	3.725.140,04	34.025,43	89.236,96
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.063.563,08	0,00	0,00	0,00	4.053.938,42	-9.624,66	4.133,64
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	312.572,26	0,00	0,00	0,00	316.181,14	3.608,88	9.484,37
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.881.031,66	0,00	0,00	0,00	1.908.191,72	27.160,06	33.000,90
					11.642.676,83	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	1.921.652,05	0,00	0,00	0,00	1.916.941,64	-4.710,41	2.835,75
BANESTES VALORES FIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	894.153,31	0,00	0,00	894.622,49	469,18	469,18
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	51.322,11	1.392,20	-15.974,61	0,00	37.183,68	443,98	1.692,30
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1.376.563,90	0,00	0,00	0,00	1.392.612,72	16.048,82	44.957,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
					4.241.360,53	0,00	0,00

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA	1.575.181,11	0,00	0,00	0,00	1.593.684,33	18.503,22	49.388,61
CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA.	817,53	0,00	0,00	0,00	827,13	9,60	25,63
					1.594.511,46	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	681.873,53	0,00	0,00	0,00	676.263,27	-5.610,26	20.247,74
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	514.049,33	0,00	0,00	0,00	498.474,11	-15.575,22	-20.213,95
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	2.412.540,36	0,00	0,00	0,00	2.352.730,13	-59.810,23	-20.150,24
					3.527.467,51	0,00	0,00

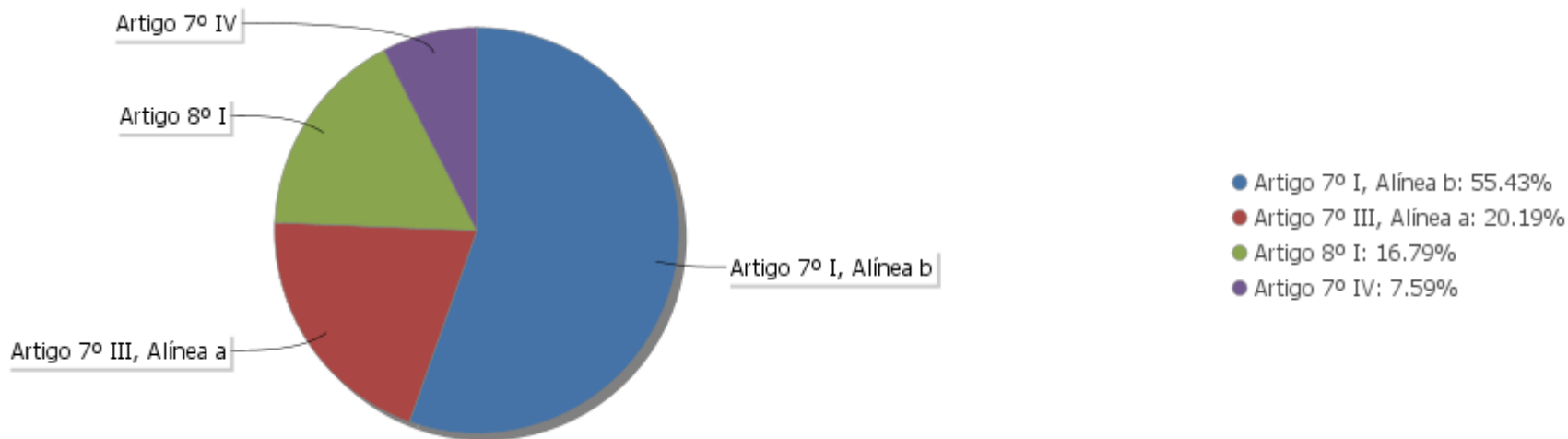
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

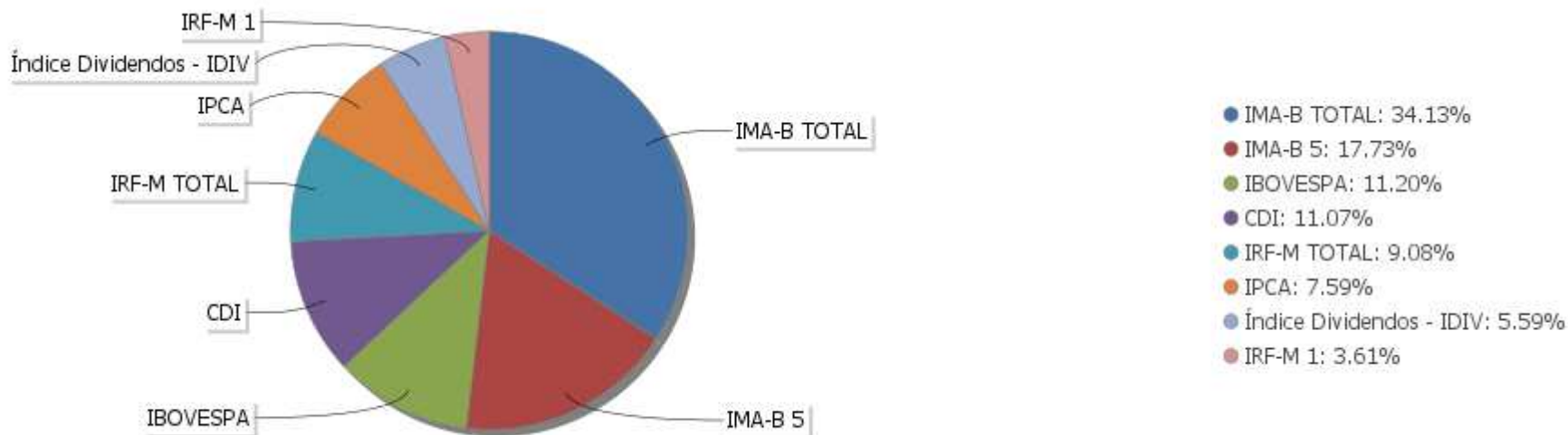
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	18.913.030,76	90,04	18.913.030,76	90,04
de 31 a 365 dias	498.474,11	2,37	19.411.504,87	92,41
acima de 365 dias	1.594.511,46	7,59	21.006.016,33	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

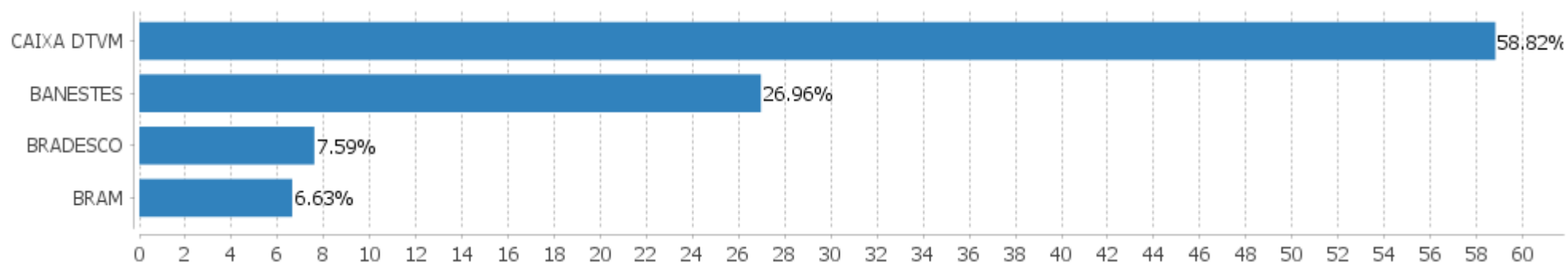


Alocação Por Estratégia



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	0,16	0,38	3,38	-0,26	1,16	-2,00	0,47	1,93	0,49	2,23	-1,12	0,03	6,93
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	1,05	11,10
p.p. indexador	-0,79	-1,00	1,32	-1,70	0,26	-3,09	0,74	1,84	0,37	1,24	-1,92	-1,02	-4,16
2021	-1,34	-1,21	0,27	1,83	1,50	0,14	-1,20	-1,40	-0,98	-3,25	1,86	1,16	-2,75
IPCA + 5,04%	0,64	1,21	1,38	0,70	1,24	0,94	1,39	1,30	1,58	1,65	1,34	1,18	15,59
p.p. indexador	-1,98	-2,43	-1,12	1,13	0,26	-0,80	-2,60	-2,71	-2,56	-4,90	0,51	-0,03	-18,33
2020	0,51	0,41	-5,27	1,05	1,25	1,36	3,09	-1,34	-1,74	-0,38	2,29	4,36	5,35
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	-0,20	-0,25	-5,84	0,90	1,18	0,62	2,20	-2,06	-2,86	-1,73	0,94	2,50	-5,29
2019										2,48	-1,72	1,45	2,17
IPCA + 6,00%										0,63	0,98	1,64	3,28
p.p. indexador										1,85	-2,70	-0,19	-1,11

Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	16	41,03	03 meses	1,11	2,87	-1,75	7,04
Meses abaixo - Meta Atuarial	23	58,97	06 meses	4,05	2,80	1,25	6,06
			12 meses	6,93	11,10	-4,16	5,64
			24 meses	4,00	28,41	-24,41	5,88
			36 meses	9,56	42,08	-32,52	6,62
			Desde 30/09/2019	11,94	46,75	-34,81	6,41
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	4,36	2020-12					
Menor rentabilidade da Carteira	-5,27	2020-03					

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 Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. Var. IPCA p.p.	1,17 0,55	3,20 1,57	3,20 1,57				
CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA Var. IPCA p.p.	1,17 0,55	3,20 1,57	3,20 1,57				
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,24 -0,04	0,10 -0,13	0,10 -0,13	1,86 -0,07	6,19 -0,17	4,57 -0,45	10,91 -0,84
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,13 0,06	0,24 0,01	0,24 0,01	2,00 0,06	5,66 -0,71	-1,90 -6,93	-1,94 -13,69
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	1,18 0,00	3,12 -0,03	3,12 -0,03	6,60 -0,09	11,96 -0,05	13,99 -1,30	21,13 1,41
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,92 -0,02	2,46 -0,07	2,46 -0,07	2,96 -0,01	9,67 -0,11	14,40 -0,40	23,26 -0,76
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,15 -0,02	3,09 -0,06	3,09 -0,06	6,56 -0,13	11,74 -0,28	14,76 -0,54	18,92 -0,80
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,44 -0,03	1,76 0,02	1,76 0,02	6,44 -0,05	8,72 -0,10	6,35 -0,31	13,19 -0,61
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	1,05 93,59	3,08 96,20	3,08 96,20	6,49 98,12	12,20 98,59	17,87 103,22	17,62 85,68
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,25 -0,05	0,15 -0,09	0,15 -0,09	1,96 0,02	6,25 -0,12	0,03 -5,00	-0,71 -12,46
BANESTES VALORES FIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	1,08 96,08	3,16 98,79	3,16 98,79	6,67 100,82	12,57 101,59	18,38 106,18	18,26 88,83
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,17 103,79	3,34 104,31	3,34 104,31	6,89 104,19	13,00 105,05	18,58 107,34	21,11 102,67
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-3,03 -1,42	-3,90 -7,05	-3,90 -7,05	9,85 2,14	-4,57 -17,22	-34,78 -40,21	-29,72 -34,09
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p.	-2,48 -0,03	-0,85 -0,57	-0,85 -0,57	6,33 -5,03	2,47 -2,21	8,22 16,02	11,17 16,28
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,82 0,79	3,09 -0,07	3,09 -0,07	9,39 1,68	7,49 -5,16	-12,58 -18,01	
DORES DO RIO PRETO Var. IPCA + 5,04% p.p.	0,03 -1,02	1,11 -1,75	1,11 -1,75	4,05 1,25	6,93 -4,16	4,00 -24,41	9,56 -31,38
CDI	1,12	3,20	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	-2,45	-0,27	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11
INPC + 6,00%	1,20	3,01	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46
IPCA + 6,00%	1,13	3,10	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	D+1 du	D+0	D+30	D+34		0,00
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,15
BANESTES VALORES FIC FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,50
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	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 IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	D+1 du	D+0	D+13 du	D+15 du		2,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,18	3,16	3,16	6,70	12,02	15,30	19,73	27,82	36,73
IRF-M 1+	1,62	1,10	1,10	6,63	7,41	2,06	10,68	26,44	41,95
IRF-M TOTAL	1,48	1,74	1,74	6,49	8,82	6,66	13,80	27,49	41,17
IMA-B 5	0,94	2,53	2,53	2,98	9,78	14,79	24,02	40,34	54,18
IMA-B 5+	-1,19	-1,72	-1,72	1,24	3,30	-3,47	1,84	32,76	53,22
IMA-B TOTAL	-0,19	0,23	0,23	1,94	6,37	5,02	11,75	37,40	55,34
IMA-GERAL TOTAL	0,77	1,73	1,73	4,95	9,66	10,71	16,62	31,57	44,78
IDKA 2	1,24	2,25	2,25	2,34	9,34	14,78	24,67	39,41	53,01
IDKA 20	-3,32	-5,66	-5,66	0,71	-1,92	-16,13	-14,29	23,65	48,88
CDI	1,12	3,20	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,96

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,45	-0,27	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11	24,86	43,63
IBRX 100	-2,63	-0,39	-0,39	10,33	4,02	-7,61	-4,37	27,56	47,23
IBRX 50	-2,55	0,38	0,38	12,12	5,72	-5,43	-2,00	26,57	44,96
SMALL CAP	-3,01	-7,61	-7,61	5,76	-15,06	-28,82	-29,28	11,87	20,97
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	-1,61	3,15	3,15	7,71	12,65	5,43	4,37	51,51	75,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-7,26	3,34	3,34	1,04	-24,68	2,63	53,84	106,24	126,51

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,00	-4,14	-4,14	2,56	2,22	-0,11	-10,33	21,92	28,78

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-5,43	5,58	5,58	1,05	-25,01	-5,95	38,64	78,90	86,12

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,62	1,63	1,63	0,28	5,79	16,43	21,69	26,93	31,68
INPC	0,69	1,55	1,55	0,30	5,93	16,70	23,05	28,57	32,98
IGPM	0,45	-1,09	-1,09	-2,51	5,45	24,20	52,94	64,11	76,48
SELIC	1,12	3,20	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,97

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,97	2,61	2,61	2,28	10,00	25,89	36,82	48,44	60,11
IPCA + 5,00%	1,05	2,86	2,86	2,78	11,05	28,31	40,79	54,22	67,93
IPCA + 5,50%	1,09	2,98	2,98	3,03	11,58	29,53	42,80	57,17	71,96
IPCA + 5,89%	1,12	3,07	3,07	3,22	11,99	30,49	44,38	59,51	75,15
IPCA + 6,00%	1,13	3,10	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83	60,17	76,06
INPC + 4,00%	1,04	2,53	2,53	2,31	10,15	26,18	38,35	50,36	61,69
INPC + 6,00%	1,20	3,01	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46	62,24	77,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
291	03/10/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	2.049,00	89,60901051	22,8660040800
289	04/10/2022	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,00	3.092,39	1.497,40985349	2,0651593800
292	06/10/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	4.174,76	182,29248725	22,9014374800
293	10/10/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	160,39	6,99738095	22,9214332100
294	14/10/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	613,81	26,74004570	22,9547102100
290	18/10/2022	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	108.900,68	0,00	52.499,48175911	2,0743191400
295	18/10/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	2.000,00	87,03135109	22,9802246500
296	20/10/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	1.990,50	86,53239558	23,0029457400
297	21/10/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	2.430,04	105,58994744	23,0139332300
288	26/10/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.876,46	0,00	514,59018600	3,6465133800
298	27/10/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	370,50	16,06711018	23,0595294200
299	28/10/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	100,00	4,33428002	23,0718826500
300	01/11/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	2.201,21	95,30479163	23,0965302200
309	01/11/2022	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	185.399,00	45.161,18132037	4,1052734800
301	04/11/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	3.296,45	142,58452247	23,1192694900
302	10/11/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	6.078,27	262,39283136	23,1647715700
308	10/11/2022	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	104.882,88	0,00	50.206,37205817	2,0890352300
303	17/11/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	933,25	40,20928504	23,2098133300
304	21/11/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	447,12	19,24500680	23,2330393300
307	24/11/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	938,23	0,00	257,86218144	3,6384940000
305	28/11/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	167,67	7,19953486	23,2890045500
306	29/11/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	752,39	32,29150861	23,2999334000
311	01/12/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	2.204,00	94,49729042	23,3234200700
323	01/12/2022	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	197.630,00	48.672,93859706	4,0603671300
312	05/12/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	864,17	37,01397591	23,3471271000
313	07/12/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	3.165,01	135,44101812	23,3681793300
314	12/12/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	2.000,00	85,46474100	23,4014633000
324	12/12/2022	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	12.000,00	2.997,40160500	4,0034675300

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
315	13/12/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	1.546,07	66,03134065	23,4141846100
325	13/12/2022	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	20.531,12	5.142,20907595	3,9926653500
316	14/12/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	160,39	6,84696125	23,4249901700
326	16/12/2022	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	181.763,00	45.626,75579689	3,9836932700
328	16/12/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	1.938,39	82,67282714	23,4465188500
317	19/12/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	1.368,13	58,32466238	23,4571439300
310	26/12/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.876,46	0,00	510,34889407	3,6768180000
318	27/12/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	929,28	39,50183270	23,5249844500
319	28/12/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	581,83	24,72259698	23,5343398800
320	29/12/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	1.217,34	51,70345977	23,5446526300
321	29/12/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	1.392,20	0,00	59,13019920	23,5446526300
322	29/12/2022	BANESTES VALORES FIC FI RF REFERENCIADO DI	894.153,31	0,00	433.961,63358502	2,0604432300
327	29/12/2022	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	150.738,51	0,00	70.893,03475680	2,1262809600
Total			1.264.758,73	644.155,48		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 564.655,86

Value-At-Risk: 2,69%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
DORES DO RIO PRETO		2,69	2,69			21.006.016,33	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,63%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B		2,89	0,15	0,14			1.198.122,47	5,70
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,95	0,50	0,05			4.053.938,42	19,30
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,11	0,00	0,01			316.181,14	1,51
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,41	0,21	0,03			3.725.140,04	17,73
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,58	0,12	0,04			1.908.191,72	9,08
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1		0,15	0,00	0,04			441.103,04	2,10
Sub-total	3,70	1,98	0,99		-0,17	0,48	11.642.676,83	55,43

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF		2,80	0,23	0,22			1.916.941,64	9,13
BANESTES VALORES FIC FI RF REFERENCIADO DI		0,06	-0,00	0,06			894.622,49	4,26
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI		0,06	-0,00	0,06			37.183,68	0,18
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,01	0,00	0,01			1.392.612,72	6,63
Sub-total	2,89	1,26	0,23		-0,26	0,36	4.241.360,53	20,19

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA.		0,25	0,00	0,28			827,13	0,00
CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA		0,25	0,00	0,28			1.593.684,33	7,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	3,95	0,25	0,00		0,01	1,17	1.594.511,46	7,59

Renda Variável Value-At-Risk: 9,46%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL		10,68	0,22	6,33			498.474,11	2,37
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE		10,09	1,01	4,72			2.352.730,13	11,20
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA		9,53	0,25	7,22			676.263,27	3,22
Sub-total	19,21	9,46	1,47		-0,18	-2,24	3.527.467,51	16,79