



LDB
EMPRESAS

COTIA
DEZEMBRO 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 31.12.2021.

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

RENDA FIXA

62,09%

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-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,64	0,84	2,64	11.149.731,81	1,29	6.208.104.156,65	0,18
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	6,50	-0,13	-5,18	8.519.767,94	0,99	556.775.917,37	1,53
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,79	0,20	-1,51	35.475.191,21	4,10	7.081.253.604,41	0,50
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,76	0,21	-1,53	30.159.018,82	3,49	4.689.992.155,11	0,64
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,64	0,85	2,70	18.550.194,68	2,15	6.465.382.741,43	0,29
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,78	0,77	4,31	161.617.433,91	18,69	12.444.051.491,75	1,30
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,61	0,71	4,65	39.059.114,08	4,52	9.277.694.744,55	0,42
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,76	0,72	4,66	62.187.199,65	7,19	10.998.710.156,34	0,57
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,80	0,76	3,32	14.865.767,34	1,72	6.458.635.592,00	0,23
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,33	0,83	-0,11	105.038.718,07	12,15	12.561.638.596,69	0,84
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,65	0,68	2,30	486.622.137,51	56,28		

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
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,30	0,08	-1,47	4.447.317,87	0,51	625.914.328,31	0,71
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,20	0,75	4,60	14.932.404,69	1,73	8.765.736.063,59	0,17
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,15	0,80	4,62	12.858.950,15	1,49	7.206.695.128,79	0,18
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,13	0,67	3,27	2.305.081,39	0,27	3.073.023.342,66	0,08
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,10	0,86	4,53	5.023.674,25	0,58	2.626.754.965,66	0,19
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,76	0,46	6,00	10.689.424,36	1,24	1.723.608.994,11	0,62
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,11	0,66	3,53	50.256.852,71	5,81		

Renda Fixa

2,48

0,68

2,43

536.878.990,22

62,09

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

28,54%

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA BRASIL IBX-50	21,02	3,82	-11,29	10.362.977,25	1,20	1.100.433.742,83	0,94
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,64	3,44	-11,53	19.129.635,45	2,21	994.621.415,62	1,92
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			20,74	3,57	-11,45	29.492.612,70	3,41		

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	19,41	1,63	-15,42	16.125.829,84	1,86	681.956.137,29	2,36
SAFRA	SAFRA	SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	18,72	2,35	-12,91	4.965.011,33	0,57	193.638.424,91	2,56
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	20,34	1,88	-16,64	4.422.760,54	0,51	723.867.535,77	0,61
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	19,16	2,31	-13,91	4.090.464,43	0,47	1.378.837.386,58	0,30
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	20,64	0,06	-15,22	13.475.969,02	1,56	668.180.768,94	2,02
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,72	-0,32	-10,50	13.748.812,98	1,59	924.501.793,20	1,49
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	17,92	0,97	-8,51	3.354.329,62	0,39	2.631.453.374,95	0,13
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	20,03	4,08	-1,07	7.048.680,21	0,82	1.098.659.963,05	0,64
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	13,46	5,28	9,20	30.751.376,72	3,56	2.828.008.571,13	1,09
BB	BB	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	19,63	3,56	-3,47	5.867.582,31	0,68	1.417.181.864,81	0,41
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	19,96	2,19	-15,47	8.903.825,49	1,03	826.907.180,52	1,08
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	27,04	-1,60	-15,03	6.380.224,29	0,74	297.006.334,02	2,15
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	21,12	0,81	-20,97	7.416.677,24	0,86	271.461.635,16	2,73
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	24,57	3,38	-22,84	4.436.142,39	0,51	406.121.559,47	1,09
SAFRA	SAFRA	SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	25,84	5,80	-13,06	3.078.974,10	0,36	65.913.646,24	4,67
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			18,19	2,30	-11,10	134.066.660,51	15,50		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	13,24	5,42	32,11	10.725.720,43	1,24	2.394.295.587,10	0,45
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,38	5,56	32,83	61.049.507,58	7,06	3.768.911.648,33	1,62
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	13,41	5,54	32,74	11.484.202,20	1,33	2.374.573.482,34	0,48
Sub-total Artigo 8º III			10,42	5,54	23,31	83.259.430,21	9,63		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			15,35	3,54	-1,14	246.818.703,42	28,54		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

9,37%

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,57	1,70	30,51	47.505.963,39	5,49	3.890.658.229,39	1,22
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	17,53	3,45	33,92	33.512.920,25	3,88	3.983.843.860,12	0,84
Sub-total Artigo 9º A, III			17,18	2,42	31,91	81.018.883,64	9,37		
Investimentos no Exterior			17,18	2,42	31,91	81.018.883,64	9,37		
Total			4,81	1,63	2,96	864.716.577,28	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			ALM	Limite Legal
				Mínimo	Objetivo	Máximo		
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	486.622.137,51	56,28	58,00	58,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	50.256.852,71	5,81	5,00	5,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	536.878.990,22	62,09					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	29.492.612,70	3,41	0,00	4,00	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	134.066.660,51	15,50	11,00	18,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	83.259.430,21	9,63	5,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	246.818.703,42	28,54					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	81.018.883,64	9,37	7,00	7,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	81.018.883,64	9,37					10,00

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	0,68 89,28	2,30 52,33	1,52 82,77	1,52 49,34	2,30 52,33	3.294.510,09	11.117.595,45
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,66 86,06	3,53 80,38	1,79 97,12	2,92 94,70	3,53 80,38	344.133,64	1.899.347,64
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	3,57 0,72	-11,45 0,48	-6,10 -0,56	-19,04 -1,71	-11,45 0,48	1.017.332,52	-3.812.831,40
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	2,30 -0,56	-11,10 0,82	-4,28 1,26	-15,97 1,36	-11,10 0,82	2.991.792,78	-16.325.544,48
Artigo 8º III % do CDI	5,54 725,68	23,31 530,33	12,93 702,21	13,48 436,79	23,31 530,33	4.332.081,93	13.021.206,63
Artigo 9º A, III % do CDI	2,42 316,43	31,91 725,94	12,10 657,15	20,76 672,34	31,91 725,94	1.825.581,93	18.215.869,82
COTIA (Total)						13.805.432,89	24.115.643,66

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	38.785.212,13	0,00	0,00	0,00	39.059.114,08	273.901,95	1.729.144,05
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	14.753.315,08	0,00	0,00	0,00	14.865.767,34	112.452,26	484.643,15
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	35.346.676,56	56.887,38	0,00	0,00	35.475.191,21	71.627,27	-540.131,47
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.056.372,22	0,00	0,00	0,00	11.149.731,81	93.359,59	378.605,35
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	61.742.829,58	0,00	0,00	0,00	62.187.199,65	444.370,07	2.762.005,35
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	160.386.570,84	0,00	0,00	0,00	161.617.433,91	1.230.863,07	6.540.354,60
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	30.096.014,75	0,00	0,00	0,00	30.159.018,82	63.004,07	-468.695,79
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.394.111,39	0,00	0,00	0,00	18.550.194,68	156.083,29	811.263,11
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	104.178.531,00	0,00	0,00	0,00	105.038.718,07	860.187,07	-114.571,26
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	8.531.106,49	0,00	0,00	0,00	8.519.767,94	-11.338,55	-465.021,64
					486.622.137,51	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	2.689.580,97	256,76	-401.611,90	0,00	2.305.081,39	16.855,56	74.526,56
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	15.260.801,41	43.360,16	-2.564.867,51	0,00	12.858.950,15	119.656,09	746.230,78
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14.820.584,74	0,00	0,00	0,00	14.932.404,69	111.819,95	485.238,23
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	4.980.800,51	0,00	0,00	0,00	5.023.674,25	42.873,74	217.687,20
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	10.640.266,49	0,00	0,00	0,00	10.689.424,36	49.157,87	605.060,93
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4.443.547,44	0,00	0,00	0,00	4.447.317,87	3.770,43	-66.333,99
					50.256.852,71	0,00	0,00

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	18.493.662,97	0,00	0,00	0,00	19.129.635,45	635.972,48	-2.494.062,67
FIA BRASIL IBX-50	9.981.617,21	0,00	0,00	0,00	10.362.977,25	381.360,04	-1.318.768,73
					29.492.612,70	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	3.997.931,46	0,00	0,00	0,00	4.090.464,43	92.532,97	-801.015,57
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	28.280.940,68	958.849,40	0,00	0,00	30.751.376,72	1.511.586,64	2.128.799,94
BB AÇÕES DIVIDENDOS	15.867.675,96	0,00	0,00	0,00	16.125.829,84	258.153,88	-2.935.852,61
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	5.665.702,04	0,00	0,00	0,00	5.867.582,31	201.880,27	-621.630,20
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	6.772.579,16	0,00	0,00	0,00	7.048.680,21	276.101,05	-499.896,97
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	13.793.521,20	0,00	0,00	0,00	13.748.812,98	-44.708,22	-1.596.121,55
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	13.468.152,62	0,00	0,00	0,00	13.475.969,02	7.816,40	-2.457.480,69
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	8.712.989,65	0,00	0,00	0,00	8.903.825,49	190.835,84	-1.707.119,72
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	3.322.071,89	0,00	0,00	0,00	3.354.329,62	32.257,73	-311.915,65
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	4.341.168,67	0,00	0,00	0,00	4.422.760,54	81.591,87	-859.573,08
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	6.483.757,06	0,00	0,00	0,00	6.380.224,29	-103.532,77	-1.128.289,35
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	7.357.088,32	0,00	0,00	0,00	7.416.677,24	59.588,92	-1.981.451,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	4.290.909,95	0,00	0,00	0,00	4.436.142,39	145.232,44	-1.352.282,34
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	4.851.226,86	0,00	0,00	0,00	4.965.011,33	113.784,47	-735.818,43
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	2.910.302,81	0,00	0,00	0,00	3.078.974,10	168.671,29	-500.846,42
					134.066.660,51	0,00	0,00

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	53.165.388,72	4.707.231,66	0,00	0,00	61.049.507,58	3.176.887,20	8.507.617,38
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	10.880.866,50	0,00	0,00	0,00	11.484.202,20	603.335,70	2.256.509,10
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	10.173.861,40	0,00	0,00	0,00	10.725.720,43	551.859,03	2.081.340,86
					83.259.430,21	0,00	0,00

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	45.223.994,03	1.525.590,02	0,00	0,00	47.505.963,39	756.379,34	10.348.437,89
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	30.443.717,66	2.000.000,00	0,00	0,00	33.512.920,25	1.069.202,59	7.867.431,93
					81.018.883,64	0,00	0,00

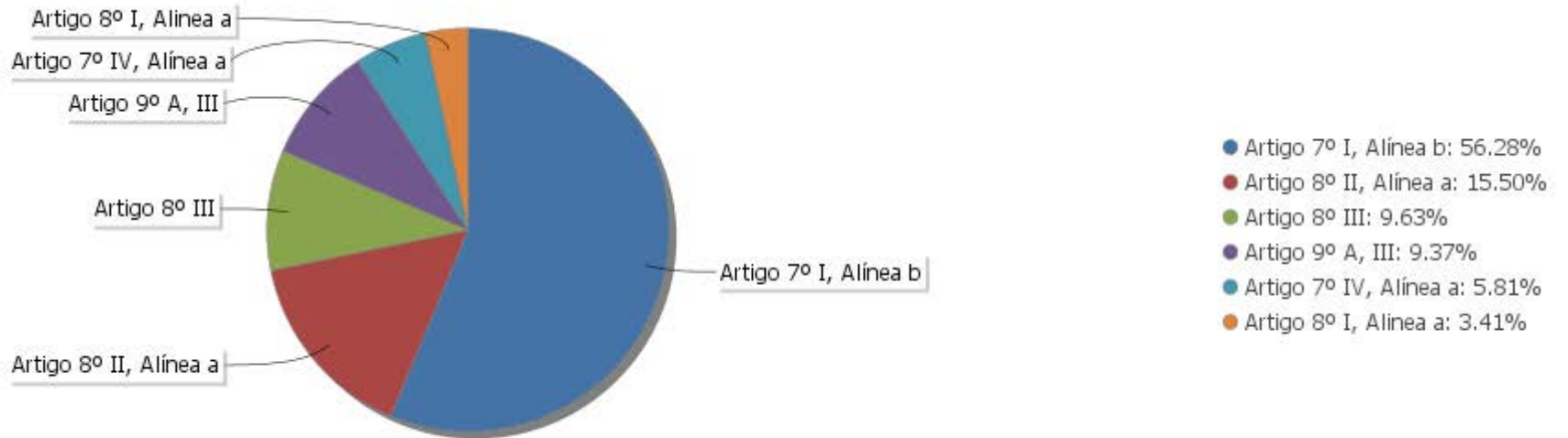
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

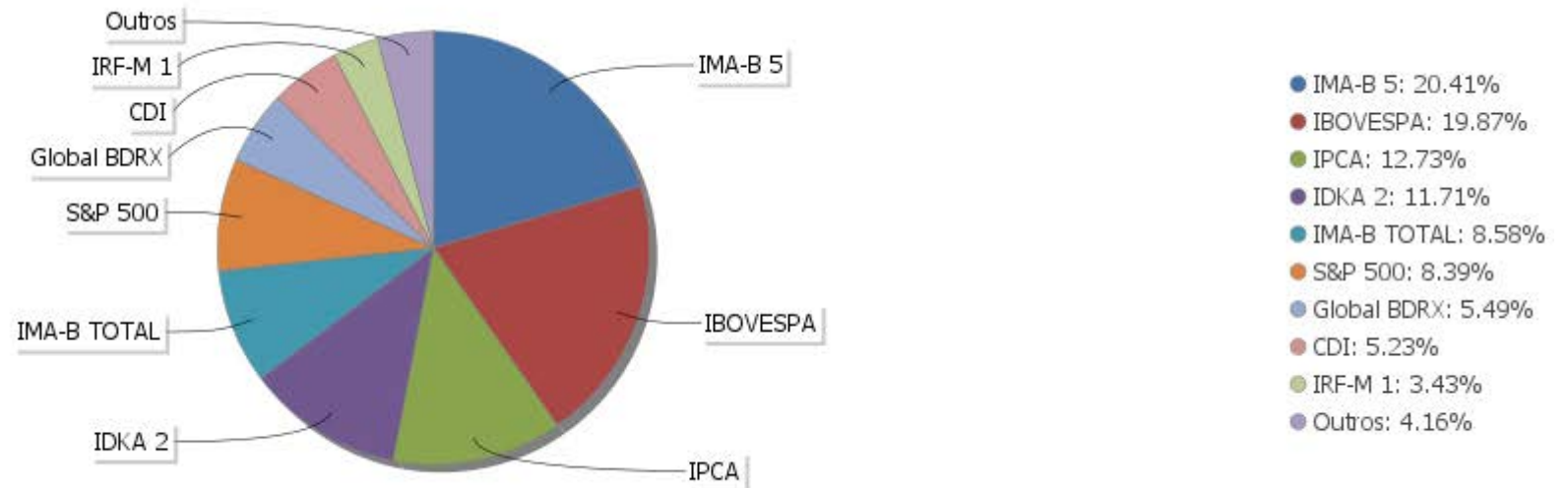
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	806.332.140,33	93,25	806.332.140,33	93,25
de 31 a 365 dias	58.384.436,95	6,75	864.716.577,28	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	864.716.577,28	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

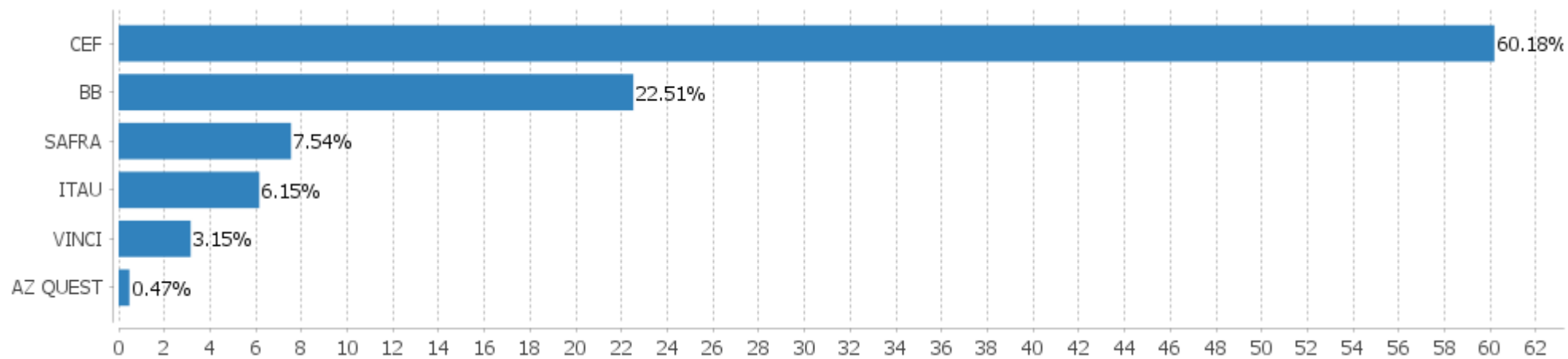


Alocação Por Estratégia



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	-0,21	-0,66	1,09	1,18	1,16	0,12	-0,23	-0,29	-1,34	-0,40	0,93	1,63	2,96
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,67	1,37	1,22	15,99
p.p. indexador	-0,88	-1,90	-0,32	0,45	-0,11	-0,86	-1,66	-1,63	-2,95	-2,08	-0,45	0,41	-13,03
2020	0,49	-0,32	-3,56	1,40	1,62	1,41	1,59	-0,08	-0,74	-0,16	2,49	2,57	6,75
IPCA + 5,85%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,85	10,61
p.p. indexador	-0,21	-0,98	-4,13	1,26	1,55	0,68	0,71	-0,80	-1,86	-1,50	1,14	0,72	-3,85
2019	1,23	0,48	0,57	0,84	0,95	1,23	0,79	0,30	1,39	1,36	-0,05	1,42	11,03
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	0,40	-0,41	-0,62	-0,22	0,31	0,78	0,07	-0,32	0,94	0,72	-1,02	-0,23	0,44
2018	0,86	0,51	0,95	0,49	-0,51	0,40	1,00	0,18	0,69	1,76	0,42	0,86	7,85
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	0,06	-0,23	0,37	-0,22	-1,40	-1,35	0,15	-0,27	-0,23	0,80	0,16	0,24	-2,07
2017	1,58	2,23	1,12	0,32	-0,10	0,50	2,52	1,12	1,18	0,19	-0,06	0,55	11,68
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	0,68	1,48	0,33	-0,23	-0,92	0,24	1,79	0,39	0,55	-0,72	-0,80	-0,35	2,64

Performance Sobre a Meta Atuarial

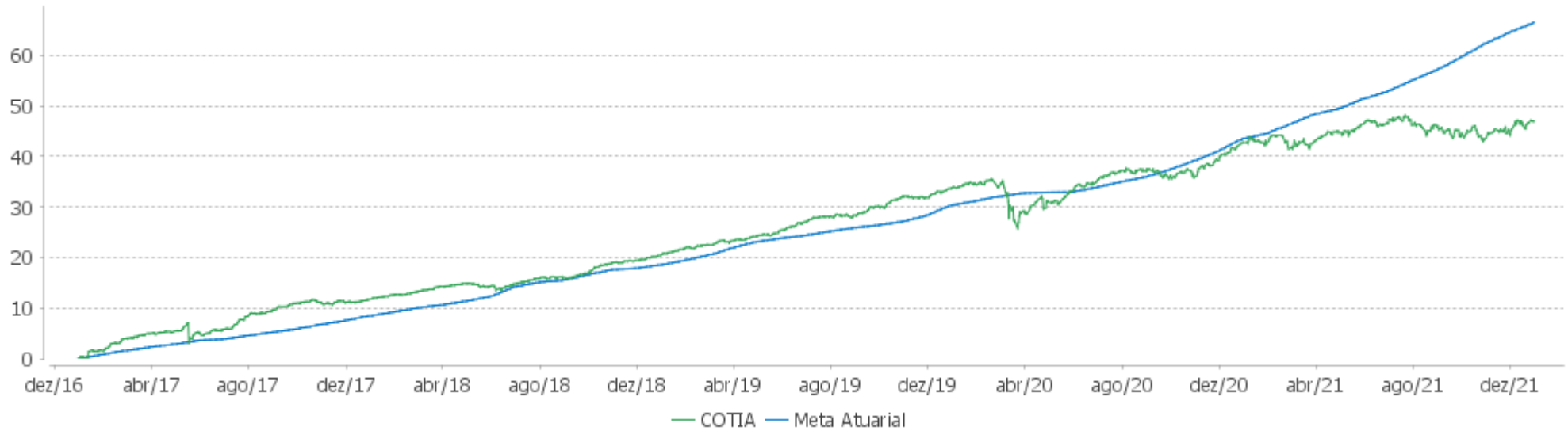
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	27	45,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	33	55,00
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,57	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-3,56	2020-03

Relatório

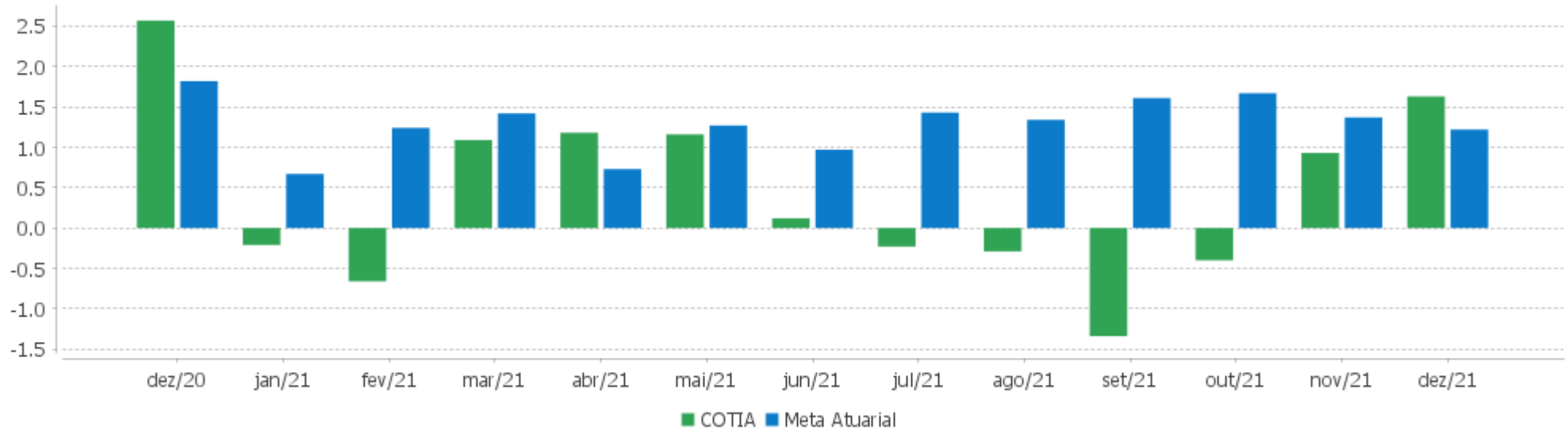
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,16	4,32	-2,17	5,58
06 meses	0,25	8,94	-8,69	5,30
12 meses	2,96	15,99	-13,03	4,81
24 meses	9,91	28,29	-18,39	5,56
36 meses	22,03	41,88	-19,85	4,63
48 meses	31,61	55,95	-24,34	4,08
60 meses	46,99	70,07	-23,08	4,20
Desde 30/12/2016	46,99	70,07	-23,08	4,20

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
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	0,08 11,11	-1,47 -33,44	0,37 20,34	-0,61 -19,84	-1,47 -33,44	5,95 81,66	31,88 232,90
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,80 104,63	4,62 105,21	1,93 104,82	3,26 105,62	4,62 105,21	7,13 97,94	13,29 97,07
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,67 87,65	3,27 74,33	1,58 85,85	2,49 80,68	3,27 74,33	4,96 68,13	10,02 73,22
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,75 98,81	4,60 104,55	1,89 102,69	3,40 110,10	4,60 104,55	7,12 97,76	13,24 96,76
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	0,46 60,51	6,00 136,51	2,19 118,80	4,92 159,42	6,00 136,51	10,36 142,18	
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,86 0,13	4,53 -5,53	2,16 -0,80	3,49 -2,58	4,53 -5,53	7,52 -7,51	20,33 0,34
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,21 -0,02	-1,53 -0,27	1,00 -0,06	-0,70 -0,15	-1,53 -0,27	4,44 -0,62	28,03 -1,14
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,77 -0,02	4,31 -0,25	1,97 -0,06	3,12 -0,12	4,31 -0,25	12,39 -0,58	26,84 -0,99
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,71 -0,12	4,65 -0,33	1,86 0,02	3,18 0,13	4,65 -0,33	12,93 -1,09	25,58 -1,92
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,83 0,10	-0,11 -10,17	1,07 -1,89	-0,82 -6,89	-0,11 -10,17	6,55 -8,48	24,06 4,07
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,84 -0,03	2,64 -0,29	1,10 -0,03	1,97 -0,12	2,64 -0,29	6,20 -0,68	13,10 -1,01
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,72 -0,11	4,66 -0,31	1,82 -0,02	3,05 0,00	4,66 -0,31	13,07 -0,95	25,72 -1,78
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,76 -0,02	4,27 -0,30	1,94 -0,09	3,06 -0,17	4,27 -0,30	12,38 -0,59	26,87 -0,97
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,85 -0,03	2,70 -0,23	1,09 -0,04	1,99 -0,11	2,70 -0,23	6,43 -0,45	13,40 -0,70
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,13 -0,36	-5,18 -3,91	-0,28 -1,34	-3,07 -2,53	-5,18 -3,91	1,69 -3,37	25,53 -3,64
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,20 -0,02	-1,51 -0,25	0,97 -0,09	-0,70 -0,16	-1,51 -0,25	4,53 -0,53	28,20 -0,97
FIA BRASIL IBX-50	3,82	-11,29	-5,58	-19,12	-11,29	-9,95	16,56

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.	0,97	0,64	-0,03	-1,78	0,64	-0,60	-2,71
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	3,44	-11,53	-6,39	-19,00	-11,53	-9,52	21,15
Var. IGCT p.p.	-0,04	-0,72	-0,19	-0,31	-0,72	-1,66	-3,27
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,56	32,83	13,07	14,36	32,83	47,69	94,62
Var. S&P 500 p.p.	1,93	-3,44	-0,45	-9,37	-3,44	-56,56	-79,20
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	5,42	32,11	12,80	14,10	32,11	48,74	96,32
Var. IBOVESPA p.p.	2,57	44,04	18,35	31,43	44,04	58,10	77,05
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	5,54	32,74	13,02	14,30	32,74	49,91	98,49
Var. S&P 500 p.p.	1,92	-3,52	-0,50	-9,42	-3,52	-54,34	-75,33
ITAU INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	0,81	-20,97	-12,77	-25,33	-20,97	-15,30	
Var. IBOVESPA p.p.	-2,04	-9,05	-7,22	-8,00	-9,05	-5,94	
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	0,06	-15,22	-6,16	-19,71	-15,22	-13,19	30,66
Var. IBOVESPA p.p.	-2,79	-3,29	-0,61	-2,38	-3,29	-3,84	11,39
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	3,56	-6,26	-3,10	-11,41	-6,26	6,88	
Var. IBOVESPA p.p.	0,71	5,66	2,44	5,92	5,66	16,24	
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	0,97	-8,51	-7,99	-18,47	-8,51	-12,97	26,43
Var. IBOVESPA p.p.	-1,88	3,42	-2,44	-1,14	3,42	-3,61	7,16
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-0,32	-10,50	-3,49	-13,76	-10,50	-7,77	31,03
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,93	-4,09	-1,66	-5,46	-4,09	-0,42	-3,46
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	4,08	-4,76	-2,54	-8,88	-4,76	0,93	42,75
Var. IBOVESPA p.p.	1,22	7,17	3,00	8,45	7,17	10,29	23,48
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	3,38	-22,84	-19,53	-31,61	-22,84	-12,19	
Var. IBOVESPA p.p.	0,53	-10,91	-13,99	-14,27	-10,91	-2,83	
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	2,35	-12,91	-5,07	-13,81	-12,91	-14,65	19,17
Var. IBOVESPA p.p.	-0,51	-0,98	0,48	3,52	-0,98	-5,30	-0,10
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	5,28	30,30	12,24	12,99	30,30		
Var. IBOVESPA p.p.	2,42	42,22	17,78	30,32	42,22		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	2,31	-9,66	-8,26	-20,26	-9,66	-12,51	30,94
Var. IBOVESPA p.p.	-0,54	2,27	-2,71	-2,92	2,27	-3,16	11,67
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	1,88	-16,64	-8,98	-21,40	-16,64	-14,85	14,99
Var. IBOVESPA p.p.	-0,97	-4,71	-3,44	-4,07	-4,71	-5,49	-4,28
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-1,60	-15,03					
Var. IBOVESPA p.p.	-4,45	-8,47					
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	5,80	-13,06	-12,51	-25,39	-13,06	-16,52	25,67
Var. SMALL CAP p.p.	2,00	3,14	-1,23	-0,60	3,14	0,22	-6,04
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1,63	-15,42	-5,04	-18,78	-15,42	-22,12	0,11

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.	-1,23	-3,49	0,50	-1,44	-3,49	-12,76	-19,16
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	2,19 -0,66	-15,47 -3,54	-10,34 -4,79	-21,61 -4,28	-15,47 -3,54	-14,48 -5,12	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	1,70 -0,01	30,51 -3,14	11,81 -0,48	20,44 -0,99	30,51 -3,14	101,98 -3,86	171,58 -7,67
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	3,45 0,60	33,92 45,85	12,50 18,05	21,19 38,52	33,92 45,85	93,45 102,81	165,70 146,43
COTIA Var. IPCA + 5,41% p.p.	1,63 0,41	2,96 -13,03	2,16 -2,17	0,25 -8,69	2,96 -13,03	9,91 -17,85	22,03 -18,47
CDI	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69
IBOVESPA	2,85	-11,93	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27
INPC + 6,00%	1,27	16,74	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52
IPCA + 6,00%	1,27	16,64	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	20.0000000000000	2,00
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	-	
BB AÇÕES DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	2,00
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	1,00
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	2,00
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32	20.0000000000000	2,00
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	1,00
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,10
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	1,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FIA BRASIL IBX-50	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	0,70
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	0,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,40
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du	0,00	1,72
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	D+1 du	D+0	D+21 du	D+23 du	0,00	1,72
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	D+1 du	D+0	D+23 du	D+25 du	0,00	1,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du		1,90
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	D+1 du	D+0	D+2 du	D+4 du	0,00	1,50
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,40
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	1,00
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	D+1 du	D+0	D+22 du	D+24 du		0,80
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32	0,00	0,00
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	0,00	1,50
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+0	D+0	D+3 du	D+4 du	0,00	0,30
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+2 du	0,00	1,00
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	3,50
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	20.000000000000	2,00

Além da taxa de administração, será devida, pelo FUNDO à GESTORA, uma taxa de performance no valor equivalente a 20% (vinte por cento) aplicável sobre a valorização diária da cota do FUNDO que exceder a 100% (cem por cento) da variação diária do IBOVESPA no mesmo período.

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	0,88	2,93	1,13	2,10	2,93	6,88	14,10	22,06	35,63
IRF-M 1+	2,29	-4,99	0,93	-1,74	-4,99	3,04	17,72	32,16	54,19
IRF-M TOTAL	1,89	-1,99	0,98	-0,42	-1,99	4,57	17,15	29,72	49,44
IMA-B 5	0,79	4,57	2,03	3,24	4,57	12,97	27,83	40,44	58,11
IMA-B 5+	-0,34	-6,55	0,09	-4,11	-6,55	-1,41	28,53	48,33	67,24
IMA-B TOTAL	0,22	-1,26	1,06	-0,55	-1,26	5,06	29,17	46,04	64,72
IMA-GERAL TOTAL	0,87	0,96	1,34	0,82	0,96	6,35	19,98	32,02	48,95
IDKA 2	0,83	4,97	1,84	3,05	4,97	14,02	27,50	39,94	58,99
IDKA 20	-2,28	-14,50	-2,87	-11,27	-14,50	-12,61	26,07	51,79	70,27
CDI	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	20,99	33,03

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	2,85	-11,93	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27	37,20	74,05
IBRX 100	3,14	-11,17	-5,51	-18,37	-11,17	-8,07	22,63	41,54	80,53
IBRX 50	3,76	-10,54	-4,49	-18,01	-10,54	-7,30	19,73	37,12	73,89
SMALL CAP	3,80	-16,20	-11,28	-24,79	-16,20	-16,75	31,71	42,41	112,70
IFIX	8,78	-2,28	3,28	1,81	-2,28	-12,28	19,27	25,98	50,42
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	1,60	-6,41	-1,83	-8,30	-6,41	-7,35	34,49	55,95	95,40

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	0,73	10,06	2,96	6,07	10,06	15,03	19,99	24,48	28,15
INPC	0,73	10,16	2,75	5,97	10,16	16,16	21,37	25,53	28,13
IGPM	0,87	17,78	1,54	2,35	17,78	45,04	55,63	67,36	66,49
SELIC	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	21,00	33,06

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	3,63	36,26	13,52	23,73	36,26	104,25	173,82	200,73	264,52
MSCI ACWI	3,17	25,42	9,15	16,96	25,42	84,89	138,58	148,21	206,39
MSCI World									

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,09	14,45	3,97	8,20	14,45	24,38	34,95	45,56	55,77
IPCA + 5,00%	1,18	15,54	4,22	8,73	15,54	26,77	38,87	51,22	63,36
IPCA + 5,50%	1,22	16,09	4,35	8,99	16,09	27,98	40,86	54,11	67,27
IPCA + 5,89%	1,26	16,52	4,44	9,20	16,52	28,92	42,43	56,40	70,37
IPCA + 6,00%	1,27	16,64	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87	57,04	71,26
INPC + 4,00%	1,09	14,55	3,77	8,10	14,55	25,60	36,50	46,79	55,74
INPC + 6,00%	1,27	16,74	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52	58,37	71,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
346	01/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	23.776,57	10.960,19883400	2,1693557170
345	02/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.514,00	3.001,96774100	2,1699100600
344	03/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.370,04	3.856,34585100	2,1704588550
343	06/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	40.873,47	18.826,98380200	2,1710046830
351	06/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	43.360,16	0,00	18.125,48715200	2,3922203930
330	07/12/2021	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	56.887,38	0,00	8.789,53255600	6,4721735350
342	08/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.370,00	3.393,03557400	2,1720962950
341	09/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.713,00	2.629,51856900	2,1726410560
340	13/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	256,76	0,00	118,10631000	2,1739735990
339	14/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.198,78	3.770,18279100	2,1746372670
348	14/12/2021	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	3.705,51	0,00	2.293,11863100	1,6159259920
338	15/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	40.544,00	18.638,37397500	2,1752970540
352	15/12/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	707.231,66	0,00	408.309,49998700	1,7320970000
337	16/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.627,13	6.722,14490400	2,1759617220
336	17/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	80.130,05	36.813,83836500	2,1766285060
353	20/12/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.000.000,00	0,00	2.376.188,68839100	1,6833680000
355	21/12/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1.525.590,02	0,00	220.711,48670760	6,9121460000
335	22/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.379,00	632,96637600	2,1786307330
347	22/12/2021	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	955.143,89	0,00	581.662,55351900	1,6420927980
354	22/12/2021	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	2.000.000,00	0,00	2.582,84543500	774,3397930000
334	27/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.007,40	920,55860400	2,1806324900
333	28/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	74.606,91	34.202,92049600	2,1813023250
350	28/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.227.975,13	926.120,55851700	2,4057074530
332	29/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	87.307,32	40.013,00721600	2,1819734650
349	29/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	336.892,38	139.993,43330700	2,4064870190
331	30/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	194,23	88,98849600	2,1826416650
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 22.334.739,13

Value-At-Risk: 2,58%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
COTIA		2,58	2,58			864.716.577,28	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,27%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,62	0,00	0,03			11.149.731,81	1,29
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA		3,10	0,02	0,38			8.519.767,94	0,99
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,99	0,06	0,04			35.475.191,21	4,10
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,98	0,05	0,03			30.159.018,82	3,49
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,62	0,00	0,02			18.550.194,68	2,15
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,20	0,10	0,02			161.617.433,91	18,69
BB PREV RF IDKA2		1,37	0,03	0,38			39.059.114,08	4,52
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,62	0,05	0,26			62.187.199,65	7,19
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,20	0,01	0,04			14.865.767,34	1,72
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,06	0,05	1,07			105.038.718,07	12,15
Sub-total	1,93	1,37	0,38		-0,04	0,68	486.622.137,51	56,28

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO		3,20	0,01	3,19			4.447.317,87	0,51
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,06	0,00	0,06			14.932.404,69	1,73
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,05	0,00	0,03			12.858.950,15	1,49
BB PREV RF FLUXO FIC		0,04	0,00	0,01			2.305.081,39	0,27
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI		0,61	0,00	0,63			5.023.674,25	0,58
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI		0,44	-0,00	0,45			10.689.424,36	1,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,45	0,34	0,01		-0,24	0,66	50.256.852,71	5,81

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,41%

Artigo 8º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA BRASIL IBX-50		10,90	0,10	1,78			10.362.977,25	1,20
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		10,65	0,19	0,08			19.129.635,45	2,21
Sub-total	19,27	10,72	0,29		0,15	3,57	29.492.612,70	3,41

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS		10,34	0,16	3,00			16.125.829,84	1,86
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES		10,49	0,05	3,66			4.965.011,33	0,57
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		10,84	0,05	2,07			4.422.760,54	0,51
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,30	0,03	5,27			4.090.464,43	0,47
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS		10,29	0,13	1,92			13.475.969,02	1,56
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS		9,84	0,13	2,29			13.748.812,98	1,59
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		9,34	0,03	4,16			3.354.329,62	0,39
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		9,99	0,07	2,40			7.048.680,21	0,82
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA		6,15	0,17	9,40			30.751.376,72	3,56
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI		10,16	0,06	1,96			5.867.582,31	0,68
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		11,45	0,10	3,88			8.903.825,49	1,03
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		12,64	0,07	6,49			6.380.224,29	0,74
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI		13,39	0,09	5,13			7.416.677,24	0,86
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		17,13	0,06	10,56			4.436.142,39	0,51
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA		17,05	0,05	2,86			3.078.974,10	0,36
Sub-total	16,38	8,91	1,22		0,09	2,30	134.066.660,51	15,50

Artigo 8º III

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		6,41	0,06	9,38			10.725.720,43	1,24
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,48	0,35	5,81			61.049.507,58	7,06
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI		6,47	0,07	5,82			11.484.202,20	1,33
Sub-total	16,68	6,47	0,48		0,29	5,54	83.259.430,21	9,63

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,11%

Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		8,18	0,11	0,67			47.505.963,39	5,49
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		8,41	0,09	13,95			33.512.920,25	3,88
Sub-total	18,16	8,11	0,20		0,09	2,42	81.018.883,64	9,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de dezembro de 2021, vale observar que:

- O percentual alocado no Artigo 7º I, Alínea b, (56,28% dos recursos) está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos;