



LDB
EMPRESAS

COTIA
MARÇO 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 31.03.2022.

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

61,51%

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				
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,72	0,06	0,87	2,23	4.998.318,49	0,56	5.022.847.839,72	0,10
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	6,11	0,05	2,96	2,39	8.723.409,93	0,97	466.865.839,19	1,87
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,56	0,04	3,01	2,76	36.485.443,42	4,06	6.731.035.549,75	0,54
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,54	0,05	3,06	2,82	31.010.066,90	3,45	4.323.772.543,08	0,72
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,72	0,06	0,87	2,22	18.961.188,66	2,11	5.633.845.930,29	0,34
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,68	-0,04	2,59	3,76	167.691.230,16	18,67	11.602.279.538,38	1,45
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,60	-0,06	2,62	3,82	40.550.059,36	4,51	8.945.530.970,72	0,45
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,71	-0,06	2,63	3,82	64.564.212,80	7,19	10.820.442.688,05	0,60
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,71	-0,04	2,58	3,74	16.613.287,39	1,85	6.475.752.452,47	0,26
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,16	0,04	1,16	2,64	5.156.094,94	0,57	2.425.114.860,62	0,21
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,10	0,06	0,82	2,32	107.470.475,61	11,96	9.043.444.595,41	1,19
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,60	-0,00	2,17	3,22	502.223.787,66	55,90		

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				
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,12	0,00	3,50	3,14	4.587.089,69	0,51	452.865.096,70	1,01
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,21	0,04	0,93	2,55	19.985.608,11	2,22	11.946.672.563,32	0,17
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	0,04	0,96	2,57	13.201.907,59	1,47	8.356.230.168,64	0,16
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,17	0,04	0,83	2,18	1.622.413,75	0,18	3.423.570.144,27	0,05
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,79	-0,00	1,48	2,84	10.992.882,84	1,22	1.683.932.732,54	0,65
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,55	0,03	1,29	2,65	50.389.901,98	5,61		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

2,42

-0,00

2,09

3,16

552.613.689,64

61,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

20,51%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	17,68	-0,18	5,06	11,50	6.542.372,38	0,73	1.562.892.965,41	0,42
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	17,78	-0,06	7,48	15,24	18.582.930,37	2,07	742.021.949,59	2,50
SAFRA	SAFRA	SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	17,64	0,12	9,16	14,72	5.696.068,41	0,63	169.678.775,51	3,36
CAIXA DTVM	CEF	FIA BRASIL IBX-50	19,30	-0,56	5,61	15,18	11.935.820,24	1,33	885.075.581,16	1,35
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	19,04	-0,41	4,64	12,59	4.979.596,91	0,55	616.631.969,58	0,81
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	19,04	-0,31	6,10	14,11	21.828.479,89	2,43	1.088.008.450,35	2,01
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	16,53	-0,45	5,09	6,27	4.347.085,74	0,48	1.463.287.787,94	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	19,15	-0,18	5,79	16,94	15.758.550,24	1,75	785.355.221,64	2,01
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,45	0,09	7,07	15,68	15.905.110,12	1,77	1.055.290.766,99	1,51
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	17,68	-0,72	5,54	5,66	3.544.269,21	0,39	2.555.347.096,74	0,14
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	17,70	-0,29	5,24	8,72	7.663.504,37	0,85	1.195.349.878,36	0,64
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	14,83	-1,01	4,72	-3,48	34.225.984,65	3,81	2.194.362.838,12	1,56
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	19,45	-0,41	5,11	9,65	9.762.662,67	1,09	848.423.172,75	1,15
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	24,68	-0,71	4,95	12,19	7.157.658,52	0,80	320.772.868,33	2,23
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	20,75	-0,51	5,38	10,79	8.216.704,11	0,91	239.399.487,93	3,43
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	28,05	-0,55	6,93	9,09	4.839.185,08	0,54	376.372.403,32	1,29
SAFRA	SAFRA	SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	27,29	-0,51	8,56	5,21	3.239.407,17	0,36	60.077.370,06	5,39
Sub-total Artigo 8º I			16,82	-0,42	5,88	9,74	184.225.390,08	20,51		
Renda Variável			14,72	-0,42	5,88	9,74	184.225.390,08	20,51		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,88%

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,89	-1,78	-4,11	-19,62	42.775.539,79	4,76	2.671.897.209,12	1,60
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	18,50	-1,98	-4,53	-21,86	28.042.166,58	3,12	2.224.682.241,76	1,26
Sub-total Artigo 9º III			18,34	-1,86	-4,28	-20,54	70.817.706,37	7,88		
Investimentos no Exterior			18,34	-1,86	-4,28	-20,54	70.817.706,37	7,88		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

10,10%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	14,82	-1,16	4,58	-3,00	16.337.717,49	1,82	1.503.624.719,70	1,09
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	15,02	-1,17	4,57	-3,05	63.241.189,41	7,04	2.963.569.112,96	2,13
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	14,99	-1,17	4,58	-3,11	11.127.000,17	1,24	2.089.574.099,71	0,53
Sub-total Artigo 10º I			20,66	-1,17	4,57	-3,05	90.705.907,07	10,10		
Investimentos Estruturados			20,66	-1,17	4,57	-3,05	90.705.907,07	10,10		
Total			5,26	-0,36	2,55	1,52	898.362.693,16	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	502.223.787,66	55,90	56,72	30,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	50.389.901,98	5,61	6,37	11,50	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	552.613.689,64	61,51					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	184.225.390,08	20,51	18,86	3,50	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	184.225.390,08	20,51					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	70.817.706,37	7,88	9,11	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	70.817.706,37	7,88					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	90.705.907,07	10,10	8,94	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	90.705.907,07	10,10					15,00
Total		898.362.693,16	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	2,17 235,18	3,22 132,64	3,22 132,64	4,79 111,10	6,14 95,80	10.737.291,17	15.746.204,31
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,29 139,84	2,65 109,14	2,65 109,14			626.304,10	1.254.351,17
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,88 -0,18	9,74 -4,74	9,74 -4,74			10.216.490,89	16.305.278,47
Artigo 9º III % do CDI	-4,28 -463,09	-20,54 -847,08	-20,54 -847,08	-10,92 -253,33	-6,94 -108,26	-3.163.753,87	-17.314.355,46
Artigo 10º I % do CDI	4,57 495,20	-3,05 -125,91	-3,05 -125,91			3.913.939,01	-2.247.888,15
COTIA (Total)						22.330.271,30	13.743.590,34

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	39.514.709,72	0,00	0,00	0,00	40.550.059,36	1.035.349,64	1.490.945,28
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	35.419.382,08	0,00	0,00	0,00	36.485.443,42	1.066.061,34	981.808,52
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	16.195.651,39	0,00	0,00	0,00	16.613.287,39	417.636,00	597.520,05
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	7.539.932,25	436.662,89	-3.043.449,27	0,00	4.998.318,49	65.172,62	195.258,78
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	62.911.854,05	0,00	0,00	0,00	64.564.212,80	1.652.358,75	2.377.013,15
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	163.463.512,48	0,00	0,00	0,00	167.691.230,16	4.227.717,68	6.073.796,25
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	30.088.420,12	0,00	0,00	0,00	31.010.066,90	921.646,78	851.048,08
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.798.434,85	0,00	0,00	0,00	18.961.188,66	162.753,81	410.993,98
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	106.591.957,10	0,00	0,00	0,00	107.470.475,61	878.518,51	2.431.757,54
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	5.096.806,13	0,00	0,00	0,00	5.156.094,94	59.288,81	132.420,69
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	8.472.622,70	0,00	0,00	0,00	8.723.409,93	250.787,23	203.641,99
					502.223.787,66	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\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	1.846.966,05	0,00	-239.586,10	0,00	1.622.413,75	15.033,80	43.768,65
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	13.075.911,59	0,00	0,00	0,00	13.201.907,59	125.996,00	330.283,08
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	17.646.891,47	2.168.396,84	0,00	0,00	19.985.608,11	170.319,80	437.069,14
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	10.832.949,00	0,00	0,00	0,00	10.992.882,84	159.933,84	303.458,48
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4.432.069,03	0,00	0,00	0,00	4.587.089,69	155.020,66	139.771,82
					50.389.901,98	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\$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	4.136.562,63	0,00	0,00	0,00	4.347.085,74	210.523,11	256.621,31
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	32.097.311,87	600.000,00	0,00	0,00	34.225.984,65	1.528.672,78	-886.230,47
BB AÇÕES DIVIDENDOS	17.289.239,83	0,00	0,00	0,00	18.582.930,37	1.293.690,54	2.457.100,53
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20.574.264,27	0,00	0,00	0,00	21.828.479,89	1.254.215,62	2.698.844,44
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	6.227.093,03	0,00	0,00	0,00	6.542.372,38	315.279,35	674.790,07
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	7.281.589,58	0,00	0,00	0,00	7.663.504,37	381.914,79	614.824,16
FIA BRASIL IBX-50	11.301.737,65	0,00	0,00	0,00	11.935.820,24	634.082,59	1.572.842,99
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	14.895.634,49	0,00	0,00	0,00	15.758.550,24	862.915,75	2.282.581,22
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	14.854.816,68	0,00	0,00	0,00	15.905.110,12	1.050.293,44	2.156.297,14
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	9.288.184,68	0,00	0,00	0,00	9.762.662,67	474.477,99	858.837,18
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	3.358.149,82	0,00	0,00	0,00	3.544.269,21	186.119,39	189.939,59
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	4.758.903,67	0,00	0,00	0,00	4.979.596,91	220.693,24	556.836,37
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	6.819.911,74	0,00	0,00	0,00	7.157.658,52	337.746,78	777.434,23
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	7.797.554,22	0,00	0,00	0,00	8.216.704,11	419.149,89	800.026,87
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	4.525.642,05	0,00	0,00	0,00	4.839.185,08	313.543,03	403.042,69
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	5.218.288,16	0,00	0,00	0,00	5.696.068,41	477.780,25	731.057,08
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	2.984.014,82	0,00	0,00	0,00	3.239.407,17	255.392,35	160.433,07
					184.225.390,08	0,00	0,00

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	44.609.802,58	0,00	0,00	0,00	42.775.539,79	-1.834.262,79	-9.843.601,79
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	29.371.657,66	0,00	0,00	0,00	28.042.166,58	-1.329.491,08	-7.470.753,67
					70.817.706,37	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	59.030.121,62	1.500.000,00	0,00	0,00	63.241.189,41	2.711.067,79	-1.802.683,18
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	10.639.536,16	0,00	0,00	0,00	11.127.000,17	487.464,01	-357.202,03
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	15.622.310,28	0,00	0,00	0,00	16.337.717,49	715.407,21	-88.002,94
					90.705.907,07	0,00	0,00

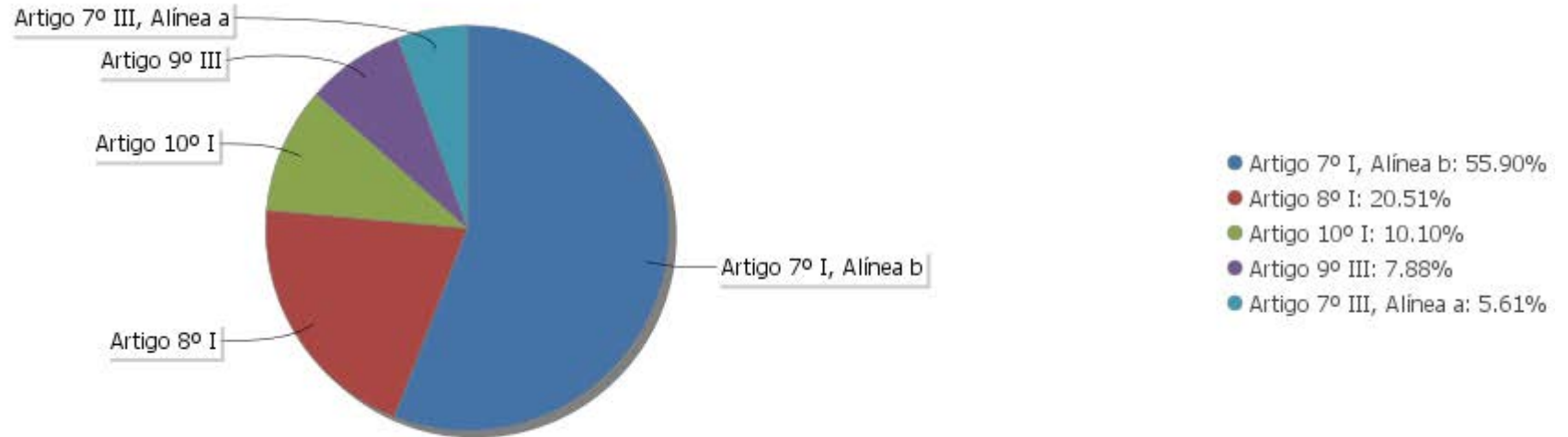
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

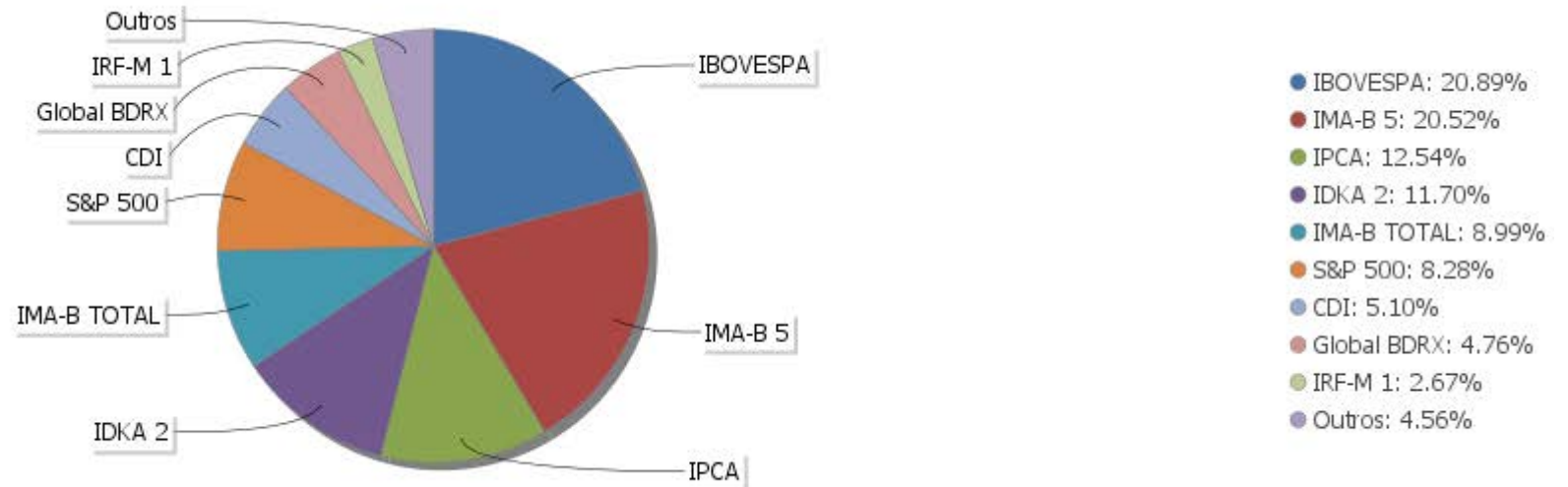
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	825.515.048,84	91,89	825.515.048,84	91,89
de 31 a 365 dias	72.847.644,32	8,11	898.362.693,16	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	898.362.693,16	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

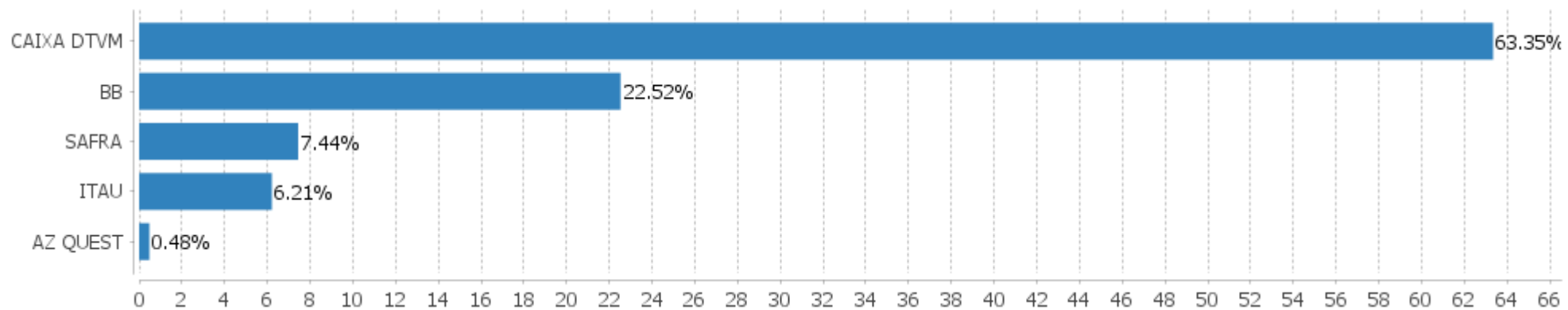


Alocação Por Estratégia



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	-0,60	-0,41	2,55										1,52
IPCA + 4,88%	0,94	1,37	2,04										4,42
p.p. indexador	-1,54	-1,78	0,50										-2,90
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

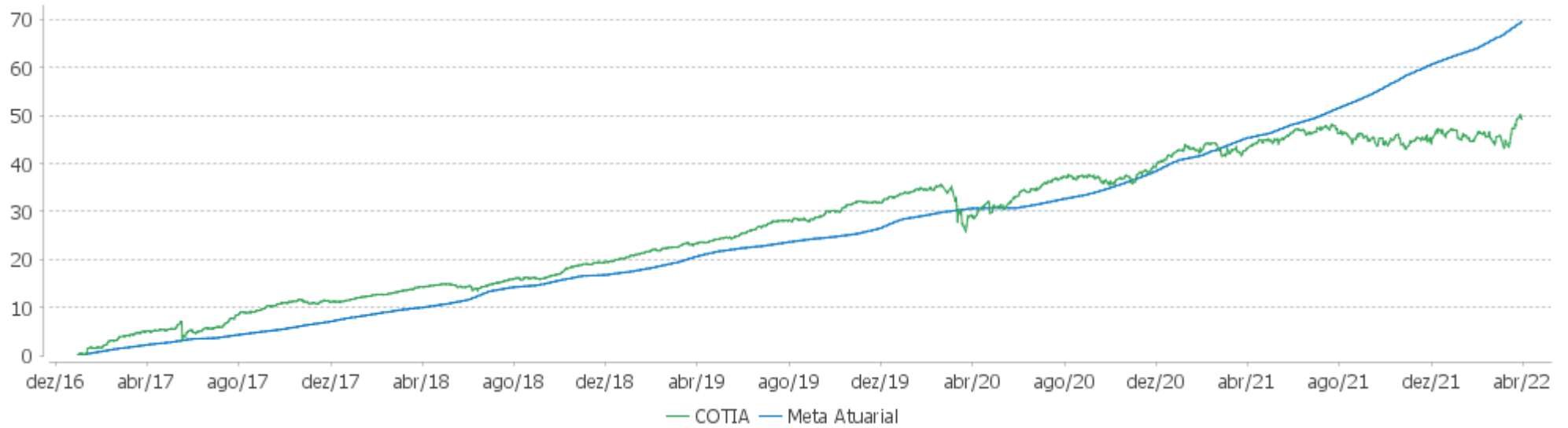
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	28	44,44
Meses abaixo - Meta Atuarial	35	55,56
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,57	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-3,56	2020-03

Relatório

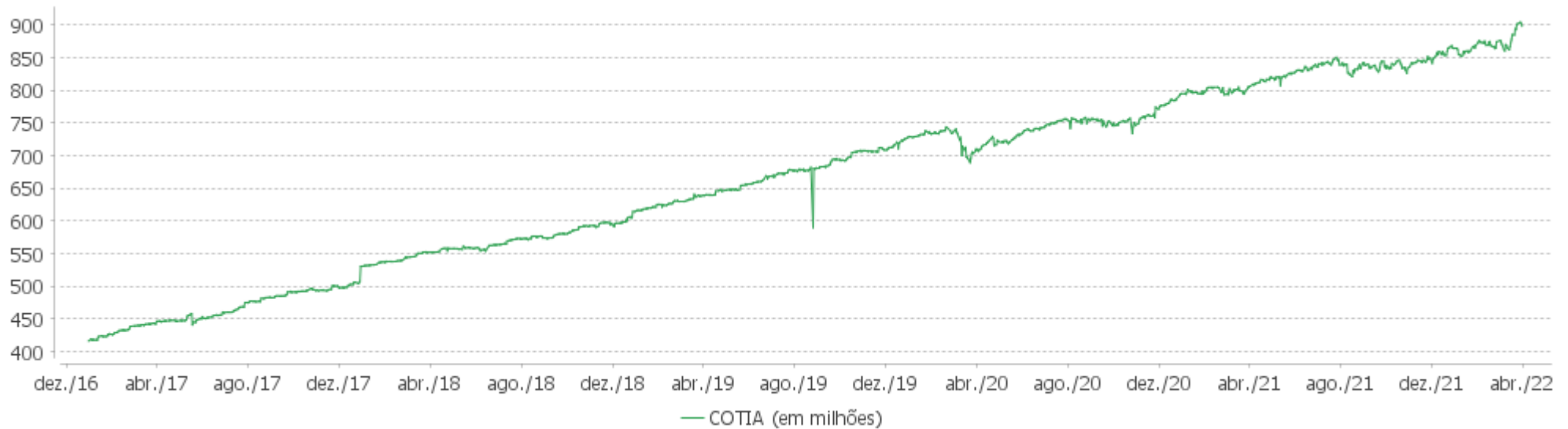
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,52	4,42	-2,90	6,65
06 meses	3,71	8,93	-5,22	6,11
12 meses	4,30	17,18	-12,87	5,26
24 meses	15,50	31,40	-15,91	4,84
36 meses	21,10	43,90	-22,81	4,98
48 meses	30,56	59,44	-28,88	4,39
60 meses	42,12	73,34	-31,22	4,39
Desde 30/12/2016	49,22	77,58	-28,35	4,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

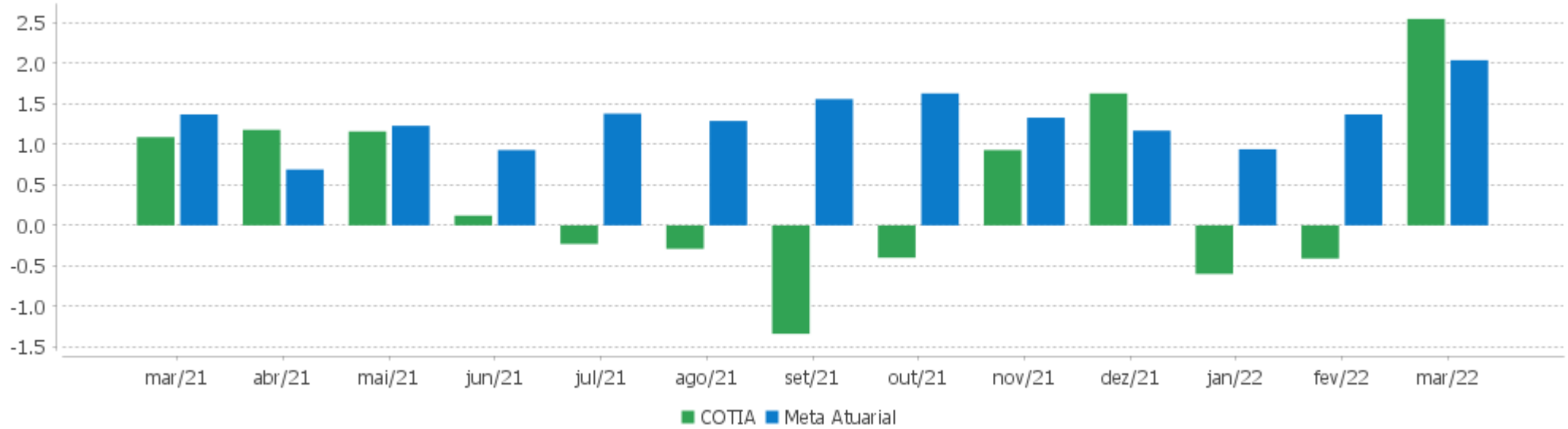


Patrimônio Líquido



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.	3,06 -0,01	2,82 -0,05	2,82 -0,05	3,85 -0,11	4,23 -0,27	14,81 -0,55	24,76 -1,14
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	2,59 -0,02	3,76 -0,06	3,76 -0,06	5,80 -0,12	8,48 -0,24	17,37 -0,59	27,97 -1,01
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	2,62 0,08	3,82 -0,06	3,82 -0,06	5,75 -0,05	8,64 -0,45	18,02 -0,43	27,20 -2,04
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,82 -0,80	2,32 -0,89	2,32 -0,89	3,41 -2,85	2,39 -8,91	7,61 -10,48	22,09 0,11
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,87 -0,02	2,23 -0,04	2,23 -0,04	3,36 -0,08	4,88 -0,26	7,10 -0,67	13,96 -0,99
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	2,63 0,09	3,82 -0,06	3,82 -0,06	5,71 -0,08	8,69 -0,41	17,87 -0,58	27,34 -1,91
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	2,58 -0,03	3,74 -0,07	3,74 -0,07	5,75 -0,17	8,38 -0,33	17,29 -0,67	27,99 -0,98
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,01 -0,06	2,76 -0,11	2,76 -0,11	3,77 -0,20	4,18 -0,33	14,69 -0,67	24,92 -0,98
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,96 -0,11	2,39 -0,48	2,39 -0,48	2,10 -1,86	1,52 -2,98	10,59 -4,77	21,32 -4,58
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,87 -0,02	2,22 -0,06	2,22 -0,06	3,33 -0,10	4,92 -0,22	7,31 -0,46	14,24 -0,71
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	1,16 -0,46	2,64 -0,56	2,64 -0,56	4,85 -1,40	6,92 -4,38	9,12 -8,97	19,76 -2,22
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,50 0,43	3,14 0,27	3,14 0,27	3,53 -0,43	5,19 0,69	15,35 -0,00	28,99 3,09
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,96 104,35	2,57 105,87	2,57 105,87	4,55 105,47	6,77 105,64	9,24 105,21	14,50 98,55
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,83 90,19	2,18 89,84	2,18 89,84	3,79 88,01	5,27 82,24	6,45 73,43	11,03 75,02
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	1,48 159,88	2,84 117,09	2,84 117,09	5,09 118,05	8,86 138,13	11,63 132,49	
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,93 100,44	2,55 105,38	2,55 105,38	4,49 104,26	6,91 107,69	9,00 102,47	14,44 98,16
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	5,38	10,79	10,79	-3,36	-9,72	44,56	

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.	-0,69	-3,69	-3,69	-11,48	-12,61	-19,78	
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	5,79 -0,27	16,94 2,46	16,94 2,46	9,73 1,61	1,88 -1,01	55,05 -9,28	40,48 14,71
FIA BRASIL IBX-50 Var. IBOVESPA p.p.	5,61 -0,45	15,18 0,70	15,18 0,70	8,76 0,63	2,95 0,07	66,89 2,55	24,34 -1,42
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	5,06 -1,00	11,50 -2,98	11,50 -2,98	8,04 -0,09	6,30 3,42	87,48 23,15	54,01 28,24
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	5,54 -0,52	5,66 -8,82	5,66 -8,82	-2,78 -10,90	-4,38 -7,26	51,19 -13,15	24,77 -0,99
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	7,07 -2,93	15,68 0,21	15,68 0,21	11,65 -1,72	6,45 -5,20	54,59 -1,00	35,48 -8,02
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,24 -0,82	8,72 -5,76	8,72 -5,76	5,96 -2,17	6,30 3,42	67,64 3,31	37,46 11,69
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	6,93 0,87	9,09 -5,39	9,09 -5,39	-12,22 -20,35	-15,99 -18,88	42,83 -21,50	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,09 -0,97	6,27 -8,20	6,27 -8,20	-2,50 -10,63	-3,61 -6,50	49,24 -15,09	36,90 11,14
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	9,16 3,10	14,72 0,25	14,72 0,25	8,91 0,78	4,07 1,18	49,41 -14,93	28,23 2,46
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,72 -1,34	-3,48 -17,96	-3,48 -17,96	8,33 0,20	18,36 15,47		
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA Var. SMALL CAP p.p.	8,56 -0,25	5,21 -1,48	5,21 -1,48	-7,95 -2,61	-7,97 1,83	48,21 -0,24	30,54 -0,13
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	4,64 -1,42	12,59 -1,89	12,59 -1,89	2,47 -5,65	-3,79 -6,68	50,39 -13,95	20,69 -5,07
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	4,95 -1,11	12,19 -2,29	12,19 -2,29				
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	6,10 -0,09	14,11 -0,41	14,11 -0,41	6,82 -0,60	1,59 -0,96	63,59 -3,48	27,76 -3,64
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	7,48 1,42	15,24 0,76	15,24 0,76	9,42 1,30	1,08 -1,81	39,81 -24,53	10,17 -15,60
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	5,11 -0,95	9,65 -4,83	9,65 -4,83	-1,69 -9,82	-5,16 -8,04	46,39 -17,94	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-4,11 -0,13	-19,62 -0,29	-19,62 -0,29	-10,12 -0,72	-7,40 -2,26	52,03 -4,80	93,17 -5,60
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	-4,53	-21,86	-21,86	-12,08	-6,29	49,12	81,53

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.	-10,59	-36,33	-36,33	-20,21	-9,17	-15,22	55,76
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	4,57 9,32	-3,05 16,25	-3,05 16,25	9,62 18,02	20,58 25,75	82,26 22,52	66,50 -27,84
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	4,58 -1,48	-3,00 -17,48	-3,00 -17,48	9,42 1,29	20,24 17,36	81,76 17,43	67,89 42,13
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI Var. S&P 500 p.p.	4,58 9,33	-3,11 16,19	-3,11 16,19	9,51 17,90	20,44 25,61	84,11 24,37	69,32 -25,02
COTIA Var. IPCA + 4,88% p.p.	2,55 0,50	1,52 -2,90	1,52 -2,90	3,71 -5,09	4,30 -12,43	15,50 -14,35	21,10 -19,64
CDI	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71
IBOVESPA	6,06	14,48	14,48	8,13	2,89	64,34	25,77
INPC + 6,00%	2,23	4,91	4,91	9,38	18,43	34,19	47,02
IPCA + 6,00%	2,14	4,69	4,69	9,37	17,98	32,62	45,29

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	-	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		2,00
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32		2,00
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
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 5 LP FIC FI	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
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
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
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	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
FIA BRASIL IBX-50	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	D+1 du	D+0	D+21 du	D+23 du		1,72
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	D+1 du	D+0	D+23 du	D+25 du		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	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESA, APURADO PELA BM&FBOVESA	1,90
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESA ATIVO FICFI	D+1 du	D+0	D+2 du	D+4 du		1,50
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,00
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	D+0	D+0	D+21 du	D+24 du		
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	D+1 du	D+0	D+22 du	D+24 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE EQUIVALENTE A 10% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESA, APURADO PELA B3.	0,80
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	O GESTOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE	0,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO CERTIFICADO DE DEPÓSITO INTERFINANCEIRO - CDI DE UM DIA, APURADO PELA CETIP.	
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	Método Passivo.	0,00
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+0	D+0	D+3 du	D+4 du		0,30
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+2 du		1,00
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		3,50
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	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.	2,00

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	0,89	2,28	2,28	3,43	5,14	7,77	14,95	22,64	34,09
IRF-M 1+	0,81	0,79	0,79	1,73	0,56	2,39	15,66	27,47	45,50
IRF-M TOTAL	0,84	1,35	1,35	2,35	2,19	4,49	16,08	26,70	43,00
IMA-B 5	2,61	3,81	3,81	5,92	8,72	17,96	28,97	40,83	57,68
IMA-B 5+	3,56	1,91	1,91	1,99	0,35	12,40	21,66	42,68	57,29
IMA-B TOTAL	3,07	2,87	2,87	3,96	4,50	15,36	25,90	43,16	58,53
IMA-GERAL TOTAL	1,57	2,54	2,54	3,91	4,91	10,14	19,47	30,83	44,94
IDKA 2	2,54	3,88	3,88	5,80	9,10	18,45	29,25	41,12	58,63
IDKA 20	4,00	0,37	0,37	-2,51	-7,51	6,54	12,87	41,87	51,51
CDI	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71	21,98	32,24

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,06	14,48	14,48	8,13	2,89	64,34	25,77	40,57	84,66
IBRX 100	5,96	14,89	14,89	8,55	2,79	66,70	29,68	46,11	91,79
IBRX 50	5,43	15,47	15,47	10,28	4,13	71,54	27,56	41,05	86,31
SMALL CAP	8,81	6,69	6,69	-5,35	-9,80	48,46	30,68	46,05	95,46
Índice Consumo - ICON	5,74			-11,99	-18,58	22,89	14,32	13,52	40,45
Índice Dividendos - IDIV	10,00	15,48	15,48	13,37	11,66	55,59	43,49	63,17	97,87

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	-4,75	-19,30	-19,30	-8,39	-5,17	59,75	94,34	144,53	186,72

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,42	-0,88	-0,88	2,37	-2,35	11,46	11,96	17,92	36,76

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-6,10	-19,97	-19,97	-12,65	-12,11	46,60	70,12	100,67	137,04

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	1,62	3,20	3,20	6,25	11,30	18,09	21,99	27,57	30,99
INPC	1,71	3,42	3,42	6,26	11,73	19,48	23,44	29,20	31,22
IGPM	1,74	5,49	5,49	7,11	14,77	50,46	60,70	73,99	74,34
SELIC	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71	21,99	32,26

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,97	4,20	4,20	8,34	15,75	27,68	37,22	49,19	59,20
IPCA + 5,00%	2,05	4,45	4,45	8,86	16,86	30,14	41,22	55,00	66,95
IPCA + 5,50%	2,10	4,57	4,57	9,11	17,42	31,38	43,24	57,97	70,94
IPCA + 5,89%	2,13	4,66	4,66	9,31	17,85	32,35	44,84	60,31	74,11
IPCA + 6,00%	2,14	4,69	4,69	9,37	17,98	32,62	45,29	60,98	75,01
INPC + 4,00%	2,06	4,42	4,42	8,35	16,20	29,19	38,85	51,10	59,47
INPC + 6,00%	2,23	4,91	4,91	9,38	18,43	34,19	47,02	63,04	75,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
404	03/03/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	11.827,04	5.341,70269000	2,2140955210
405	04/03/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.900,00	4.018,21262200	2,2149151470
417	04/03/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	16.485,44	0,00	5.819,35501700	2,8328637710
406	07/03/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	190,00	85,75204400	2,2156906250
407	09/03/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.713,00	2.576,55195200	2,2173044080
408	10/03/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.224,83	1.453,87388900	2,2180947230
409	14/03/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.438,74	2.450,21902600	2,2196954400
410	15/03/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	202,36	91,13284000	2,2204948400
411	16/03/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.227,21	552,47525700	2,2212940470
402	22/03/2022	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.500.000,00	0,00	882.359,16959414	1,6999880000
403	22/03/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.168.396,84	0,00	542.242,90436966	3,9989400000
418	22/03/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	308.275,98	0,00	108.225,36579500	2,8484632760
419	22/03/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	111.901,47	0,00	39.284,85613300	2,8484632760
422	23/03/2022	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	600.000,00	0,00	378.693,28005800	1,5843956880
412	25/03/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.577,98	2.504,26638300	2,2273908390
413	28/03/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.955,79	4.019,20613100	2,2282484920
414	29/03/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	107.704,84	48.317,24298000	2,2291180820
420	29/03/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	2.610.966,90	913.754,24768000	2,8574060330
415	30/03/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.438,24	2.438,69318200	2,2299812210
416	31/03/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	75.186,07	33.702,55480400	2,2308715300
421	31/03/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	432.482,37	151.238,31519700	2,8596084890
Total			4.705.059,73	3.283.035,37		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 27.739.048,39

Value-At-Risk: 3,09%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
COTIA		3,09	3,09			898.362.693,16	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,88%

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		0,33	0,00	0,01			4.998.318,49	0,56
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA		2,27	0,01	0,39			8.723.409,93	0,97
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,95	0,03	0,03			36.485.443,42	4,06
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,96	0,03	0,01			31.010.066,90	3,45
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,31	0,00	0,01			18.961.188,66	2,11
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,06	0,07	0,01			167.691.230,16	18,67
BB PREV RF IDKA2		1,07	0,02	0,18			40.550.059,36	4,51
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,11	0,03	0,20			64.564.212,80	7,19
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,08	0,01	0,03			16.613.287,39	1,85
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		0,37	0,00	0,36			5.156.094,94	0,57
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,35	0,01	0,36			107.470.475,61	11,96
Sub-total	2,56	0,95	0,21		0,49	2,17	502.223.787,66	55,90

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO		2,30	0,01	0,43			4.587.089,69	0,51
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,06	0,00	0,04			19.985.608,11	2,22
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,04	0,00	0,02			13.201.907,59	1,47
BB PREV RF FLUXO FIC		0,03	0,00	0,00			1.622.413,75	0,18
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI		0,43	-0,00	0,42			10.992.882,84	1,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,58	0,24	0,01		0,63	1,29	50.389.901,98	5,61

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,29%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI		8,09	0,04	2,33			6.542.372,38	0,73
BB AÇÕES DIVIDENDOS		8,10	0,12	3,29			18.582.930,37	2,07
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES		8,89	0,04	4,39			5.696.068,41	0,63
FIA BRASIL IBX-50		9,58	0,09	1,86			11.935.820,24	1,33
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		10,12	0,04	2,49			4.979.596,91	0,55
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		9,15	0,17	0,09			21.828.479,89	2,43
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		9,20	0,03	4,95			4.347.085,74	0,48
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS		8,28	0,11	1,79			15.758.550,24	1,75
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		7,57	0,10	2,40			15.905.110,12	1,77
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		8,84	0,03	5,12			3.544.269,21	0,39
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		8,03	0,05	2,34			7.663.504,37	0,85
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA		9,17	0,31	8,99			34.225.984,65	3,81
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		10,23	0,09	4,30			9.762.662,67	1,09
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		11,78	0,07	6,26			7.157.658,52	0,80
ITAU INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI		10,85	0,08	4,54			8.216.704,11	0,91
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		18,72	0,07	13,62			4.839.185,08	0,54
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA		17,06	0,04	4,08			3.239.407,17	0,36
Sub-total	20,20	8,29	1,49		0,25	5,88	184.225.390,08	20,51

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 9,47%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		9,04	0,15	8,90			16.337.717,49	1,82

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		9,59	0,60	6,57			63.241.189,41	7,04
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI		9,40	0,10	6,56			11.127.000,17	1,24
Sub-total	22,09	9,47	0,86		0,17	4,57	90.705.907,07	10,10

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,36%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		10,42	0,30	0,97			42.775.539,79	4,76
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		10,77	0,22	12,50			28.042.166,58	3,12
Sub-total	25,67	10,36	0,52		-0,20	-4,28	70.817.706,37	7,88