



LDB
EMPRESAS

COTIA
SETEMBRO 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 30.09.2022.

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

65,77%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,080000%)	3,00	0,14	0,06	8.548.830,49	0,96
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		3,00	0,14	0,06	8.548.830,49	0,96

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	0,73	1,09	8,39	3.015.397,73	0,34	6.071.749.354,31	0,05
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	5,85	1,34	5,33	8.974.239,47	1,01	357.276.654,08	2,51
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,46	1,45	5,92	37.605.171,65	4,23	5.858.339.074,80	0,64
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,49	1,50	6,09	20.233.736,84	2,28	3.871.147.074,69	0,52
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,72	1,09	8,39	25.903.468,71	2,92	5.416.816.231,94	0,48
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,68	0,43	7,04	172.994.232,96	19,48	8.885.835.879,64	1,95
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,83	0,53	6,74	46.599.437,69	5,25	8.749.817.040,89	0,53
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,92	0,51	6,53	70.939.396,70	7,99	8.482.726.221,67	0,84
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,71	0,40	6,90	29.816.009,38	3,36	6.260.416.458,58	0,48
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,84	1,53	8,40	5.445.802,24	0,61	2.451.788.610,47	0,22
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,69	1,24	8,29	83.569.262,02	9,41	5.850.800.339,33	1,43
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,63	0,76	6,89	505.096.155,39	56,87		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,09	1,47	5,45	4.689.676,36	0,53	444.503.225,14	1,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,16	1,11	9,12	32.950.849,60	3,71	13.954.428.357,23	0,24
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,14	1,09	9,08	21.196.399,09	2,39	11.863.594.899,56	0,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,14	0,99	8,07	42.336,48	0,00	3.459.949.589,95	0,00
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,78	1,08	8,93	11.643.844,26	1,31	2.088.496.299,29	0,56
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	0,48	1,13	8,87	70.523.105,79	7,94		
		Renda Fixa	2,39	0,80	7,18	584.168.091,67	65,77		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

18,78%

Artigo 8º I (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	18,04	-0,03	8,50	17.496.909,94	1,97	643.661.333,34	2,72
SAFRA	SAFRA	SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	18,68	-1,96	7,57	5.340.840,03	0,60	100.378.416,62	5,32
CAIXA DTVM	CEF	FIA BRASIL IBX-50	20,23	0,32	3,65	10.741.428,98	1,21	710.401.540,64	1,51
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	19,93	0,80	6,29	4.700.739,66	0,53	489.228.783,31	0,96
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,30	-0,13	3,58	19.815.329,44	2,23	882.000.687,94	2,25
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	17,31	-2,18	-5,30	3.873.588,70	0,44	1.083.847.526,25	0,36
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	19,68	1,28	9,36	14.737.110,00	1,66	686.461.522,28	2,15
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,62	-0,09	8,36	14.897.994,20	1,68	940.722.110,37	1,58
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,75	-1,00	2,10	3.424.788,22	0,39	1.961.836.267,82	0,17
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	18,92	-1,34	-1,51	6.942.114,42	0,78	1.044.236.872,39	0,66
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	21,83	-8,03	-20,16	28.312.005,86	3,19	1.316.041.552,71	2,15
BB	BB	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	19,33	-0,36	1,67	5.965.736,13	0,67	1.433.036.477,39	0,42
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	20,41	-0,69	2,56	9.131.323,39	1,03	678.381.558,66	1,35
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	22,13	-1,60	2,44	6.535.783,97	0,74	252.608.332,81	2,59
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	21,74	-0,26	1,10	7.498.256,14	0,84	203.988.888,33	3,68
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	30,69	0,73	-0,25	4.424.984,95	0,50	237.020.075,64	1,87
SAFRA	SAFRA	SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	29,95	0,56	-4,97	2.926.068,69	0,33	43.334.936,63	6,75
Sub-total Artigo 8º I			17,79	-1,62	-0,66	166.765.002,72	18,78		
Renda Variável			17,37	-1,62	-0,66	166.765.002,72	18,78		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,84%

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	22,78	-7,72	-30,97	36.735.083,66	4,14	2.057.509.929,37	1,79
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	23,35	-6,87	-33,02	24.035.723,60	2,71	1.090.419.986,23	2,20
Sub-total Artigo 9º III			22,60	-7,38	-31,81	60.770.807,26	6,84		
Investimentos no Exterior			22,60	-7,38	-31,81	60.770.807,26	6,84		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

8,61%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

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	21,77	-8,56	-19,58	13.544.171,93	1,52	706.287.111,00	1,92
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	21,98	-8,62	-19,76	53.686.417,17	6,04	1.721.873.439,88	3,12
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	21,97	-8,62	-19,75	9.215.922,55	1,04	1.207.167.139,22	0,76
Sub-total Artigo 10º I			23,75	-8,61	-19,73	76.446.511,65	8,61		
Investimentos Estruturados			23,75	-8,61	-19,73	76.446.511,65	8,61		
Total			6,66	-1,13	-0,96	888.150.413,30	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 a	Títulos do Tesouro Nacional	8.548.830,49	0,96	0,00	35,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	505.096.155,39	56,87	56,72	30,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	70.523.105,79	7,94	6,37	11,50	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	584.168.091,67	65,77					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	166.765.002,72	18,78	18,86	3,50	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	166.765.002,72	18,78					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	60.770.807,26	6,84	9,11	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	60.770.807,26	6,84					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	76.446.511,65	8,61	8,94	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	76.446.511,65	8,61					15,00
Total		888.150.413,30	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 a % do CDI	0,14 13,42	0,06 2,25				12.277,39	4.721,66
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,76 71,32	6,89 77,52	1,22 36,73	3,56 56,42	8,52 78,21	3.832.580,19	33.013.030,05
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,13 105,31	8,87 99,82	3,16 95,37	6,07 96,11		767.927,42	5.568.626,98
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-1,62 -2,09	-0,66 -5,64	7,90 -3,77	-9,48 -1,18		-2.744.290,86	-1.155.108,89
Artigo 9º III % do CDI	-7,38 -688,80	-31,81 -357,81	-4,42 -133,61	-14,19 -224,73	-23,56 -216,21	-4.844.933,78	-27.361.254,57
Artigo 10º I % do CDI	-8,61 -803,40	-19,73 -221,91	-2,64 -79,66	-17,20 -272,47		-7.204.253,03	-18.107.283,57
COTIA (Total)						-10.180.692,67	-8.037.268,34

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150830 (6,080000%)	8.536.553,10	0,00	0,00	0,00	8.548.830,49	12.277,39	4.721,66
					8.548.830,49	0,00	0,00

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	46.353.978,39	0,00	0,00	0,00	46.599.437,69	245.459,30	2.693.053,59
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	37.067.526,08	0,00	0,00	0,00	37.605.171,65	537.645,57	2.101.536,75
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	29.697.012,28	0,00	0,00	0,00	29.816.009,38	118.997,10	1.245.869,06
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.981.611,92	1.400,50	0,00	0,00	3.015.397,73	32.385,31	335.962,50
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	70.579.407,64	0,00	0,00	0,00	70.939.396,70	359.989,06	4.086.601,53
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	172.258.452,18	0,00	0,00	0,00	172.994.232,96	735.780,78	11.376.799,05
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19.935.414,93	0,00	0,00	0,00	20.233.736,84	298.321,91	1.459.481,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	25.624.709,81	0,00	0,00	0,00	25.903.468,71	278.758,90	1.635.800,26
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	82.544.470,99	0,00	0,00	0,00	83.569.262,02	1.024.791,03	7.201.326,48
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	5.363.618,05	0,00	0,00	0,00	5.445.802,24	82.184,19	422.127,99
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	8.855.972,43	0,00	0,00	0,00	8.974.239,47	118.267,04	454.471,53
					505.096.155,39	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	282.392,93	4.654,64	-247.232,44	0,00	42.336,48	2.521,35	91.742,32
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	22.958.649,20	1.275.781,67	-3.291.035,77	0,00	21.196.399,09	253.003,99	2.279.319,93
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	27.410.676,75	5.220.151,07	0,00	0,00	32.950.849,60	320.021,78	2.000.786,34
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	11.519.585,01	0,00	0,00	0,00	11.643.844,26	124.259,25	954.419,90
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4.621.555,31	0,00	0,00	0,00	4.689.676,36	68.121,05	242.358,49
					70.523.105,79	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	3.960.095,29	0,00	0,00	0,00	3.873.588,70	-86.506,59	-216.875,73
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	30.784.505,58	0,00	0,00	0,00	28.312.005,86	-2.472.499,72	-6.800.209,26
BB AÇÕES DIVIDENDOS	17.502.426,17	0,00	0,00	0,00	17.496.909,94	-5.516,23	1.371.080,10
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	19.841.407,27	0,00	0,00	0,00	19.815.329,44	-26.077,83	685.693,99
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	5.987.005,77	0,00	0,00	0,00	5.965.736,13	-21.269,64	98.153,82
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	7.036.258,40	0,00	0,00	0,00	6.942.114,42	-94.143,98	-106.565,79
FIA BRASIL IBX-50	10.706.883,62	0,00	0,00	0,00	10.741.428,98	34.545,36	378.451,73
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	14.551.248,41	0,00	0,00	0,00	14.737.110,00	185.861,59	1.261.140,98
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	14.911.410,04	0,00	0,00	0,00	14.897.994,20	-13.415,84	1.149.181,22
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	9.195.082,19	0,00	0,00	0,00	9.131.323,39	-63.758,80	227.497,90
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	3.459.408,29	0,00	0,00	0,00	3.424.788,22	-34.620,07	70.458,60
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	4.663.608,96	0,00	0,00	0,00	4.700.739,66	37.130,70	277.979,12

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	6.642.039,79	0,00	0,00	0,00	6.535.783,97	-106.255,82	155.559,68
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	7.518.002,14	0,00	0,00	0,00	7.498.256,14	-19.746,00	81.578,90
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	4.392.706,54	0,00	0,00	0,00	4.424.984,95	32.278,41	-11.157,44
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	5.447.395,39	0,00	0,00	0,00	5.340.840,03	-106.555,36	375.828,70
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	2.909.809,73	0,00	0,00	0,00	2.926.068,69	16.258,96	-152.905,41
					166.765.002,72	0,00	0,00

Artigo 9º 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	39.808.205,50	0,00	0,00	0,00	36.735.083,66	-3.073.121,84	-15.884.057,92
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	25.807.535,54	0,00	0,00	0,00	24.035.723,60	-1.771.811,94	-11.477.196,65
					60.770.807,26	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	58.753.751,69	0,00	0,00	0,00	53.686.417,17	-5.067.334,52	-12.957.455,42
ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	10.085.144,76	0,00	0,00	0,00	9.215.922,55	-869.222,21	-2.268.279,65
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	14.811.868,23	0,00	0,00	0,00	13.544.171,93	-1.267.696,30	-2.881.548,50
					76.446.511,65	0,00	0,00

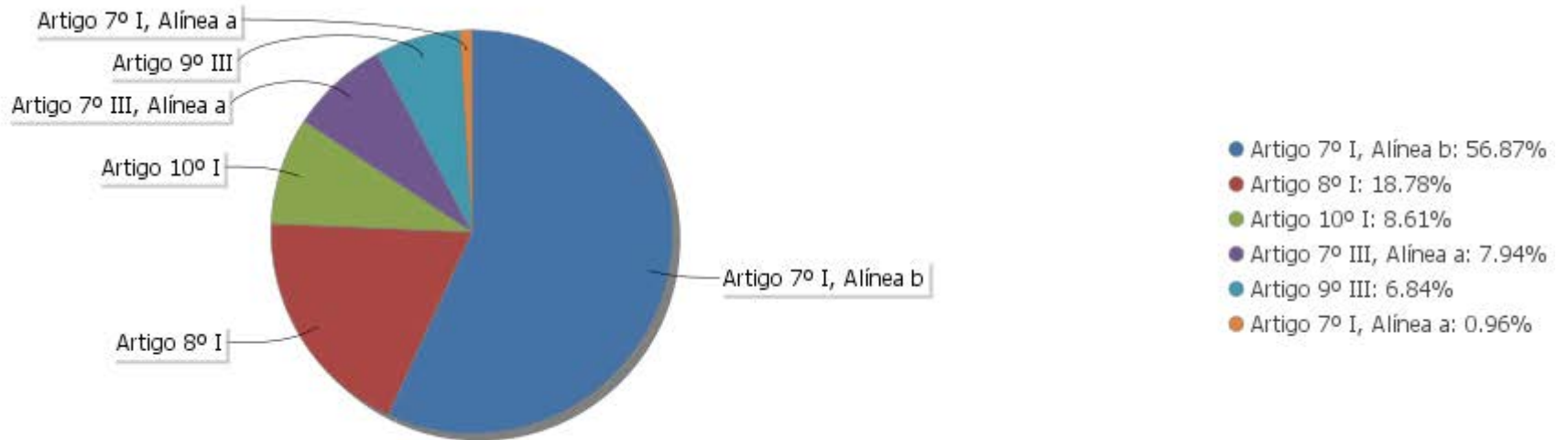
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

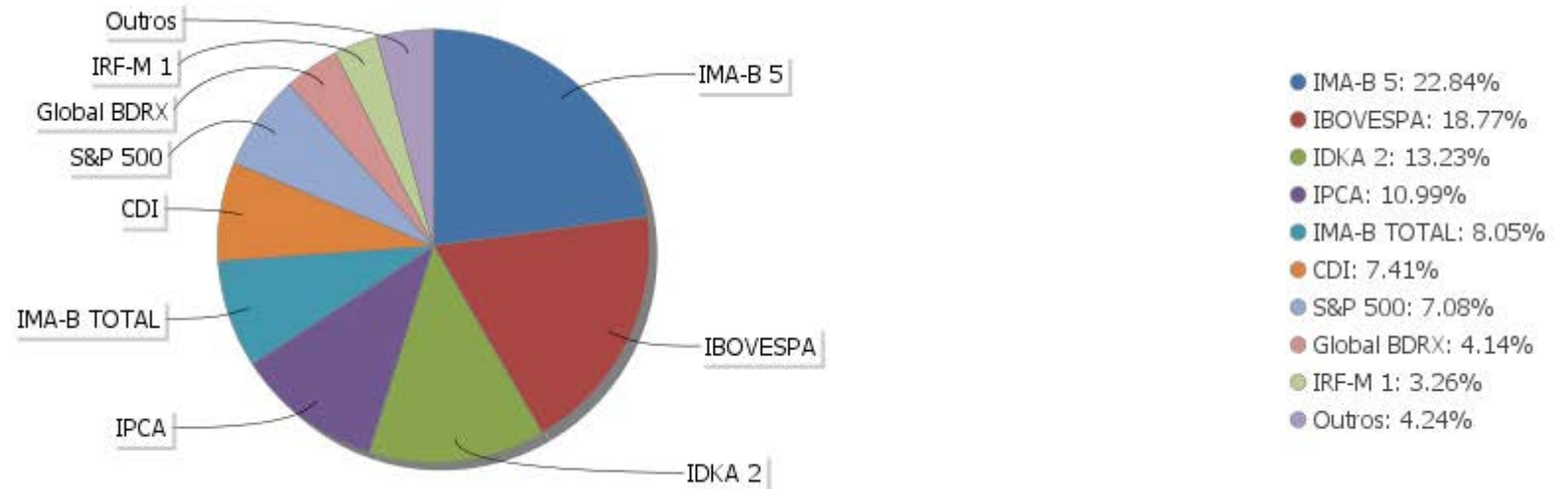
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	812.009.227,52	91,43	812.009.227,52	91,43
de 31 a 365 dias	67.592.355,29	7,61	879.601.582,81	99,04
acima de 365 dias	8.548.830,49	0,96	888.150.413,30	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

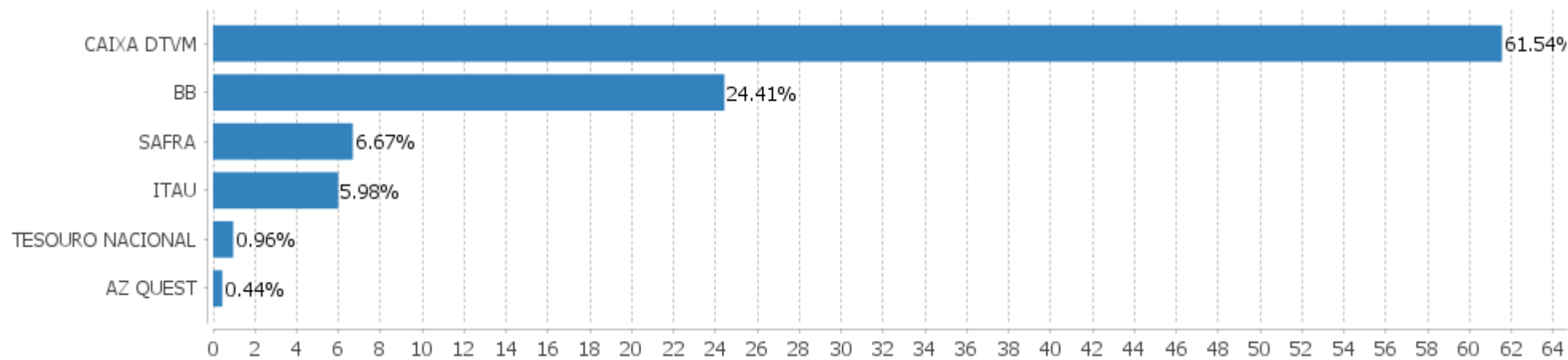


Alocação Por Estratégia



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	-2,43	0,69	-2,47	2,48	0,48	-1,13				-0,96
IPCA + 5,41%	0,98	1,41	2,09	1,46	0,93	1,11	-0,24	0,12	0,15				8,29
p.p. indexador	-1,58	-1,82	0,46	-3,89	-0,24	-3,59	2,73	0,36	-1,28				-9,25
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

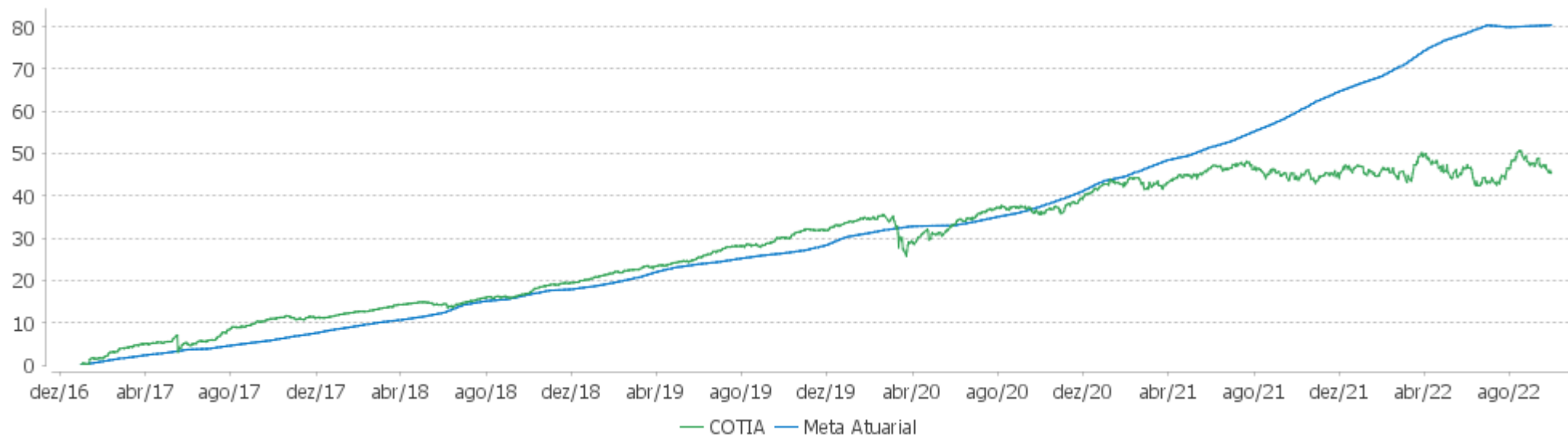
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	30	43,48
Meses abaixo - Meta Atuarial	39	56,52
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,57	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-3,56	2020-03

Relatório

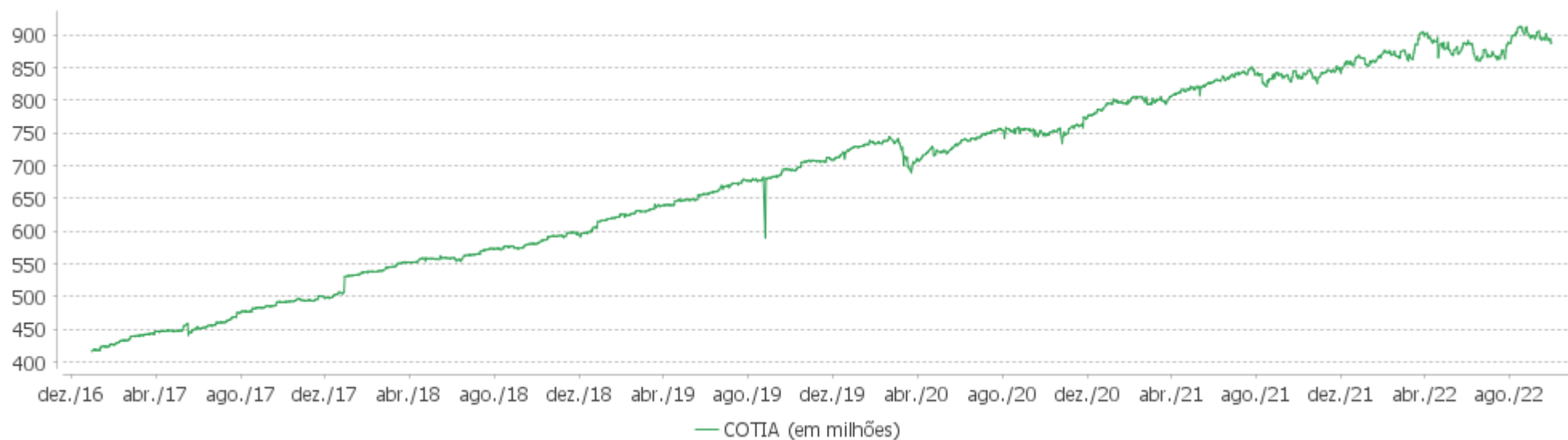
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,81	0,03	1,79	6,37
06 meses	-2,45	3,58	-6,02	7,17
12 meses	1,17	12,97	-11,80	6,66
24 meses	7,01	31,39	-24,38	5,63
36 meses	11,83	43,49	-31,65	5,75
48 meses	24,55	56,46	-31,91	5,04
60 meses	31,24	73,23	-42,00	4,56
Desde 30/12/2016	45,57	84,16	-38,58	4,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

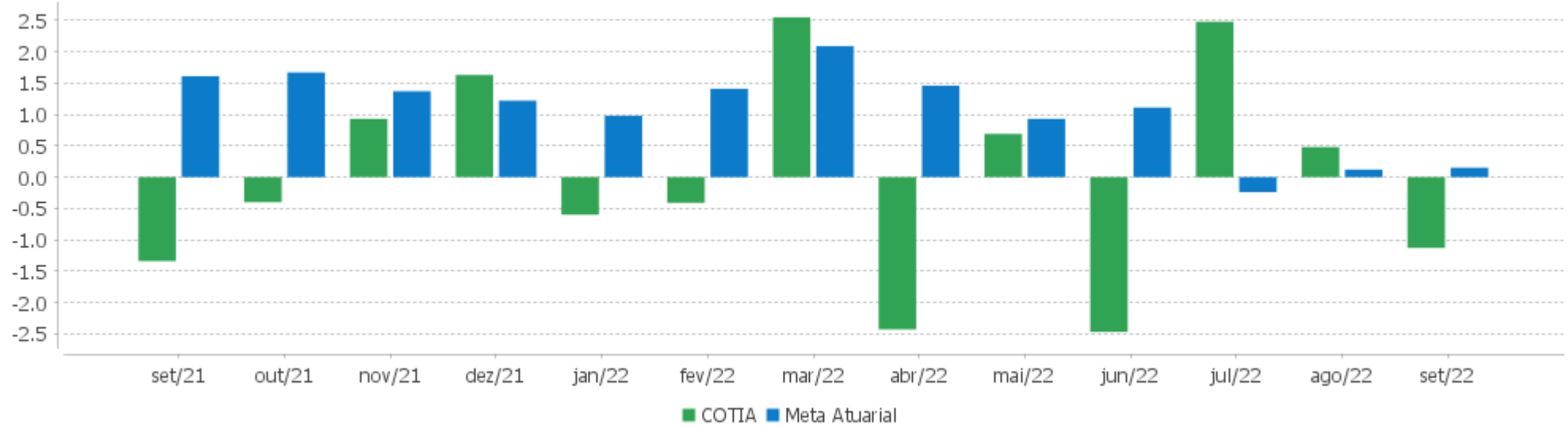


Patrimônio Líquido



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
NTN-B 150830 (6,080000%) Var. IPCA p.p.	0,14 0,43	6,23 2,14	0,64 1,96	5,02 4,16	11,11 3,95	22,38 4,23	25,73 3,88
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,50 0,02	6,09 -0,03	1,76 0,06	3,18 0,02	7,15 -0,10	11,91 -0,38	13,79 -0,88
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,43 0,00	7,04 -0,03	0,50 0,06	3,16 0,02	9,15 -0,10	15,36 -0,39	23,34 -0,79
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,53 -0,09	6,74 -0,20	0,26 0,18	2,81 -0,13	8,72 -0,19	15,30 -0,38	23,69 -1,24
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,09 -0,03	8,39 -0,21	3,37 -0,06	6,02 -0,16	9,57 -0,24	11,94 -0,61	16,61 -1,05
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,24 1,53	8,29 4,20	3,54 4,86	5,84 4,98	9,44 2,28	10,38 -7,77	17,45 -4,40
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,40 -0,02	6,90 -0,17	0,40 -0,03	3,05 -0,09	8,97 -0,27	15,18 -0,56	23,19 -0,94
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,51 -0,11	6,53 -0,41	0,11 0,02	2,60 -0,34	8,47 -0,45	14,89 -0,79	23,34 -1,60
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,34 -0,14	5,33 -0,79	1,70 -0,00	2,88 -0,28	5,04 -2,21	7,36 -4,94	10,46 -4,21
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,09 -0,02	8,39 -0,20	3,37 -0,07	6,04 -0,13	9,57 -0,25	12,03 -0,52	16,89 -0,78
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,45 -0,03	5,92 -0,20	1,63 -0,07	3,07 -0,09	6,95 -0,30	11,76 -0,54	13,80 -0,87
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	1,53 1,82	8,40 4,31	2,97 4,30	5,62 4,76	10,74 3,57	13,75 -4,40	17,95 -3,91
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,47 -0,01	5,45 -0,67	1,22 -0,48	2,24 -0,92	5,84 -1,40	11,30 -1,00	14,84 0,17
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,09 101,93	9,08 102,10	3,35 101,16	6,35 100,55	11,18 102,63	14,77 103,93	18,19 99,53
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,99 92,75	8,07 90,82	3,06 92,31	5,77 91,41	9,78 89,79	11,85 83,36	14,54 79,54
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,11 103,09	9,12 102,57	3,34 100,77	6,40 101,38	11,18 102,63	14,86 104,57	18,19 99,54
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	1,08	8,93	2,85	5,92	11,31	16,36	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	100,62	100,43	86,05	93,80	103,82	115,10	
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-0,26 -0,73	1,10 -3,87	12,82 1,16	-8,74 -0,44	-11,81 -10,96	-4,69 -21,01	-3,14 -8,19
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	1,28 0,81	9,36 4,38	11,86 0,20	-6,48 1,82	2,62 3,47	12,21 -4,11	12,18 7,13
FIA BRASIL IBX-50 Var. IBOVESPA p.p.	0,32 -0,15	3,65 -1,32	11,39 -0,27	-10,01 -1,70	-2,13 -1,28	15,01 -1,30	3,20 -1,85
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-0,36 -0,82	1,67 -3,30	9,61 -2,05	-8,81 -0,51	-1,48 -0,63	22,12 5,81	23,24 18,19
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	-1,00 -1,47	2,10 -2,87	11,81 0,14	-3,37 4,93	-6,05 -5,21	12,04 -4,27	0,24 -4,81
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,09 1,71	8,36 -0,85	6,94 2,52	-6,33 -0,90	4,58 -2,63	21,26 -6,94	12,79 -2,84
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,34 -1,81	-1,51 -6,49	7,67 -3,99	-9,41 -1,11	-4,02 -3,17	24,18 7,87	12,69 7,64
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,73 0,27	-0,25 -5,23	16,08 4,41	-8,56 -0,26	-19,74 -18,89	-9,26 -25,57	-2,23 -7,28
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,18 -2,65	-5,30 -10,28	7,57 -4,09	-10,89 -2,59	-13,12 -12,27	0,05 -16,27	-0,91 -5,96
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA Var. IBOVESPA p.p.	-8,03 -8,50	-20,16 -25,13	-2,85 -14,51	-17,28 -8,98	-10,39 -9,54	15,59 -0,73	
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-1,96 -2,43	7,57 2,60	5,26 -6,40	-6,24 2,07	2,11 2,96	15,49 -0,83	3,05 -2,00
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA Var. SMALL CAP p.p.	0,56 2,40	-4,97 3,10	19,73 5,25	-9,67 4,15	-16,85 1,58	-2,61 2,97	-4,97 2,30
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-1,60 -2,07	2,44 -2,54	11,81 0,14	-8,69 -0,39			
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	0,80 0,33	6,29 1,31	12,66 1,00	-5,60 2,70	-3,26 -2,42	7,77 -8,55	2,10 -2,96
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	-0,03 -0,50	8,50 3,53	8,61 -3,05	-5,84 2,46	3,03 3,88	10,63 -5,68	-7,57 -12,62
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	-0,13 0,05	3,58 -0,68	11,14 -0,19	-9,22 -0,26	-3,03 -0,83	14,00 -2,06	4,65 -2,93
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	-0,69 -1,16	2,56 -2,42	11,57 -0,10	-6,47 1,84	-8,05 -7,20	3,01 -13,30	0,48 -4,57
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-7,72	-30,97	-4,35	-14,12	-22,81	-8,72	47,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Global BDRX p.p.	0,66	-0,19	0,03	0,08	-0,54	-2,81	-3,67
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	-6,87 -7,33	-33,02 -37,99	-4,54 -16,20	-14,29 -5,99	-24,65 -23,80	-9,11 -25,42	35,30 30,24
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-8,62 -3,27	-19,76 7,36	-2,65 -0,42	-17,23 -7,55	-9,27 8,00	18,60 16,41	28,89 -27,50
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-8,56 -9,03	-19,58 -24,56	-2,60 -14,26	-17,10 -8,80	-9,29 -8,44	18,31 2,00	30,09 25,04
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI Var. S&P 500 p.p.	-8,62 -3,26	-19,75 7,36	-2,62 -0,40	-17,18 -7,49	-9,30 7,96	18,63 16,43	30,97 -25,41
COTIA Var. IPCA + 5,41% p.p.	-1,13 -1,28	-0,96 -9,25	1,81 1,79	-2,45 -6,02	1,17 -11,80	7,01 -24,24	11,83 -30,86
CDI	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28
IBOVESPA	0,47	4,97	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05
INPC + 6,00%	0,17	8,98	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90
IPCA + 6,00%	0,20	8,74	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10

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 QUANTITATIVO FIC 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 VARIÇÃO 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 IBOVSPA 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	1,11	8,59	3,43	6,17	9,81	12,55	17,67	26,42	34,96
IRF-M 1+	1,58	6,25	5,47	5,41	7,24	3,87	11,78	35,04	42,24
IRF-M TOTAL	1,40	6,96	4,66	5,53	8,01	6,91	13,92	33,10	40,74
IMA-B 5	0,42	7,07	0,43	3,14	9,25	15,75	24,13	43,24	52,60
IMA-B 5+	2,39	5,10	3,01	3,14	5,19	8,56	6,75	54,62	53,36
IMA-B TOTAL	1,48	6,12	1,70	3,16	7,25	12,30	14,67	50,64	54,48
IMA-GERAL TOTAL	1,26	7,80	3,17	5,13	9,24	11,95	16,81	36,41	43,76
IDKA 2	0,62	6,94	0,09	2,94	8,91	15,68	24,94	40,99	52,99
IDKA 20	5,00	3,97	6,75	3,59	0,98	3,03	-6,12	61,55	50,87
CDI	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,07

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,47	4,97	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05	38,69	48,11
IBRX 100	-0,05	4,43	10,77	-9,10	-1,33	16,26	6,28	43,30	51,68
IBRX 50	0,48	5,31	11,70	-8,80	0,58	19,15	7,21	38,32	48,42
SMALL CAP	-1,84	-8,06	14,47	-13,82	-18,43	-5,58	-7,27	45,86	34,71
IFIX	0,49	6,63	6,98	7,58	10,13	7,01	11,42	40,10	34,66
Índice Consumo - ICON	-1,18		15,08	-17,92	-27,77	-28,97	-29,71	8,70	-9,15
Índice Dividendos - IDIV	-1,80	9,21	4,42	-5,43	7,21	28,20	15,63	76,72	67,29

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	-0,29	4,09	-1,32	0,86	7,17	18,15	21,85	25,38	31,05
INPC	-0,32	4,32	-1,23	0,87	7,19	18,75	23,37	26,97	32,02
IGPM	-0,95	6,61	-1,43	1,07	8,25	35,16	59,40	64,77	81,31
SELIC	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,08

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	-5,36	-27,11	-2,23	-9,68	-17,26	2,19	56,39	66,16	142,89
MSCI ACWI	-5,78	-28,97	-4,29	-11,25	-22,48	-6,15	37,99	42,53	93,97

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,04	7,20	-0,32	2,87	11,46	27,77	37,05	46,63	59,32
IPCA + 5,00%	0,12	7,97	-0,07	3,37	12,53	30,23	41,03	52,34	67,10
IPCA + 5,50%	0,16	8,35	0,05	3,62	13,06	31,48	43,06	55,26	71,10
IPCA + 5,89%	0,19	8,65	0,14	3,81	13,48	32,45	44,65	57,56	74,27
IPCA + 6,00%	0,20	8,74	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10	58,22	75,18
INPC + 4,00%	0,01	7,43	-0,22	2,89	11,48	28,42	38,75	48,49	60,50
INPC + 6,00%	0,17	8,98	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90	60,23	76,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
545	02/09/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.500,00	3.207,01136400	2,3386259510
546	05/09/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.743,69	745,25722400	2,3397156630
539	06/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	14.579,92	0,00	5.599,59891000	2,6037436310
547	06/09/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.034,00	3.859,34990000	2,3408087460
548	09/09/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.713,00	2.438,32466500	2,3430021780
538	12/09/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.400,50	0,00	465,38538000	3,0093338930
544	13/09/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	4.654,64	0,00	1.984,73776600	2,3452166220
541	14/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	93.242,44	35.721,09937900	2,6102903220
549	14/09/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.240,97	528,90319600	2,3463083780
550	15/09/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	72,00	30,67200100	2,3474177490
551	16/09/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.385,00	589,73391900	2,3485167720
540	22/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.261.201,75	0,00	481.661,03272900	2,6184425650
556	22/09/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.220.151,07	0,00	1.227.122,87088500	4,2539758600
552	23/09/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	20.500,00	8.708,31422900	2,3540721500
553	27/09/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.210,12	937,95845200	2,3563090620
542	29/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.732.043,81	1.040.605,34439700	2,6254370350
554	29/09/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	116.391,54	49.349,70577200	2,3585052470
543	30/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	465.749,52	177.306,80169900	2,6268000750
555	30/09/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	81.442,12	34.515,08435300	2,3596094730
Total			6.501.987,88	3.538.268,21		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 30.094.325,45

Value-At-Risk: 3,39%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
COTIA		3,39	3,39			888.150.413,30	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,11%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150830 (6,080000%)		0,19	-0,00	0,17			8.548.830,49	0,96
Sub-total	0,30	0,19	-0,00		-3,10	0,14	8.548.830,49	0,96

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		0,18	0,00	0,01			3.015.397,73	0,34
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA		2,58	0,01	0,30			8.974.239,47	1,01
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,44	0,04	0,05			37.605.171,65	4,23
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,46	0,02	0,06			20.233.736,84	2,28
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,17	0,00	0,01			25.903.468,71	2,92
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,14	0,09	0,04			172.994.232,96	19,48
BB PREV RF IDKA2		1,42	0,03	0,32			46.599.437,69	5,25
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,54	0,05	0,42			70.939.396,70	7,99
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,15	0,02	0,03			29.816.009,38	3,36
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI		1,42	0,00	1,43			5.445.802,24	0,61
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,25	0,04	1,27			83.569.262,02	9,41
Sub-total	2,67	1,26	0,30		-0,12	0,76	505.096.155,39	56,87

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO		2,69	0,01	0,36			4.689.676,36	0,53
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,03	-0,00	0,03			32.950.849,60	3,71
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	-0,00	0,01			21.196.399,09	2,39
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,00			42.336,48	0,00
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI		0,37	0,00	0,37			11.643.844,26	1,31
Sub-total	0,59	0,21	0,01		0,10	1,13	70.523.105,79	7,94

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,24%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS		8,33	0,13	3,58			17.496.909,94	1,97
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES		8,36	0,04	4,18			5.340.840,03	0,60
FIA BRASIL IBX-50		9,55	0,10	1,98			10.741.428,98	1,21
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		10,02	0,04	1,85			4.700.739,66	0,53
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		10,63	0,19	0,15			19.815.329,44	2,23
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,43	0,03	5,15			3.873.588,70	0,44
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS		9,87	0,13	1,92			14.737.110,00	1,66
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		8,42	0,11	1,93			14.897.994,20	1,68
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC		8,65	0,03	4,41			3.424.788,22	0,39
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		10,58	0,06	3,08			6.942.114,42	0,78
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA		13,50	0,39	10,96			28.312.005,86	3,19
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI		10,69	0,06	1,83			5.965.736,13	0,67
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		9,41	0,08	3,90			9.131.323,39	1,03
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		9,01	0,05	4,55			6.535.783,97	0,74
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI		9,79	0,07	3,89			7.498.256,14	0,84
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		12,49	0,05	7,37			4.424.984,95	0,50
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA		11,34	0,03	2,88			2.926.068,69	0,33
Sub-total	19,97	9,24	1,59		-0,13	-1,62	166.765.002,72	18,78

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 13,38%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		13,28	0,18	10,82			13.544.171,93	1,52
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		13,40	0,74	7,87			53.686.417,17	6,04
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI		13,39	0,13	7,87			9.215.922,55	1,04
Sub-total	24,76	13,38	1,05		-0,39	-8,61	76.446.511,65	8,61

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,66%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		11,01	0,27	2,09			36.735.083,66	4,14
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		10,54	0,17	13,59			24.035.723,60	2,71
Sub-total	20,14	10,66	0,44		-0,42	-7,38	60.770.807,26	6,84