



LDB
EMPRESAS

COTIA
DEZEMBRO 2022



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 30.12.2022.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **66,01%**

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,685000%)	4,24	0,04	0,85	1,98	41.626.784,41	4,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,080000%)	2,99	0,04	0,88	2,64	8.768.889,55	0,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,255000%)	4,26	0,04	0,90	1,13	40.285.121,13	4,38
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,80	0,04	0,87	2,47	90.680.795,09	9,86

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	0,48	0,05	1,16	11,73	3.108.456,49	0,34	6.516.931.621,39	0,05
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	5,41	0,04	-0,11	5,68	9.003.510,39	0,98	328.699.769,54	2,74
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,32	0,04	-0,22	6,09	37.667.387,26	4,10	6.078.064.149,48	0,62
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,40	0,04	-0,24	6,19	9.505.463,90	1,03	3.466.339.701,42	0,27
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,48	0,05	1,15	11,74	26.704.514,29	2,90	6.557.713.378,25	0,41
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,60	0,04	0,92	9,67	177.243.314,48	19,28	7.960.289.495,76	2,23
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,82	0,04	1,22	9,32	26.363.141,49	2,87	7.489.389.892,90	0,35
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,92	0,04	1,23	9,04	72.613.224,23	7,90	6.893.208.496,34	1,05
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,62	0,04	0,91	9,51	10.926.527,72	1,19	5.613.586.065,55	0,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,08	0,05	-0,37	7,83	5.416.980,87	0,59	2.189.575.950,42	0,25
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,78	0,05	1,14	10,70	14.039.887,31	1,53	5.292.657.963,96	0,27
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,61	0,04	0,86	9,10	392.592.408,43	42,70		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	5,91	0,04	-0,25	4,94	4.666.906,11	0,51	397.808.834,02	1,17
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,10	0,05	1,15	12,67	32.042.418,56	3,49	13.943.633.561,86	0,23
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,09	0,05	1,12	12,59	74.448.676,44	8,10	12.858.761.791,29	0,58
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,08	0,05	1,03	11,26	453.890,15	0,05	3.841.990.026,28	0,01
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,78	0,05	1,15	11,81	11.952.076,11	1,30	2.325.266.703,21	0,51
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,50	0,05	1,07	12,08	123.563.967,37	13,44		
Renda Fixa			2,25	0,04	0,90	9,60	606.837.170,89	66,01		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

18,02%

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	21,09	0,01	-2,57	-0,75	5.823.287,48	0,63	1.369.079.222,31	0,43
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	19,00	-0,00	-2,09	6,63	17.195.296,27	1,87	591.938.977,49	2,90
SAFRA	SAFRA	SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	19,57	-0,01	-1,68	8,95	5.409.494,53	0,59	86.233.088,93	6,27
CAIXA DTVM	CEF	FIA BRASIL IBX-50	21,54	-0,00	-2,49	2,32	10.603.122,73	1,15	672.041.029,27	1,58
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	20,41	-0,01	-2,13	4,71	4.630.872,31	0,50	494.877.498,01	0,94
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21,38	-0,01	-2,62	2,43	19.593.655,85	2,13	844.496.837,07	2,32
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	20,27	0,01	-1,80	-8,69	3.734.832,84	0,41	999.511.078,28	0,37
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	21,12	-0,00	-3,47	4,78	14.120.314,47	1,54	658.481.538,24	2,14
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	19,00	-0,01	-2,42	8,49	14.916.475,02	1,62	902.168.515,36	1,65
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	20,59	-0,01	1,80	5,16	3.527.519,98	0,38	1.879.797.625,43	0,19
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	20,42	0,01	-2,48	-3,47	6.804.070,54	0,74	987.099.652,68	0,69
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	23,65	0,00	-4,58	-13,32	30.734.566,62	3,34	1.307.589.645,54	2,35
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	21,19	-0,02	-3,65	-1,79	8.744.380,01	0,95	638.491.745,31	1,37
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	23,35	-0,00	-4,80	-8,10	5.863.641,03	0,64	227.381.609,67	2,58
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	22,16	-0,01	-2,69	-3,35	7.168.214,96	0,78	151.820.473,84	4,72
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	28,36	-0,01	-2,14	-7,66	4.096.235,24	0,45	205.166.844,97	2,00
SAFRA	SAFRA	SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	29,21	-0,01	-3,07	-11,72	2.718.235,97	0,30	42.087.894,66	6,46
Sub-total Artigo 8º I			18,83	-0,00	-2,96	-1,31	165.684.215,85	18,02		
Renda Variável			18,83	-0,00	-2,96	-1,31	165.684.215,85	18,02		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,85%

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	26,84	-0,00	-4,79	-28,54	38.027.442,14	4,14	1.938.590.167,99	1,96
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	26,80	0,01	-4,67	-30,39	24.978.893,97	2,72	910.995.998,19	2,74
Sub-total Artigo 9º III			26,43	0,00	-4,74	-29,30	63.006.336,11	6,85		
Investimentos no Exterior			26,43	0,00	-4,74	-29,30	63.006.336,11	6,85		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,12%

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	23,96	0,05	-4,81	-11,92	14.834.744,68	1,61	643.989.310,17	2,30
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	24,18	0,05	-4,90	-11,97	58.892.739,35	6,41	1.723.160.287,50	3,42
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	24,16	0,05	-4,81	-11,92	10.115.148,96	1,10	1.178.133.424,16	0,86
Sub-total Artigo 10º I			24,14	0,05	-4,87	-11,96	83.842.632,99	9,12		
Investimentos Estruturados			24,14	0,05	-4,87	-11,96	83.842.632,99	9,12		
Total			6,81	0,03	-0,77	1,47	919.370.355,84	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	90.680.795,09	9,86	0,00	35,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	392.592.408,43	42,70	56,72	30,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	123.563.967,37	13,44	6,37	11,50	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	606.837.170,89	66,01					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	165.684.215,85	18,02	18,86	3,50	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	165.684.215,85	18,02					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	63.006.336,11	6,85	9,11	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	63.006.336,11	6,85					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	83.842.632,99	9,12	8,94	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	83.842.632,99	9,12					15,00
Total		919.370.355,84	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	0,87 77,72	2,47 41,29	2,41 75,37			784.800,77	1.481.125,42
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,86 76,16	9,10 73,55	2,07 64,59	3,31 49,99	9,10 73,55	3.296.995,45	42.230.781,92
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,07 95,16	12,08 97,66	2,95 92,18	6,20 93,71	12,08 97,66	1.210.376,94	8.088.333,73
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-2,96 -0,51	-1,31 -5,99	-0,65 -0,37	7,20 -4,16	-1,31 -5,99	-5.045.513,97	-2.235.895,76
Artigo 9º III % do CDI	-4,74 -422,32	-29,30 -236,83	3,68 115,02	-0,91 -13,71	-29,30 -236,83	-3.137.908,57	-25.125.725,72
Artigo 10º I % do CDI	-4,87 -433,69	-11,96 -96,68	9,67 302,52	6,78 102,55	-11,96 -96,68	-4.293.735,77	-10.711.162,23
COTIA (Total)						-7.184.985,15	13.727.457,36

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 (5,685000%)	41.276.421,60	0,00	0,00	0,00	41.626.784,41	350.362,81	807.124,35
NTN-B 150830 (6,080000%)	8.692.255,34	0,00	0,00	0,00	8.768.889,55	76.634,21	224.780,72
NTN-B 150830 (6,255000%)	39.927.317,38	0,00	0,00	0,00	40.285.121,13	357.803,75	449.220,35
					90.680.795,09	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	26.045.743,57	0,00	0,00	0,00	26.363.141,49	317.397,92	3.623.420,25
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	37.749.719,21	0,00	0,00	0,00	37.667.387,26	-82.331,95	2.163.752,36
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	11.526.412,15	0,00	-700.000,00	0,00	10.926.527,72	100.115,57	1.799.562,37
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	3.072.900,58	0,00	0,00	0,00	3.108.456,49	35.555,91	429.021,26
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	71.728.139,92	0,00	0,00	0,00	72.613.224,23	885.084,31	5.760.429,06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	175.623.964,98	0,00	0,00	0,00	177.243.314,48	1.619.349,50	15.625.880,57
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.528.031,29	0,00	0,00	0,00	9.505.463,90	-22.567,39	1.297.871,23
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.399.709,96	0,00	0,00	0,00	26.704.514,29	304.804,33	2.436.845,84
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	74.415.547,29	0,00	-60.544.998,14	0,00	14.039.887,31	169.338,16	8.216.949,91
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	5.437.086,39	0,00	0,00	0,00	5.416.980,87	-20.105,52	393.306,62
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	9.013.155,78	0,00	0,00	0,00	9.003.510,39	-9.645,39	483.742,45
					392.592.408,43	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	29.898,66	725.038,48	-303.803,62	0,00	453.890,15	2.756,63	95.345,79
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	16.125.541,51	61.898.352,13	-4.367.447,11	0,00	74.448.676,44	792.229,91	3.517.884,03
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	22.747.764,42	9.003.221,55	0,00	0,00	32.042.418,56	291.432,59	2.992.863,92
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	11.816.590,81	0,00	0,00	0,00	11.952.076,11	135.485,30	1.262.651,75
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4.678.433,60	0,00	0,00	0,00	4.666.906,11	-11.527,49	219.588,24
					123.563.967,37	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	3.803.420,83	0,00	0,00	0,00	3.734.832,84	-68.587,99	-355.631,59
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	32.210.757,55	0,00	0,00	0,00	30.734.566,62	-1.476.190,93	-4.377.648,50
BB AÇÕES DIVIDENDOS	17.561.712,46	0,00	0,00	0,00	17.195.296,27	-366.416,19	1.069.466,43
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20.121.386,99	0,00	0,00	0,00	19.593.655,85	-527.731,14	464.020,40
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	5.976.665,93	0,00	0,00	0,00	5.823.287,48	-153.378,45	-44.294,83
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	6.976.794,33	0,00	0,00	0,00	6.804.070,54	-172.723,79	-244.609,67
FIA BRASIL IBX-50	10.873.813,65	0,00	0,00	0,00	10.603.122,73	-270.690,92	240.145,48
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	14.627.275,46	0,00	0,00	0,00	14.120.314,47	-506.960,99	644.345,45
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	15.287.140,92	0,00	0,00	0,00	14.916.475,02	-370.665,90	1.167.662,04
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	9.075.731,10	0,00	0,00	0,00	8.744.380,01	-331.351,09	-159.445,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	3.465.185,89	0,00	0,00	0,00	3.527.519,98	62.334,09	173.190,36
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	4.731.463,72	0,00	0,00	0,00	4.630.872,31	-100.591,41	208.111,77
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	6.159.445,13	0,00	0,00	0,00	5.863.641,03	-295.804,10	-516.583,26
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	7.366.630,95	0,00	0,00	0,00	7.168.214,96	-198.415,99	-248.462,28
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	4.185.805,91	0,00	0,00	0,00	4.096.235,24	-89.570,67	-339.907,15
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	5.502.051,71	0,00	0,00	0,00	5.409.494,53	-92.557,18	444.483,20
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	2.804.447,29	0,00	0,00	0,00	2.718.235,97	-86.211,32	-360.738,13
					165.684.215,85	0,00	0,00

Artigo 9º III (Fundos de 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	39.942.072,10	0,00	0,00	0,00	38.027.442,14	-1.914.629,96	-14.591.699,44
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	26.202.172,58	0,00	0,00	0,00	24.978.893,97	-1.223.278,61	-10.534.026,28
					63.006.336,11	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	61.925.444,76	0,00	0,00	0,00	58.892.739,35	-3.032.705,41	-7.751.133,24
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	10.626.615,93	0,00	0,00	0,00	10.115.148,96	-511.466,97	-1.369.053,24
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	15.584.308,07	0,00	0,00	0,00	14.834.744,68	-749.563,39	-1.590.975,75
					83.842.632,99	0,00	0,00

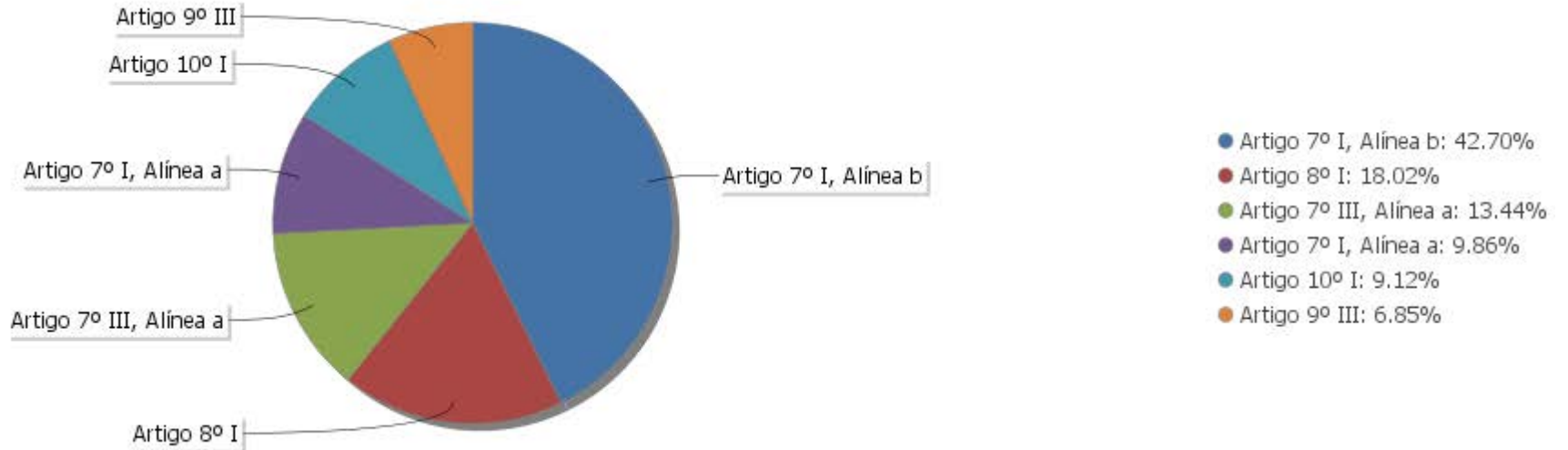
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

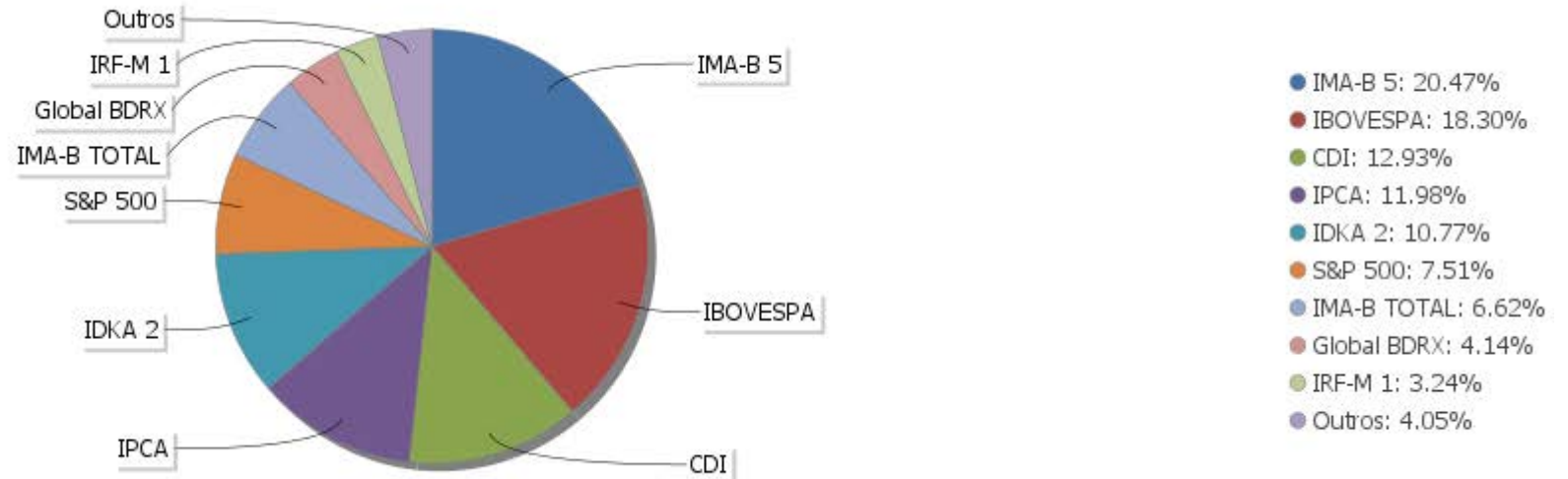
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	763.448.709,50	83,04	763.448.709,50	83,04
de 31 a 365 dias	65.240.851,25	7,10	828.689.560,75	90,14
acima de 365 dias	90.680.795,09	9,86	919.370.355,84	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

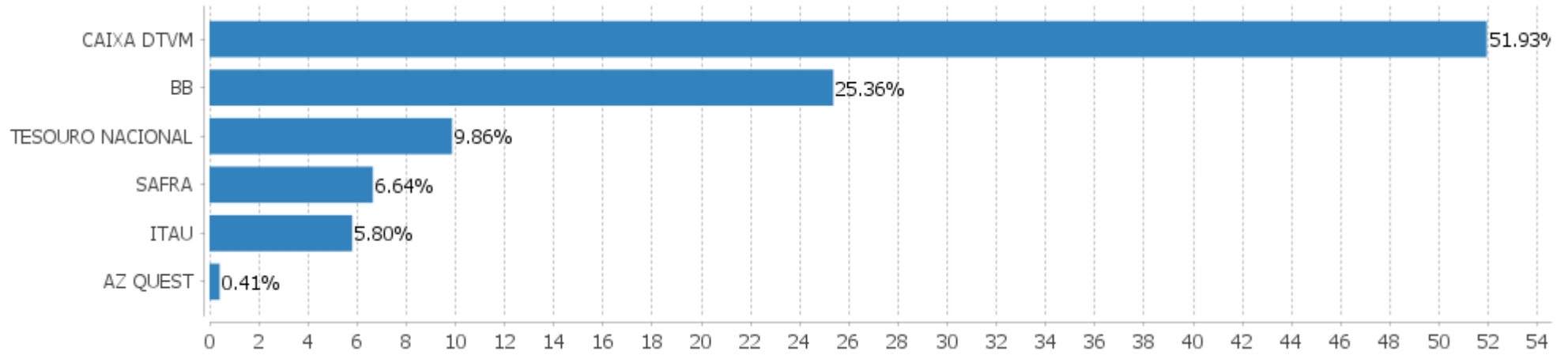


Alocação Por Estratégia



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	3,05	0,20	-0,77	1,47
IPCA + 4,88%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,28	0,07	0,11	0,97	0,79	1,04	10,93
p.p. indexador	-1,54	-1,78	0,50	-3,85	-0,20	-3,54	2,77	0,41	-1,24	2,08	-0,59	-1,81	-9,46
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	31	43,06
Meses abaixo - Meta Atuarial	41	56,94

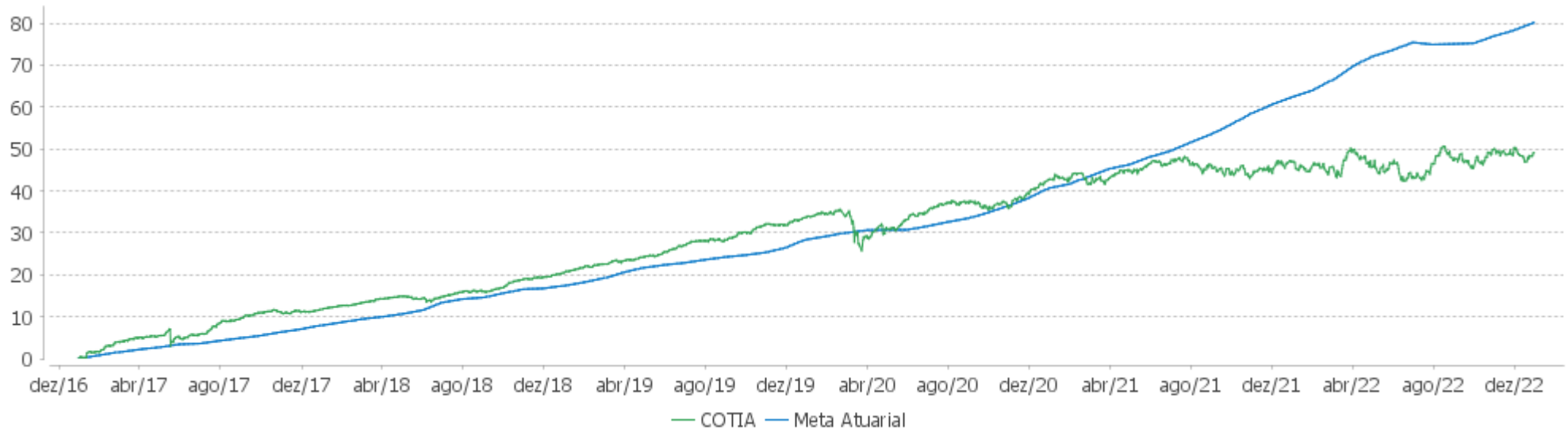
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,05	2022-10
Menor rentabilidade da Carteira	-3,56	2020-03

Relatório

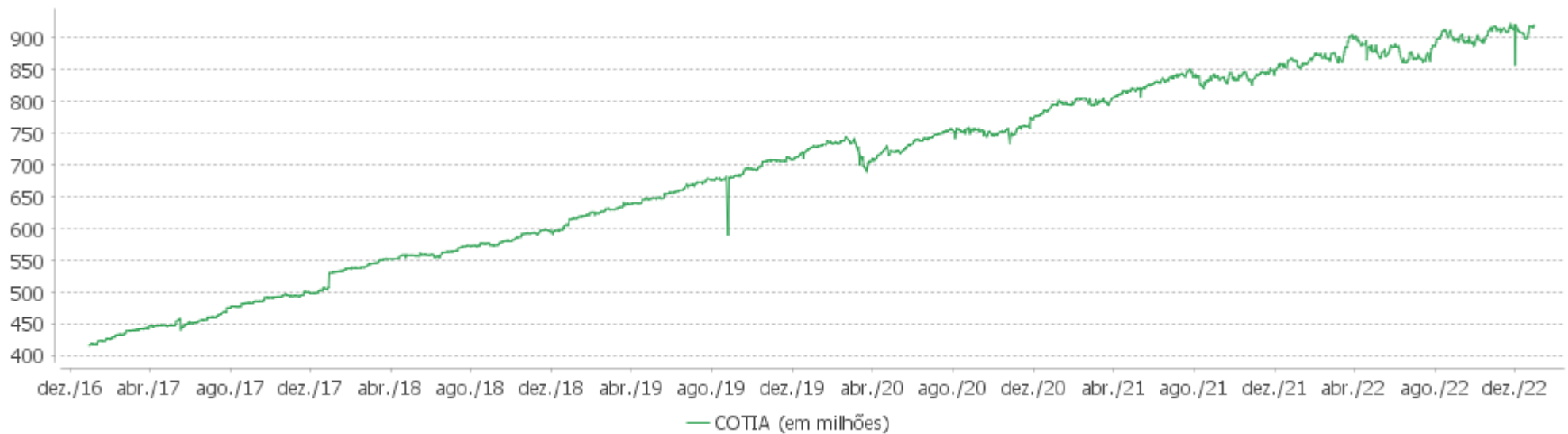
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,46	2,83	-0,37	6,23
06 meses	4,31	2,72	1,59	6,27
12 meses	1,47	10,93	-9,46	6,81
24 meses	4,47	28,67	-24,20	5,89
36 meses	11,52	42,31	-30,79	6,00
48 meses	23,82	57,38	-33,56	5,25
60 meses	33,54	72,99	-39,45	4,75
Desde 30/12/2016	49,15	88,65	-39,50	4,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

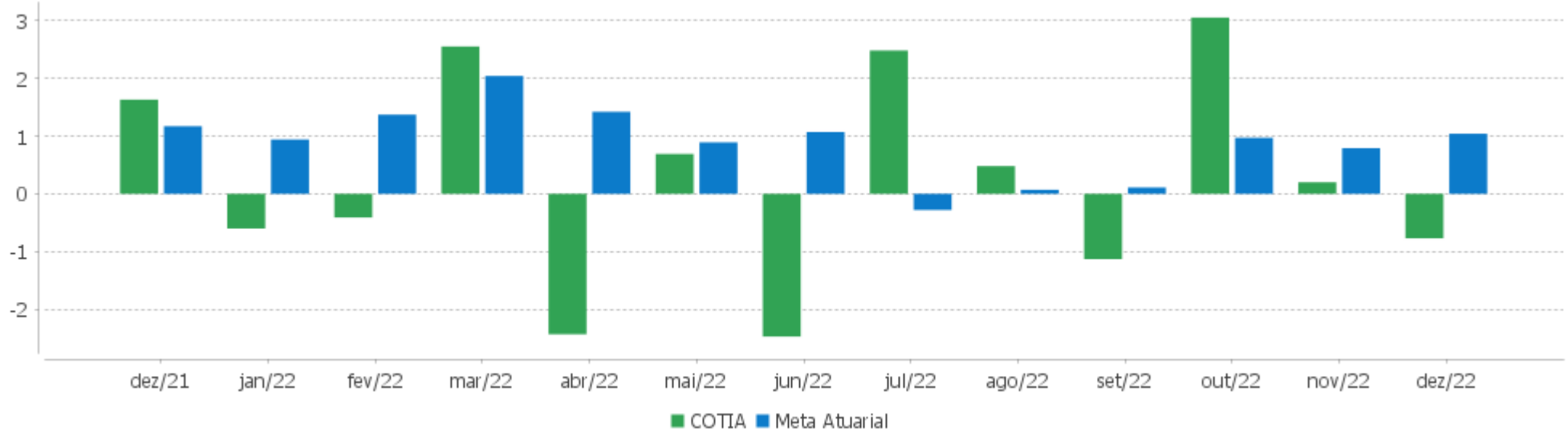


Patrimônio Líquido



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 (6,255000%) Var. IPCA p.p.	0,90 0,28	5,93 0,14	2,62 0,99	0,30 0,02	5,93 0,14		
NTN-B 150830 (5,685000%) Var. IPCA p.p.	0,85 0,23	5,58 -0,21	2,48 0,85	0,13 -0,15	5,58 -0,21		
NTN-B 150830 (6,080000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,26	8,96 3,17	2,57 0,95	3,23 2,94	8,96 3,17	20,33 3,90	25,69 4,00
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,24 -0,04	6,19 -0,17	0,10 -0,13	1,86 -0,07	6,19 -0,17	4,57 -0,45	10,91 -0,84
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,92 -0,02	9,67 -0,11	2,46 -0,07	2,96 -0,01	9,67 -0,11	14,40 -0,40	23,26 -0,76
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,22 -0,02	9,32 -0,02	2,42 0,17	2,69 0,36	9,32 -0,02	14,40 -0,38	23,46 -1,22
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,14 0,52	10,70 4,91	2,23 0,60	5,84 5,56	10,70 4,91	10,58 -5,85	17,95 -3,74
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,16 -0,02	11,73 -0,29	3,09 -0,07	6,56 -0,14	11,73 -0,29	14,68 -0,62	18,66 -1,07
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,91 -0,03	9,51 -0,27	2,44 -0,09	2,86 -0,12	9,51 -0,27	14,19 -0,61	23,07 -0,95
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,23 -0,01	9,04 -0,30	2,36 0,11	2,47 0,13	9,04 -0,30	14,12 -0,66	23,29 -1,38
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,22 -0,02	6,09 -0,28	0,17 -0,07	1,80 -0,14	6,09 -0,28	4,49 -0,54	10,90 -0,85
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,11 0,09	5,68 -0,69	0,33 0,09	2,03 0,09	5,68 -0,69	0,21 -4,82	7,47 -4,29
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,15 -0,02	11,74 -0,28	3,09 -0,06	6,56 -0,13	11,74 -0,28	14,76 -0,54	18,92 -0,80
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	-0,37 -0,99	7,83 2,04	-0,53 -2,16	2,43 2,14	7,83 2,04	12,71 -3,72	15,94 -5,75
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,25 -0,05	4,94 -1,43	-0,49 -0,72	0,73 -1,21	4,94 -1,43	3,40 -1,63	11,18 -0,57
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,12 99,92	12,59 101,73	3,22 100,61	6,67 100,91	12,59 101,73	17,79 102,78	20,62 100,29
BB PREV RF FLUXO FIC	1,03	11,26	2,95	6,09	11,26	14,89	16,78

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	92,01	91,00	92,16	92,12	91,00	86,04	81,63
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,15	12,67	3,25	6,70	12,67	17,85	20,69
% do CDI	102,35	102,40	101,77	101,28	102,40	103,09	100,66
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	1,15	11,81	2,65	5,57	11,81	18,52	23,39
% do CDI	102,07	95,47	82,77	84,23	95,47	106,98	113,78
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	-2,69	-3,35	-4,40	7,86	-3,35	-23,62	-18,14
Var. IBOVESPA p.p.	-0,25	-8,04	-4,13	-3,50	-8,04	-15,82	-13,02
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	-3,47	4,78	-4,19	7,18	4,78	-11,16	-9,04
Var. IBOVESPA p.p.	-1,02	0,10	-3,91	-4,18	0,10	-3,36	-3,93
FIA BRASIL IBX-50	-2,49	2,32	-1,29	9,96	2,32	-9,23	-7,87
Var. IBOVESPA p.p.	-0,04	-2,37	-1,01	-1,40	-2,37	-1,43	-2,76
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	-2,57	-0,75	-2,39	7,00	-0,75	-6,97	6,08
Var. IBOVESPA p.p.	-0,12	-5,44	-2,11	-4,36	-5,44	0,83	11,19
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	1,80	5,16	3,00	15,16	5,16	-3,78	-8,47
Var. IBOVESPA p.p.	4,24	0,48	3,27	3,80	0,48	4,02	-3,36
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	-2,42	8,49	0,12	7,07	8,49	-2,90	0,06
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,81	-4,16	-3,03	-0,64	-4,16	-8,32	-4,31
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-2,48	-3,47	-1,99	5,53	-3,47	-8,07	-2,57
Var. IBOVESPA p.p.	-0,03	-8,16	-1,71	-5,83	-8,16	-0,27	2,54
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	-2,14	-7,66	-7,43	7,45	-7,66	-28,75	-18,91
Var. IBOVESPA p.p.	0,31	-12,35	-7,15	-3,90	-12,35	-20,95	-13,80
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	-4,58	-13,32	8,56	5,46	-13,32	12,94	
Var. IBOVESPA p.p.	-2,14	-18,01	8,83	-5,89	-18,01	20,74	
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	-1,68	8,95	1,29	6,62	8,95	-5,11	-7,01
Var. IBOVESPA p.p.	0,76	4,27	1,56	-4,74	4,27	2,69	-1,90
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	-1,80	-8,69	-3,58	3,72	-8,69	-17,52	-20,12
Var. IBOVESPA p.p.	0,64	-13,38	-3,31	-7,64	-13,38	-9,72	-15,01
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	-3,07	-11,72	-7,10	11,22	-11,72	-23,24	-26,30
Var. SMALL CAP p.p.	-0,06	3,34	0,51	5,46	3,34	5,57	2,98
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	-2,13	4,71	-1,49	10,99	4,71	-12,72	-10,84
Var. IBOVESPA p.p.	0,32	0,02	-1,21	-0,37	0,02	-4,92	-5,73
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-4,80	-8,10	-10,28	0,31	-8,10		
Var. IBOVESPA p.p.	-2,36	-12,78	-10,01	-11,05	-12,78		
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-2,09	6,63	-1,72	6,74	6,63	-9,81	-16,96
Var. IBOVESPA p.p.	0,36	1,95	-1,45	-4,62	1,95	-2,01	-11,85
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-2,62	2,43	-1,12	9,89	2,43	-9,39	-7,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IGCT p.p.	-0,06	-1,11	-0,42	-0,66	-1,11	-1,72	-2,72
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	-3,65 -1,20	-1,79 -6,48	-4,24 -3,96	6,84 -4,52	-1,79 -6,48	-16,98 -9,18	-16,01 -10,90
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-4,79 -0,58	-28,54 -0,49	3,52 -0,42	-0,98 -0,37	-28,54 -0,49	-6,74 -2,90	44,34 -3,76
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	-4,67 -2,22	-30,39 -35,08	3,92 4,20	-0,79 -12,15	-30,39 -35,08	-6,78 1,02	34,65 39,77
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-4,90 2,36	-11,97 12,71	9,70 6,36	6,79 5,75	-11,97 12,71	16,92 14,29	30,01 -23,83
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-4,81 -2,36	-11,92 -16,61	9,53 9,80	6,69 -4,67	-11,92 -16,61	16,36 24,16	31,01 36,12
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI Var. S&P 500 p.p.	-4,81 2,44	-11,92 12,76	9,76 6,42	6,88 5,84	-11,92 12,76	16,92 14,28	32,04 -21,80
COTIA Var. IPCA + 4,88% p.p.	-0,77 -1,81	1,47 -9,46	2,46 -0,37	4,31 1,59	1,47 -9,46	4,47 -23,55	11,52 -28,78
CDI	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56
IBOVESPA	-2,45	4,69	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11
INPC + 6,00%	1,20	12,26	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46
IPCA + 6,00%	1,13	12,11	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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 IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	1,90
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA 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 IBOVESPA, 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	1,18	12,02	3,16	6,70	12,02	15,30	19,73	27,82	36,73
IRF-M 1+	1,62	7,41	1,10	6,63	7,41	2,06	10,68	26,44	41,95
IRF-M TOTAL	1,48	8,82	1,74	6,49	8,82	6,66	13,80	27,49	41,17
IMA-B 5	0,94	9,78	2,53	2,98	9,78	14,79	24,02	40,34	54,18
IMA-B 5+	-1,19	3,30	-1,72	1,24	3,30	-3,47	1,84	32,76	53,22
IMA-B TOTAL	-0,19	6,37	0,23	1,94	6,37	5,02	11,75	37,40	55,34
IMA-GERAL TOTAL	0,77	9,66	1,73	4,95	9,66	10,71	16,62	31,57	44,78
IDKA 2	1,24	9,34	2,25	2,34	9,34	14,78	24,67	39,41	53,01
IDKA 20	-3,32	-1,92	-5,66	0,71	-1,92	-16,13	-14,29	23,65	48,88
CDI	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,96

Renda Variável

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

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	-7,26	-24,68	3,34	1,04	-24,68	2,63	53,84	106,24	126,51

Investimentos Imobiliários

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

Investimentos no Exterior

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

Indicadores Econômicos

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

Meta Atuarial

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
635	01/12/2022	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	20.709.097,36	12.505.387,84907400	1,6560140000
636	01/12/2022	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	39.835.900,78	24.055.292,27409913	1,6560140000
638	01/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	91.888,66	0,00	38.200,20159800	2,4054496090
652	01/12/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	625.783,65	233.277,73859200	2,6825690860
640	02/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.397,75	996,33266300	2,4065757230
650	02/12/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	60.544.998,14	0,00	22.558.149,82065200	2,6839523020
641	06/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	26.683,69	11.077,46363700	2,4088266840
642	07/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	540,00	224,07109400	2,4099494020
643	08/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	800,00	331,80258500	2,4110722360
653	08/12/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	101.819,72	37.859,80255900	2,6893885630
644	12/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	29.057,65	12.040,57748500	2,4133103280
645	19/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	53.858,84	22.265,61205200	2,4189247470
637	20/12/2022	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	700.000,00	29.913,78721000	23,4005809790
639	20/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	633.149,82	0,00	261.628,63801100	2,4200325500
646	21/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	15.779,00	6.517,15811700	2,4211473340
651	21/12/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.353.353,99	0,00	500.951,66803500	2,7015659920
634	22/12/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	9.003.221,55	0,00	2.049.810,68803200	4,3922210000
647	27/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.371,91	3.039,06869500	2,4257135130
648	28/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	111.856,54	46.090,83448600	2,4268716600
654	28/12/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.102.480,05	1.145.444,22757300	2,7085387270
655	29/12/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	537.363,69	198.293,08524100	2,7099466900
649	30/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	55.458,24	22.830,27026200	2,4291538980
Total			71.626.612,16	65.916.248,87		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 26.480.351,40

Value-At-Risk: 2,88%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
COTIA		2,88	2,88			919.370.355,84	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,99%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150830 (5,685000%)		0,22	-0,00	0,23			41.626.784,41	4,53
NTN-B 150830 (6,080000%)		0,17	-0,00	0,14			8.768.889,55	0,95
NTN-B 150830 (6,255000%)		0,25	-0,00	0,26			40.285.121,13	4,38
Sub-total	1,43	0,21	-0,00		-0,17	0,87	90.680.795,09	9,86

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		0,12	0,00	0,01			3.108.456,49	0,34
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA		2,94	0,01	0,35			9.003.510,39	0,98
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,92	0,05	0,05			37.667.387,26	4,10
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,95	0,01	0,05			9.505.463,90	1,03
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,11	0,00	0,01			26.704.514,29	2,90
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,41	0,11	0,03			177.243.314,48	19,28
BB PREV RF IDKA2		1,48	0,01	0,39			26.363.141,49	2,87
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,52	0,04	0,40			72.613.224,23	7,90
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,43	0,01	0,02			10.926.527,72	1,19
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI		1,94	0,00	1,96			5.416.980,87	0,59
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,62	0,00	0,64			14.039.887,31	1,53
Sub-total	2,56	1,48	0,26		-0,10	0,86	392.592.408,43	42,70

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO		3,21	0,01	0,40			4.666.906,11	0,51
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,01	0,00	0,01			32.042.418,56	3,49
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	-0,00	0,01			74.448.676,44	8,10
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			453.890,15	0,05
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI		0,39	0,00	0,39			11.952.076,11	1,30
Sub-total	0,29	0,16	0,01		-0,19	1,07	123.563.967,37	13,44

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,79%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI		11,32	0,05	1,32			5.823.287,48	0,63
BB AÇÕES DIVIDENDOS		10,92	0,13	2,66			17.195.296,27	1,87
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES		10,44	0,04	3,31			5.409.494,53	0,59
FIA BRASIL IBX-50		11,49	0,09	2,02			10.603.122,73	1,15
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		11,35	0,04	1,73			4.630.872,31	0,50
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		11,26	0,17	0,19			19.593.655,85	2,13
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		11,91	0,03	5,52			3.734.832,84	0,41
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS		12,39	0,13	2,62			14.120.314,47	1,54
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		11,25	0,12	3,12			14.916.475,02	1,62
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		11,11	0,03	5,23			3.527.519,98	0,38
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		10,88	0,06	1,51			6.804.070,54	0,74
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA		10,74	0,28	13,46			30.734.566,62	3,34
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		12,22	0,08	4,13			8.744.380,01	0,95
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		13,55	0,06	5,88			5.863.641,03	0,64
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI		12,11	0,07	3,99			7.168.214,96	0,78
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		12,87	0,04	4,75			4.096.235,24	0,45
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA		13,83	0,03	2,11			2.718.235,97	0,30
Sub-total	16,35	9,79	1,44		-0,25	-2,96	165.684.215,85	18,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 11,47%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		11,36	0,15	13,77			14.834.744,68	1,61
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		11,49	0,59	7,74			58.892.739,35	6,41
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI		11,47	0,10	7,73			10.115.148,96	1,10
Sub-total	17,59	11,47	0,84		-0,34	-4,87	83.842.632,99	9,12

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,89%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		13,54	0,21	1,33			38.027.442,14	4,14
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		12,25	0,13	18,40			24.978.893,97	2,72
Sub-total	21,77	12,89	0,33		-0,27	-4,74	63.006.336,11	6,85