



CARAGUATATUBA
OUTUBRO 2021



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 29.10.2021.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 67,76%

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-M	3,34	-2,68	-5,78	15.547.032,02	2,94	4.936.979.120,19	0,31
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,57	-0,62	1,07	3.028.734,52	0,57	161.739.642,12	1,87
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,58	-2,56	-4,97	11.289.361,28	2,13	437.560.103,51	2,58
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,58	-0,52	1,00	9.503.696,86	1,80	6.857.913.148,95	0,14
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,61	-2,58	-4,98	15.789.617,51	2,98	6.948.438.281,62	0,23
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,59	-2,56	-5,00	43.928.491,50	8,30	4.811.776.336,97	0,91
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,65	-3,93	-10,45	20.924.757,05	3,96	985.822.490,63	2,12
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,68	-1,25	-1,25	4.386.078,63	0,83	1.192.878.203,57	0,37
ITAU	ITAU	ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	8,65	-3,88	-10,42	4.035.733,39	0,76	224.372.819,32	1,80
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,66	-3,98	-10,58	33.715.393,85	6,37	1.296.457.169,22	2,60
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	4,97	-3,49	-9,40	31.266.051,43	5,91	1.356.658.213,03	2,30
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,65	-1,29	1,46	11.379.748,88	2,15	11.036.712.361,17	0,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,35	-2,64	-5,68	4.714.519,30	0,89	1.295.006.190,43	0,36
BB	BB	BB PREV RF VII	1,59	-0,50	4,14	467.408,81	0,09	242.394.068,14	0,19
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,40	-0,66	-1,82	48.294.155,39	9,13	13.374.488.418,39	0,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,90	-2,48	-5,75	258.270.780,42	48,82		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,14	0,57	3,55	8.498.368,58	1,61	1.705.692.442,05	0,50
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,08	-3,46	-5,24	39.499.522,38	7,47	663.087.337,89	5,96
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,19	0,50	3,17	1.690.427,46	0,32	7.402.600.316,43	0,02
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,95	-0,36	1,96	49.477.403,18	9,35	2.956.661.982,44	1,67

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,80	-1,53	-0,90	99.165.721,60	18,74		
Artigo 7º VII, Alínea a (Cota Sênior de FIDC)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	11,42	0,05	-4,20	1.024.694,13	0,19	40.254.448,00	2,55
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			11,42	0,05	-8,25	1.024.694,13	0,19		
Renda Fixa			4,36	-2,21	-4,55	358.461.196,15	67,76		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

23,72%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,47	-7,87	-12,93	22.259.849,67	4,21	1.033.151.119,42	2,15
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			20,47	-7,87	-12,93	22.259.849,67	4,21		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	21,09	-8,62	-17,61	4.950.010,19	0,94	548.943.483,80	0,90
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	19,27	-4,81	-15,21	1.354.838,45	0,26	702.110.244,75	0,19
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	21,12	-12,54	-10,38	6.025.938,10	1,14	1.715.756.643,77	0,35
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	19,94	-8,78	-16,45	14.013.130,29	2,65	778.358.877,30	1,80
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	20,26	-6,80	-15,80	6.717.157,29	1,27	665.873.580,06	1,01
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,84	-4,31	-11,26	12.320.608,67	2,33	970.137.115,48	1,27
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	21,70	-1,31	-11,39	0,00	0,00	1.330.734.646,49	0,00
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,04	-7,54	-8,06	5.815.429,85	1,10	2.833.533.744,77	0,21
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	32,47	-10,54	-10,54	9.829.091,42	1,86	306.395.170,42	3,21
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			19,28	-8,36	-14,87	61.026.204,26	11,54		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	13,21	7,63	26,41	42.222.590,91	7,98	2.337.314.930,66	1,81
Sub-total Artigo 8º III			13,21	7,63	26,41	42.222.590,91	7,98		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			17,68	-3,50	-7,34	125.508.644,84	23,72		
--	--	--	--------------	--------------	--------------	-----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

8,52%

Artigo 9º A, II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16,90	7,86	7,86	1.617.887,40	0,31	2.132.488.277,70	0,08
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	13,50	7,65	7,65	1.614.820,95	0,31	779.750.780,24	0,21
Sub-total Artigo 9º A, II			12,72	7,76	7,76	3.232.708,35	0,61		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,17	10,93	29,48	41.830.897,32	7,91	3.720.209.176,93	1,12
Sub-total Artigo 9º A, III			17,17	10,93	29,48	41.830.897,32	7,91		
Investimentos no Exterior			17,14	10,70	29,21	45.063.605,67	8,52		
Total			5,73	-1,55	-4,07	529.033.446,66	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								Pró-Gestão Nível 1
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	258.270.780,42	48,82	20,00	40,00	80,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	99.165.721,60	18,74	10,00	19,50	35,00	0,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	1.024.694,13	0,19	0,00	0,50	1,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	358.461.196,15	67,76					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alinea a	Fundos de Ações Referenciados	22.259.849,67	4,21	0,00	5,00	10,00	0,00	35,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	61.026.204,26	11,54	5,00	15,00	20,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	42.222.590,91	7,98	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	125.508.644,84	23,72					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	3.232.708,35	0,61	0,00	5,00	5,00	0,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	41.830.897,32	7,91	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	45.063.605,67	8,52					10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-2,48 -515,91	-5,75 -191,64	-4,15 -307,58	-3,60 -157,17	-0,41 -12,24	-6.572.074,53	-17.152.341,30
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-1,53 -317,64	-0,90 -30,13	-1,17 -86,90	-0,09 -4,14	2,18 65,60	-1.536.896,52	-902.575,30
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	0,05 11,26	-8,25 -275,09	1,74 128,69	1,42 61,88	-8,23 -247,70	553,79	-58.664,59
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-7,87 -1,13	-12,93 0,10	-16,80 -1,77	-15,14 -2,19	9,20 -0,96	-1.901.031,98	-3.306.279,16
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-8,36 -1,63	-14,87 -1,83	-16,54 -1,51	-14,82 -1,88	3,65 -6,52	-5.570.837,89	-10.661.496,00
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	7,63 14,37	26,41 39,45	6,12 21,14	12,21 25,15		2.830.245,06	3.423.246,25
Artigo 9º A, II % do CDI	7,76 1.614,71	7,76 1.614,71				232.708,35	232.708,35
Artigo 9º A, III % do CDI	10,93 2.274,98	29,48 982,70	13,35 989,52	13,59 592,90	33,54 1.009,37	4.121.230,28	6.251.093,50
CARAGUATATUBA (Total)						-8.396.103,44	-22.174.308,25

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	16.208.145,23	0,00	0,00	0,00	15.789.617,51	-418.527,72	-827.628,65
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	21.780.423,15	0,00	0,00	0,00	20.924.757,05	-855.666,10	-2.640.379,06
BB PREV RF IRF-M	15.974.825,27	0,00	0,00	0,00	15.547.032,02	-427.793,25	-953.669,36
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	9.057.351,37	496.626,38	0,00	0,00	9.503.696,86	-50.280,89	63.277,83
BB PREV RF VII	469.739,84	0,00	0,00	0,00	467.408,81	-2.331,03	19.067,94
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11.528.728,90	0,00	0,00	0,00	11.379.748,88	-148.980,02	176.426,84
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	35.112.952,23	0,00	0,00	0,00	33.715.393,85	-1.397.558,38	-5.113.448,86
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	45.083.364,31	0,00	0,00	0,00	43.928.491,50	-1.154.872,81	-2.313.588,64
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	32.397.781,64	0,00	0,00	0,00	31.266.051,43	-1.131.730,21	-3.242.717,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.842.394,71	0,00	0,00	0,00	4.714.519,30	-127.875,41	-284.104,16
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	48.615.616,44	0,00	0,00	0,00	48.294.155,39	-321.461,05	-881.453,50
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	16.571.954,05	0,00	-5.000.000,00	0,00	11.289.361,28	-282.592,77	-702.876,45
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	4.198.852,38	0,00	0,00	0,00	4.035.733,39	-163.118,99	-469.348,38
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	1.738.076,08	3.973.575,51	-2.649.150,74	0,00	3.028.734,52	-33.766,33	173.399,52
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	4.441.598,20	0,00	0,00	0,00	4.386.078,63	-55.519,57	-55.519,57
					258.270.780,42	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.872.356,83	0,00	-191.111,54	0,00	1.690.427,46	9.182,17	62.737,27
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	49.653.823,26	0,00	0,00	0,00	49.477.403,18	-176.420,08	955.006,55
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	8.297.821,86	152.797,05	0,00	0,00	8.498.368,58	47.749,67	262.916,03
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	40.916.930,66	0,00	0,00	0,00	39.499.522,38	-1.417.408,28	-2.183.235,15
					99.165.721,60	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC ITALIA SENIOR	1.024.140,34	0,00	0,00	0,00	1.024.694,13	553,79	-58.664,59
					1.024.694,13	0,00	0,00

Artigo 8º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	24.160.881,65	0,00	0,00	0,00	22.259.849,67	-1.901.031,98	-3.306.279,16
					22.259.849,67	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1.423.370,14	0,00	0,00	0,00	1.354.838,45	-68.531,69	-243.055,41
BRADESCO F I A SELECTION	5.416.771,78	0,00	0,00	0,00	4.950.010,19	-466.761,59	-1.058.169,28
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	6.889.645,57	0,00	0,00	0,00	6.025.938,10	-863.707,47	-697.800,58
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	12.874.953,84	0,00	0,00	0,00	12.320.608,67	-554.345,17	-1.562.812,24
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	7.207.485,04	0,00	0,00	0,00	6.717.157,29	-490.327,75	-1.260.039,53
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	6.289.431,56	0,00	0,00	0,00	5.815.429,85	-474.001,71	-509.806,34
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	15.362.577,24	0,00	0,00	0,00	14.013.130,29	-1.349.446,95	-2.759.816,29
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	11.132.806,98	0,00	-10.986.961,31	0,00	0,00	-145.845,67	-1.412.126,44
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	0,00	10.986.961,31	0,00	0,00	9.829.091,42	-1.157.869,90	-1.157.869,90
					61.026.204,26	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	34.392.345,85	5.000.000,00	0,00	0,00	42.222.590,91	2.830.245,06	3.423.246,25
					42.222.590,91	0,00	0,00

Artigo 9º A, II

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.500.000,00	0,00	0,00	0,00	1.617.887,40	117.887,40	117.887,40
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	1.500.000,00	0,00	0,00	0,00	1.614.820,95	114.820,95	114.820,95
					3.232.708,35	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	37.709.667,04	0,00	0,00	0,00	41.830.897,32	4.121.230,28	6.251.093,50
					41.830.897,32	0,00	0,00

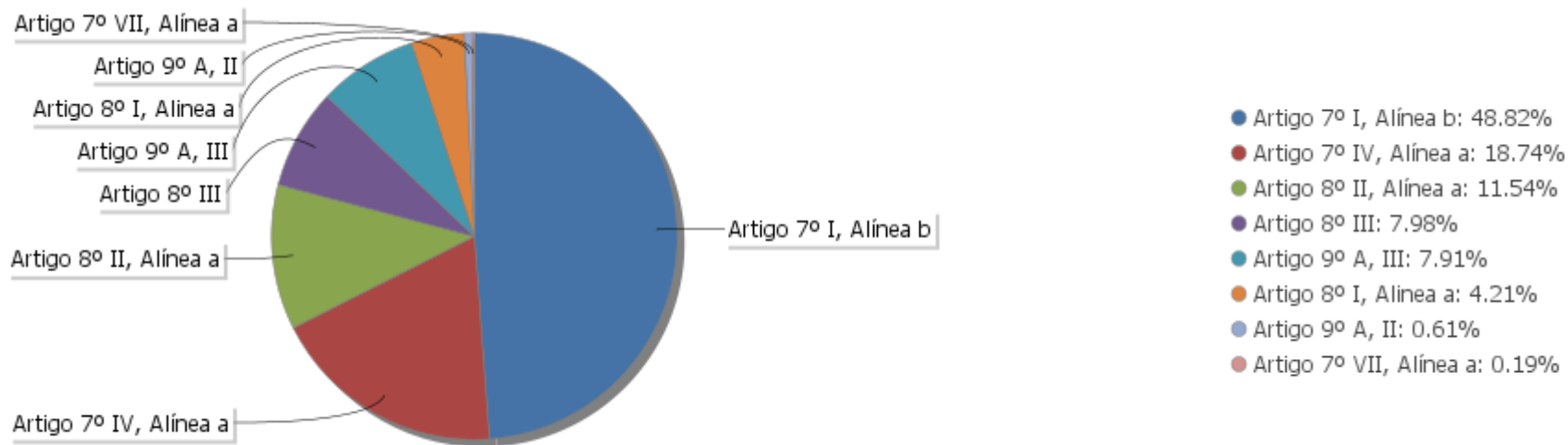
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

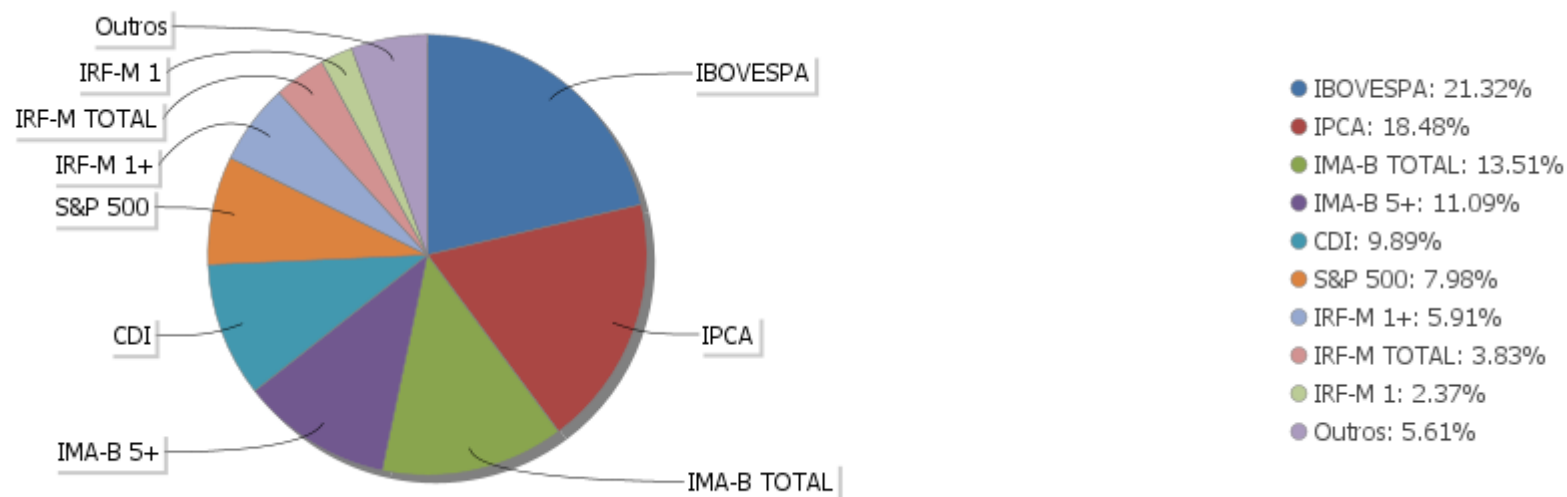
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	502.688.147,91	95,02	502.688.147,91	95,02
de 31 a 365 dias	25.320.604,62	4,79	528.008.752,53	99,81
acima de 365 dias	1.024.694,13	0,19	529.033.446,66	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

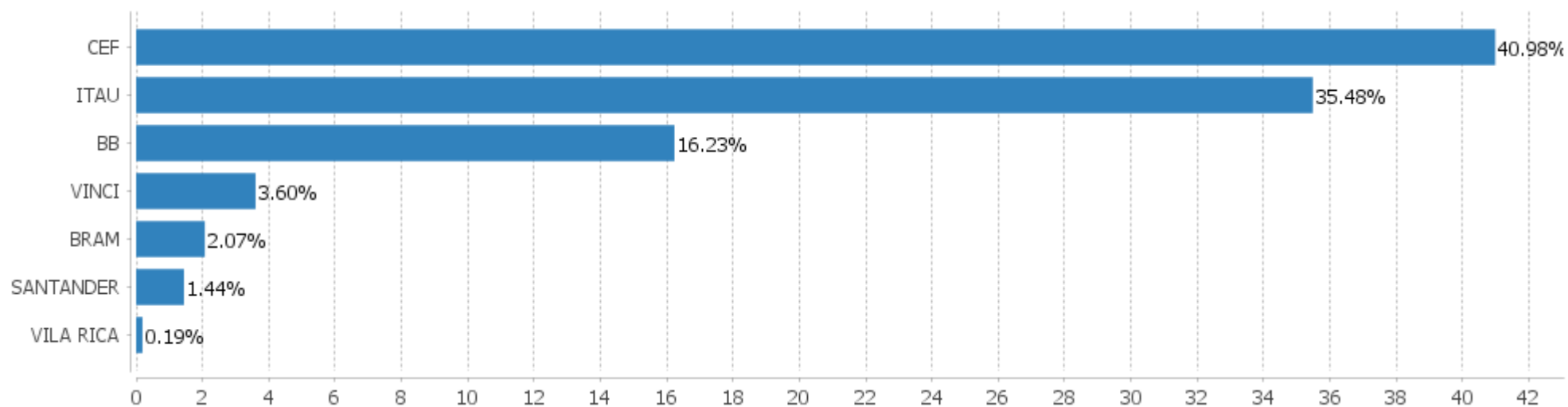


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,94	-1,45	0,38	1,02	1,49	0,37	-0,80	-0,98	-1,64	-1,55			-4,07
IPCA + 5,46%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,98	1,43	1,34	1,61	1,68			13,09
p.p. indexador	-1,61	-2,69	-1,04	0,29	0,21	-0,60	-2,23	-2,32	-3,25	-3,23			-17,16
2020	0,26	-1,20	-8,82	2,26	2,04	2,60	3,94	-1,32	-1,68	-0,06	3,29	4,43	5,12
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,65
p.p. indexador	-0,45	-1,86	-9,40	2,11	1,97	1,86	3,06	-2,04	-2,80	-1,40	1,94	2,58	-5,52
2019	1,51	0,37	0,41	0,94	1,99	2,58	1,16	0,11	1,85	2,11	-0,78	2,17	15,34
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	0,68	-0,53	-0,78	-0,12	1,35	2,13	0,44	-0,51	1,40	1,47	-1,75	0,52	4,75

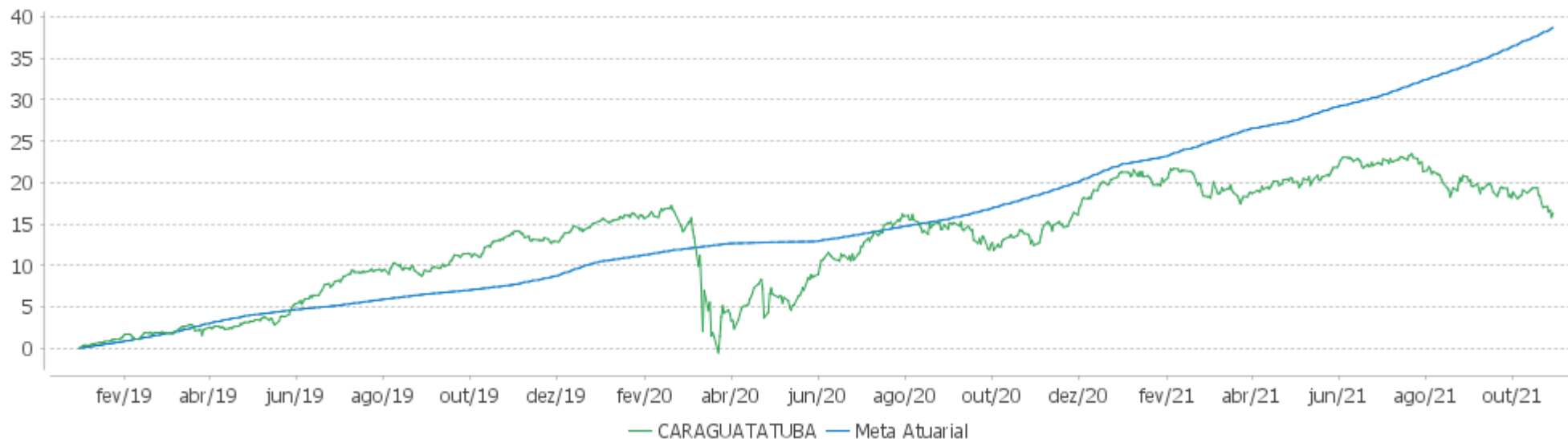
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

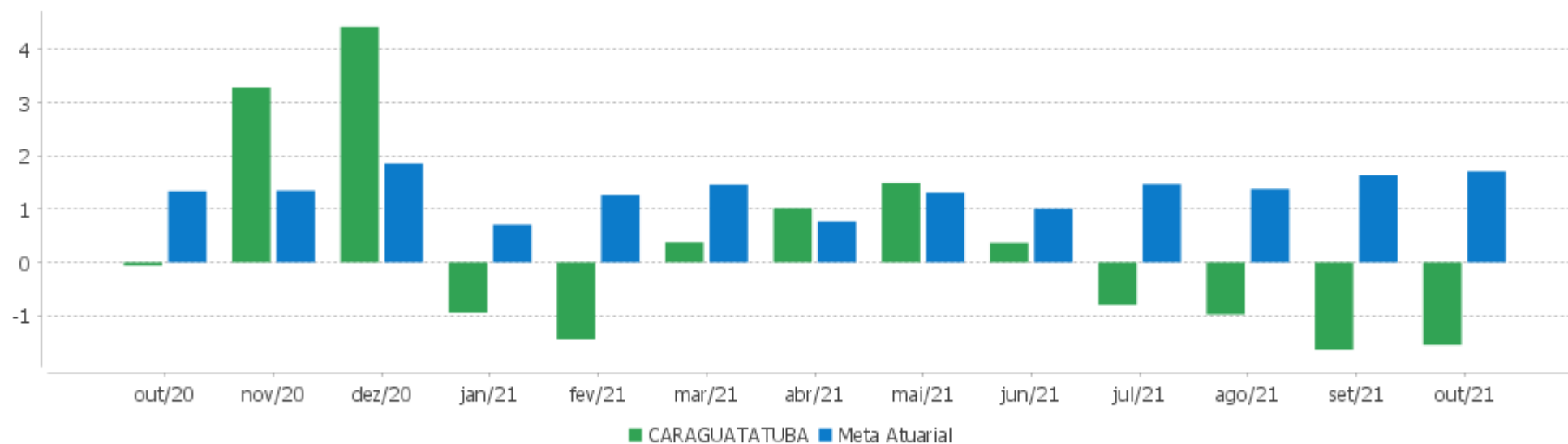
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	15	44,12	03 meses	-4,12	4,70	-8,82	6,48
Meses abaixo - Meta Atuarial	19	55,88	06 meses	-3,10	8,60	-11,71	5,73
			12 meses	3,48	16,75	-13,27	5,73
			24 meses	2,23	28,43	-26,20	10,00
Maior rentabilidade da Carteira	4,43	2020-12	Desde 31/12/2018	16,31	38,38	-22,07	8,57
Menor rentabilidade da Carteira	-8,82	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,57 119,25	3,55 118,45	1,64 121,39	2,79 121,86	3,91 117,54	6,89 103,55	13,37 100,71
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	-3,46 -721,10	-5,24 -174,61	-4,18 -310,04	-2,70 -117,99	1,51 45,38	1,09 16,34	30,01 225,99
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,50 104,67	3,17 105,67	1,53 113,52	2,55 111,29	3,70 111,46	6,36 95,60	12,78 96,27
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	-0,36 -1,61	1,96 -6,28	0,79 -2,53	1,51 -4,22	2,27 -8,40	5,61 -9,40	20,03 2,10
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	0,05 11,26	-4,20 -140,15	6,17 457,58	5,84 254,81	-4,18 -125,88	2.299,90 34.568,24	104.141,92 784.354,37
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	-0,62 -0,08	1,07 -0,17	0,06 -0,17	0,70 -0,13	1,60 -0,18	5,28 -0,63	12,60 -0,87
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,56 -0,02	-5,00 -0,22	-3,82 -0,09	-2,82 -0,14	1,58 -0,26	0,15 -0,66	26,66 -1,11
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-1,25 -0,01	1,05 -0,17	-0,15 -0,05	0,38 -0,11	4,21 -0,22	9,95 -0,44	24,83 -0,78
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	-0,52 0,02	1,00 -0,23	0,18 -0,05	0,70 -0,12	1,52 -0,26	5,24 -0,67	12,47 -1,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-2,64 -0,01	-5,68 -0,19	-3,61 -0,09	-3,73 -0,14	-3,52 -0,21	0,50 -0,49	14,90 -0,93
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-3,98 -0,11	-10,58 -0,33	-7,43 -0,24	-6,14 -0,29	-1,35 -0,33	-7,51 -0,70	26,13 -1,54
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-3,88 -0,01	-10,42 -0,17	-7,23 -0,04	-5,96 -0,11	-1,30 -0,29	-7,45 -0,64	26,17 -1,51
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	-3,49 -0,05	-9,40 -0,29	-5,35 -0,14	-5,88 -0,27	-6,24 -0,34	-2,10 -0,56	15,08 -1,05
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,56 -0,01	-4,97 -0,18	-3,78 -0,05	-2,78 -0,11	1,58 -0,25	0,31 -0,50	26,62 -1,15
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,50 2,05	4,14 8,93	1,25 4,99	3,04 5,71	6,63 4,80	11,48 10,67	23,11 -4,66
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,66 -1,91	-1,82 -10,05	-1,75 -5,07	-2,29 -8,02	0,30 -10,38	4,82 -10,19	24,02 6,09
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-1,29	1,46	-0,03	0,46	4,40	10,83	23,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IDKA 2 p.p.	0,17	-0,10	0,09	0,21	-0,22	-0,83	-1,67
BB PREV RF IRF-M	-2,68	-5,78	-3,67	-3,83	-3,60	0,38	14,87
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,05	-0,28	-0,14	-0,24	-0,30	-0,61	-0,95
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	-2,58	-4,98	-3,83	-2,83	1,60	0,29	26,82
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,04	-0,20	-0,10	-0,15	-0,23	-0,52	-0,94
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	-3,93	-10,45	-7,30	-6,06	-1,35	-7,32	26,58
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,05	-0,20	-0,11	-0,21	-0,34	-0,51	-1,09
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	7,63	26,41	6,12	12,21	44,35	52,17	76,53
Var. S&P 500 p.p.	-3,29	-6,73	-9,33	-2,82	6,65	-61,50	-81,25
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-7,87	-12,93	-16,80	-15,14	9,20	-3,27	21,36
Var. IBOVESPA p.p.	-1,13	0,10	-1,77	-2,19	-0,96	0,20	2,97
BRADESCO F I A SELECTION	-8,62	-17,61	-18,09	-15,68	-3,81	-16,16	2,60
Var. IBOVESPA p.p.	-1,88	-4,57	-3,06	-2,74	-13,98	-12,69	-15,79
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	-11,28	-20,34	-19,37	-17,52	-3,43	-6,99	19,52
Var. IBOVESPA p.p.	-4,54	-7,31	-4,34	-4,57	-13,59	-3,52	1,13
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	-6,80	-15,80	-16,70	-15,60	3,76	-1,13	44,50
Var. IBOVESPA p.p.	-0,06	-2,76	-1,68	-2,65	-6,41	2,34	26,11
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-7,54	-8,06	-15,47	-11,98	9,73	-3,63	30,82
Var. IBOVESPA p.p.	-0,80	4,98	-0,45	0,97	-0,44	-0,16	12,43
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-4,31	-11,26	-11,69	-11,00	10,90	-0,23	41,49
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,07	-2,55	-2,71	-3,45	-2,87	-1,98	-0,17
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	-8,78	-16,45	-17,48	-16,72	2,98	-6,40	18,83
Var. IBOVESPA p.p.	-2,05	-3,42	-2,45	-3,77	-7,18	-2,93	0,44
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-10,54	-10,54					
Var. IBOVESPA p.p.	-2,80	-2,80					
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-4,81	-15,21	-14,06	-14,31	3,72	-15,44	6,24
Var. IBOVESPA p.p.	1,92	-2,17	0,96	-1,37	-6,44	-11,97	-12,15
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	-12,54	-10,38	-18,27	-13,75	5,56	-0,00	37,64
Var. IBOVESPA p.p.	-5,80	2,66	-3,25	-0,80	-4,60	3,47	19,25
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	7,86	25,08	10,73	9,22	31,15	112,42	
% do CDI	1.635,99	836,12	795,22	402,06	937,40	1.689,70	
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	7,65	25,27	4,78	12,49	42,40		
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,31	0,05	-8,59	1,61	10,17		
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	10,93	29,48	13,35	13,59	33,54	114,42	160,27
Var. IBOVESPA p.p.	17,67	42,52	28,37	26,54	23,38	117,89	141,88
CARAGUATATUBA	-1,55	-4,07	-4,12	-3,10	3,48	2,23	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 5,89% p.p.	-3,26	-17,54	-8,92	-11,93	-13,66	-26,61	
CDI	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28
IBOVESPA	-6,74	-13,04	-15,02	-12,95	10,16	-3,47	18,39
INPC + 6,00%	1,63	13,79	4,79	9,12	17,69	30,64	42,02
IPCA + 6,00%	1,72	13,57	4,83	8,88	17,26	29,10	40,32

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	-0,54	1,23	0,23	0,83	1,78	5,91	13,47	21,48	36,42
IRF-M 1+	-3,44	-9,10	-5,21	-5,61	-5,90	-1,54	16,13	28,17	50,67
IRF-M TOTAL	-2,63	-5,50	-3,53	-3,59	-3,30	0,99	15,83	26,75	47,22
IMA-B 5	-1,24	1,22	-0,10	0,49	4,43	10,39	25,61	37,29	55,80
IMA-B 5+	-3,87	-10,25	-7,19	-5,85	-1,01	-6,80	27,68	41,57	63,18
IMA-B TOTAL	-2,54	-4,79	-3,73	-2,67	1,83	0,81	27,76	40,92	61,47
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-1,35	-2,10	-1,67	-0,96	0,67	2,85	17,88	28,05	46,14
IMA-GERAL TOTAL	-1,31	-1,68	-1,71	-0,86	1,05	3,75	19,11	29,71	47,78
IDKA 2	-1,47	1,56	-0,12	0,25	4,62	11,66	25,12	37,32	56,68
IDKA 20	-6,31	-17,52	-13,17	-11,45	-5,06	-17,66	27,75	43,34	67,23
CDI	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28	20,70	34,10

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-6,74	-13,04	-15,02	-12,95	10,16	-3,47	18,39	39,29	59,42
IBRX 100	-6,81	-12,40	-16,15	-14,19	10,40	-1,79	22,56	43,44	64,83
IBRX 50	-6,27	-12,20	-16,31	-13,99	11,64	-2,23	17,51	38,33	58,04
SMALL CAP	-12,53	-17,37	-21,28	-20,14	3,62	-2,77	38,93	46,64	90,99
IFIX	-1,47	-6,78	-5,26	-6,48	-3,29	-4,17	19,32	20,19	41,88
Índice Consumo - ICON	-9,73	-20,10	-18,41	-17,11	-8,62	-10,39	29,95	16,52	35,92
Índice Dividendos - IDIV	-4,23	-8,71	-8,99	-7,55	13,78	1,74	41,65	49,00	84,75

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	1,25	8,24	3,32	5,73	10,67	15,01	17,92	23,30	26,63
INPC	1,16	8,45	3,27	5,96	11,08	16,38	19,35	24,13	26,41
IGPM	0,64	16,74	0,66	6,24	21,73	47,21	51,84	68,23	65,87
SELIC	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28	20,71	34,13

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	10,92	33,14	15,45	15,03	37,70	113,67	157,78	207,96	284,24
MSCI ACWI	8,97	25,22	13,38	10,89	32,23	96,53	133,44	158,41	221,64
MSCI World	9,54	28,15	13,97	12,82	35,37	100,32	138,32	168,41	233,05

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,57	11,80	4,33	7,84	15,06	24,32	32,57	44,11	53,90
IPCA + 5,00%	1,64	12,68	4,58	8,36	16,16	26,70	36,41	49,70	61,40
IPCA + 5,50%	1,68	13,13	4,71	8,62	16,71	27,90	38,35	52,55	65,25
IPCA + 5,89%	1,71	13,47	4,80	8,82	17,14	28,84	39,89	54,81	68,31
IPCA + 6,00%	1,72	13,57	4,83	8,88	17,26	29,10	40,32	55,45	69,18
INPC + 4,00%	1,48	12,02	4,29	8,08	15,49	25,80	34,17	45,08	53,62
INPC + 6,00%	1,63	13,79	4,79	9,12	17,69	30,64	42,02	56,50	68,89

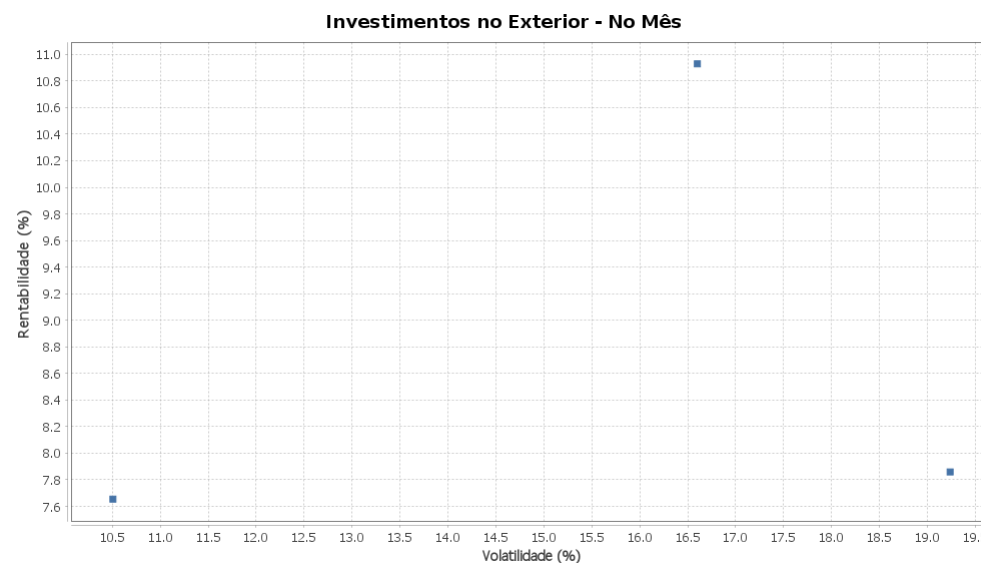
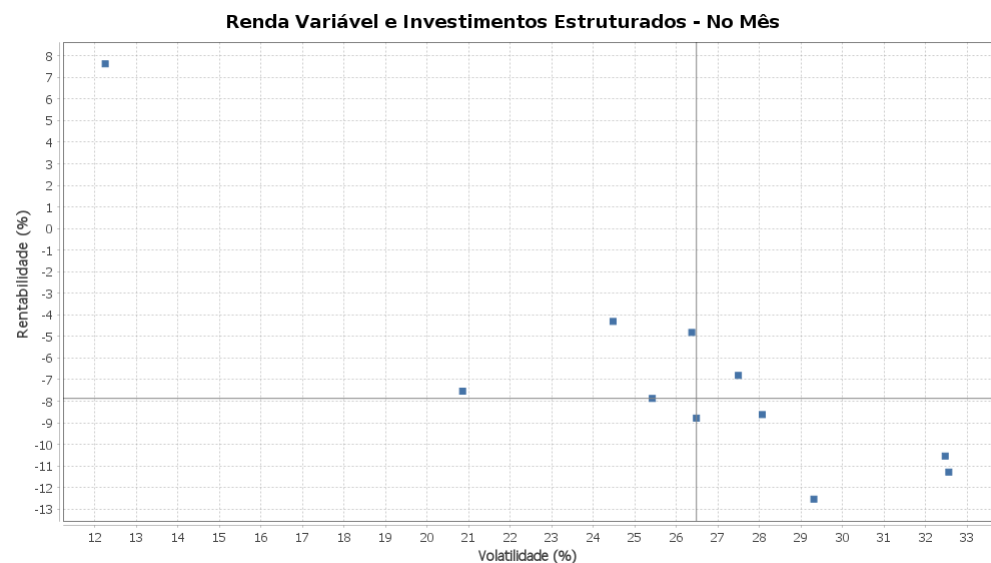
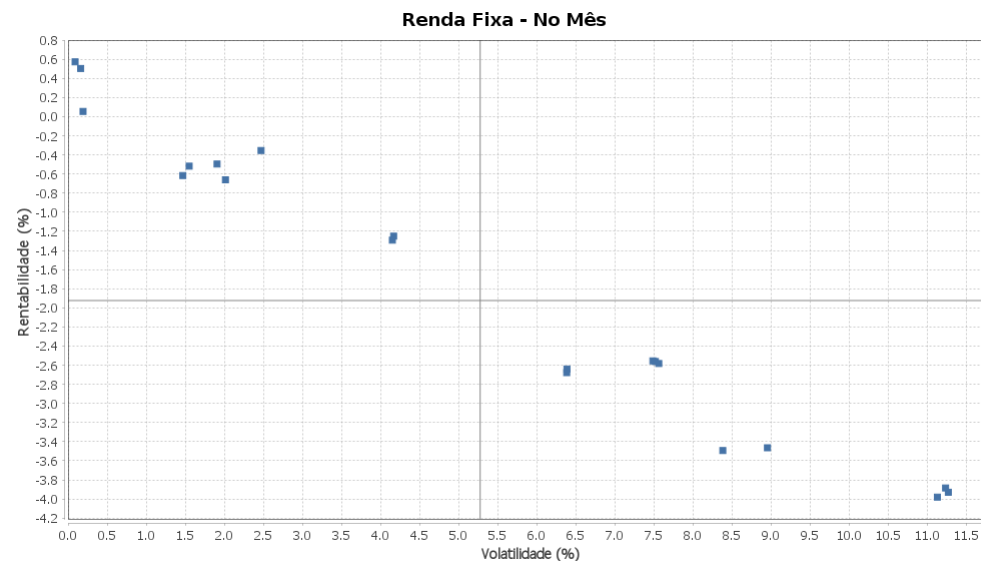
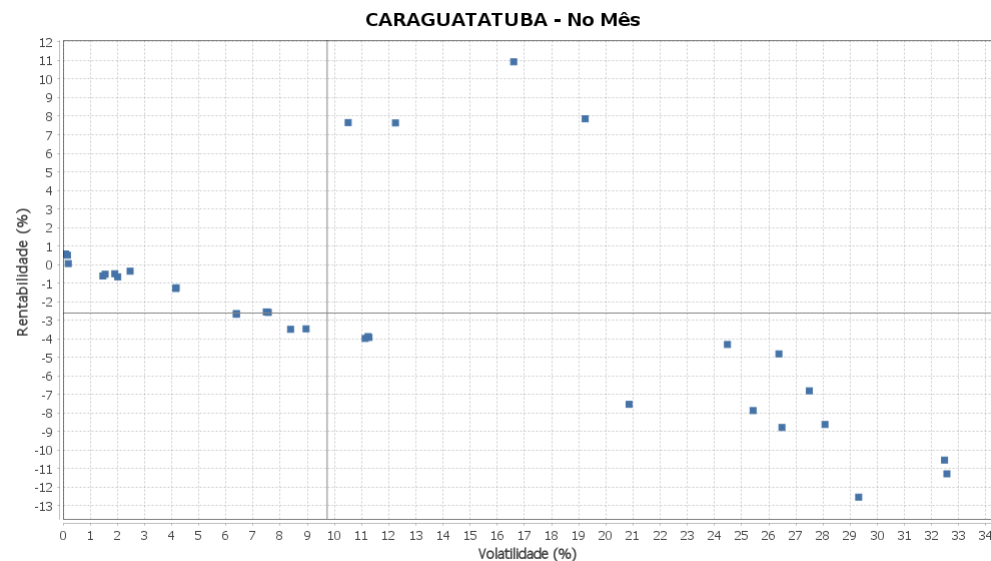
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
167	01/10/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	400,00	0,00	11,64687000	34,3439930000
168	07/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.207,61	0,00	796,80101300	2,7705913570
169	07/10/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	47.000,00	12.225,98508400	3,8442710000
170	08/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	163.293,06	0,00	58.882,86272200	2,7731848020
171	08/10/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	292.829,51	0,00	8.516,82711000	34,3824650000
172	11/10/2021	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	10.986.961,31	0,00	423.571,00644000	25,9388890000
173	11/10/2021	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	0,00	10.986.961,31	423.571,00644000	25,9388890000
174	13/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.314,51	0,00	834,38873700	2,7738988990
175	13/10/2021	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	0,00	5.000.000,00	132.399,37754000	37,7645280000
176	14/10/2021	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	5.000.000,00	0,00	222.210,42038000	22,5011950000
177	14/10/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	24.084,20	0,00	7,31172000	3.293,9160300000
178	20/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	12.309,62	0,00	4.444,54841900	2,7695997070
179	20/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	316.501,58	0,00	114.277,01237800	2,7695997070
180	20/10/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	3.679.546,00	0,00	107.086,09472000	34,3606330000
181	25/10/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	112.571,49	0,00	34,10768000	3.300,4733831208
182	27/10/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	144.111,54	37.371,44457900	3,8561940000
183	27/10/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,00	2.649.150,74	77.501,68757000	34,1818460000
184	27/10/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	13.737,00	0,00	4,16004000	3.302,1316200000
185	28/10/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	800,00	0,00	23,39310000	34,1981210000
186	28/10/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.404,36	0,00	0,72786000	3.303,3275629929
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 13.771.012,08

Value-At-Risk: 2,60%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,09	0,06	-0,00	1,02	0,57	8.498.368,58	1,61
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,16	0,06	0,00	0,14	0,50	1.690.427,46	0,32
FIDC ITALIA SENIOR	Artigo 7º VII, Alínea a	0,19	0,29	0,00	-2,22	0,05	1.024.694,13	0,19
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,47	0,54	-0,00	-0,75	-0,62	3.028.734,52	0,57
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,55	0,56	0,00	-0,64	-0,52	9.503.696,86	1,80
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,91	0,81	0,00	-0,51	-0,50	467.408,81	0,09
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,42	0,08	-0,57	-0,66	48.294.155,39	9,13
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	2,47	0,61	0,03	-0,34	-0,36	49.477.403,18	9,35
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,15	1,56	0,02	-0,43	-1,29	11.379.748,88	2,15
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,17	1,43	0,01	-0,42	-1,25	4.386.078,63	0,83
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	6,38	1,75	0,03	-0,49	-2,68	15.547.032,02	2,94
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,39	1,74	0,01	-0,49	-2,64	4.714.519,30	0,89
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	7,49	2,74	0,04	-0,41	-2,56	11.289.361,28	2,13
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,52	2,75	0,16	-0,40	-2,56	43.928.491,50	8,30
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,56	2,76	0,06	-0,40	-2,58	15.789.617,51	2,98
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	8,38	2,23	0,09	-0,47	-3,49	31.266.051,43	5,91
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	8,95	2,89	0,15	-0,44	-3,46	39.499.522,38	7,47
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	Artigo 9º A, II	10,51	5,05	0,01	0,68	7,65	1.614.820,95	0,31
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	11,13	3,75	0,17	-0,40	-3,98	33.715.393,85	6,37
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	Artigo 7º I, Alínea b	11,23	3,75	0,02	-0,39	-3,88	4.035.733,39	0,76
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	11,27	3,79	0,11	-0,39	-3,93	20.924.757,05	3,96
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	Artigo 8º III	12,25	6,49	0,30	0,58	7,63	42.222.590,91	7,98
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	16,60	6,69	-0,05	0,63	10,93	41.830.897,32	7,91
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	19,24	7,39	-0,01	0,38	7,86	1.617.887,40	0,31
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	20,85	8,01	0,08	-0,38	-7,54	5.815.429,85	1,10
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	24,48	9,50	0,19	-0,20	-4,31	12.320.608,67	2,33
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	25,42	10,37	0,38	-0,33	-7,87	22.259.849,67	4,21
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	26,37	9,90	0,02	-0,20	-4,81	1.354.838,45	0,26

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	26,48	10,60	0,25	-0,35	-8,78	14.013.130,29	2,65
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	27,49	9,95	0,11	-0,26	-6,80	6.717.157,29	1,27
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	28,07	11,47	0,09	-0,32	-8,62	4.950.010,19	0,94
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	29,31	12,56	0,12	-0,44	-12,54	6.025.938,10	1,14
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	Artigo 8º II, Alínea a	32,47	12,64	0,15	-0,34	-10,54	9.829.091,42	1,86
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	32,56	NaN	0,00	-0,36	-11,28	0,00	0,00