



CARAGUATATUBA
4º TRIMESTRE 2021



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.12.2021.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **66,58%**

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,900000%)	4,14	0,39	0,39	38.112.344,74	6,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822 (6,090000%)	4,17	0,34	0,34	15.431.109,58	2,82
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,11	0,39	0,39	53.543.454,32	9,77

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	3,52	1,88	0,93	16.124.140,18	2,94	4.897.855.877,38	0,33
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,64	0,84	1,08	359.354,25	0,07	142.521.365,80	0,25
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,75	0,21	1,01	11.702.304,81	2,13	393.080.062,36	2,98
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,64	0,84	1,10	10.992.934,25	2,01	6.208.104.156,65	0,18
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,79	0,20	0,97	16.366.053,99	2,99	7.081.253.604,41	0,23
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,76	0,21	1,00	45.534.437,80	8,31	4.689.992.155,11	0,97
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	9,05	-0,33	0,01	21.782.065,96	3,97	1.022.290.416,95	2,13
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,77	0,77	1,98	4.529.481,21	0,83	1.144.893.205,94	0,40
ITAU	ITAU	ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	9,05	-0,36	0,03	4.200.131,05	0,77	246.014.699,70	1,71
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,99	-0,34	-0,14	35.062.910,60	6,40	1.353.637.713,77	2,59
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	5,10	2,27	0,86	32.675.659,51	5,96	1.203.780.064,86	2,71
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,76	0,72	1,82	11.738.583,84	2,14	10.998.710.156,34	0,11
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,52	1,87	0,97	4.889.433,76	0,89	1.233.687.856,77	0,40
BB	BB	BB PREV RF VII	1,63	0,58	1,82	478.291,11	0,09	248.037.532,98	0,19
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,33	0,83	1,07	49.134.040,19	8,96	12.561.638.596,69	0,39
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,99	0,64	0,80	265.569.822,51	48,45		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,17	0,80	2,02	3.494.021,36	0,64	1.663.005.755,26	0,21
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,30	0,08	0,37	25.719.964,84	4,69	625.914.328,31	4,11
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,20	0,75	1,89	13.287.330,18	2,42	8.765.736.063,59	0,15
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,10	0,86	2,16	2.449.310,46	0,45	2.626.754.965,66	0,09
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,98	0,43	1,31	44.950.626,84	8,20		

Artigo 7º VII, Alínea a (Cota Sênior de FIDC)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	11,37	0,47	0,83	930.827,37	0,17	40.395.435,01	2,30
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			11,37	0,47	0,83	930.827,37	0,17		
Renda Fixa			4,46	0,64	1,00	364.994.731,04	66,58		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

24,22%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,64	3,44	-6,39	22.617.348,87	4,13	994.621.415,62	2,27
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			20,64	3,44	-6,39	22.617.348,87	4,13		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	21,47	2,00	-8,61	4.950.175,70	0,90	535.410.218,31	0,92
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	19,41	1,63	-5,04	1.351.577,93	0,25	681.956.137,29	0,20
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	22,59	3,89	-12,01	6.062.240,71	1,11	1.419.483.989,90	0,43
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	20,34	1,88	-8,98	13.982.271,75	2,55	723.867.535,77	1,93
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	20,64	0,06	-6,16	6.763.424,74	1,23	668.180.768,94	1,01
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,72	-0,32	-3,49	12.425.705,45	2,27	924.501.793,20	1,34
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	17,92	0,97	-7,99	5.787.099,75	1,06	2.631.453.374,95	0,22
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	27,04	-1,60	-15,03	9.335.972,60	1,70	297.006.334,02	3,14
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			19,74	0,78	-8,92	60.658.468,63	11,07		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	13,41	5,54	13,02	49.476.009,96	9,03	2.374.573.482,34	2,08
Sub-total Artigo 8º III			13,41	5,54	13,02	49.476.009,96	9,03		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			17,46	2,97	-1,79	132.751.827,46	24,22		
--	--	--	--------------	-------------	--------------	-----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

9,20%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16,28	0,89	6,63	1.599.430,07	0,29	2.180.881.081,62	0,07
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	14,05	5,61	11,28	1.669.255,25	0,30	900.729.355,99	0,19
Sub-total Artigo 9º A, II			13,60	3,24	8,96	3.268.685,32	0,60		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,57	1,70	11,81	47.153.904,89	8,60	3.890.658.229,39	1,21
Sub-total Artigo 9º A, III			17,57	1,70	11,81	47.153.904,89	8,60		
Investimentos no Exterior			17,45	1,80	11,60	50.422.590,21	9,20		
Total			5,82	1,32	1,12	548.169.148,71	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 a	Títulos do Tesouro Nacional	53.543.454,32	9,77	0,00	5,00	10,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	265.569.822,51	48,45	20,00	40,00	80,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	44.950.626,84	8,20	10,00	19,50	35,00	0,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	930.827,37	0,17	0,00	0,50	1,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	364.994.731,04	66,58					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alinea a	Fundos de Ações Referenciados	22.617.348,87	4,13	0,00	5,00	10,00	0,00	35,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	60.658.468,63	11,07	5,00	15,00	20,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	49.476.009,96	9,03	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	132.751.827,46	24,22					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	3.268.685,32	0,60	0,00	5,00	5,00	0,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	47.153.904,89	8,60	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	50.422.590,21	9,20					10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,39 139,08	0,39 139,08				198.369,69	198.369,69
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,64 83,26	0,80 43,56	0,80 43,56	-1,46 -47,33	-2,58 -58,66	1.672.820,58	2.100.217,28
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,43 55,96	1,31 71,34	1,31 71,34	1,70 54,98	1,95 44,45	-44.585.680,36	-43.756.407,01
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	0,47 62,02	0,83 44,82	0,83 44,82	3,03 98,00	-7,54 -171,65	-925.960,62	-922.373,67
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	3,44 0,59	-6,39 -0,84	-6,39 -0,84	-19,00 -1,66	-11,53 0,39	-21.865.425,95	-24.160.881,65
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,78 -2,07	-8,92 -3,37	-8,92 -3,37	-20,30 -2,97	-15,39 -3,46	-60.186.801,93	-66.597.042,15
Artigo 8º III % do CDI	5,54 726,20	13,02 707,02	13,02 707,02	14,30 463,36	32,74 744,96	-46.876.731,25	-44.392.345,85
Artigo 9º A, II % do CDI	3,24 424,72	8,96 486,30	8,96 486,30			102.673,74	268.685,32
Artigo 9º A, III % do CDI	1,70 222,99	11,81 641,32	11,81 641,32	20,44 662,12	30,51 694,13	789.443,06	4.444.237,85
CARAGUATATUBA (Total)						-171.677.293,04	-172.817.540,19

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150523 (5,900000%)	0,00	37.965.926,42	0,00	0,00	38.112.344,74	146.418,32	146.418,32
NTN-B 150822 (6,090000%)	0,00	15.379.158,21	0,00	0,00	15.431.109,58	51.951,37	51.951,37
					53.543.454,32	0,00	0,00

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	16.332.835,50	0,00	0,00	0,00	16.366.053,99	33.218,49	157.908,76
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	21.853.415,78	0,00	0,00	0,00	21.782.065,96	-71.349,82	1.642,81
BB PREV RF IRF-M	15.827.111,00	0,00	0,00	0,00	16.124.140,18	297.029,18	149.314,91
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	10.130.818,85	772.744,85	0,00	0,00	10.992.934,25	89.370,55	114.753,50
BB PREV RF VII	475.520,34	0,00	0,00	0,00	478.291,11	2.770,77	8.551,27
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11.654.703,62	0,00	0,00	0,00	11.738.583,84	83.880,22	209.854,94
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	35.183.187,52	0,00	0,00	0,00	35.062.910,60	-120.276,92	-50.041,63
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	45.439.313,54	0,00	0,00	0,00	45.534.437,80	95.124,26	451.073,49
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	31.951.169,85	0,00	0,00	0,00	32.675.659,51	724.489,66	277.877,87
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.799.621,73	0,00	0,00	0,00	4.889.433,76	89.812,03	47.039,05
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	48.731.669,83	0,00	0,00	0,00	49.134.040,19	402.370,36	518.423,75
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	11.678.308,71	0,00	0,00	0,00	11.702.304,81	23.996,10	130.350,76
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	4.215.176,46	0,00	0,00	0,00	4.200.131,05	-15.045,41	1.278,67
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	355.972,43	400,00	0,00	0,00	359.354,25	2.981,82	-5.693,88
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	4.495.031,92	0,00	0,00	0,00	4.529.481,21	34.449,29	87.883,01
					265.569.822,51	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.606.287,16	8.193.135,92	-578.960,84	0,00	13.287.330,18	66.867,94	95.507,28
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	40.234.899,74	0,00	-37.965.926,42	0,00	2.449.310,46	180.337,14	761.413,62
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	8.577.797,24	106.575,40	-5.244.325,52	0,00	3.494.021,36	53.974,24	155.106,54
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	41.035.355,89	0,00	-15.379.158,21	0,00	25.719.964,84	63.767,16	182.192,39
					44.950.626,84	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea a (Cota Sênior de FIDC)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIDC ITALIA SENIOR	1.027.727,29	0,00	0,00	101.766,67	930.827,37	4.866,75	8.453,70
					930.827,37	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21.865.425,95	0,00	0,00	0,00	22.617.348,87	751.922,92	-1.543.532,78
					22.617.348,87	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1.329.940,90	0,00	0,00	0,00	1.351.577,93	21.637,03	-71.792,21
BRADESCO F I A SELECTION	4.852.908,95	0,00	0,00	0,00	4.950.175,70	97.266,75	-466.596,08
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	5.835.099,37	0,00	0,00	0,00	6.062.240,71	227.141,34	-827.404,86
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	12.466.111,23	0,00	0,00	0,00	12.425.705,45	-40.405,78	-449.248,39
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	6.759.501,78	0,00	0,00	0,00	6.763.424,74	3.922,96	-444.060,30
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	5.731.446,69	0,00	0,00	0,00	5.787.099,75	55.653,06	-502.331,81
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	13.724.324,31	0,00	0,00	0,00	13.982.271,75	257.947,44	-1.380.305,49
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	9.487.468,70	0,00	0,00	0,00	9.335.972,60	-151.496,10	-1.650.988,72
					60.658.468,63	0,00	0,00

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	46.876.731,25	0,00	0,00	0,00	49.476.009,96	2.599.278,71	5.083.664,11
					49.476.009,96	0,00	0,00

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.585.370,94	0,00	0,00	0,00	1.599.430,07	14.059,13	99.430,07
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	1.580.640,64	0,00	0,00	0,00	1.669.255,25	88.614,61	169.255,25
					3.268.685,32	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	46.364.461,83	0,00	0,00	0,00	47.153.904,89	789.443,06	4.444.237,85
					47.153.904,89	0,00	0,00

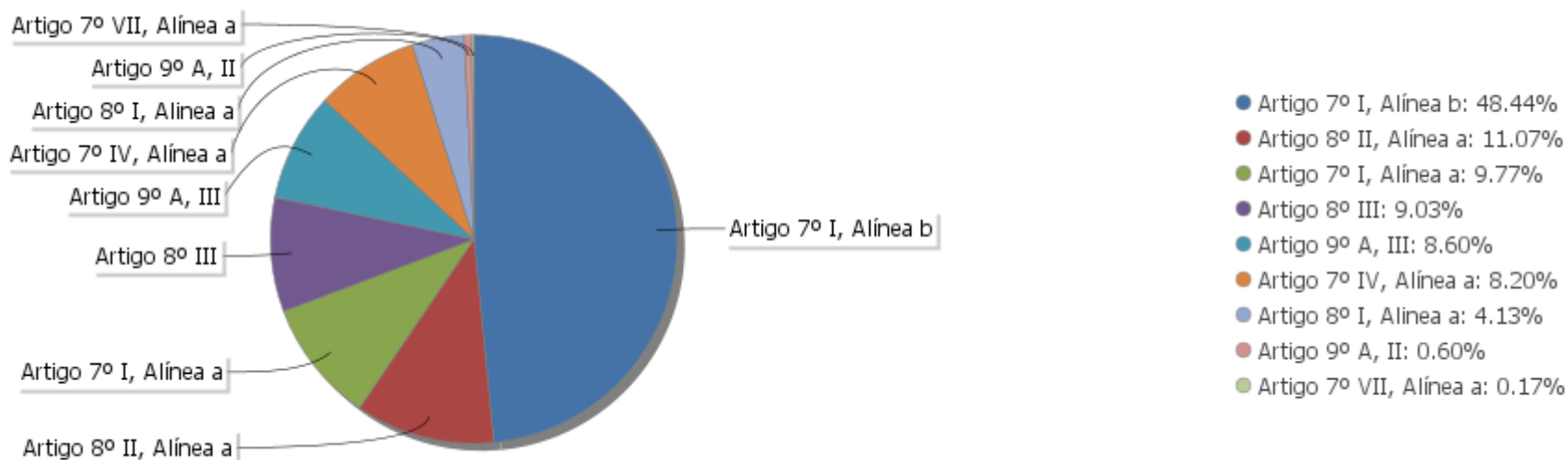
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

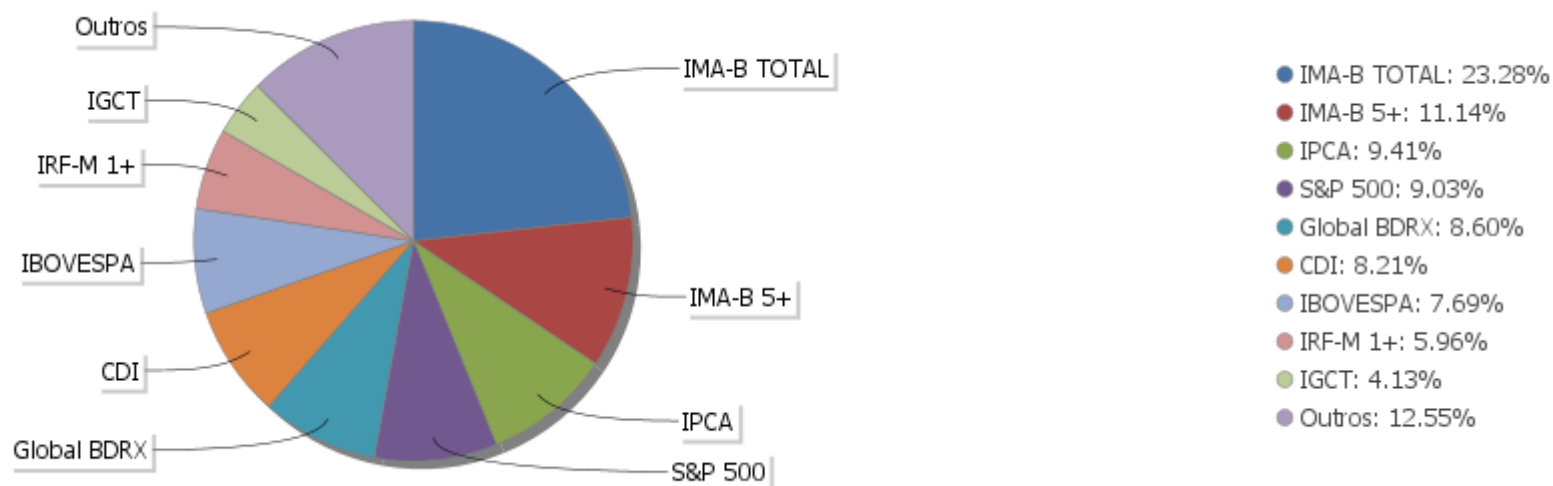
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	468.240.345,97	85,42	468.240.345,97	85,42
de 31 a 365 dias	41.816.458,00	7,63	510.056.803,97	93,05
acima de 365 dias	38.112.344,74	6,95	548.169.148,71	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

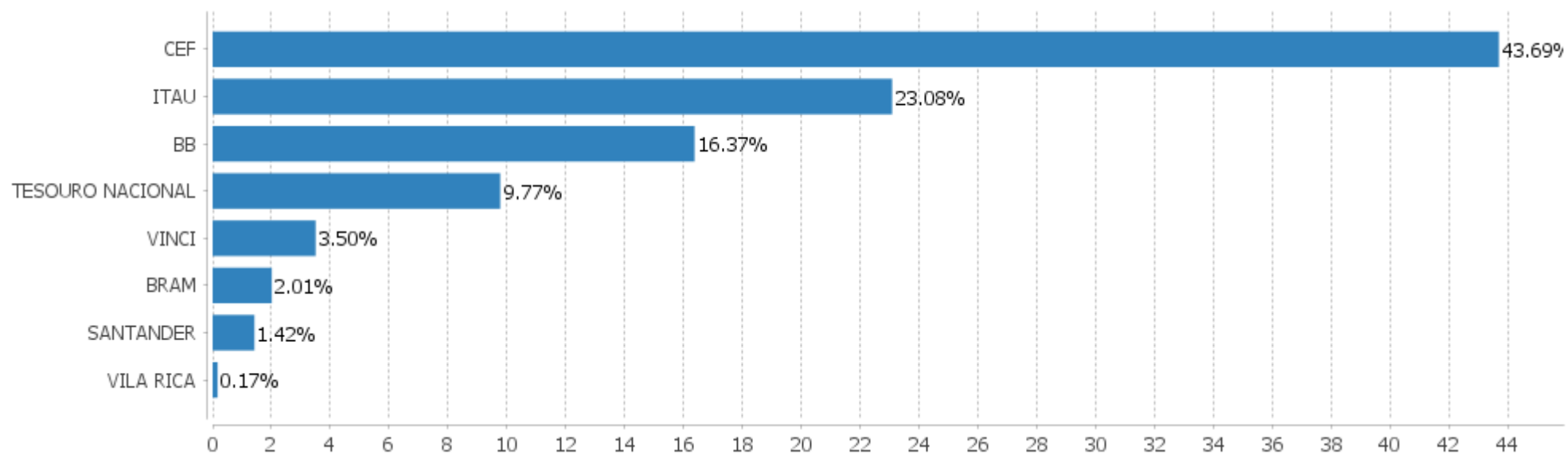


Alocação Por Estratégia



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	1,37	1,32	-1,47
IPCA + 5,46%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,98	1,43	1,34	1,61	1,68	1,38	1,22	16,05
p.p. indexador	-1,61	-2,69	-1,04	0,29	0,21	-0,60	-2,23	-2,32	-3,25	-3,23	-0,00	0,10	-17,51
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

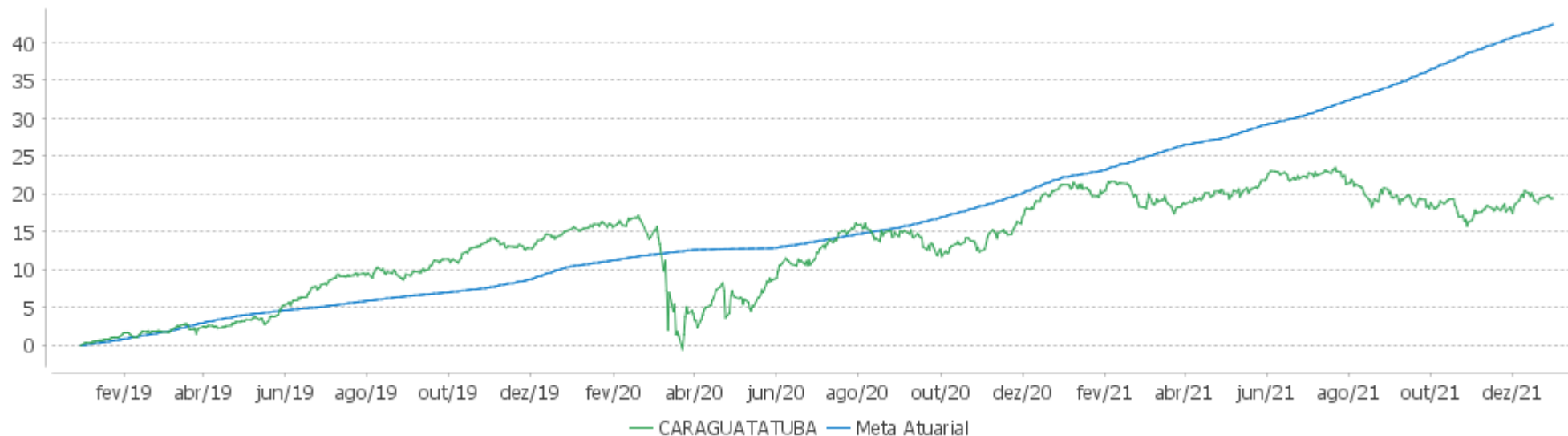
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

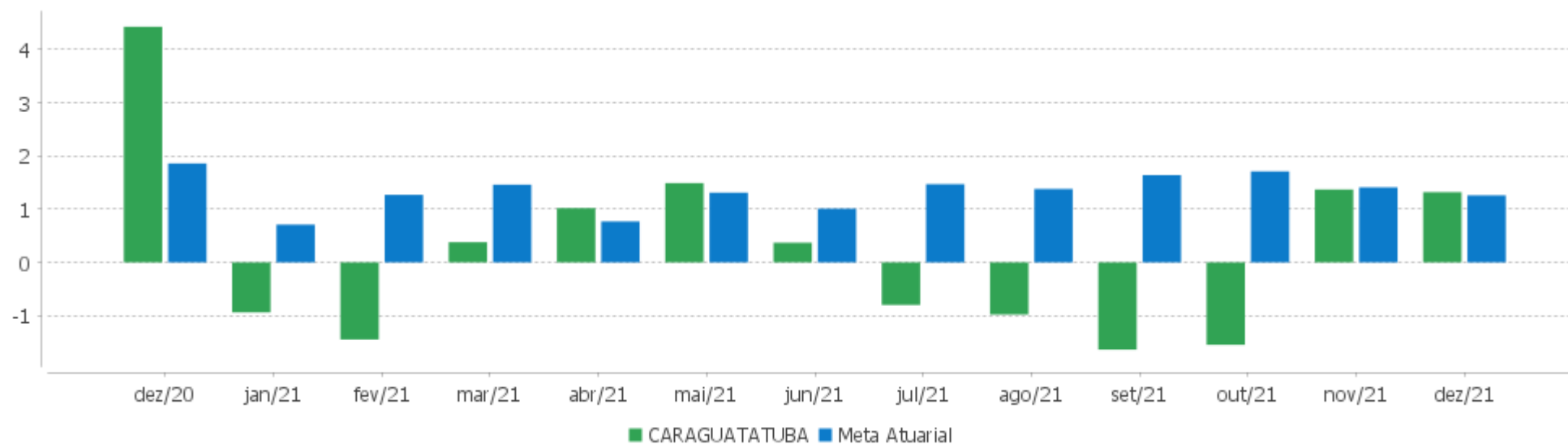
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	16	44,44	03 meses	1,12	4,34	-3,22	6,28
Meses abaixo - Meta Atuarial	20	55,56	06 meses	-2,30	8,97	-11,27	6,17
			12 meses	-1,47	16,05	-17,51	5,82
			24 meses	3,58	28,40	-24,82	10,09
			36 meses	19,47	42,00	-22,53	8,45
			Desde 31/12/2018	19,47	42,00	-22,53	8,45
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	4,43	2020-12					
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 Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150523 (5,900000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,29 1,06	1,56 0,50	1,56 0,50	5,90 6,44	10,28 11,55	15,05 9,99	19,33 -9,85
NTN-B 150822 (6,090000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,30 1,08	4,60 3,54	4,60 3,54	5,98 6,53	10,46 11,73	15,41 10,35	19,88 -9,30
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,80 105,06	2,02 109,46	2,02 109,46	3,54 114,61	5,04 114,65	7,69 105,63	13,90 101,55
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	0,08 11,11	0,37 20,34	0,37 20,34	-0,61 -19,84	-1,47 -33,44	5,95 81,66	31,88 232,90
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,75 98,81	1,89 102,69	1,89 102,69	3,40 110,10	4,60 104,55	7,12 97,76	13,24 96,76
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,86 0,13	2,16 -0,80	2,16 -0,80	3,49 -2,58	4,53 -5,53	7,52 -7,51	20,33 0,34
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	0,47 62,02	0,83 44,82	0,83 44,82	7,52 243,51	-3,47 -78,85	1.369,49 18.800,04	111.834,20 817.078,30
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,84 -0,04	1,08 -0,05	1,08 -0,05	2,00 -0,09	2,79 -0,13	6,37 -0,51	13,31 -0,79
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,21 -0,02	1,00 -0,06	1,00 -0,06	-0,70 -0,15	-1,53 -0,27	4,44 -0,62	28,03 -1,14
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,77 -0,02	1,98 -0,05	1,98 -0,05	3,12 -0,11	4,35 -0,21	12,52 -0,45	27,04 -0,80
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,84 -0,03	1,10 -0,03	1,10 -0,03	1,97 -0,12	2,64 -0,29	6,20 -0,68	13,10 -1,01
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,87 -0,01	0,97 -0,01	0,97 -0,01	-0,51 -0,08	-2,18 -0,19	4,11 -0,46	16,27 -0,88
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,34 -0,00	-0,14 -0,23	-0,14 -0,23	-4,47 -0,36	-7,00 -0,45	-2,14 -0,72	26,96 -1,56
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,36 -0,02	0,03 -0,06	0,03 -0,06	-4,21 -0,11	-6,77 -0,22	-2,10 -0,69	27,07 -1,46
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	2,27 -0,02	0,86 -0,07	0,86 -0,07	-1,95 -0,20	-5,31 -0,32	2,47 -0,58	16,70 -1,02
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLAÇÃO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,21 -0,02	1,01 -0,05	1,01 -0,05	-0,65 -0,10	-1,49 -0,22	4,53 -0,53	28,12 -1,05
BB PREV RF VII	0,58	1,82	1,82	4,29	6,57	12,55	24,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,36	0,76	0,76	4,83	7,83	7,49	-4,85
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,83	1,07	1,07	-0,82	-0,11	6,55	24,06
Var. IPCA p.p.	0,10	-1,89	-1,89	-6,89	-10,17	-8,48	4,07
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,72	1,82	1,82	3,05	4,66	13,07	25,72
Var. IDKA 2 p.p.	-0,11	-0,02	-0,02	0,00	-0,31	-0,95	-1,78
BB PREV RF IRF-M	1,88	0,93	0,93	-0,59	-2,28	3,97	16,22
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,01	-0,05	-0,05	-0,17	-0,29	-0,60	-0,92
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,20	0,97	0,97	-0,70	-1,51	4,53	28,20
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,09	-0,09	-0,16	-0,25	-0,53	-0,97
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,33	0,01	0,01	-4,26	-6,78	-2,06	27,37
Var. IMA-B 5+ p.p.	0,01	-0,08	-0,08	-0,15	-0,23	-0,65	-1,15
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	5,54	13,02	13,02	14,30	32,74	49,91	98,49
Var. S&P 500 p.p.	1,92	-0,50	-0,50	-9,42	-3,52	-54,34	-75,33
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	3,44	-6,39	-6,39	-19,00	-11,53	-9,52	21,15
Var. IGCT p.p.	-0,04	-0,19	-0,19	-0,31	-0,72	-1,66	-3,27
BRADESCO F I A SELECTION	2,00	-8,61	-8,61	-22,08	-17,61	-20,64	1,24
Var. IBOVESPA p.p.	-0,85	-3,07	-3,07	-4,74	-5,68	-11,28	-18,03
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	0,06	-6,16	-6,16	-19,71	-15,22	-13,19	30,66
Var. IBOVESPA p.p.	-2,79	-0,61	-0,61	-2,38	-3,29	-3,84	11,39
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	0,97	-7,99	-7,99	-18,47	-8,51	-12,97	26,43
Var. IBOVESPA p.p.	-1,88	-2,44	-2,44	-1,14	3,42	-3,61	7,16
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	1,88	-8,98	-8,98	-21,40	-16,64	-14,85	14,99
Var. IBOVESPA p.p.	-0,97	-3,44	-3,44	-4,07	-4,71	-5,49	-4,28
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-0,32	-3,49	-3,49	-13,76	-10,50	-7,77	31,03
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,93	-1,66	-1,66	-5,46	-4,09	-0,42	-3,46
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-1,60	-15,03					
Var. IBOVESPA p.p.	-4,45	-8,47					
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1,63	-5,04	-5,04	-18,78	-15,42	-22,12	0,11
Var. IBOVESPA p.p.	-1,23	0,50	0,50	-1,44	-3,49	-12,76	-19,16
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	3,89	-12,01	-12,01	-20,59	-9,84	-11,55	27,79
Var. SMALL CAP p.p.	0,10	-0,73	-0,73	4,20	6,36	5,20	-3,91
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1,70	11,81	11,81	20,44	30,51	101,98	171,58
Var. Global BDRX p.p.	-0,01	-0,48	-0,48	-0,99	-3,14	-3,86	-7,67
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	0,89 116,14	6,63 359,92	6,63 359,92	15,15 490,83	23,65 538,19	99,50 1.365,97	
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	5,61	11,28	11,28	10,54	29,49		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. MSCI ACWI p.p.	2,44	2,14	2,14	-6,43	4,06		
CARAGUATATUBA	1,32	1,12	1,12	-2,30	-1,47	3,58	19,47
Var. IPCA + 5,89% p.p.	0,06	-3,32	-3,32	-11,50	-17,99	-25,34	-22,96
CDI	0,76	1,84	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69
IBOVESPA	2,85	-5,55	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27
INPC + 6,00%	1,27	4,26	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52
IPCA + 6,00%	1,27	4,47	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	2,00
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	1,00
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+2 du	D+2 du	0,00	0,20
BB PREV RF IRF-M	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,10
BB PREV RF VII	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	1,50
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	1,50
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	0,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,40
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du	0,00	1,72
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	D+1 du	D+0	D+21 du	D+23 du	0,00	1,72
FIDC ITALIA SENIOR	Não se aplica	Não se aplica				
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du		1,90
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	D+1 du	D+0	D+2 du	D+4 du	0,00	1,50
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI			D+0	D+0	0,00	0,18
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,18
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	1,00
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du	0,00	0,18
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,18
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+8 du	0,00	1,00
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,88	1,13	1,13	2,10	2,93	6,88	14,10	22,06	35,63
IRF-M 1+	2,29	0,93	0,93	-1,74	-4,99	3,04	17,72	32,16	54,19
IRF-M TOTAL	1,89	0,98	0,98	-0,42	-1,99	4,57	17,15	29,72	49,44
IMA-B 5	0,79	2,03	2,03	3,24	4,57	12,97	27,83	40,44	58,11
IMA-B 5+	-0,34	0,09	0,09	-4,11	-6,55	-1,41	28,53	48,33	67,24
IMA-B TOTAL	0,22	1,06	1,06	-0,55	-1,26	5,06	29,17	46,04	64,72
IMA-GERAL TOTAL	0,87	1,34	1,34	0,82	0,96	6,35	19,98	32,02	48,95
IDKA 2	0,83	1,84	1,84	3,05	4,97	14,02	27,50	39,94	58,99
IDKA 20	-2,28	-2,87	-2,87	-11,27	-14,50	-12,61	26,07	51,79	70,27
CDI	0,76	1,84	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	20,99	33,03

Renda Variável

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,73	2,96	2,96	6,07	10,06	15,03	19,99	24,48	28,15
INPC	0,73	2,75	2,75	5,97	10,16	16,16	21,37	25,53	28,13
IGPM	0,87	1,54	1,54	2,35	17,78	45,04	55,63	67,36	66,49
SELIC	0,76	1,84	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	21,00	33,06

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,63	13,52	13,52	23,73	36,26	104,25	173,82	200,73	264,52
MSCI ACWI	3,17	9,15	9,15	16,96	25,42	84,89	138,58	148,21	206,39
MSCI World									

Meta Atuarial

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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
187	04/11/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,00	8.935,09	261,31861000	34,1923220000
188	05/11/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,00	1.207,53	35,30373000	34,2040440000
189	09/11/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	218.124,83	0,00	79.075,02918400	2,7584539930
190	10/11/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.207,61	0,00	800,20212100	2,7588154790
191	10/11/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.314,51	0,00	838,95063500	2,7588154790
192	10/11/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	57.000,00	14.740,65367300	3,8668570000
193	18/11/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	10.000.000,00	538.299,90357000	18,5770050000
194	19/11/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	316.501,58	0,00	114.449,71489200	2,7654204320

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
195	19/11/2021	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	5.000.000,00	0,00	208.905,32482000	23,9342870000
196	19/11/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.689.825,18	0,00	952.711,55588000	3,8729720000
197	22/11/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	12.309,62	0,00	4.453,22045900	2,7642062890
198	22/11/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5.000.000,00	0,00	728.472,08371134	6,8636810000
199	22/11/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	293.664,59	0,00	75.805,59676400	3,8739170000
200	23/11/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	23.641,67	0,00	7,12160000	3.319,7136710000
201	29/11/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,00	2.687.710,10	78.116,93978000	34,4062390000
202	29/11/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	106.355,62	0,00	27.405,76817700	3,8807750000
203	29/11/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	13.737,00	0,00	3.539,75687800	3,8807750000
204	29/11/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	150.449,86	38.767,99338900	3,8807750000
205	30/11/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.404,36	0,00	0,72311000	3.325,0266211227
206	30/11/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	270,00	0,00	69,55256500	3,8819560000
207	30/11/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.684,33	0,00	2.752,30579600	3,8819560000
208	30/11/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	10.684,33	2.752,30578900	3,8819560000
209	07/12/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	439.411,37	0,00	158.042,94621000	2,7803288950
210	07/12/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.314,53	0,00	832,46626100	2,7803288950
211	07/12/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	400,00	0,00	11,59330568	34,5026700000
212	08/12/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	186.000,00	47.826,43014900	3,8890630000
213	10/12/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.207,61	0,00	792,96359000	2,7839991970
214	10/12/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	23.641,67	0,00	6.075,11695800	3,8915580000
215	14/12/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,00	2.533.499,34	759,57894645	3.335,3996340000
216	14/12/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	294.357,88	0,00	75.589,20121500	3,8941790000
217	14/12/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	24.421,33	0,00	6.271,23971400	3,8941790000
218	14/12/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	86.000,00	22.084,24426100	3,8941790000
219	15/12/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.404,36	0,00	0,72060820	3.336,5704110000
220	16/12/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	107.684,65	0,00	27.635,78237800	3,8965660000
221	17/12/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	12.309,70	0,00	4.416,28261700	2,7873442590
222	17/12/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	316.501,64	0,00	113.549,53338700	2,7873442590
223	17/12/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.675.758,60	0,00	943.002,96388100	3,8979290000
224	20/12/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	37.965.926,42	2.023.709,54791810	18,7605610000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
225	20/12/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.908.317,80	0,00	1.002.254,58171000	3,8995260000
226	20/12/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	100.000,00	25.644,14233100	3,8995260000
227	21/12/2021	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	0,00	15.379.158,21	1.344.412,39406272	11,4393160000
228	21/12/2021	NTN-B 150523 (5,900000%)	37.965.926,42	0,00	10.000,00000000	3.796,5926420000
229	22/12/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	101.766,68	0,00	30,43793119	3.343,4164550000
230	22/12/2021	NTN-B 150822 (6,090000%)	15.379.158,21	0,00	4.000,00000000	3.844,7895520000
231	22/12/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	86.725,29	0,00	22.223,97644400	3,9023300000
232	27/12/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	24.165,70	0,00	6.186,37010400	3,9062810000
233	28/12/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,00	2.710.826,18	809,61352866	3.348,2965440000
234	28/12/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	24.421,33	0,00	6.249,62381400	3,9076480000
235	28/12/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	206.960,84	52.963,02014000	3,9076480000
236	28/12/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	23.641,67	0,00	6.050,10226100	3,9076480000
237	29/12/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.404,36	0,00	0,71782467	3.349,5087230000
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 14.864.721,04

Value-At-Risk: 2,71%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARAGUATATUBA		2,71	2,71			548.169.148,71	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,98%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150523 (5,900000%)		0,23	0,00	2,95			38.112.344,74	6,95
NTN-B 150822 (6,090000%)		0,23	0,00	2,95			15.431.109,58	2,82
Sub-total	0,11	0,18	0,00		-3,46	0,39	53.543.454,32	9,77

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M		1,78	0,03	0,02			16.124.140,18	2,94
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,60	0,00	0,82			359.354,25	0,07
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI		2,96	0,04	0,01			11.702.304,81	2,13
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,62	0,00	0,03			10.992.934,25	2,01
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,99	0,06	0,04			16.366.053,99	2,99
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,98	0,16	0,03			45.534.437,80	8,31
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		4,35	0,11	0,14			21.782.065,96	3,97
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,21	0,01	0,01			4.529.481,21	0,83
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI		4,29	0,02	0,01			4.200.131,05	0,77
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		4,29	0,18	0,08			35.062.910,60	6,40
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		2,44	0,09	0,02			32.675.659,51	5,96
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,62	0,02	0,26			11.738.583,84	2,14
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,78	0,01	0,02			4.889.433,76	0,89
BB PREV RF VII		0,73	0,00	2,84			478.291,11	0,09

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,06	0,05	1,07			49.134.040,19	8,96
Sub-total	3,85	2,40	0,78		-0,03	0,64	265.569.822,51	48,45

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,04	0,00	0,04			3.494.021,36	0,64
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO		3,20	0,10	3,19			25.719.964,84	4,69
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,06	0,00	0,06			13.287.330,18	2,42
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		0,61	0,00	0,63			2.449.310,46	0,45
Sub-total	2,31	1,87	0,10		-0,15	0,43	44.950.626,84	8,20

Artigo 7º VII, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR		0,31	0,00	0,32			930.827,37	0,17
Sub-total	1,56	0,31	0,00		-0,19	0,47	930.827,37	0,17

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 8,00%

Artigo 8º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		10,65	0,35	0,08			22.617.348,87	4,13
Sub-total	19,33	10,65	0,35		0,14	3,44	22.617.348,87	4,13

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO F I A SELECTION		11,62	0,08	3,12			4.950.175,70	0,90
BB AÇÕES DIVIDENDOS		10,34	0,02	3,00			1.351.577,93	0,25
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		14,72	0,13	4,08			6.062.240,71	1,11
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		10,84	0,23	2,07			13.982.271,75	2,55
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS		10,29	0,10	1,92			6.763.424,74	1,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS		9,84	0,18	2,29			12.425.705,45	2,27
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		9,34	0,08	4,16			5.787.099,75	1,06
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		12,64	0,16	6,49			9.335.972,60	1,70
Sub-total	18,17	10,87	1,00		0,00	0,78	60.658.468,63	11,07

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI		6,47	0,39	5,82			49.476.009,96	9,03
Sub-total	16,64	6,47	0,39		0,29	5,54	49.476.009,96	9,03

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,99%

Artigo 9º A, II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		7,93	-0,00	7,93			1.599.430,07	0,29
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI		7,51	0,01	7,09			1.669.255,25	0,30
Sub-total	13,61	6,42	0,01		0,18	3,24	3.268.685,32	0,60

Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		8,18	0,08	0,67			47.153.904,89	8,60
Sub-total	18,91	8,18	0,08		0,05	1,70	47.153.904,89	8,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O percentual alocado no Artigo 7º IV, Alínea a, (8,20% dos recursos) está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos;