



CARAGUATATUBA
1º TRIMESTRE 2022



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.01.2022.

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 **66,92%**

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%)	4,13	1,15	1,15	38.550.732,30	7,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822 (6,090000%)	4,16	1,17	1,17	15.610.946,54	2,85
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,29	1,15	1,15	54.161.678,84	9,89

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	3,54	-0,13	-0,13	16.103.617,90	2,94	4.743.847.539,71	0,34
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,67	0,64	0,64	362.040,06	0,07	143.407.509,52	0,25
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,67	-0,75	-0,75	11.615.009,72	2,12	320.131.317,42	3,63
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,68	0,61	0,61	12.543.312,61	2,29	5.049.727.685,75	0,25
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,71	-0,77	-0,77	16.240.381,13	2,97	6.778.952.570,88	0,24
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,68	-0,76	-0,76	45.189.679,65	8,25	4.513.989.587,78	1,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,94	-1,63	-1,63	21.427.462,99	3,91	954.093.578,76	2,25
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,76	0,10	0,10	4.533.881,84	0,83	1.235.193.585,55	0,37
ITAU	ITAU	ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	8,94	-1,63	-1,63	4.131.859,31	0,75	219.673.300,95	1,88
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,88	-1,62	-1,62	34.495.437,07	6,30	1.336.256.948,50	2,58
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	5,10	-0,54	-0,54	32.500.181,54	5,94	1.104.395.418,47	2,94
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,77	0,02	0,02	11.740.792,19	2,14	10.879.369.499,05	0,11
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,54	-0,07	-0,07	4.885.923,29	0,89	1.205.162.298,95	0,41
BB	BB	BB PREV RF VII	1,68	0,56	0,56	480.990,20	0,09	249.437.254,95	0,19
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,30	0,67	0,67	43.737.750,46	7,99	11.686.800.915,89	0,37
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,91	-0,50	-0,50	259.988.319,96	47,48		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos 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	0,18	0,83	0,83	3.525.749,93	0,64	1.727.195.635,13	0,20
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,23	-1,09	-1,09	25.438.835,22	4,65	502.964.015,45	5,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,21	0,79	0,79	19.919.934,27	3,64	9.998.166.423,55	0,20
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,12	0,52	0,52	2.462.104,79	0,45	2.545.578.020,48	0,10
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			2,67	-0,30	-0,30	51.346.624,21	9,38		

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	11,35	0,27	0,27	933.345,46	0,17	40.395.435,01	2,31
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			11,35	0,27	0,27	933.345,46	0,17		
Renda Fixa			4,38	-0,23	-0,23	366.429.968,47	66,92		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

16,20%

Artigo 8º I (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	21,12	6,78	6,78	5.285.583,75	0,97	571.613.964,36	0,92
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	19,03	7,46	7,46	1.452.396,82	0,27	715.015.451,35	0,20
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	23,10	3,96	3,96	6.302.433,11	1,15	1.385.056.471,22	0,46
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	20,09	6,58	6,58	14.901.691,05	2,72	691.726.019,35	2,15
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,24	6,70	6,70	24.131.851,28	4,41	1.044.534.082,64	2,31
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	20,20	9,48	9,48	7.404.373,93	1,35	731.059.746,80	1,01
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,38	8,81	8,81	13.520.648,73	2,47	1.002.148.547,16	1,35
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	17,93	1,34	1,34	5.864.753,85	1,07	2.616.325.769,44	0,22
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	27,14	5,65	5,65	9.863.811,54	1,80	313.796.569,49	3,14
Sub-total Artigo 8º I			20,35	6,55	6,55	88.727.544,06	16,20		
Renda Variável			17,28	6,55	6,55	88.727.544,06	16,20		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

8,32%

Artigo 9º 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	15,68	-12,56	-12,56	1.398.600,60	0,26	1.847.646.866,71	0,08
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	14,11	-5,30	-5,30	1.580.724,11	0,29	908.938.685,96	0,17
Sub-total Artigo 9º II			13,94	-8,85	-8,85	2.979.324,71	0,54		

Artigo 9º 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	17,35	-9,75	-9,75	42.558.267,97	7,77	3.479.303.240,79	1,22
Sub-total Artigo 9º III			17,35	-9,75	-9,75	42.558.267,97	7,77		
Investimentos no Exterior			17,15	-9,69	-9,69	45.537.592,68	8,32		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

8,56%

Artigo 10º I (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	13,62	-5,29	-5,29	46.860.325,68	8,56	2.221.853.983,54	2,11
Sub-total Artigo 10º I			13,62	-5,29	-5,29	46.860.325,68	8,56		
Investimentos Estruturados			18,05	-5,29	-5,29	46.860.325,68	8,56		
Total			5,79	-0,53	-0,53	547.555.430,89	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	54.161.678,84	9,89	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	259.988.319,96	47,48	10,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	51.346.624,21	9,38	3,00	14,25	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	933.345,46	0,17	0,00	0,25	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	366.429.968,47	66,92					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	88.727.544,06	16,20	0,00	5,50	35,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	88.727.544,06	16,20					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	2.979.324,71	0,54	0,00	2,96	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	42.558.267,97	7,77	0,00	7,04	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	45.537.592,68	8,32					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	46.860.325,68	8,56	0,00	9,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	46.860.325,68	8,56					15,00

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	1,15 157,68	1,15 157,68				618.224,52	618.224,52
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,50 -68,52	-0,50 -68,52	2,85 135,68	-1,42 -40,91	-2,19 -43,84	-1.340.499,00	-1.340.499,00
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,30 -41,03	-0,30 -41,03				-119.983,94	-119.983,94
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,27 36,94	0,27 36,94				2.518,09	2.518,09
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	6,55 -0,44	6,55 -0,44				5.451.726,56	5.451.726,56
Artigo 9º II % do CDI	-8,85 -1.208,90	-8,85 -1.208,90	-7,84 -373,78			-289.360,61	-289.360,61
Artigo 9º III % do CDI	-9,75 -1.330,92	-9,75 -1.330,92	-9,03 -430,53	3,11 89,61	11,35 226,78	-4.595.636,92	-4.595.636,92
Artigo 10º I % do CDI	-5,29 -721,96	-5,29 -721,96				-2.615.684,28	-2.615.684,28
CARAGUATATUBA (Total)						-2.888.695,58	-2.888.695,58

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%)	38.112.344,74	0,00	0,00	0,00	38.550.732,30	438.387,56	438.387,56
NTN-B 150822 (6,090000%)	15.431.109,58	0,00	0,00	0,00	15.610.946,54	179.836,96	179.836,96
					54.161.678,84	618.224,52	0,11

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	16.366.053,99	0,00	0,00	0,00	16.240.381,13	-125.672,86	-125.672,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	21.782.065,96	0,00	0,00	0,00	21.427.462,99	-354.602,97	-354.602,97
BB PREV RF IRF-M	16.124.140,18	0,00	0,00	0,00	16.103.617,90	-20.522,28	-20.522,28
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	10.992.934,25	1.479.179,36	0,00	0,00	12.543.312,61	71.199,00	71.199,00
BB PREV RF VII	478.291,11	0,00	0,00	0,00	480.990,20	2.699,09	2.699,09
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11.738.583,84	0,00	0,00	0,00	11.740.792,19	2.208,35	2.208,35
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	35.062.910,60	0,00	0,00	0,00	34.495.437,07	-567.473,53	-567.473,53
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	45.534.437,80	0,00	0,00	0,00	45.189.679,65	-344.758,15	-344.758,15
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	32.675.659,51	0,00	0,00	0,00	32.500.181,54	-175.477,97	-175.477,97
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.889.433,76	0,00	0,00	0,00	4.885.923,29	-3.510,47	-3.510,47
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	49.134.040,19	0,00	-5.720.582,91	0,00	43.737.750,46	324.293,18	324.293,18
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	11.702.304,81	0,00	0,00	0,00	11.615.009,72	-87.295,09	-87.295,09
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	4.200.131,05	0,00	0,00	0,00	4.131.859,31	-68.271,74	-68.271,74
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	359.354,25	400,00	0,00	0,00	362.040,06	2.285,81	2.285,81
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	4.529.481,21	0,00	0,00	0,00	4.533.881,84	4.400,63	4.400,63
					259.988.319,96	-1.340.499,00	-0,25

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos 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	13.287.330,18	9.778.736,77	-3.265.492,48	0,00	19.919.934,27	119.359,80	119.359,80
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2.449.310,46	0,00	0,00	0,00	2.462.104,79	12.794,33	12.794,33
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	3.494.021,36	2.737,02	0,00	0,00	3.525.749,93	28.991,55	28.991,55
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	25.719.964,84	0,00	0,00	0,00	25.438.835,22	-281.129,62	-281.129,62
					51.346.624,21	-119.983,94	-0,02

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIDC ITALIA SENIOR	930.827,37	0,00	0,00	0,00	933.345,46	2.518,09	2.518,09

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
					933.345,46	2.518,09	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1.351.577,93	0,00	0,00	0,00	1.452.396,82	100.818,89	100.818,89
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	22.617.348,87	0,00	0,00	0,00	24.131.851,28	1.514.502,41	1.514.502,41
BRADESCO F I A SELECTION	4.950.175,70	0,00	0,00	0,00	5.285.583,75	335.408,05	335.408,05
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	6.062.240,71	0,00	0,00	0,00	6.302.433,11	240.192,40	240.192,40
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	12.425.705,45	0,00	0,00	0,00	13.520.648,73	1.094.943,28	1.094.943,28
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	6.763.424,74	0,00	0,00	0,00	7.404.373,93	640.949,19	640.949,19
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	5.787.099,75	0,00	0,00	0,00	5.864.753,85	77.654,10	77.654,10
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	13.982.271,75	0,00	0,00	0,00	14.901.691,05	919.419,30	919.419,30
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	9.335.972,60	0,00	0,00	0,00	9.863.811,54	527.838,94	527.838,94
					88.727.544,06	5.451.726,56	1,00

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.599.430,07	0,00	0,00	0,00	1.398.600,60	-200.829,47	-200.829,47
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	1.669.255,25	0,00	0,00	0,00	1.580.724,11	-88.531,14	-88.531,14
					2.979.324,71	-289.360,61	-0,05

Artigo 9º 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	47.153.904,89	0,00	0,00	0,00	42.558.267,97	-4.595.636,92	-4.595.636,92
					42.558.267,97	-4.595.636,92	-0,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	49.476.009,96	0,00	0,00	0,00	46.860.325,68	-2.615.684,28	-2.615.684,28
					46.860.325,68	-2.615.684,28	-0,48

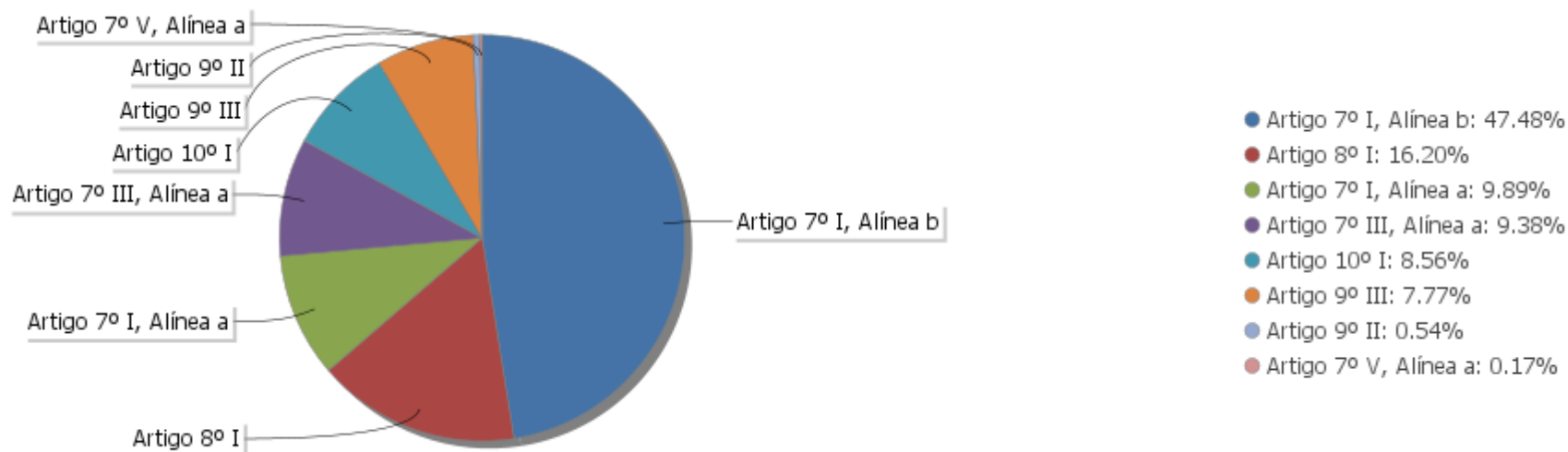
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

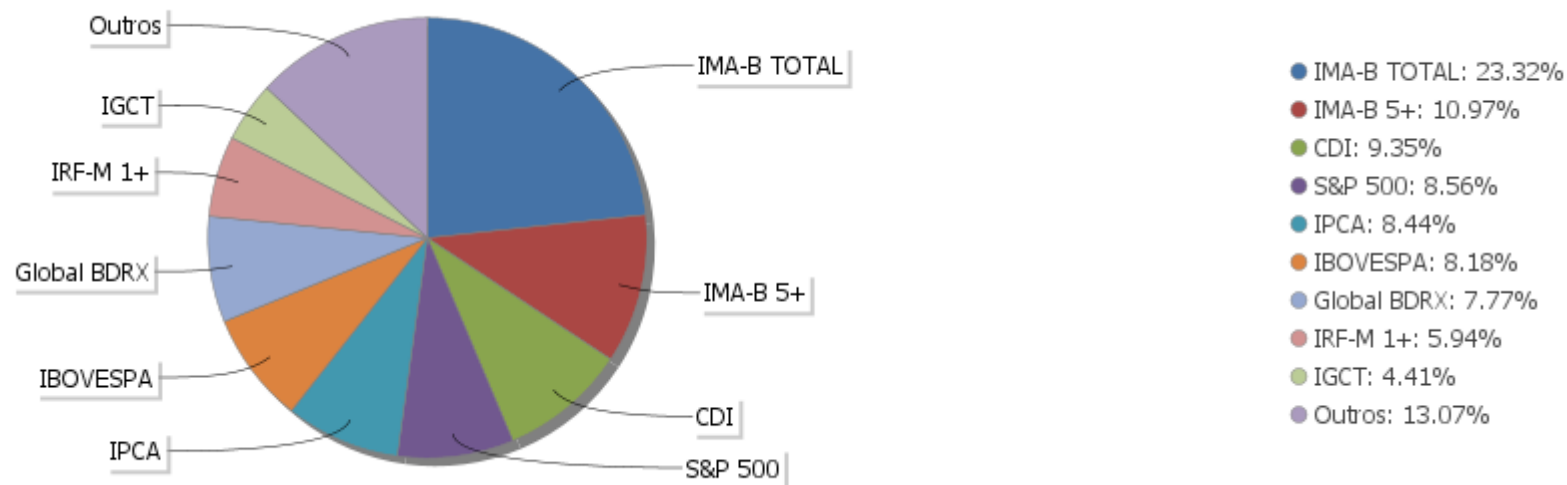
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	465.189.639,88	84,96	465.189.639,88	84,96
de 31 a 365 dias	43.815.058,71	8,00	509.004.698,59	92,96
acima de 365 dias	38.550.732,30	7,04	547.555.430,89	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

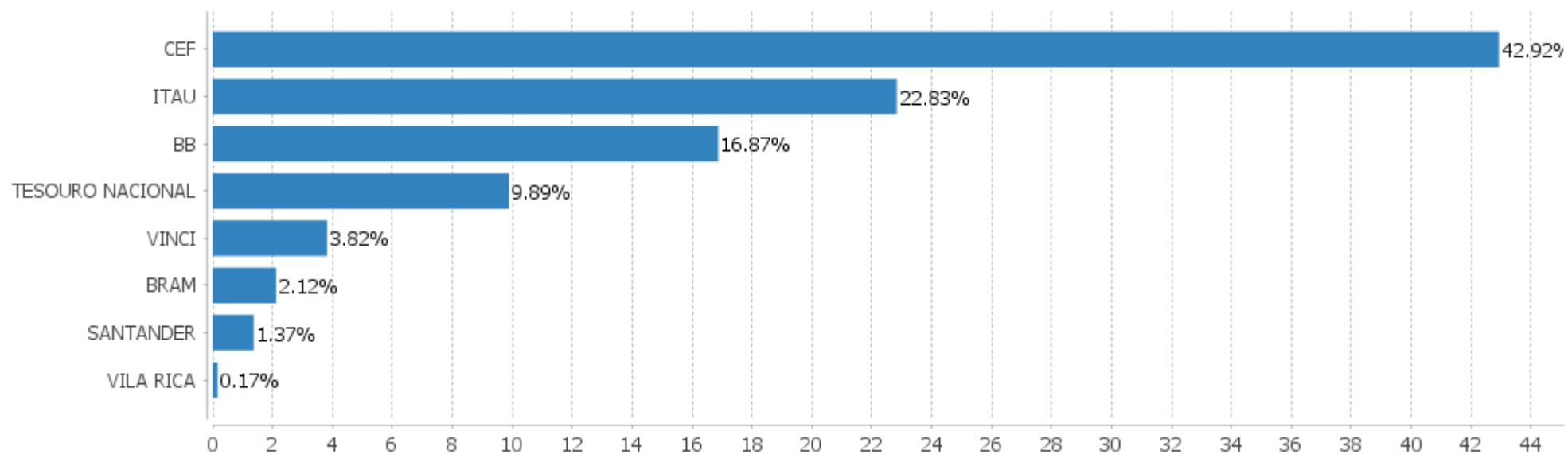


Alocação Por Estratégia



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	-0,53												-0,53
IPCA + 5,46%	0,99												0,99
p.p. indexador	-1,52												-1,52
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

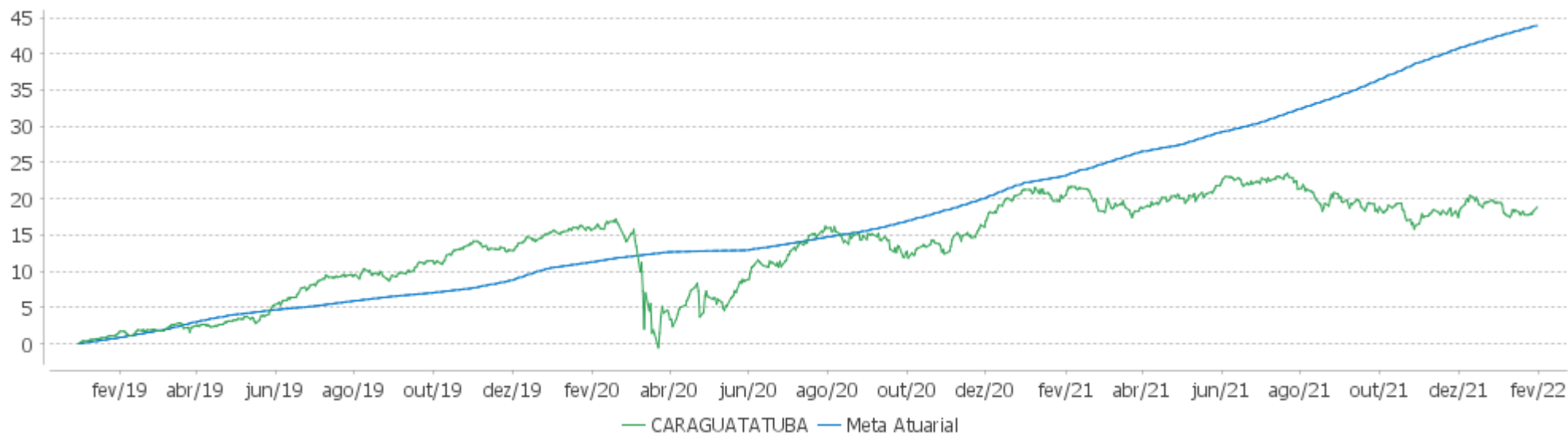
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

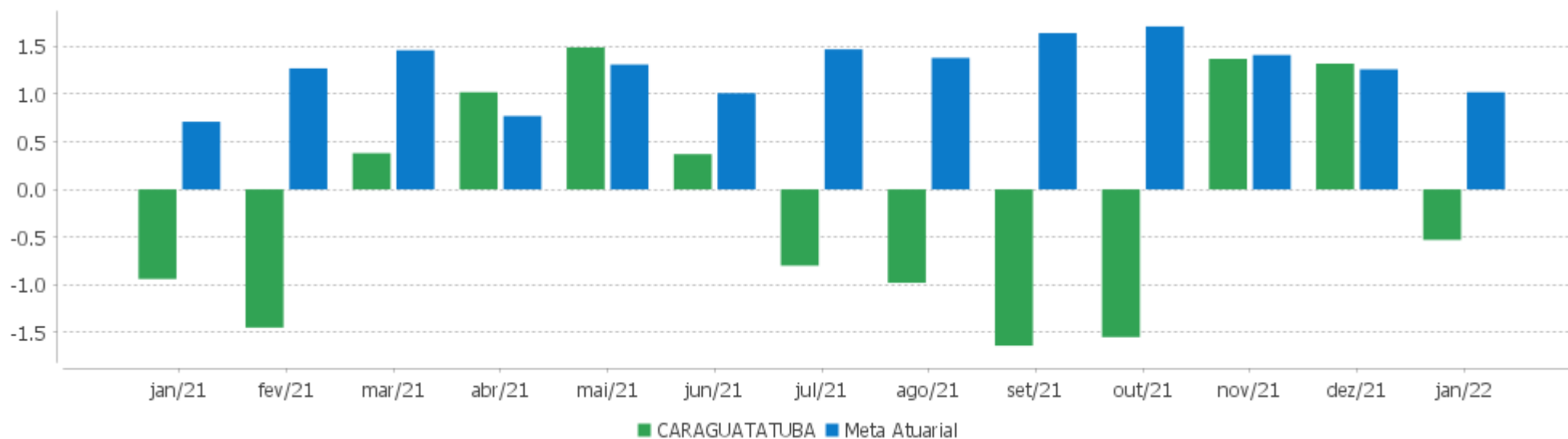
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	16	43,24	03 meses	2,17	3,63	-1,46	5,79
Meses abaixo - Meta Atuarial	21	56,76	06 meses	-2,04	8,49	-10,53	6,17
			12 meses	-1,06	16,41	-17,47	5,79
			24 meses	2,76	28,75	-25,99	10,14
			36 meses	17,07	42,22	-25,15	8,49
			Desde 31/12/2018	18,83	43,40	-24,57	8,38
	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
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,83 113,31	0,83 113,31	2,28 108,56	3,95 113,73	5,78 115,47	8,19 106,81	14,23 102,39
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	-1,09 -149,27	-1,09 -149,27	2,84 135,43	-1,46 -42,04	-1,51 -30,15	4,58 59,70	24,89 179,02
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,79 107,46	0,79 107,46	2,18 103,93	3,74 107,77	5,25 104,90	7,57 98,71	13,53 97,36
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,52 -0,02	0,52 -0,02	3,06 0,82	3,87 -1,76	4,93 -5,44	7,72 -7,70	18,15 -2,10
NTN-B 150523 (5,900000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,15 1,88	1,15 1,88	1,22 -1,72	5,83 6,74	10,10 11,25	14,88 10,87	19,73 -3,13
NTN-B 150822 (6,090000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,17 1,90	1,17 1,90	4,25 1,32	5,92 6,83	10,28 11,43	15,25 11,23	20,28 -2,58
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,64 0,01	0,64 0,01	2,35 0,04	2,42 -0,13	3,38 -0,14	6,59 -0,49	13,42 -0,74
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,76 -0,02	-0,76 -0,02	2,87 -0,07	-1,06 -0,15	-1,42 -0,27	3,39 -0,62	21,71 -1,15
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,10 -0,02	0,10 -0,02	3,37 -0,05	3,22 -0,11	4,37 -0,21	12,03 -0,45	25,25 -0,78
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,61 -0,01	0,61 -0,01	2,25 -0,06	2,43 -0,11	3,24 -0,29	6,41 -0,67	13,14 -1,02
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,07 0,01	-0,07 0,01	3,64 0,01	-0,11 -0,08	-1,50 -0,22	3,17 -0,41	14,64 -0,82
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,62 -0,01	-1,62 -0,01	2,31 -0,13	-5,29 -0,37	-6,93 -0,45	-3,68 -0,65	17,26 -1,36
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,63 -0,02	-1,63 -0,02	2,38 -0,07	-5,02 -0,10	-6,70 -0,22	-3,70 -0,67	17,32 -1,30
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,54 -0,04	-0,54 -0,04	3,95 -0,06	-1,62 -0,21	-4,49 -0,37	0,83 -0,57	14,18 -0,99
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,75 -0,01	-0,75 -0,01	2,88 -0,05	-1,01 -0,10	-1,36 -0,21	3,50 -0,52	21,90 -0,96
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,56 1,30	0,56 1,30	2,91 -0,03	4,19 5,10	6,86 8,01	12,96 8,94	23,37 0,51
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,67	0,67	2,42	0,62	0,53	6,39	21,39

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,13	0,13	0,18	-5,00	-9,85	-9,02	1,14
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,02	0,02	3,17	3,14	4,54	12,57	24,17
Var. IDKA 2 p.p.	-0,03	-0,03	-0,24	-0,15	-0,33	-0,90	-1,81
BB PREV RF IRF-M	-0,13	-0,13	3,58	-0,22	-1,62	2,96	14,51
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,05	-0,05	-0,05	-0,19	-0,34	-0,62	-0,94
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,77	-0,77	2,85	-1,09	-1,42	3,46	21,90
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,03	-0,08	-0,18	-0,27	-0,56	-0,96
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	-1,63	-1,63	2,40	-5,08	-6,71	-3,70	17,56
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,02	-0,02	-0,04	-0,16	-0,24	-0,67	-1,06
FIDC ITALIA SENIOR	0,27	0,27	1,04	7,28	-3,27	1.426,45	70.023,65
% do CDI	36,94	36,94	49,76	209,54	-65,46	18.610,82	503.729,22
BRADESCO F I A SELECTION	6,78	6,78	6,78	-12,54	-9,79	-14,15	2,09
Var. IBOVESPA p.p.	-0,21	-0,21	-1,57	-4,61	-7,25	-12,73	-13,06
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	9,48	9,48	10,23	-8,18	-4,17	-6,79	26,23
Var. IBOVESPA p.p.	2,49	2,49	1,88	-0,25	-1,63	-5,37	11,08
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	1,34	1,34	0,85	-14,76	-5,90	-11,63	16,17
Var. IBOVESPA p.p.	-5,64	-5,64	-7,50	-6,83	-3,36	-10,21	1,03
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	6,58	6,58	6,34	-12,24	-9,03	-9,86	11,53
Var. IBOVESPA p.p.	-0,41	-0,41	-2,01	-4,31	-6,49	-8,44	-3,61
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	5,65	5,65	0,35				
Var. IBOVESPA p.p.	-1,33	-1,33	-8,00				
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	8,81	8,81	9,74	-3,09	1,19	-1,16	27,04
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,34	1,34	-0,43	-3,37	-4,77	-2,33	-1,47
BB AÇÕES DIVIDENDOS	7,46	7,46	7,20	-7,87	-4,93	-15,96	-0,64
Var. IBOVESPA p.p.	0,48	0,48	-1,15	0,06	-2,39	-14,54	-15,78
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	6,70	6,70	8,41	-9,80	-2,87	-2,40	17,07
Var. IGCT p.p.	-0,14	-0,14	-0,22	-0,39	-0,77	-1,77	-3,15
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	3,96	3,96	4,59	-14,52	-3,69	-9,51	22,86
Var. SMALL CAP p.p.	0,55	0,55	-0,30	2,91	6,56	4,78	-1,63
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-12,56	-12,56	-13,55	-4,28	2,36	63,87	
% do CDI	-1.714,70	-1.714,70	-646,35	-123,26	47,13	833,31	
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	-5,30	-5,30	-2,11	2,57	23,55		
Var. MSCI ACWI p.p.	3,46	3,46	6,50	-1,05	14,39		
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-9,75	-9,75	-9,03	3,11	11,35	71,14	143,50
Var. Global BDRX p.p.	0,09	0,09	-0,12	-0,27	-2,22	-3,19	-6,48
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	-5,29	-5,29	-0,54	5,54	25,95	41,47	74,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. S&P 500 p.p.	3,76	3,76	6,37	-1,92	7,01	-34,20	-70,41
CARAGUATATUBA	-0,53	-0,53	2,17	-2,04	-1,06	2,76	17,07
Var. IPCA + 5,89% p.p.	-1,55	-1,55	-1,56	-10,75	-17,94	-26,56	-25,64
CDI	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90
IBOVESPA	6,98	6,98	8,35	-7,93	-2,54	-1,42	15,14
INPC + 6,00%	1,16	1,16	3,78	8,75	17,24	31,05	44,93
IPCA + 6,00%	1,03	1,03	3,76	8,77	17,00	29,59	43,15

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		2,00
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+2 du	D+2 du		0,20
BB PREV RF IRF-M	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 VII	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
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+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	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 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 DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	D+1 du	D+0	D+21 du	D+23 du		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		1,50
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		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		0,18
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,18
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						
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		0,18
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,18
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+8 du		1,00
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI						
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		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	0,63	0,63	2,31	2,54	3,53	7,08	14,16	22,11	34,75
IRF-M 1+	-0,50	-0,50	4,01	-1,41	-4,13	1,40	15,16	29,50	49,44
IRF-M TOTAL	-0,08	-0,08	3,63	-0,03	-1,28	3,58	15,45	27,96	45,98
IMA-B 5	0,11	0,11	3,42	3,32	4,57	12,47	26,04	38,75	56,48
IMA-B 5+	-1,61	-1,61	2,45	-4,92	-6,47	-3,03	18,62	39,06	60,95
IMA-B TOTAL	-0,73	-0,73	2,94	-0,91	-1,15	4,02	22,86	40,20	60,52
IMA-GERAL TOTAL	0,21	0,21	2,90	1,13	1,42	5,98	17,98	30,01	46,61
IDKA 2	0,05	0,05	3,41	3,29	4,87	13,47	25,98	38,94	57,36
IDKA 20	-2,92	-2,92	0,64	-12,61	-14,59	-13,99	10,19	35,73	59,77
CDI	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90	21,17	32,56

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,98	6,98	8,35	-7,93	-2,54	-1,42	15,14	32,07	73,41
IBRX 100	6,87	6,87	8,36	-9,14	-2,11	-0,51	18,37	36,58	79,96
IBRX 50	7,65	7,65	9,69	-8,20	-0,93	1,71	16,71	32,14	74,76
SMALL CAP	3,42	3,42	4,89	-17,43	-10,25	-14,29	24,49	41,16	97,42
IFIX	-0,99	-0,99	3,78	-1,67	-3,56	-9,76	15,24	21,52	43,53
Índice Consumo - ICON			-5,43	-22,83	-23,46	-26,51	5,30	5,50	37,84
Índice Dividendos - IDIV	7,47	7,47	10,17	0,27	5,96	1,18	28,50	52,53	93,40

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	0,54	0,54	2,24	5,63	10,38	15,41	20,25	24,79	28,35
INPC	0,67	0,67	2,26	5,61	10,60	16,72	21,74	26,09	28,45
IGPM	1,82	1,82	2,72	3,40	16,91	46,97	58,45	69,12	68,43
SELIC	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90	21,18	32,59

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	-9,05	-9,05	-6,91	7,47	18,94	75,67	144,98	170,90	239,48
MSCI ACWI	-8,76	-8,76	-8,61	3,62	9,17	61,14	114,25	124,36	183,76
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%	0,87	0,87	3,26	7,73	14,79	24,77	35,22	45,90	55,99
IPCA + 5,00%	0,95	0,95	3,51	8,26	15,90	27,17	39,15	51,57	63,59
IPCA + 5,50%	0,99	0,99	3,64	8,51	16,45	28,37	41,14	54,46	67,50
IPCA + 5,89%	1,02	1,02	3,73	8,72	16,88	29,32	42,71	56,75	70,61
IPCA + 6,00%	1,03	1,03	3,76	8,77	17,00	29,59	43,15	57,40	71,49
INPC + 4,00%	1,00	1,00	3,28	7,71	15,02	26,18	36,90	47,41	56,11
INPC + 6,00%	1,16	1,16	3,78	8,75	17,24	31,05	44,93	59,03	71,61

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	07/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	214.005,52	0,00	76.428,00913200	2,8000928250
2	10/01/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	43.000,00	10.971,40013600	3,9192810000
3	10/01/2022	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	400,00	0,00	11,50799401	34,7584470000
4	10/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	8.379,03	0,00	2.992,65955900	2,7998607370
5	19/01/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.734.058,32	0,00	950.198,40107500	3,9297670000
6	19/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.201.288,58	0,00	427.748,00199900	2,8084025510
7	20/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	46.721,45	0,00	16.619,61594900	2,8112232040
8	21/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	8.784,78	0,00	3.123,51184400	2,8124689250
9	24/01/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	296.968,45	0,00	75.487,06403100	3,9340310000
10	27/01/2022	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	2.917.322,08	1.916.990,45273000	1,5218240000
11	27/01/2022	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	2.803.260,83	1.842.040,09655800	1,5218240000
12	27/01/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.917.322,08	0,00	740.576,92112400	3,9392560000
13	27/01/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.524.614,12	0,00	640.886,02517800	3,9392560000
14	28/01/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	27.127,09	0,00	6.883,93700900	3,9406360000
15	28/01/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.026.940,94	768.135,12932500	3,9406360000
16	28/01/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	9.262,83	2.350,59264100	3,9406360000
17	28/01/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	278.646,71	0,00	70.711,10094900	3,9406360000
18	28/01/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	186.288,71	47.273,76743600	3,9406360000
19	31/01/2022	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.737,02	0,00	0,80989238	3.379,4860500000
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 15.031.169,57

Value-At-Risk: 2,75%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARAGUATATUBA		2,75	2,75			547.555.430,89	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,59%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150523 (5,900000%)		0,30	0,00	2,15			38.550.732,30	7,04
NTN-B 150822 (6,090000%)		0,16	0,00	2,14			15.610.946,54	2,85
Sub-total	0,34	0,22	0,00		1,25	1,15	54.161.678,84	9,89

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			16.103.617,90	2,94
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,61	0,00	0,83			362.040,06	0,07
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI		2,15	0,03	0,01			11.615.009,72	2,12
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,63	0,01	0,03			12.543.312,61	2,29
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,14	0,04	0,03			16.240.381,13	2,97
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,15	0,10	0,01			45.189.679,65	8,25
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		3,67	0,08	0,12			21.427.462,99	3,91
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,07	0,00	0,01			4.533.881,84	0,83
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI		3,59	0,02	0,01			4.131.859,31	0,75
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		3,61	0,13	0,08			34.495.437,07	6,30
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		2,52	0,08	0,03			32.500.181,54	5,94
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,60	0,02	0,26			11.740.792,19	2,14
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,79	0,01	0,02			4.885.923,29	0,89
BB PREV RF VII		0,77	0,00	2,08			480.990,20	0,09

Carteira: CARAGUATATUBA

Data Extrato: 31/01/2022

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		0,74	0,02	0,76			43.737.750,46	7,99
Sub-total	3,73	1,99	0,55		-0,33	-0,50	259.988.319,96	47,48

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,05	0,00	0,04			3.525.749,93	0,64
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO		2,47	0,06	2,47			25.438.835,22	4,65
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,07	0,00	0,07			19.919.934,27	3,64
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		0,59	0,00	0,61			2.462.104,79	0,45
Sub-total	2,67	1,26	0,06		-0,39	-0,30	51.346.624,21	9,38

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR		0,05	0,00	0,06			933.345,46	0,17
Sub-total	0,94	0,05	0,00		-0,49	0,27	933.345,46	0,17

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,20%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO F I A SELECTION		12,33	0,10	3,53			5.285.583,75	0,97
BB AÇÕES DIVIDENDOS		10,29	0,02	3,36			1.452.396,82	0,27
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		15,27	0,14	4,09			6.302.433,11	1,15
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		11,49	0,26	2,28			14.901.691,05	2,72
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		11,27	0,40	0,10			24.131.851,28	4,41
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS		10,91	0,12	2,12			7.404.373,93	1,35
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS		9,82	0,20	2,22			13.520.648,73	2,47
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		9,69	0,09	4,89			5.864.753,85	1,07
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		13,36	0,18	6,55			9.863.811,54	1,80
Sub-total	20,35	11,20	1,50		0,29	6,55	88.727.544,06	16,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 8,13%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI		8,13	0,47	5,80			46.860.325,68	8,56
Sub-total	18,05	8,13	0,47		-0,33	-5,29	46.860.325,68	8,56

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,81%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		8,15	0,00	8,16			1.398.600,60	0,26
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI		8,13	0,01	6,83			1.580.724,11	0,29
Sub-total	12,92	7,03	0,01		-0,74	-8,85	2.979.324,71	0,54

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		9,01	0,15	0,89			42.558.267,97	7,77
Sub-total	22,05	9,01	0,15		-0,48	-9,75	42.558.267,97	7,77