



**LDB**  
EMPRESAS

**VILA VELHA - CONSOLIDADO**  
FEVEREIRO 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 25.02.2022.

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 68,44%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,661000%)	4,11	1,11	2,26	20.549.103,01	4,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,840000%)	4,12	1,13	2,29	15.554.327,57	3,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (3,680000%) ..	0,45	0,97	1,95	7.219.427,39	1,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,290000%) ..	0,45	1,02	2,05	367.618,84	0,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,100000%) ..	0,45	1,07	2,17	14.268.431,73	3,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	4,13	0,42	0,69	25.131.499,81	5,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,260000%)	2,67	1,09	2,20	20.599.315,39	4,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,250000%)	2,80	1,08	2,20	25.318.567,45	5,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,270000%)	2,71	1,09	2,20	30.410.477,34	6,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,290000%)	2,67	1,09	2,20	25.351.614,32	5,40
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,48</b>	<b>1,00</b>	<b>2,07</b>	<b>184.770.382,85</b>	<b>39,39</b>

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 IDKA2	2,63	1,16	1,17	5.818.546,12	1,24	9.012.864.987,26	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,75	1,15	1,17	13.186.944,62	2,81	10.680.932.817,60	0,12
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,14	0,63	1,25	699.928,67	0,15	779.530.510,06	0,09

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,50	1,38	1,47	4.174.939,47	0,89	1.638.119.424,99	0,25
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	2,10	1,10	1,47	2.459.728,86	0,52	291.545.720,90	0,84
BB	BB	BB PREV RF VII	1,65	1,13	1,70	1.568.938,10	0,33	245.088.375,73	0,64
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,36	1,10	1,39	5.553.910,89	1,18	427.908.930,22	1,30
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	1,65	1,13	1,70	6.655.681,41	1,42	203.723.078,54	3,27
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,68	1,06	1,02	19.645.190,59	4,19	1.676.536.603,63	1,17
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,68	1,06	1,03	14.722.435,80	3,14	452.248.894,97	3,26
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	1,65	1,13	1,70	3.526.887,86	0,75	470.246.728,92	0,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,45	1,14	2,32	7.351.324,34	1,57	95.079.789,41	7,73
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,96</b>	<b>1,10</b>	<b>1,26</b>	<b>85.364.456,73</b>	<b>18,20</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,13	0,54	1,06	1.235.998,23	0,26	936.227.822,67	0,13
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,68	0,68	3.750.142,97	0,80	7.639.104.845,31	0,05
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	0,68	1,33	465.222,42	0,10	3.177.445.522,66	0,01
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,26	0,87	1,63	36.764.501,15	7,84	2.907.017.295,14	1,26
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,16	0,79	1,35	8.728.040,94	1,86	140.645.511,93	6,21
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,17</b>	<b>0,83</b>	<b>1,51</b>	<b>50.943.905,71</b>	<b>10,86</b>		

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3,21	0,37	0,40	0,00	0,00	614.226.993,42	0,00
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea b</b>			<b>3,21</b>	<b>0,37</b>	<b>0,45</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>2,48</b>	<b>1,00</b>	<b>1,73</b>	<b>321.078.745,29</b>	<b>68,44</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

13,99%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	19,24	0,80	7,55	295.710,56	0,06	1.039.411.814,62	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,33	-1,41	7,57	0,00	0,00	985.463.082,71	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	19,15	0,84	7,83	1.529.734,02	0,33	563.109.784,87	0,27
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	14,27	-2,56	-7,83	63.826.312,80	13,61	2.257.981.164,09	2,83
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>18,42</b>	<b>-2,31</b>	<b>-5,95</b>	<b>65.651.757,38</b>	<b>13,99</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>14,53</b>	<b>-2,31</b>	<b>-5,95</b>	<b>65.651.757,38</b>	<b>13,99</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

8,14%

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,56	-7,12	-16,17	17.541.212,98	3,74	2.975.370.153,41	0,59
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	18,39	-7,28	-18,15	4.294.248,32	0,92	2.643.901.267,54	0,16
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	18,23	-5,82	-15,82	16.348.249,89	3,48	1.110.111.462,43	1,47
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>18,06</b>	<b>-6,59</b>	<b>-16,25</b>	<b>38.183.711,19</b>	<b>8,14</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>18,06</b>	<b>-6,59</b>	<b>-16,25</b>	<b>38.183.711,19</b>	<b>8,14</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,43%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	14,34	-2,09	-7,29	44.215.770,79	9,43	3.122.842.560,56	1,42
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>14,34</b>	<b>-2,09</b>	<b>-7,29</b>	<b>44.215.770,79</b>	<b>9,43</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>19,80</b>	<b>-2,09</b>	<b>-7,29</b>	<b>44.215.770,79</b>	<b>9,43</b>		
<b>Total</b>			<b>5,04</b>	<b>-0,48</b>	<b>-2,25</b>	<b>469.129.984,65</b>	<b>100,00</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	4.889.855,04
<b>Sub-total Disponibilidades Financeiras</b>	<b>4.889.855,04</b>
<b>Total</b>	<b>474.019.839,69</b>



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	184.770.382,85	39,39	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	85.364.456,73	18,20	0,00	14,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	50.943.905,71	10,86	0,00	14,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	0,00	0,00	0,00	0,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>321.078.745,29</b>	<b>68,44</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	65.651.757,38	13,99	0,00	16,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>65.651.757,38</b>	<b>13,99</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	38.183.711,19	8,14	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>38.183.711,19</b>	<b>8,14</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	44.215.770,79	9,43	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>44.215.770,79</b>	<b>9,43</b>					15,00

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades por Artigo**

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,00 132,82	2,07 138,88	3,32 146,67	8,18 214,86	15,80 279,71	1.833.501,49	3.643.724,57
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,10 147,33	1,26 84,81	2,11 93,05	3,55 93,12	4,66 82,44	910.162,33	1.041.711,61
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,83 111,34	1,51 101,25				362.994,09	572.240,63
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,37 49,77	0,45 30,13				27.473,65	30.909,22
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-2,31 -3,21	-5,95 -13,88				-1.740.171,29	-4.889.985,00
Artigo 9º III % do CDI	-6,59 -878,63	-16,25 -1.092,53	-14,20 -627,81	-5,96 -156,57	0,60 10,69	-2.692.067,75	-7.408.556,22
Artigo 10º I % do CDI	-2,09 -279,42	-7,29 -489,88				-945.886,88	-3.474.854,74
<b>VILA VELHA - CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>-2.243.994,36</b>	<b>-10.484.809,93</b>

**RESULTADO POR ATIVO**

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150523 (5,661000%)	20.322.598,32	0,00	0,00	0,00	20.549.103,01	226.504,69	453.827,27
NTN-B 150523 (5,840000%)	15.380.919,60	0,00	0,00	0,00	15.554.327,57	173.407,97	347.602,15
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	7.150.047,79	0,00	0,00	0,00	7.219.427,39	69.379,60	138.201,59
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	363.924,83	0,00	0,00	0,00	367.618,84	3.694,01	7.372,70
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	14.116.817,97	0,00	0,00	0,00	14.268.431,73	151.613,76	303.330,38
NTN-B 150545 (5,730000%)	25.026.143,88	0,00	0,00	0,00	25.131.499,81	105.355,93	171.668,80
NTN-B 150555 (5,260000%)	20.378.108,70	0,00	0,00	0,00	20.599.315,39	221.206,69	442.781,76
NTN-B 150830 (5,250000%)	25.751.172,43	0,00	0,00	707.845,78	25.318.567,45	275.240,80	555.023,09
NTN-B 150840 (5,270000%)	30.902.656,74	0,00	0,00	823.097,45	30.410.477,34	330.918,05	667.169,07
NTN-B 150850 (5,290000%)	25.749.932,61	0,00	0,00	674.498,28	25.351.614,32	276.179,99	556.747,75

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					184.770.382,85	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	3.586.742,18	0,00	-99.721,48	0,00	3.526.887,86	39.867,16	60.021,50
BB PREV RF IDKA2	5.752.013,56	0,00	0,00	0,00	5.818.546,12	66.532,56	67.086,51
BB PREV RF IPCA	4.117.983,15	0,00	0,00	0,00	4.174.939,47	56.956,32	60.575,22
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	2.501.758,01	0,00	-69.304,10	0,00	2.459.728,86	27.274,95	36.395,98
BB PREV RF VII	1.596.778,92	0,00	-45.564,35	0,00	1.568.938,10	17.723,53	26.683,89
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	5.649.058,70	0,00	-156.331,49	0,00	5.553.910,89	61.183,68	77.640,72
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	6.768.298,13	0,00	-187.751,05	0,00	6.655.681,41	75.134,33	113.079,78
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.473.587,04	0,00	0,00	206.437,53	7.351.324,34	84.174,83	170.014,65
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.977.606,80	0,00	0,00	412.457,12	14.722.435,80	157.286,12	152.596,82
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.938.876,78	0,00	0,00	502.878,15	19.645.190,59	209.191,96	202.945,22
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	587.708,05	486.871,62	-378.965,41	0,00	699.928,67	4.314,41	8.106,32
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.954.649,34	6.121.772,80	0,00	0,00	13.186.944,62	110.522,48	123.321,33
					85.364.456,73	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	8.659.367,04	0,00	0,00	0,00	8.728.040,94	68.673,90	116.585,62
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.109.267,38	7.858.822,99	-8.744.664,28	0,00	1.235.998,23	12.572,14	24.285,92
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	22.903.212,64	13.606.579,18	0,00	0,00	36.764.501,15	254.709,33	380.065,06
BB PREV RF FLUXO FIC	287.117,28	329.275,12	-152.814,11	0,00	465.222,42	1.644,13	25.909,44
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.724.748,38	0,00	0,00	3.750.142,97	25.394,59	25.394,59
					50.943.905,71	0,00	0,00

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	7.364.991,51	0,00	-7.392.465,16	0,00	0,00	27.473,65	29.393,02
					0,00	0,00	0,00

## Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	65.504.866,17	0,00	0,00	0,00	63.826.312,80	-1.678.553,37	-5.423.595,40
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	293.358,15	0,00	0,00	0,00	295.710,56	2.352,41	20.763,41
FIA CAIXA BRASIL IBOVESA	1.516.921,64	0,00	0,00	0,00	1.529.734,02	12.812,38	111.106,03
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	9.966.637,75	0,00	-9.889.855,04	0,00	0,00	-76.782,71	730.586,61
					65.651.757,38	0,00	0,00

## Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	17.359.209,69	0,00	0,00	0,00	16.348.249,89	-1.010.959,80	-3.072.937,65
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18.885.242,35	0,00	0,00	0,00	17.541.212,98	-1.344.029,37	-3.383.344,45
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	4.631.326,90	0,00	0,00	0,00	4.294.248,32	-337.078,58	-952.274,12
					38.183.711,19	0,00	0,00

## Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	45.161.657,67	0,00	0,00	0,00	44.215.770,79	-945.886,88	-3.474.854,74
					44.215.770,79	0,00	0,00

## Disponibilidades Financeiras

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	0,00	4.889.855,04	0,00	0,00	4.889.855,04	0,00	0,00
					4.889.855,04	0,00	0,00

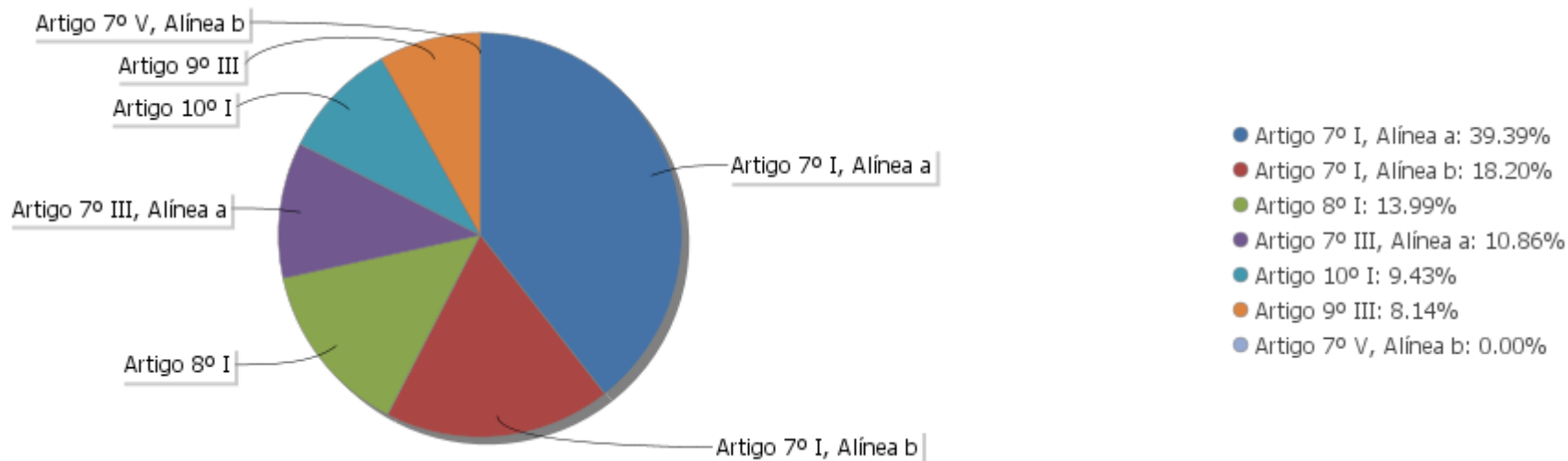
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

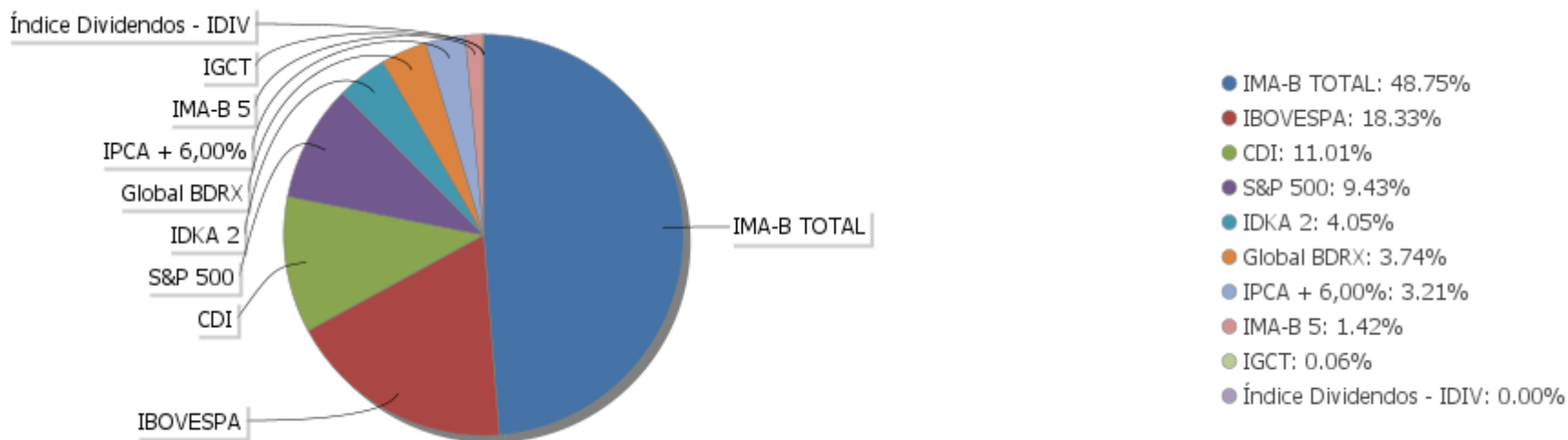
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	218.700.564,48	46,62	218.700.564,48	46,62
de 31 a 365 dias	19.102.831,71	4,07	237.803.396,19	50,69
acima de 365 dias	231.326.588,46	49,31	469.129.984,65	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

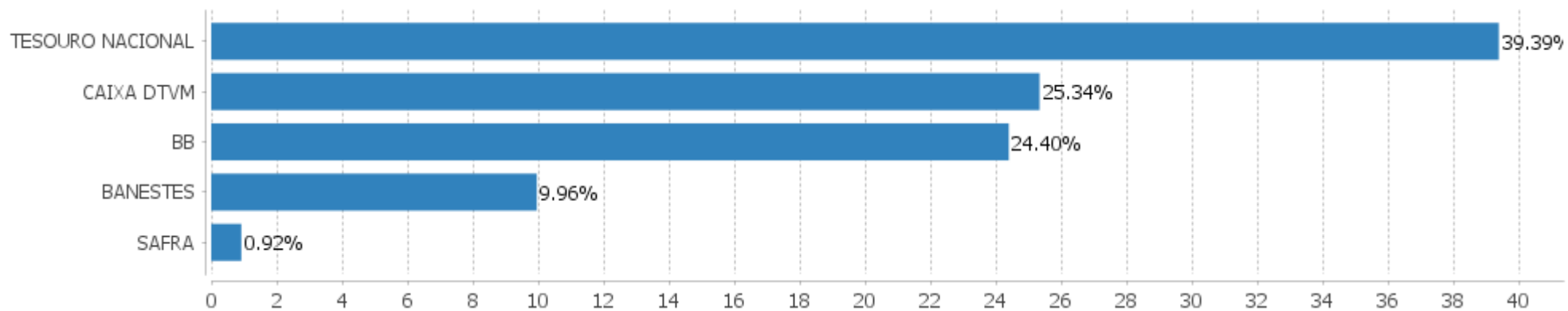


Alocação Por Estratégia



## 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	-1,78	-0,48											-2,25
IPCA + 4,92%	0,94	1,38											2,33
p.p. indexador	-2,72	-1,86											-4,58
2021	-0,48	-1,03	1,05	1,06	0,94	0,42	0,32	0,32	-1,16	1,81	0,80	2,14	6,31
IPCA + 5,43%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,97	1,43	1,34	1,61	1,68	1,37	1,22	16,01
p.p. indexador	-1,15	-2,27	-0,37	0,33	-0,33	-0,56	-1,10	-1,02	-2,77	0,13	-0,57	0,93	-9,70
2020	0,49	-0,79	-6,98	1,89	2,02	2,02	2,94	-0,49	-1,49	-0,01	2,81	3,55	5,63
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,63
p.p. indexador	-0,22	-1,45	-7,55	1,75	1,95	1,28	2,06	-1,21	-2,61	-1,35	1,46	1,69	-5,00
2019	2,66	0,46	0,52	1,25	2,07	2,43	1,16	-0,08	2,05	2,10	-0,88	2,10	16,97
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	1,83	-0,43	-0,68	0,19	1,43	1,98	0,44	-0,70	1,60	1,47	-1,85	0,46	6,38
2018								0,28	0,40	3,39	0,72	1,12	6,02
IPCA + 6,00%								0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	3,23
p.p. indexador								-0,17	-0,52	2,42	0,47	0,51	2,78

**Performance Sobre a Meta Atuarial**

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	20	46,51
Meses abaixo - Meta Atuarial	23	53,49
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,55	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-6,98	2020-03

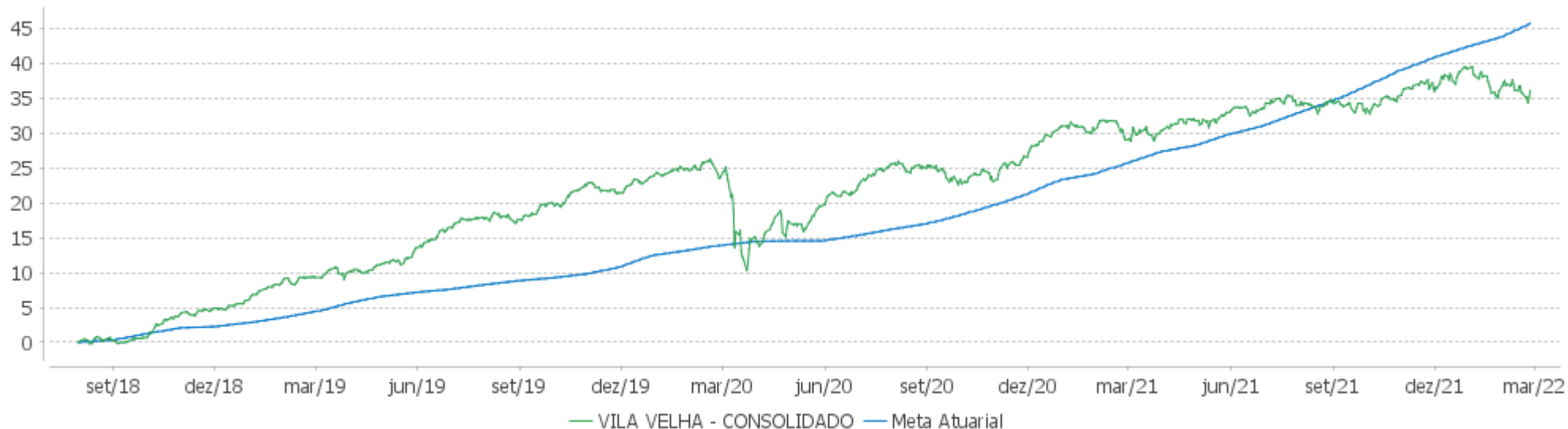
**Relatório**

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	-0,16	3,58	-3,74	6,25
06 meses	1,28	8,48	-7,20	5,69
12 meses	5,51	16,48	-10,98	5,04
24 meses	10,10	29,56	-19,45	7,14
36 meses	24,48	42,77	-18,29	6,16
Desde 31/07/2018	36,11	49,94	-13,83	5,75

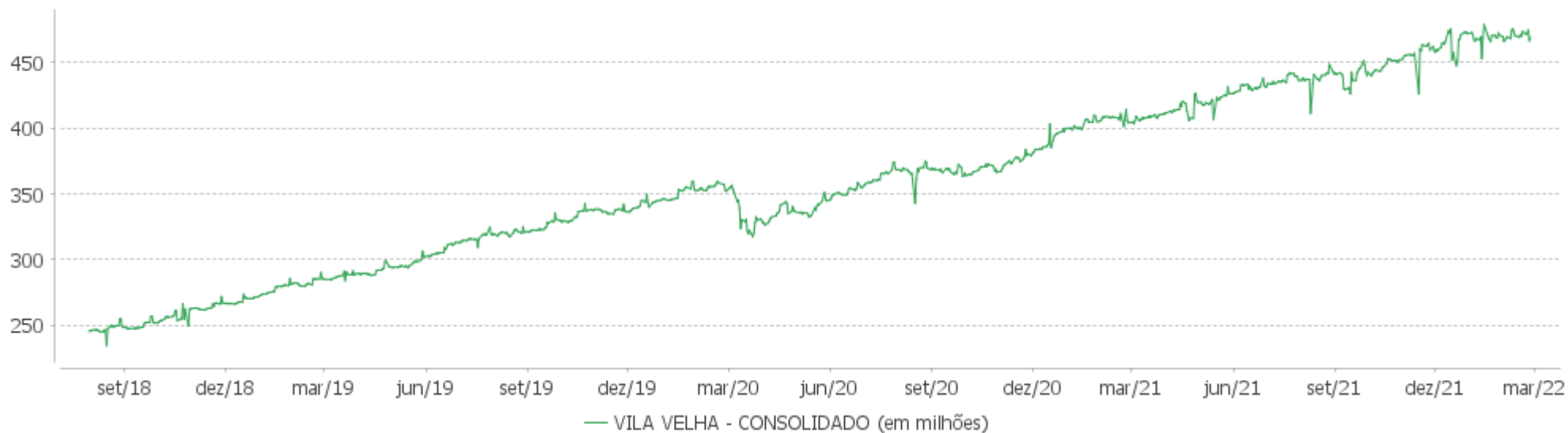


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

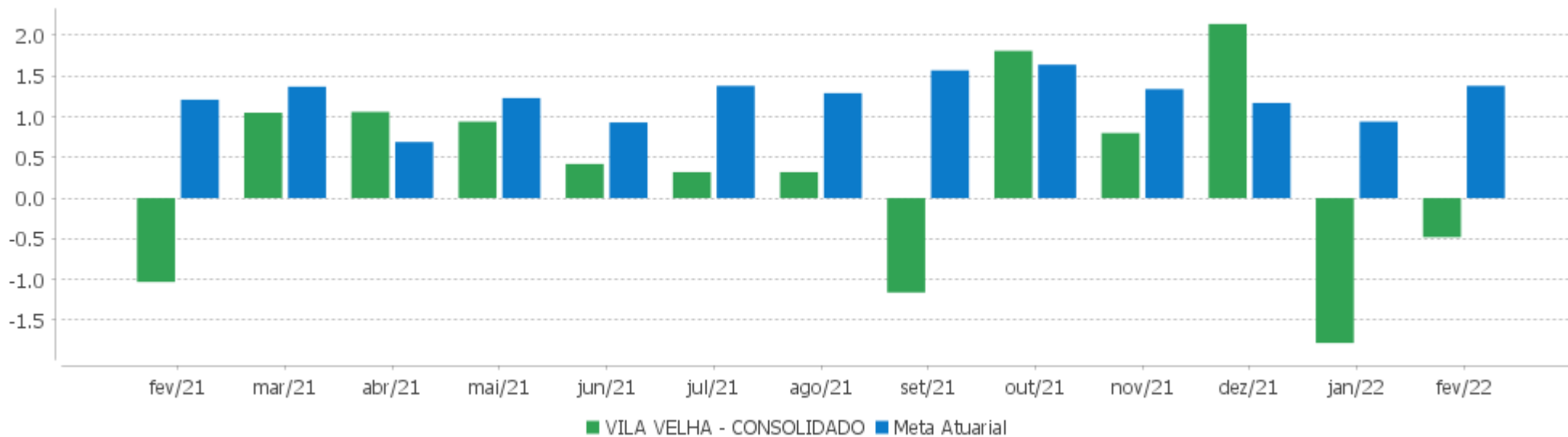


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,87 116,31	1,63 109,82	2,44 107,75	4,29 112,59	6,73 119,23	6,71 82,32	12,71 89,59
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	0,79 105,80	1,35 91,02	2,07 91,43	3,24 85,14	3,99 70,65	2,92 35,85	19,55 137,78
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,80 106,50	1,59 106,76	2,40 106,07	4,02 105,65	6,01 106,40	8,16 100,10	13,93 98,13
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,68 90,41	1,33 89,71	2,01 88,96	3,29 86,49	4,51 79,90	5,83 71,53	10,54 74,29
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO % do CDI	0,54 72,64	1,06 71,26	1,59 70,37	2,55 66,97	3,38 59,88	3,71 45,48	6,31 44,49
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,02 -0,43	1,05 -1,45	1,91 -1,88	4,35 -4,50	6,21 -11,00	12,25 -18,35	24,80 -19,15
NTN-B 150545 (5,100000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,07 0,53	2,17 2,37	3,42 3,39	8,32 7,59	16,22 15,30	27,89 23,77	39,86 17,01
NTN-B 150523 (5,661000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,11 0,57	2,26 2,45	3,55 3,52	5,50 4,77	10,26 9,34	15,14 11,02	19,50 -3,36
NTN-B 150850 (5,290000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,09 0,54	2,20 2,39	3,46 3,43	8,42 7,69	13,40 12,47	18,59 14,47	23,26 0,40
NTN-B 150545 (4,290000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,02 0,47	2,05 2,24	3,22 3,19	7,91 7,18	15,32 14,40	25,93 21,82	36,67 13,81
NTN-B 150523 (5,840000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,13 0,58	2,29 2,48	3,60 3,57	5,58 4,85	10,43 9,51	15,48 11,36	20,02 -2,84
NTN-B 150545 (3,680000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,97 0,43	1,95 2,15	3,07 3,03	7,60 6,87	14,64 13,72	24,47 20,36	34,29 11,43
NTN-B 150840 (5,270000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,09 0,54	2,20 2,39	3,46 3,43	8,41 7,68	13,32 12,40	18,39 14,28	22,94 0,08
NTN-B 150545 (5,730000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,42 -0,12	1,23 1,43	2,52 2,49	4,56 3,83	9,40 8,48	14,48 10,37	19,07 -3,79
NTN-B 150830 (5,250000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,08 0,54	2,20 2,39	3,45 3,42	8,40 7,67	13,21 12,29	18,06 13,94	22,38 -0,48
NTN-B 150555 (5,260000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,09 0,54	2,20 2,39	3,46 3,42	8,40 7,67	13,39 12,47	18,62 14,50	23,32 0,46
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	1,10	1,47	2,15	4,62	7,28	14,31	30,24

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,56	1,67	2,12	3,89	6,36	10,19	7,39
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,14	2,32	3,65	8,79	17,24	30,04	39,66
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,31	-0,18	-0,15	-0,06	0,04	-0,55	-4,29
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	1,13	1,70	2,29	4,89	8,08	15,77	30,69
Var. IMA-B 5 p.p.	0,06	0,52	0,31	0,62	1,76	2,83	4,01
BB PREV RF VII	1,13	1,70	2,29	4,89	8,08	13,76	24,11
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,58	1,89	2,26	4,16	7,16	9,65	1,25
BB PREV RF IDKA2	1,16	1,17	1,88	4,11	6,26	13,10	24,76
Var. IDKA 2 p.p.	-0,10	-0,14	-0,27	-0,20	-0,44	-1,02	-2,13
BB PREV RF IPCA	1,38	1,47	2,03	4,19	6,58	13,51	30,04
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,07	-1,03	-1,76	-4,66	-10,63	-17,09	-13,91
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,06	1,02	1,88	4,07	5,70	11,45	29,32
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,51	1,22	1,85	3,34	4,77	7,33	6,46
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	1,13	1,70	2,29	4,90	8,10	15,41	29,39
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,33	-0,80	-1,51	-3,95	-9,10	-15,19	-14,56
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,15	1,17	1,89	4,12	6,30	13,18	24,90
Var. IDKA 2 p.p.	-0,11	-0,14	-0,26	-0,19	-0,40	-0,93	-1,99
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,06	1,03	1,89	4,07	5,69	11,44	29,32
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,51	1,22	1,85	3,34	4,77	7,32	6,46
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,63	1,25	1,88	3,10	4,41	6,00	10,98
% do CDI	84,60	83,78	83,24	81,29	78,14	73,57	77,34
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	1,10	1,39	2,11	4,52	6,99	13,03	27,17
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,55	1,58	2,07	3,79	6,06	8,91	4,32
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	0,84	7,83	10,92	-4,87	2,52	7,99	17,46
Var. IBOVESPA p.p.	-0,05	-0,10	-0,10	-0,12	-0,31	-0,62	-0,91
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	-2,56	-7,83	-2,97	-1,50	17,44		
Var. IBOVESPA p.p.	-3,45	-15,77	-13,98	3,25	14,62		
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	-0,71	8,04	7,69	-2,49	5,01	4,82	25,65
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,61	3,06	1,03	-0,93	-4,18	-0,51	-2,47
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	0,80	7,55	11,25	-6,12	1,23	6,67	20,17
Var. IGCT p.p.	-0,15	-0,30	-0,35	-0,53	-0,95	-2,11	-3,39
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-7,12	-16,17	-14,74	-6,50	-0,12	68,54	113,78
Var. Global BDRX p.p.	-0,30	-0,19	-0,20	-0,69	-1,95	-3,73	-6,06
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	-5,82	-15,82	-13,38	-4,95	1,87	66,41	98,46
Var. IBOVESPA p.p.	-6,71	-23,76	-24,40	-0,21	-0,95	57,80	80,09
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	-7,28	-18,15	-15,33	-8,66	1,13	56,20	102,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-8,17	-26,09	-26,34	-3,91	-1,69	47,59	84,05
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-2,09 4,76	-7,29 7,99	-2,13 10,07	-0,03 3,10	19,98 13,06	47,75 -21,81	62,22 -54,26
VILA VELHA - CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,92% p.p.	-0,48 -1,86	-2,25 -4,58	-0,16 -3,69	1,28 -7,03	5,51 -10,50	10,10 -17,86	24,48 -15,13
CDI	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19
IBOVESPA	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	18,37
INPC + 6,00%	1,44	2,62	3,92	8,81	17,47	32,17	45,56
IPCA + 6,00%	1,45	2,50	3,80	8,85	17,20	30,60	43,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du		0,50
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+0		1,70
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,60
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	D+0	D+0	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)		0,20
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IPCA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREV RF VII	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50

**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	0,74	1,38	2,27	2,93	4,26	7,47	14,48	22,35	34,40
IRF-M 1+	0,48	-0,02	2,26	0,18	-1,69	1,08	15,45	28,42	46,68
IRF-M TOTAL	0,58	0,50	2,40	1,16	0,48	3,51	15,79	27,30	43,94
IMA-B 5	1,06	1,18	1,97	4,26	6,32	12,94	26,68	39,47	55,81
IMA-B 5+	0,01	-1,60	-1,93	-2,75	-4,23	-3,33	17,98	38,31	53,22
IMA-B TOTAL	0,54	-0,19	0,03	0,73	0,92	4,12	22,86	40,19	55,41
IMA-GERAL TOTAL	0,74	0,95	1,83	2,30	2,88	6,29	18,28	30,05	44,43
IDKA 2	1,26	1,31	2,15	4,31	6,70	14,12	26,89	39,82	57,21
IDKA 20	-0,58	-3,49	-5,69	-9,10	-12,75	-14,41	8,86	34,44	45,63
CDI	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19	21,51	32,41

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	18,37	32,56	69,72
IBRX 100	1,46	8,43	11,83	-4,71	2,87	9,99	22,25	38,00	76,75
IBRX 50	1,74	9,53	13,65	-3,21	4,78	13,29	20,78	33,87	72,89
SMALL CAP	-5,19	-1,95	1,77	-18,60	-13,32	-11,41	20,21	34,33	77,03
IFIX	-1,29	-2,27	6,31	-0,32	-5,04	-7,51	12,59	18,59	35,11
Índice Consumo - ICON	-2,51		-0,33	-21,72	-21,21	-20,40	7,27	6,67	33,15
Índice Dividendos - IDIV	-2,32	4,98	6,66	-1,56	9,19	5,34	28,12	49,91	76,56



**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	1,01	1,56	2,30	5,77	10,54	16,29	20,94	25,65	29,22
INPC	1,00	1,68	2,42	5,73	10,80	17,68	22,30	27,12	29,42
IGPM	1,83	3,68	4,59	4,61	16,12	49,73	59,94	72,10	71,38
SELIC	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19	21,52	32,43

**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	-6,85	-15,28	-12,20	-3,13	6,92	69,56	116,47	155,90	207,13
MSCI ACWI	-6,59	-14,77	-12,07	-5,84	-1,21	55,63	90,73	113,55	160,11

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,31	2,19	3,30	7,83	14,98	25,74	35,98	46,92	57,07
IPCA + 5,00%	1,38	2,35	3,55	8,34	16,09	28,16	39,93	52,64	64,73
IPCA + 5,50%	1,42	2,42	3,68	8,60	16,65	29,37	41,93	55,56	68,67
IPCA + 5,89%	1,45	2,48	3,77	8,79	17,08	30,33	43,50	57,86	71,80
IPCA + 6,00%	1,45	2,50	3,80	8,85	17,20	30,60	43,95	58,52	72,69
INPC + 4,00%	1,30	2,31	3,43	7,79	15,25	27,25	37,51	48,64	57,31
INPC + 6,00%	1,44	2,62	3,92	8,81	17,47	32,17	45,56	60,37	72,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1330	01/02/2022	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	0,00	5.000.000,00	2.343.700,93102710	2,1333780000
1315	03/02/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	569,46	258,89190200	2,1996053010
1313	03/02/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.724.748,38	0,00	1.532.897,50597400	2,4298743820
1348	03/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	61.945,76	7.410,50608018	8,3591807800
1309	03/02/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	71.503,54	0,00	36.537,17307200	1,9570080000
1336	03/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.145,29	376,26773275	8,3591807800
1316	04/02/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	18.732,64	8.513,39058100	2,2003736140
1334	04/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.004,51	0,00	120,13330478	8,3616279600
1317	07/02/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	46,85	21,28390700	2,2011936450
1349	08/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.713,24	324,29536189	8,3665704700
1337	08/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	251,92	30,11030634	8,3665704700
1305	08/02/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.000.000,00	0,00	1.980.481,16978300	2,5246390000
1318	09/02/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	46.625,68	21.166,71487000	2,2027830150
1350	09/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	692.232,27	82.713,09019928	8,3690776000
1310	09/02/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	27.572,60	0,00	14.070,12969100	1,9596550000
1338	09/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	29.922,92	3.575,41433454	8,3690776000
1331	11/02/2022	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	7.175.783,03	0,00	3.897.023,16031035	1,8413498547
1326	11/02/2022	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	0,00	7.392.465,16	2.994.823,08180200	2,4684146470
1319	14/02/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	17.009,56	7.713,45129700	2,2051814870
1307	14/02/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	83.509,68	42.570,77496500	1,9616670000
1324	15/02/2022	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	0,00	99.721,48	40.208,89809300	2,4800848750
1325	15/02/2022	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	0,00	69.304,10	27.486,07401100	2,5214259400
1327	15/02/2022	BB PREV RF VII	0,00	45.564,35	22.985,11631500	1,9823415020
1328	15/02/2022	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	0,00	156.331,49	75.195,36646700	2,0790042970
1329	15/02/2022	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	0,00	187.751,05	100.648,80505100	1,8654076410
1320	16/02/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.132,59	1.872,68224100	2,2067758800
1351	16/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	219.041,52	26.134,37378396	8,3813571300
1339	16/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	23.617,30	2.817,83721172	8,3813571300

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1332	16/02/2022	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	2.980.796,15	0,00	1.616.688,86295714	1,8437661200
1321	17/02/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	17.901,29	8.109,03074700	2,2075745620
1345	17/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	477.734,19	0,00	56.983,49581316	8,3837290600
1335	17/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.834.018,33	0,00	218.759,25570412	8,3837290600
1346	18/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	51.512,18	0,00	6.142,43931252	8,3862741500
1340	18/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	331.552,27	39.535,10943904	8,3862741500
1341	18/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.007,47	120,13330478	8,3862741500
1342	18/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	402.473,94	47.991,98463980	8,3862741500
1333	18/02/2022	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	3.450.000,00	0,00	1.869.394,49239846	1,8455173700
1306	18/02/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.121.772,80	0,00	443.546,59250000	2,5290980000
1322	22/02/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	600,90	271,89701600	2,2100279340
1352	22/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.656,25	316,55181628	8,3912012600
1311	22/02/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	302.213,66	0,00	153.744,39191500	1,9656890000
1347	23/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	5.494.553,78	0,00	654.604,28062899	8,3937028000
1314	24/02/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	329.275,12	0,00	148.881,00907000	2,2116663640
1353	24/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	375.330,60	44.702,94899304	8,3961037600
1356	24/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	51.572,56	6.142,43931252	8,3961037600
1354	24/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	374.289,57	44.578,96005403	8,3961037600
1357	24/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.941.911,21	469.492,91249436	8,3961037600
1355	24/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	478.439,34	56.983,49581316	8,3961037600
1312	24/02/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	85.581,82	0,00	43.508,47349900	1,9670150000
1343	24/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.012.665,34	120.611,34168943	8,3961037600
1412	24/02/2022	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	0,00	4.889.855,04	2.321.836,51792069	2,1060290000
	24/02/2022	DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	4.889.855,04	0,00	4.889.855,04000000	1,0000000000
1323	25/02/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	47.195,14	21.331,66157400	2,2124455630
1358	25/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	701.706,50	83.551,35129975	8,3985057000
1308	25/02/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	295.455,73	150.152,22412100	1,9677080000
1344	25/02/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	38.189,01	4.547,11961525	8,3985057000
<b>Total</b>			<b>37.017.925,13</b>	<b>27.117.436,47</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Análise de Risco**

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

Value-At-Risk (R\$): 12.298.213,70

Value-At-Risk: 2,62%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VILA VELHA - CONSOLIDADO		2,62	2,62			469.129.984,65	100,00

**Renda Fixa**

Value-At-Risk: 0,33%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150523 (5,661000%)		0,23	-0,00	2,13			20.549.103,01	4,38
NTN-B 150523 (5,840000%)		0,23	-0,00	2,13			15.554.327,57	3,32
NTN-B 150545 (3,680000%) ..		0,09	0,00	2,13			7.219.427,39	1,54
NTN-B 150545 (4,290000%) ..		0,09	0,00	2,13			367.618,84	0,08
NTN-B 150545 (5,100000%) ..		0,09	0,00	2,13			14.268.431,73	3,04
NTN-B 150545 (5,730000%)		0,30	-0,00	2,13			25.131.499,81	5,36
NTN-B 150555 (5,260000%)		0,09	0,00	2,13			20.599.315,39	4,39
NTN-B 150830 (5,250000%)		0,12	0,00	2,13			25.318.567,45	5,40
NTN-B 150840 (5,270000%)		0,12	0,00	2,13			30.410.477,34	6,48
NTN-B 150850 (5,290000%)		0,12	0,00	2,13			25.351.614,32	5,40
<b>Sub-total</b>	0,52	0,11	-0,00		0,47	1,00	184.770.382,85	39,39

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IDKA2		1,35	0,00	0,37			5.818.546,12	1,24
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,60	0,00	0,25			13.186.944,62	2,81
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,04	-0,00	0,00			699.928,67	0,15
BB PREV RF IPCA		1,33	0,00	1,33			4.174.939,47	0,89
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI		1,12	0,00	1,57			2.459.728,86	0,52
BB PREV RF VII		0,77	0,00	2,03			1.568.938,10	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI		1,01	0,00	1,50			5.553.910,89	1,18
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP		0,77	0,00	0,96			6.655.681,41	1,42
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,54	0,00	1,07			19.645.190,59	4,19
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,54	0,00	1,07			14.722.435,80	3,14
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI		0,77	0,00	0,78			3.526.887,86	0,75
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,09	0,00	0,11			7.351.324,34	1,57
<b>Sub-total</b>	<b>1,88</b>	<b>1,17</b>	<b>0,01</b>		<b>0,19</b>	<b>1,10</b>	<b>85.364.456,73</b>	<b>18,20</b>

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO		0,04	-0,00	0,01			1.235.998,23	0,26
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,06	-0,00	0,03			3.750.142,97	0,80
BB PREV RF FLUXO FIC		0,04	-0,00	0,00			465.222,42	0,10
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI		0,07	-0,00	0,06			36.764.501,15	7,84
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF		0,30	0,00	0,29			8.728.040,94	1,86
<b>Sub-total</b>	<b>0,11</b>	<b>0,08</b>	<b>-0,00</b>		<b>0,77</b>	<b>0,83</b>	<b>50.943.905,71</b>	<b>10,86</b>

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
<b>Sub-total</b>	<b>2,36</b>	<b>NaN</b>	<b>0,00</b>		<b>-0,16</b>	<b>0,37</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,66%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		10,34	0,00	0,10			295.710,56	0,06
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA		9,72	0,01	0,16			1.529.734,02	0,33
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA		8,83	1,18	11,35			63.826.312,80	13,61

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
<b>Sub-total</b>	20,34	8,66	1,18		-0,15	-2,31	65.651.757,38	13,99

**Investimentos Estruturados**

Value-At-Risk: 8,68%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		8,68	0,80	6,14			44.215.770,79	9,43
<b>Sub-total</b>	21,98	8,68	0,80		-0,13	-2,09	44.215.770,79	9,43

**Investimentos no Exterior**

Value-At-Risk: 9,41%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		9,66	0,29	0,82			17.541.212,98	3,74
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		10,15	0,08	14,57			4.294.248,32	0,92
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I		9,56	0,26	14,24			16.348.249,89	3,48
<b>Sub-total</b>	27,47	9,41	0,63		-0,27	-6,59	38.183.711,19	8,14