



LDB
EMPRESAS

VILA VELHA - CONSOLIDADO
OUTUBRO 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 31.10.2022.

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 86,86%

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%)	2,94	0,54	9,64	21.401.267,38	3,97
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,840000%)	2,94	0,55	9,79	16.216.982,85	3,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (6,000000%)	2,95	0,56	4,60	40.639.031,86	7,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (6,760000%)	4,15	0,62	2,04	22.445.926,99	4,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (7,950000%)	4,20	0,71	1,18	84.434.143,99	15,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (3,680000%) ..	0,65	0,38	7,93	7.479.225,07	1,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,290000%) ..	0,65	0,43	8,45	381.645,86	0,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,100000%) ..	0,65	0,49	9,15	14.851.579,62	2,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	4,56	0,54	9,10	26.476.477,56	4,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,260000%)	0,65	0,51	9,29	21.460.654,76	3,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,250000%)	0,66	0,50	9,28	26.332.018,07	4,89
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,270000%)	0,66	0,51	9,30	31.660.258,77	5,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,290000%)	0,66	0,51	9,32	26.409.151,41	4,90
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,79	0,57	9,92	340.188.364,19	63,18

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,11	0,62	0,62	1.666.392,59	0,31	2.666.161.216,37	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,92	1,89	8,19	20.412.221,07	3,79	3.200.270.776,09	0,64
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,92	1,89	8,17	15.324.857,21	2,85	470.754.249,93	3,26
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,63	1,85	8,72	6.252.734,70	1,16	7.996.820.457,76	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,70	1,83	8,48	65.365,74	0,01	8.108.886.938,29	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,11	0,89	8,56	10.001.719,37	1,86	818.815.798,11	1,22
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,01	2,24	9,55	4.507.475,99	0,84	3.736.730.846,68	0,12
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	1,96	1,88	9,63	853.398,87	0,16	101.151.306,54	0,84
BB	BB	BB PREV RF VII	1,54	1,00	11,60	1.721.758,09	0,32	96.211.778,28	1,79
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,06	1,89	9,36	2.643.545,61	0,49	203.675.715,62	1,30
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,12	1,02	5,69	5.100.700,38	0,95	3.431.042.897,91	0,15
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,08	1,62	9,33	68.550.169,62	12,73		

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	0,11	0,47	7,08	0,00	0,00	683.555.024,40	0,00
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,12	1,04	9,23	4.068.455,92	0,76	12.427.649.222,70	0,03
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,12	0,95	9,10	1.907.504,69	0,35	3.859.205.707,52	0,05
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,16	1,07	3,98	26.430.448,70	4,91	3.446.775.272,58	0,77
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,14	1,02	8,33	26.577.117,79	4,94	5.698.434.941,39	0,47
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,13	1,04	10,04	58.983.527,10	10,95		
Renda Fixa			0,96	0,79	9,34	467.722.060,91	86,86		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

2,87%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	17,62	3,84	-0,66	3.491.877,77	0,65	241.413.999,35	1,45
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇÁ FI	20,68	5,63	9,42	300.843,23	0,06	907.112.837,29	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	20,10	5,36	10,73	11.618.354,94	2,16	533.817.936,67	2,18
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	22,80	7,70	-14,01	21.560,20	0,00	1.381.539.424,92	0,00
Sub-total Artigo 8º I			19,89	5,02	-5,23	15.432.636,14	2,87		
Renda Variável			19,15	5,02	-5,23	15.432.636,14	2,87		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,26%

Artigo 9º III (Fundos de 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	24,16	1,70	-29,79	14.690.755,79	2,73	2.030.078.847,62	0,72
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	24,28	2,32	-31,47	3.595.510,27	0,67	1.004.133.508,36	0,36
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	22,89	4,33	-26,73	4.639.273,67	0,86	690.721.324,94	0,67
Sub-total Artigo 9º III			23,39	2,32	-29,41	22.925.539,73	4,26		
Investimentos no Exterior			23,39	2,32	-29,41	22.925.539,73	4,26		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

6,01%

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	23,03	8,77	-12,72	32.374.313,10	6,01	1.767.351.817,15	1,83
Sub-total Artigo 10º I			23,03	8,77	-12,72	32.374.313,10	6,01		
Investimentos Estruturados			24,25	8,77	-12,72	32.374.313,10	6,01		
Total			4,77	1,41	2,27	538.454.549,88	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	340.188.364,19	63,18	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	68.550.169,62	12,73	0,00	14,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	58.983.527,10	10,95	0,00	14,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	467.722.060,91	86,86					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	15.432.636,14	2,87	0,00	16,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	15.432.636,14	2,87					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	22.925.539,73	4,26	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	22.925.539,73	4,26					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	32.374.313,10	6,01	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	32.374.313,10	6,01					15,00
Total		538.454.549,88	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,57 56,12	9,92 99,15	0,80 24,42	3,90 59,98	13,14 114,38	1.937.560,85	21.163.150,27
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,62 158,25	9,33 93,27	2,38 72,28	3,77 57,87	12,63 109,90	1.152.716,11	8.023.767,13
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,04 101,63	10,04 100,38	3,36 101,84	6,57 100,99		591.279,58	4.441.034,32
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	0,45 4,48	0,00 0,00	0,00 0,00		0,00	30.909,22
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,02 -0,43	-5,23 -15,93	10,86 -1,61	6,53 -1,03		738.063,35	-3.624.106,24
Artigo 9º III % do CDI	2,32 227,32	-29,41 -294,02	-9,00 -273,09	-5,43 -83,49	-28,45 -247,54	519.850,89	-12.666.727,68
Artigo 10º I % do CDI	8,77 859,48	-12,72 -127,14	-3,83 -116,16	-1,40 -21,47		2.610.985,25	-5.316.308,82
VILA VELHA - CONSOLIDADO (Total)						7.550.456,03	12.051.718,20

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%)	21.287.287,86	0,00	0,00	0,00	21.401.267,38	113.979,52	1.920.365,85
NTN-B 150523 (5,840000%)	16.128.457,77	0,00	0,00	0,00	16.216.982,85	88.525,08	1.476.209,49
NTN-B 150523 (6,000000%)	40.412.310,51	0,00	0,00	0,00	40.639.031,86	226.721,35	1.809.120,64
NTN-B 150523 (6,760000%)	22.308.060,87	0,00	0,00	0,00	22.445.926,99	137.866,12	448.832,96
NTN-B 150523 (7,950000%)	83.841.803,41	0,00	0,00	0,00	84.434.143,99	592.340,58	988.240,42
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	7.450.577,12	0,00	0,00	0,00	7.479.225,07	28.647,95	558.692,54
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	380.007,31	0,00	0,00	0,00	381.645,86	1.638,55	30.281,68
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	14.778.725,64	0,00	0,00	0,00	14.851.579,62	72.853,98	1.269.220,43
NTN-B 150545 (5,730000%)	26.334.103,49	0,00	0,00	0,00	26.476.477,56	142.374,07	2.252.913,91
NTN-B 150555 (5,260000%)	21.352.814,37	0,00	0,00	0,00	21.460.654,76	107.840,39	1.859.243,35

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150830 (5,250000%)	26.199.877,78	0,00	0,00	0,00	26.332.018,07	132.140,29	2.306.098,51
NTN-B 150840 (5,270000%)	31.500.919,36	0,00	0,00	0,00	31.660.258,77	159.339,41	2.774.675,59
NTN-B 150850 (5,290000%)	26.275.857,85	0,00	0,00	0,00	26.409.151,41	133.293,56	2.317.159,21
					340.188.364,19	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\$)
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	6.486.537,34	-4.835.847,55	0,00	1.666.392,59	15.702,80	15.702,80
BB PREV RF IDKA2	6.138.905,08	0,00	0,00	0,00	6.252.734,70	113.829,62	501.275,09
BB PREV RF IPCA	4.408.610,68	0,00	0,00	0,00	4.507.475,99	98.865,31	393.111,74
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	837.614,59	0,00	0,00	0,00	853.398,87	15.784,28	206.941,55
BB PREV RF VII	1.704.654,37	0,00	0,00	0,00	1.721.758,09	17.103,72	179.503,88
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2.594.588,62	0,00	0,00	0,00	2.643.545,61	48.956,99	463.718,47
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.040.399,40	0,00	0,00	0,00	15.324.857,21	284.457,81	1.186.031,03
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.032.741,96	0,00	0,00	0,00	20.412.221,07	379.479,11	1.585.200,22
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	12.516.330,82	3.532.935,19	-6.173.296,81	0,00	10.001.719,37	125.750,17	365.951,27
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	64.191,01	0,00	0,00	0,00	65.365,74	1.174,73	1.321.742,45
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	5.049.088,81	0,00	0,00	0,00	5.100.700,38	51.611,57	316.188,85
					68.550.169,62	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 INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.060.874,55	0,00	-2.066.916,71	0,00	0,00	6.042,16	218.936,14
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	22.013.207,59	4.160.000,00	0,00	0,00	26.430.448,70	257.241,11	2.716.033,89
BB PREV RF FLUXO FIC	1.936.705,06	301.150,92	-347.304,54	0,00	1.907.504,69	16.953,25	116.277,60
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.026.615,28	0,00	0,00	0,00	4.068.455,92	41.840,64	343.707,54
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	26.307.915,37	0,00	0,00	0,00	26.577.117,79	269.202,42	892.156,00
					58.983.527,10	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	20.018,79	0,00	0,00	0,00	21.560,20	1.541,41	-4.228.348,00
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	284.802,52	0,00	0,00	0,00	300.843,23	16.040,71	25.896,08
FIA CAIXA BRASIL IBOVESA	11.027.129,73	0,00	0,00	0,00	11.618.354,94	591.225,21	199.726,95
FIA CAIXA DIVIDENDOS	3.362.621,75	0,00	0,00	0,00	3.491.877,77	129.256,02	-23.122,23
					15.432.636,14	0,00	0,00

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	4.446.813,65	0,00	0,00	0,00	4.639.273,67	192.460,02	-4.781.913,87
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	14.444.760,77	0,00	0,00	0,00	14.690.755,79	245.995,02	-6.233.801,64
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	3.514.114,42	0,00	0,00	0,00	3.595.510,27	81.395,85	-1.651.012,17
					22.925.539,73	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	29.763.327,85	0,00	0,00	0,00	32.374.313,10	2.610.985,25	-5.316.308,82
					32.374.313,10	0,00	0,00

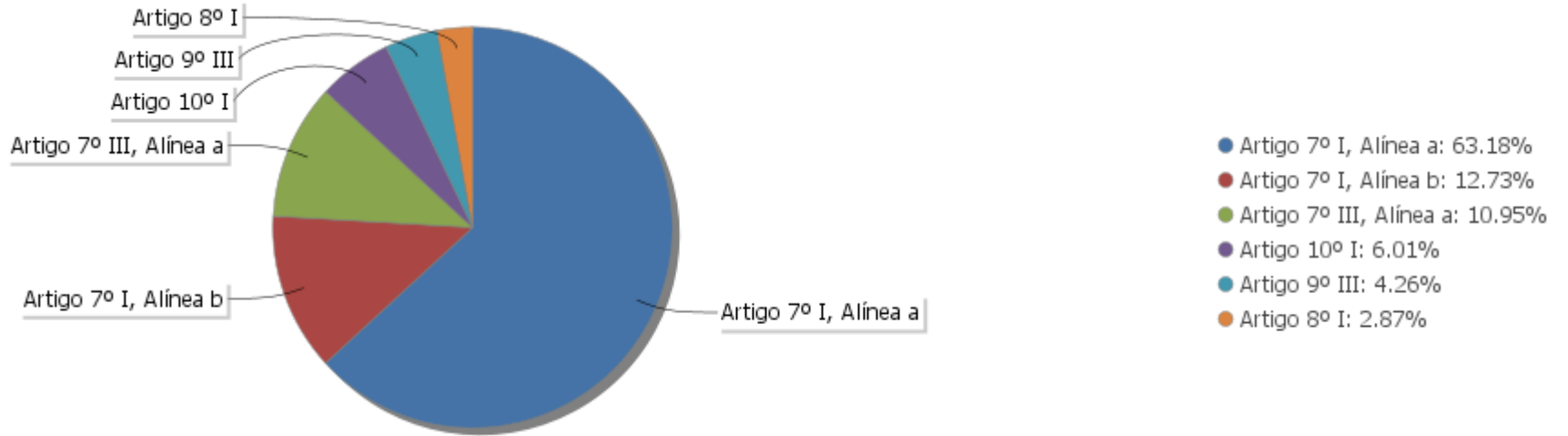
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

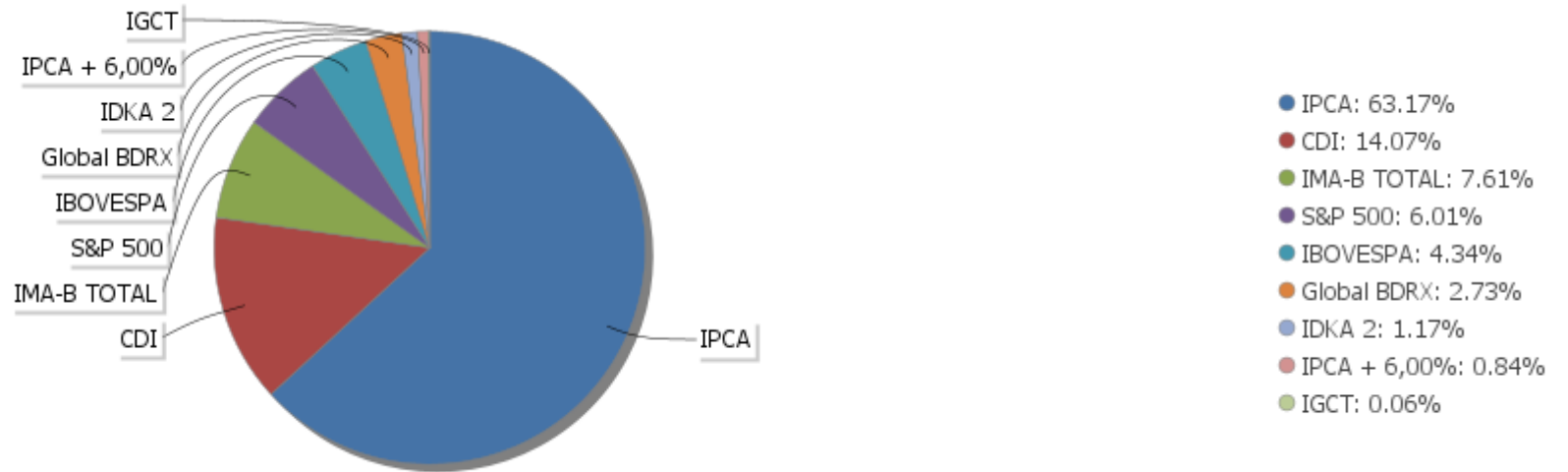
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	154.524.686,94	28,70	154.524.686,94	28,70
de 31 a 365 dias	189.644.829,06	35,22	344.169.516,00	63,92
acima de 365 dias	194.285.033,88	36,08	538.454.549,88	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

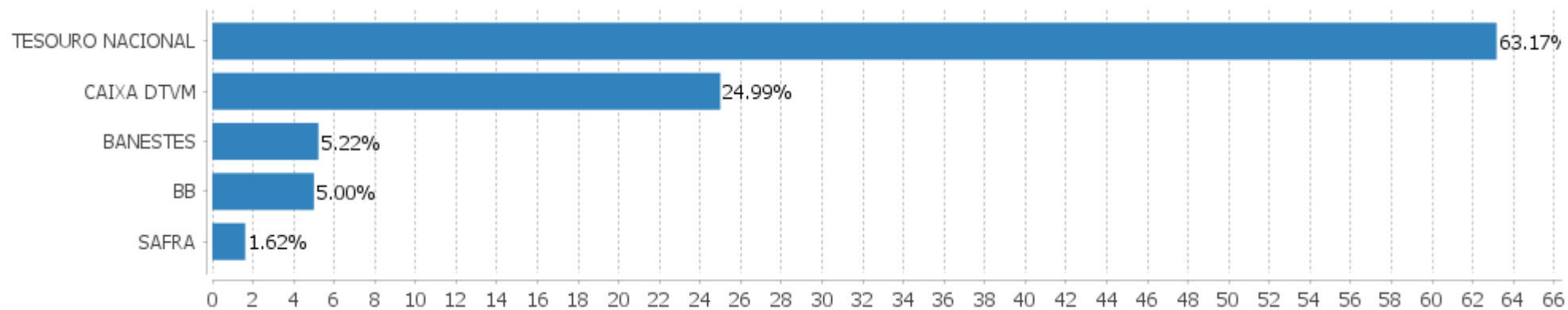


Alocação Por Estratégia



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	1,88	-0,54	0,98	-0,27	1,69	0,00	-0,58	1,41			2,27
IPCA + 4,92%	0,94	1,38	2,05	1,43	0,89	1,07	-0,28	0,08	0,11	0,97			8,96
p.p. indexador	-2,72	-1,86	-0,16	-1,97	0,09	-1,35	1,97	-0,08	-0,69	0,43			-6,69
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

Relatório

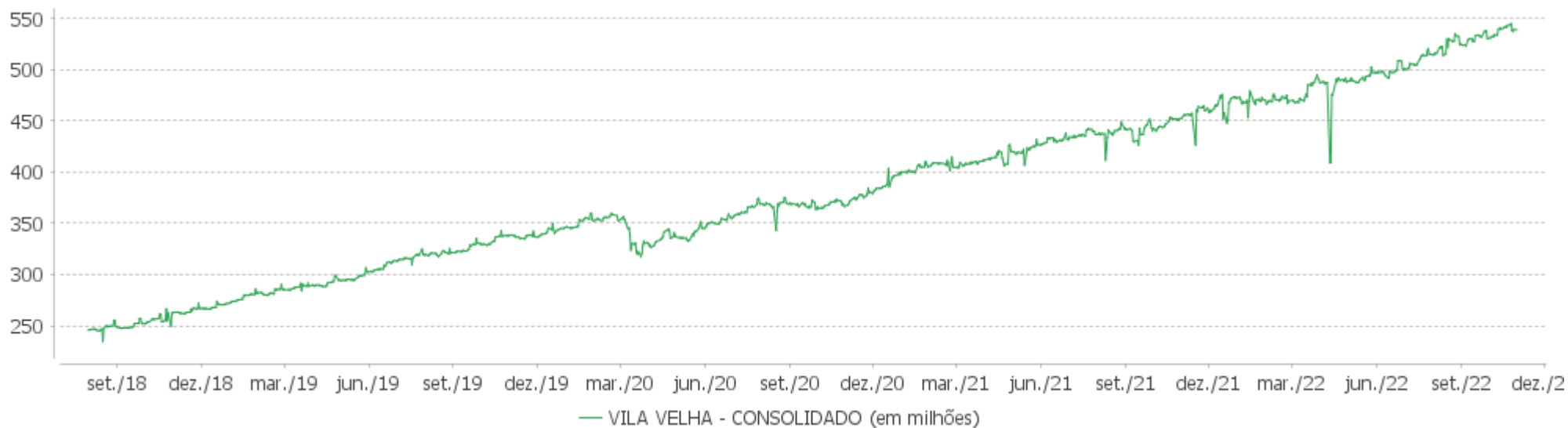
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	23	45,10	03 meses	0,82	1,16	-0,34	2,64
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	54,90	06 meses	3,25	2,87	0,38	3,14
			12 meses	5,30	11,80	-6,50	4,77
			24 meses	15,74	30,49	-14,75	4,58
Maior rentabilidade da Carteira	3,55	2020-12	36 meses	16,23	43,52	-27,29	6,24
Menor rentabilidade da Carteira	-6,98	2020-03	48 meses	36,82	55,99	-19,17	5,62
			Desde 31/07/2018	42,41	59,65	-17,24	5,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

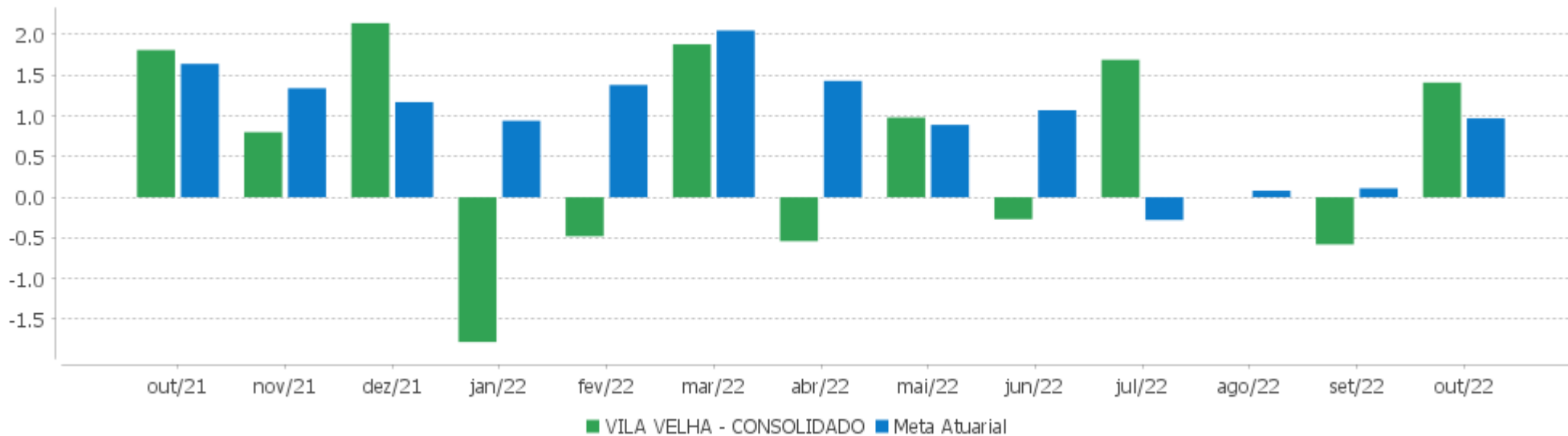


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150523 (6,000000%) Var. IPCA p.p.	0,56 -0,03	9,93 5,22	0,68 0,75	3,71 3,32	10,02 3,55	21,35 3,51	25,58 3,13
NTN-B 150545 (5,100000%) .. Var. IPCA p.p.	0,49 -0,10	9,15 4,45	0,47 0,53	3,26 2,87	12,31 5,84	30,19 12,36	41,60 19,15
NTN-B 150850 (5,290000%) Var. IPCA p.p.	0,51 -0,08	9,32 4,61	0,51 0,57	3,36 2,96	12,51 6,04	23,94 6,11	28,12 5,67
NTN-B 150523 (5,840000%) Var. IPCA p.p.	0,55 -0,04	9,79 5,09	0,65 0,71	3,63 3,24	9,86 3,39	21,01 3,18	25,08 2,63
NTN-B 150545 (3,680000%) .. Var. IPCA p.p.	0,38 -0,21	7,93 3,22	0,12 0,18	2,55 2,16	10,79 4,32	26,71 8,88	35,97 13,52
NTN-B 150523 (7,950000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,12	8,34 3,64	1,15 1,21	1,62 1,23	8,69 2,22	21,79 3,96	27,93 5,48
NTN-B 150830 (5,250000%) Var. IPCA p.p.	0,50 -0,09	9,28 4,58	0,50 0,57	3,34 2,94	12,47 6,00	23,54 5,71	27,35 4,90
NTN-B 150555 (5,260000%) Var. IPCA p.p.	0,51 -0,08	9,29 4,59	0,50 0,57	3,34 2,95	12,48 6,01	23,94 6,11	28,15 5,70
NTN-B 150523 (5,661000%) Var. IPCA p.p.	0,54 -0,05	9,64 4,93	0,60 0,66	3,54 3,15	9,68 3,21	20,64 2,81	24,52 2,07
NTN-B 150545 (4,290000%) .. Var. IPCA p.p.	0,43 -0,16	8,45 3,75	0,27 0,33	2,86 2,46	11,44 4,97	28,20 10,37	38,37 15,92
NTN-B 150840 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	0,51 -0,08	9,30 4,60	0,51 0,57	3,35 2,95	12,49 6,02	23,79 5,96	27,84 5,39
NTN-B 150523 (6,760000%) Var. IPCA p.p.	0,62 0,03	7,39 2,68	0,87 0,93	1,08 0,69	7,57 1,10	19,39 1,56	24,28 1,83
NTN-B 150545 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	0,54 -0,05	9,70 4,99	0,62 0,68	3,58 3,18	9,84 3,37	21,09 3,26	25,25 2,80
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,88 0,65	9,63 2,21	2,16 -1,70	3,65 0,08	12,64 1,24	18,93 5,49	26,10 13,80
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA % do CDI	0,78 76,75	7,42 74,15	2,52 76,48	4,92 75,65	8,41 73,17	9,95 65,49	
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,00 -0,23	11,60 4,17	3,28 -0,59	5,13 1,56	14,20 2,80	21,77 8,33	27,31 15,00
BB PREV RF IDKA2	1,85	8,72	2,35	3,19	12,14	17,05	24,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IDKA 2 p.p.	0,07	-0,13	0,30	-0,03	-0,36	-0,64	-1,17
BB PREV RF IPCA	2,24	9,55	2,18	3,12	12,46	18,19	25,17
Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,19	-0,34	0,76	-0,29	-0,40	-14,14	-20,53
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,89	8,19	2,23	3,03	12,06	15,99	21,74
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,66	0,76	-1,64	-0,54	0,66	2,54	9,44
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,83	8,48	2,24	3,04	11,90	16,82	24,01
Var. IDKA 2 p.p.	0,05	-0,37	0,19	-0,18	-0,60	-0,88	-1,60
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	1,02	9,96	3,31	6,55	11,42	15,07	18,39
% do CDI	100,15	99,59	100,39	100,55	99,38	99,19	97,25
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,89	8,17	2,21	3,01	12,04	15,96	21,70
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,66	0,74	-1,65	-0,56	0,64	2,52	9,40
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,89	8,56	2,87	5,64	9,77	12,33	14,97
% do CDI	86,82	85,62	87,00	86,58	84,97	81,11	79,19
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	1,89	9,36	2,17	3,53	12,53	18,38	24,40
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,65	1,94	-1,69	-0,04	1,13	4,94	12,09
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	1,07	10,56	3,52	6,86	12,18	17,31	17,66
% do CDI	104,45	105,54	106,71	105,44	105,97	113,90	93,40
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1,04	10,21	3,35	6,62	11,79	15,78	18,90
% do CDI	101,81	102,09	101,70	101,68	102,61	103,83	99,93
BB PREV RF FLUXO FIC	0,95	9,10	3,06	6,00	10,39	12,85	15,18
% do CDI	93,10	91,00	92,71	92,25	90,38	84,54	80,28
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,78	7,42	2,52	4,92	8,41	9,95	10,75
% do CDI	76,82	74,14	76,40	75,60	73,14	65,46	56,86
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	1,02	10,38	3,37	6,67	11,92	16,02	19,18
% do CDI	100,25	103,75	102,40	102,48	103,76	105,42	101,45
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	5,36	10,73	12,37	7,63	12,15	23,07	7,87
Var. IBOVESPA p.p.	-0,09	0,03	-0,11	0,07	0,04	-0,44	-0,35
FIA CAIXA DIVIDENDOS	3,84	12,45	6,12	3,09	15,09	27,50	10,31
Var. IBOVESPA p.p.	-1,61	1,76	-6,36	-4,48	2,98	4,00	2,09
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	7,70	-14,01	-4,26	-2,48	-9,96	27,17	
Var. IBOVESPA p.p.	2,25	-24,71	-16,74	-10,04	-22,07	3,66	
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	5,63	9,42	12,43	6,59	11,18	21,41	7,54
Var. IGCT p.p.	-0,21	-0,93	-0,31	-0,48	-1,03	-2,32	-3,13
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1,70	-29,79	-9,82	-6,27	-29,23	-5,49	51,74
Var. Global BDRX p.p.	0,37	0,07	0,16	0,29	-0,10	-2,53	-3,28
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	4,33	-26,73	-6,37	-2,90	-25,64	-0,63	53,07

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.	-1,12	-37,43	-18,84	-10,46	-37,75	-24,14	44,85
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	2,32 -3,14	-31,47 -42,17	-8,91 -21,39	-5,19 -12,76	-28,95 -41,07	-5,65 -29,16	39,53 31,31
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	8,77 3,77	-12,72 10,75	-3,83 1,19	-1,40 -1,54	-8,31 13,36	32,33 24,48	37,32 -30,03
VILA VELHA - CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,92% p.p.	1,41 0,43	2,27 -6,69	0,82 -0,34	3,25 0,38	5,30 -6,41	15,74 -13,93	16,23 -25,09
CDI	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91
IBOVESPA	5,45	10,70	12,48	7,57	12,11	23,51	8,22
INPC + 6,00%	0,94	10,00	1,33	3,32	12,85	32,81	47,43
IPCA + 6,00%	1,06	9,89	1,43	3,41	12,86	32,34	45,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA			D+0	D+0		3,50
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 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
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
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
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	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
FIA CAIXA DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI			D+0	D+0		0,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,00	9,68	3,38	6,44	11,52	13,50	18,11	26,53	35,47
IRF-M 1+	0,92	7,22	5,18	6,95	12,08	5,46	10,35	30,15	43,64
IRF-M TOTAL	0,93	7,95	4,44	6,64	11,95	8,26	13,06	29,67	41,90
IMA-B 5	1,91	9,12	2,35	3,50	12,73	17,73	24,45	41,60	54,77
IMA-B 5+	0,65	5,79	5,62	3,73	10,15	9,03	2,65	40,63	55,93
IMA-B TOTAL	1,23	7,43	3,86	3,57	11,40	13,44	12,30	42,33	56,98
IMA-GERAL TOTAL	1,01	8,88	3,72	5,61	11,80	12,98	15,99	33,17	45,02
IDKA 2	1,78	8,84	2,04	3,22	12,50	17,69	25,62	40,76	54,48
IDKA 20	-0,33	3,63	10,36	4,51	7,43	2,00	-11,54	37,24	53,99
CDI	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91	26,30	34,57

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,45	10,70	12,48	7,57	12,11	23,51	8,22	32,73	56,16
IBRX 100	5,57	10,25	12,01	6,76	11,78	23,41	9,78	37,01	60,34
IBRX 50	5,32	10,92	12,53	7,34	13,01	26,17	10,50	32,80	56,33
SMALL CAP	7,30	-1,35	16,81	0,91	0,06	3,68	-2,72	39,01	46,73
IFIX	0,02	6,66	6,30	6,34	11,80	8,12	7,14	33,40	34,37
Índice Consumo - ICON	6,28		12,02	1,65	-14,96	-22,29	-23,79	10,51	-0,91
Índice Dividendos - IDIV	4,03	13,61	6,51	3,76	16,46	32,51	18,49	64,97	73,53

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	0,59	4,70	-0,06	0,39	6,47	17,83	22,45	25,55	31,28
INPC	0,47	4,81	-0,16	0,30	6,46	18,26	23,90	27,06	32,15
IGPM	-0,97	5,58	-2,59	-1,31	6,52	29,66	56,80	61,74	79,20
SELIC	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91	26,30	34,58

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	5,00	-23,47	-5,01	0,15	-21,68	7,85	67,36	101,91	141,21
MSCI ACWI	3,03	-26,82	-6,84	-4,13	-26,70	-3,07	44,06	71,11	89,42

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,90	8,17	0,94	2,41	10,73	27,41	37,65	46,79	59,57
IPCA + 5,00%	0,98	9,03	1,18	2,91	11,79	29,86	41,64	52,49	67,35
IPCA + 5,50%	1,02	9,46	1,31	3,16	12,33	31,10	43,66	55,41	71,35
IPCA + 5,89%	1,05	9,79	1,40	3,35	12,74	32,06	45,25	57,71	74,53
IPCA + 6,00%	1,06	9,89	1,43	3,41	12,86	32,34	45,71	58,36	75,43
INPC + 4,00%	0,78	8,27	0,84	2,32	10,72	27,87	39,28	48,55	60,63
INPC + 6,00%	0,94	10,00	1,33	3,32	12,85	32,81	47,43	60,26	76,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1753	03/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	62.125,56	26.316,07719500	2,3607454690
1748	03/10/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	60.581,76	6.836,98510216	8,8608881100
1760	03/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	71.324,41	0,00	34.088,91857100	2,0923048600
1737	03/10/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.676,33	414,89407770	8,8608881100
1754	04/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	21.358,80	9.043,21442100	2,3618592910
1749	04/10/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	718.286,99	81.030,72749189	8,8643779000
1761	04/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	40.746,35	19.465,80688200	2,0932268600
1738	04/10/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	27.032,99	3.049,62066204	8,8643779000
1767	06/10/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	6.656,70	0,00	761,06857000	8,7465180700
1762	06/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	82.085,69	39.180,37127700	2,0950717700
1755	07/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.590,82	3.209,38266600	2,3651962980
1763	07/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	3.461.610,78	0,00	1.651.533,51537200	2,0959979000
1768	07/10/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	2.015,58	0,00	230,35361221	8,7499387600
1733	11/10/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	512.281,93	0,00	58.501,04769560	8,7567992400
1742	11/10/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	5.293.074,24	0,00	604.453,07639598	8,7567992400
1750	13/10/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	27.163,32	3.057,16786819	8,8851254400
1739	13/10/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.893,86	438,24479759	8,8851254400
1756	14/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	926,29	390,88957300	2,3696973870
1764	14/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	5.245,97	2.498,43760100	2,0997001800
1751	17/10/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	69.930,68	7.864,53189546	8,8919062100
1769	17/10/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	842,21	94,71647362	8,8919062100
1744	17/10/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	3.703.447,36	422.437,50690819	8,7668526100
1743	17/10/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	2.019,48	230,35404949	8,7668526100
1740	17/10/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	482.999,68	54.319,02548149	8,8919062100
1747	17/10/2022	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	4.160.000,00	0,00	2.077.936,26642795	2,0019863300
1757	18/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	245.401,82	103.458,77065800	2,3719769570
1736	19/10/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	672.508,89	0,00	76.650,52415050	8,7737024300
1771	19/10/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	672.508,89	75.571,53184918	8,8989712600

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1758	20/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.901,25	4.170,32985500	2,3742126750
1759	26/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	301.150,92	0,00	126.603,71321700	2,3786894740
1735	26/10/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	65.184,21	7.415,18647571	8,7906366500
1734	26/10/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	6.690,28	761,06888117	8,7906366500
1765	26/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	5.702.924,05	2.706.476,37583400	2,1071397855
1745	26/10/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	1.056.920,66	120.232,54993710	8,7906366500
1766	27/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	342.294,75	162.373,78363663	2,1080666000
1746	27/10/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	1.585,56	180,29859893	8,7940783200
Total			14.480.623,45	13.423.365,61		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 7.195.902,65

Value-At-Risk: 1,34%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VILA VELHA - CONSOLIDADO		1,34	1,34			538.454.549,88	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,20%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150523 (5,661000%)		0,18	0,00	0,19			21.401.267,38	3,97
NTN-B 150523 (5,840000%)		0,18	0,00	0,19			16.216.982,85	3,01
NTN-B 150523 (6,000000%)		0,18	0,00	0,19			40.639.031,86	7,55
NTN-B 150523 (6,760000%)		0,18	0,00	0,19			22.445.926,99	4,17
NTN-B 150523 (7,950000%)		0,18	0,00	0,19			84.434.143,99	15,68
NTN-B 150545 (3,680000%) ..		0,18	0,00	0,19			7.479.225,07	1,39
NTN-B 150545 (4,290000%) ..		0,18	0,00	0,19			381.645,86	0,07
NTN-B 150545 (5,100000%) ..		0,18	0,00	0,19			14.851.579,62	2,76
NTN-B 150545 (5,730000%)		0,18	0,00	0,19			26.476.477,56	4,92
NTN-B 150555 (5,260000%)		0,18	0,00	0,19			21.460.654,76	3,99
NTN-B 150830 (5,250000%)		0,18	0,00	0,19			26.332.018,07	4,89
NTN-B 150840 (5,270000%)		0,18	0,00	0,19			31.660.258,77	5,88
NTN-B 150850 (5,290000%)		0,18	0,00	0,19			26.409.151,41	4,90
Sub-total	0,32	0,18	0,00		-1,40	0,57	340.188.364,19	63,18

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA		0,01	0,00	0,01			1.666.392,59	0,31
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,52	0,01	1,62			20.412.221,07	3,79
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,53	0,01	1,62			15.324.857,21	2,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IDKA2		1,36	0,00	0,45			6.252.734,70	1,16
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,48	0,00	0,49			65.365,74	0,01
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,01	0,00	0,00			10.001.719,37	1,86
BB PREV RF IPCA		0,79	0,00	0,75			4.507.475,99	0,84
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI		1,16	0,00	2,00			853.398,87	0,16
BB PREV RF VII		0,41	0,00	2,46			1.721.758,09	0,32
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI		1,15	0,00	1,92			2.643.545,61	0,49
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI		0,01	-0,00	0,01			5.100.700,38	0,95
Sub-total	1,20	1,01	0,02		0,50	1,62	68.550.169,62	12,73

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	-0,00	0,01			4.068.455,92	0,76
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	0,00	0,01			1.907.504,69	0,35
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI		0,06	-0,00	0,06			26.430.448,70	4,91
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,02	0,00	0,02			26.577.117,79	4,94
Sub-total	0,05	0,03	-0,00		0,32	1,04	58.983.527,10	10,95

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 12,58%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		12,58	0,74	7,60			32.374.313,10	6,01
Sub-total	27,66	12,58	0,74		0,28	8,77	32.374.313,10	6,01

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,88%

Artigo 9º III

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		13,73	0,30	2,44			14.690.755,79	2,73
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		11,18	0,06	15,42			3.595.510,27	0,67
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I		12,36	0,08	16,45			4.639.273,67	0,86
Sub-total	33,22	12,88	0,44		0,04	2,32	22.925.539,73	4,26

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,75%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA DIVIDENDOS		8,45	0,02	3,49			3.491.877,77	0,65
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		10,81	0,00	0,16			300.843,23	0,06
FIA CAIXA BRASIL IBOVSPA		10,21	0,11	0,23			11.618.354,94	2,16
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA		11,61	0,00	10,89			21.560,20	0,00
Sub-total	28,80	9,75	0,14		0,14	5,02	15.432.636,14	2,87