



LDB
EMPRESAS

VILA VELHA - CONSOLIDADO
SETEMBRO 2021



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 30.09.2021.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 62,14%

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 150545 (3,680000%) ..	0,44	1,47	10,04	6.956.805,23	1,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,290000%) ..	0,44	1,52	10,52	354.054,88	0,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,100000%) ..	0,44	1,59	11,16	13.734.299,90	3,12
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,44	1,55	10,78	21.045.160,01	4,78

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
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	8,53	-0,87	-7,23	21.882.678,43	4,97	274.793.726,45	7,96
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,33	-0,15	-2,46	6.232.963,47	1,42	7.233.196.021,39	0,09
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,29	1,03	2,73	39.838.681,78	9,05	9.425.482.510,34	0,42
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,27	-1,27	-6,87	2.406.446,19	0,55	1.307.235.728,08	0,18
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,45	1,08	2,79	24.929.477,87	5,66	11.068.272.487,58	0,23
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,91	-0,37	-3,13	2.646.258,32	0,60	1.386.775.998,41	0,19
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,55	1,13	2,87	4.165.761,77	0,95	352.300.304,40	1,18
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	2,14	1,19	3,38	2.446.364,22	0,56	289.961.642,92	0,84
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1,20	0,33	0,28	7.963.009,39	1,81	162.873.582,54	4,89
BB	BB	BB PREV RF VII	1,58	1,30	4,66	1.559.430,28	0,35	243.602.920,53	0,64
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,39	1,14	2,92	5.526.528,40	1,26	425.799.207,18	1,30
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	1,59	1,30	4,66	6.610.100,82	1,50	202.327.906,93	3,27
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,68	-0,01	-1,38	17.021.404,87	3,87	8.672.013.980,14	0,20
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,43	0,35	-1,16	21.839.979,74	4,96	14.407.320.968,51	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,66	0,96	0,91	19.547.179,74	4,44	1.402.948.935,17	1,39

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,66	0,96	0,90	14.683.546,80	3,34	451.054.226,43	3,26
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	1,59	1,30	4,68	3.502.682,41	0,80	467.018.396,09	0,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,94	1,66	11,80	7.063.659,02	1,60	91.359.190,16	7,73
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,02	0,61	0,18	209.866.153,52	47,68		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,07	0,25	1,09	416.183,66	0,09	952.715.029,79	0,04
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	0,35	1,66	2.918.147,45	0,66	2.310.961.339,30	0,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,07	0,33	1,77	588.457,33	0,13	598.538.196,75	0,10
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,29	0,61	0,93	21.715.504,00	4,93	2.270.442.340,00	0,96
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,77	0,13	-0,83	8.464.782,61	1,92	141.942.485,35	5,96
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			3,03	0,44	-1,12	34.103.075,05	7,75		

Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "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	2,95	0,92	1,72	7.196.082,79	1,63	634.085.763,40	1,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	2,98	0,81	0,93	1.324.670,20	0,30	222.360.883,74	0,60
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			2,92	0,91	1,59	8.520.752,99	1,94		
Renda Fixa			2,76	0,68	0,82	273.535.141,57	62,14		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

28,00%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,39	-6,75	-5,50	293.711,06	0,07	1.120.979.496,53	0,03
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	20,80	-6,56	-6,91	1.502.654,01	0,34	611.621.285,66	0,25
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			20,73	-6,58	-6,41	1.796.365,07	0,41		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,49	-6,49	-7,26	12.080.806,48	2,74	1.005.326.835,22	1,20
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	20,82	-8,81	-15,27	9.082.680,14	2,06	196.446.321,75	4,62
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	13,94	-4,78	3,94	58.110.397,81	13,20	2.078.841.851,24	2,80
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			16,39	-5,62	-3,53	79.273.884,43	18,01		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,92	-4,64	11,95	42.177.116,05	9,58	3.166.279.756,52	1,33
Sub-total Artigo 8º III			13,92	-4,64	11,95	42.177.116,05	9,58		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			16,32	-5,42	-0,52	123.247.365,55	28,00		
--	--	--	--------------	--------------	--------------	-----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

9,86%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,24	-0,25	16,72	21.424.060,77	4,87	3.337.438.389,61	0,64
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	18,16	-0,30	-0,30	1.993.953,04	0,45	3.470.822.141,78	0,06
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	18,27	0,62	17,77	19.988.166,65	4,54	1.182.247.363,81	1,69
Sub-total Artigo 9º A, III			18,17	0,11	17,36	43.406.180,46	9,86		
Investimentos no Exterior			18,17	0,11	17,36	43.406.180,46	9,86		
Total			4,40	-1,16	1,42	440.188.687,58	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	21.045.160,01	4,78	0,00	35,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	209.866.153,52	47,68	0,00	30,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	34.103.075,05	7,75	0,00	2,50	40,00	0,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	8.520.752,99	1,94	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	273.535.141,57	62,14					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	1.796.365,07	0,41	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	79.273.884,43	18,01	0,00	15,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	42.177.116,05	9,58	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	123.247.365,55	28,00					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	43.406.180,46	9,86	0,00	8,50	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	43.406.180,46	9,86					10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,55 353,68	10,78 429,81	3,94 322,24	7,00 347,22	15,16 506,94	321.195,93	2.069.910,04
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,61 138,20	0,18 7,28	0,13 10,51	1,73 86,12	4,72 157,90	1.303.945,61	32.626,22
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,44 100,07	-1,12 -44,53	0,56 46,11	1,61 79,87	3,11 104,11	130.872,70	-314.940,82
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,91 206,83	1,59 63,52	0,82 66,83	2,33 115,43	5,22 174,39	76.536,44	133.585,79
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-6,58 -0,01	-6,41 0,35	-12,52 -0,05	-4,76 0,09	17,51 0,20	-456.287,40	10.972,42
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-5,62 0,94	-3,53 3,23	-6,81 5,67	-1,02 3,83	14,68 -2,63	-4.549.154,24	-3.056.759,66
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-4,64 1,93	11,95 18,24	1,14 13,61	9,99 14,84		-2.051.456,30	1.715.168,17
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,00 6,57	32,63 39,38	26,71 39,19	29,10 33,95	33,50 16,19	0,00	318.040,04
Artigo 9º A, III % do CDI	0,11 25,79	17,36 692,21	8,31 679,31	3,42 169,86	18,97 634,44	63.504,91	4.859.476,92
VILA VELHA - CONSOLIDADO (Total)						-5.160.842,35	5.768.079,12

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	6.855.756,37	0,00	0,00	0,00	6.956.805,23	101.048,86	640.745,32
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	348.741,83	0,00	0,00	0,00	354.054,88	5.313,05	34.057,60
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	13.519.465,88	0,00	0,00	0,00	13.734.299,90	214.834,02	1.395.107,12
					21.045.160,01	0,00	0,00

Artigo 7º I, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	22.075.515,97	0,00	0,00	0,00	21.882.678,43	-192.837,54	-1.704.661,79
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	7.936.947,86	0,00	0,00	0,00	7.963.009,39	26.061,53	-6.270,74
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	3.457.760,87	0,00	0,00	0,00	3.502.682,41	44.921,54	159.948,24
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	17.022.309,11	0,00	0,00	0,00	17.021.404,87	-904,24	-238.006,33
BB PREV RF IDKA2	44.399.685,53	0,00	-5.000.000,00	0,00	39.838.681,78	438.996,25	1.166.701,87
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	16.184.951,99	0,00	-10.000.000,00	0,00	6.232.963,47	48.011,48	-734.204,40
BB PREV RF IPCA	4.119.067,97	0,00	0,00	0,00	4.165.761,77	46.693,80	117.320,12
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	2.417.700,98	0,00	0,00	0,00	2.446.364,22	28.663,24	81.468,96
BB PREV RF VII	1.539.466,24	0,00	0,00	0,00	1.559.430,28	19.964,04	71.039,76
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	5.464.007,58	0,00	0,00	0,00	5.526.528,40	62.520,82	158.954,58
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	6.525.434,89	0,00	0,00	0,00	6.610.100,82	84.665,93	300.721,05
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.948.176,22	0,00	0,00	0,00	7.063.659,02	115.482,80	770.405,64
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.543.650,80	0,00	0,00	0,00	14.683.546,80	139.896,00	128.652,53
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.360.842,41	0,00	0,00	0,00	19.547.179,74	186.337,33	172.144,21
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19.710.612,83	5.000.000,00	0,00	0,00	24.929.477,87	218.865,04	664.508,03
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.437.282,03	0,00	0,00	0,00	2.406.446,19	-30.835,84	-443.715,51
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.656.062,54	0,00	0,00	0,00	2.646.258,32	-9.804,22	-85.375,45
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	21.762.732,09	0,00	0,00	0,00	21.839.979,74	77.247,65	-271.667,17
					209.866.153,52	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	8.453.846,64	0,00	0,00	0,00	8.464.782,61	10.935,97	-70.683,62
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	512.073,13	15.836.376,92	-15.937.801,97	0,00	416.183,66	5.535,58	23.090,06
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	10.032.007,49	11.580.000,00	0,00	0,00	21.715.504,00	103.496,51	135.504,00
BB PREV RF FLUXO FIC	2.595.095,85	409.277,94	-95.213,16	0,00	2.918.147,45	8.986,82	49.766,46
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	616.423,75	388.975,77	-418.860,01	0,00	588.457,33	1.917,82	6.261,00
					34.103.075,05	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea b

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	7.130.213,65	0,00	0,00	0,00	7.196.082,79	65.869,14	121.332,99
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	1.314.002,90	0,00	0,00	0,00	1.324.670,20	10.667,30	12.252,80
					8.520.752,99	0,00	0,00

Artigo 8º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	314.976,56	0,00	0,00	0,00	293.711,06	-21.265,50	228.335,12
FIA CAIXA BRASIL IBOVESA	6.937.675,91	0,00	-5.000.000,00	0,00	1.502.654,01	-435.021,90	-217.362,70
					1.796.365,07	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	20.089.902,33	0,00	-9.999.999,96	0,00	9.082.680,14	-1.007.222,23	-2.544.103,52
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	45.814.473,95	15.000.000,00	0,00	0,00	58.110.397,81	-2.704.076,14	651.397,14
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	12.918.662,35	0,00	0,00	0,00	12.080.806,48	-837.855,87	-946.263,25
					79.273.884,43	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	44.228.572,35	0,00	0,00	0,00	42.177.116,05	-2.051.456,30	1.715.168,17
					42.177.116,05	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	19.864.899,77	0,00	0,00	0,00	19.988.166,65	123.266,88	1.899.257,63
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	21.477.775,78	0,00	0,00	0,00	21.424.060,77	-53.715,01	2.966.266,25
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	0,00	2.000.000,00	0,00	0,00	1.993.953,04	-6.046,96	-6.046,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					43.406.180,46	0,00	0,00

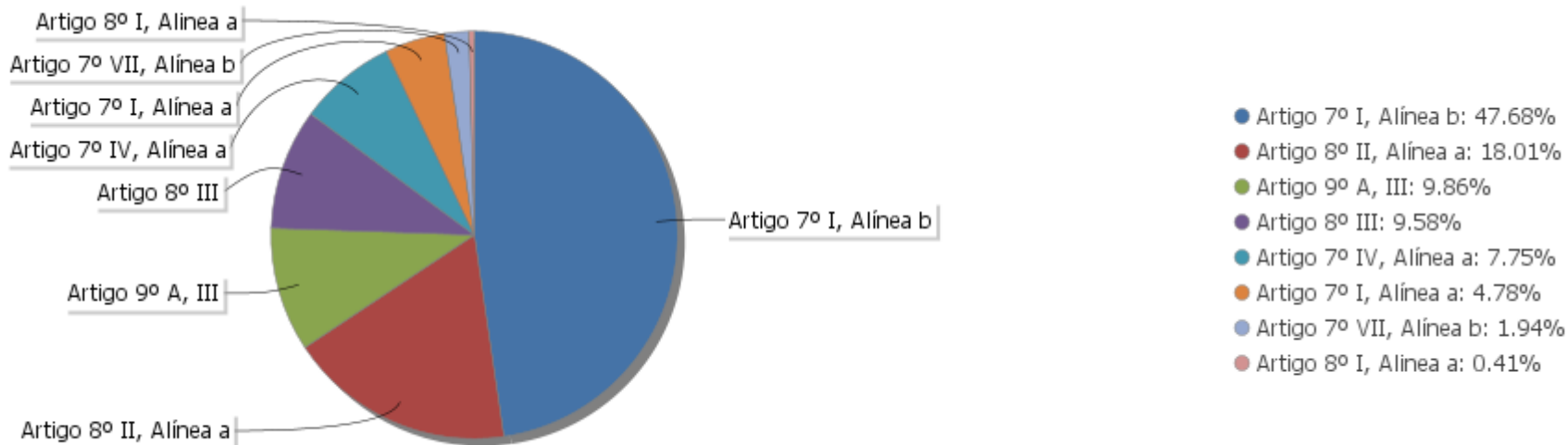
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

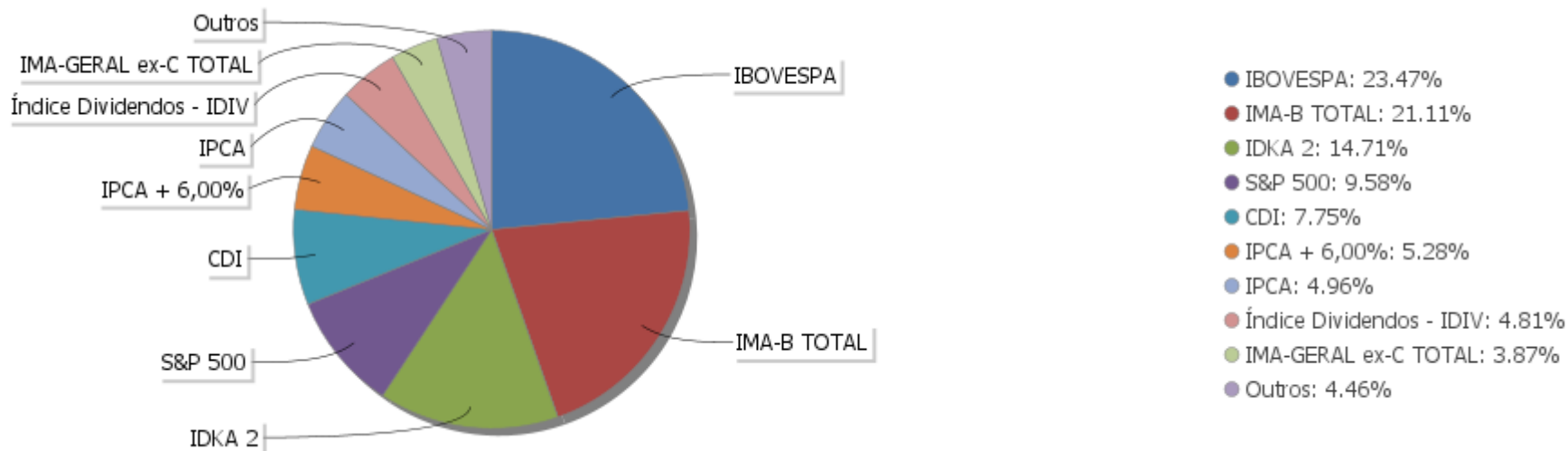
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	325.678.704,70	73,99	325.678.704,70	73,99
de 31 a 365 dias	39.899.359,15	9,06	365.578.063,85	83,05
acima de 365 dias	74.610.623,73	16,95	440.188.687,58	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

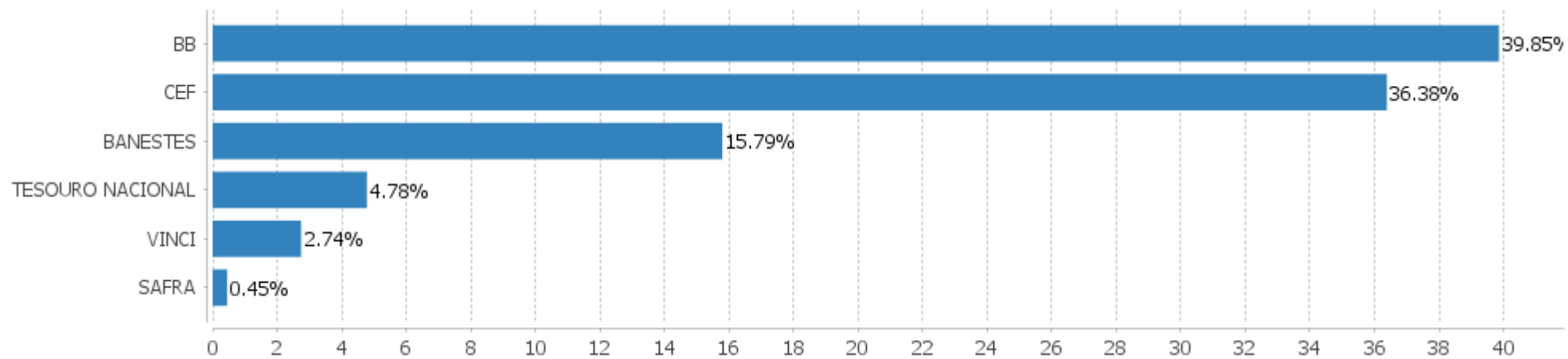


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,48	-1,03	1,05	1,06	0,94	0,42	0,32	0,32	-1,16				1,42
IPCA + 5,87%	0,70	1,27	1,46	0,77	1,31	1,01	1,46	1,37	1,64				11,55
p.p. indexador	-1,19	-2,30	-0,41	0,30	-0,37	-0,59	-1,14	-1,06	-2,80				-10,13
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

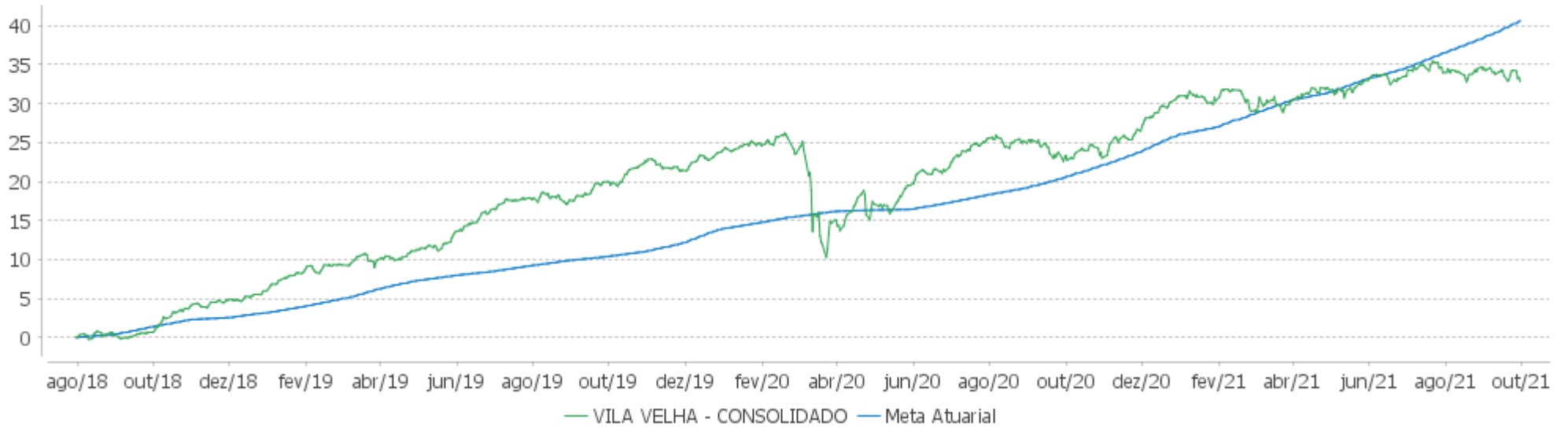
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

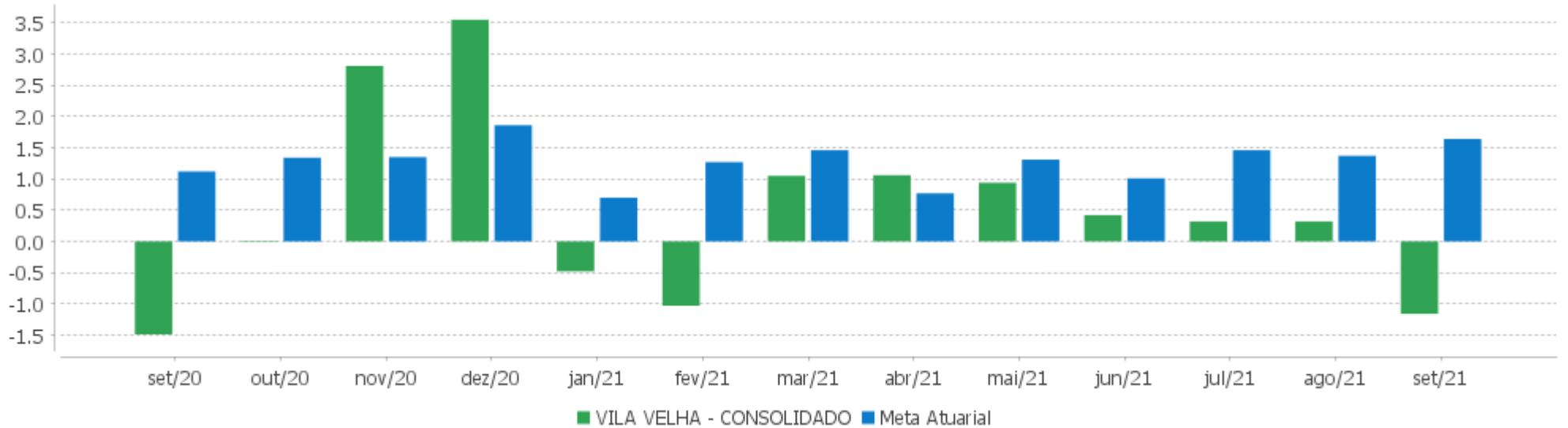
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	18	47,37	03 meses	-0,52	4,55	-5,07	4,34
Meses abaixo - Meta Atuarial	20	52,63	06 meses	1,90	7,80	-5,90	4,08
			12 meses	7,95	16,69	-8,74	4,40
			24 meses	10,70	27,45	-16,76	6,84
			36 meses	31,95	38,98	-7,03	5,86
Maior rentabilidade da Carteira	3,55	2020-12	Desde 31/07/2018	32,84	40,88	-8,04	5,74
Menor rentabilidade da Carteira	-6,98	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,19 1,32	3,38 5,69	1,86 3,45	3,47 2,95	6,75 2,04	15,02 8,10	37,94 -2,51
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	1,30 0,30	4,66 2,18	2,42 1,24	3,97 1,33	7,70 1,75	16,09 2,47	37,18 6,06
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,30 -0,35	4,68 -6,97	2,43 -2,15	3,98 -3,89	7,72 -9,11	15,54 -12,18	35,04 -4,24
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,37 -0,04	-3,13 -0,18	-1,46 -0,07	-0,35 -0,20	-1,25 -0,24	4,97 -0,50	22,56 -0,66
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,27 -0,01	-6,87 -0,24	-4,33 -0,14	-1,81 -0,20	2,97 -0,24	0,80 -0,67	45,16 -1,83
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,96 1,09	0,90 3,20	0,76 2,35	2,46 1,94	4,87 0,16	12,90 5,98	39,51 -0,95
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,14 1,28	2,92 5,22	1,66 3,25	3,28 2,76	6,40 1,69	13,48 6,56	33,39 -7,07
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,66 0,01	11,80 0,15	4,30 -0,28	7,72 -0,15	16,61 -0,22	26,97 -0,75	35,28 -4,00
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,33 -0,07	0,28 -1,50	0,68 -0,28	1,24 -0,41	1,37 -1,12	8,14 0,99	21,06 5,94
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,87 -0,74	-7,23 -4,93	-3,51 -1,92	-0,95 -1,47	2,86 -1,85	-4,59 -11,51	37,72 -2,74
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,30 1,43	4,66 6,96	2,42 4,01	3,97 3,45	7,69 2,98	13,21 6,29	26,80 -13,66
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,03 -0,06	2,73 -0,34	1,30 0,11	2,74 -0,38	6,05 -0,17	13,77 -0,94	27,54 -1,91
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,13 -0,52	2,87 -8,78	1,42 -3,16	3,06 -4,81	5,87 -10,96	14,76 -12,96	38,55 -0,73
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,01 -0,03	-1,38 -0,62	-0,70 -0,28	0,51 -0,38	1,75 -0,30	5,52 -0,51	23,63 0,04
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,96 1,10	0,91 3,21	0,76 2,35	2,46 1,94	4,88 0,17	12,92 6,00	39,51 -0,95
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,35 -0,81	-1,16 -8,06	-1,87 -4,89	-0,98 -5,73	0,85 -9,39	7,32 -6,38	26,96 9,96
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,08	2,79	1,21	2,82	5,92	13,71	27,67

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.	-0,02	-0,28	0,03	-0,30	-0,29	-1,00	-1,78
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,15	-2,46	-1,66	0,40	4,49	6,40	39,39
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,16	-0,07	-0,12	-0,22	-0,52	-1,07
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,61	3,44	1,55	2,55	4,07	4,74	11,76
% do CDI	139,17	137,39	126,69	126,74	136,13	71,17	88,13
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	0,13	-0,83	-0,11	1,35	2,53	4,44	25,62
% do CDI	29,52	-33,03	-9,40	67,04	84,61	66,74	191,92
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,25	1,09	0,65	1,02	1,14	2,08	5,33
% do CDI	57,29	43,55	53,51	50,62	38,09	31,20	39,91
BB PREV RF FLUXO FIC	0,35	1,66	0,90	1,43	1,88	4,33	9,68
% do CDI	79,41	66,19	73,21	70,75	62,88	65,05	72,54
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,33	1,77	0,91	1,49	2,04	4,77	10,42
% do CDI	76,33	70,76	74,56	74,03	68,15	71,74	78,06
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	1,59	11,16	4,06	7,25	15,69	24,86	35,46
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,72	13,46	5,65	6,73	10,98	17,94	-4,99
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	1,52	10,52	3,86	6,83	14,81	22,95	29,35
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,66	12,82	5,45	6,31	10,10	16,03	-11,11
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	1,47	10,04	3,70	6,51	14,14	21,52	27,34
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,61	12,34	5,29	5,99	9,43	14,60	-13,11
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	0,81	0,93	-0,45	1,35	3,83	11,46	30,76
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,84	-10,71	-5,02	-6,52	-13,00	-16,27	-8,51
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	0,92	1,72	1,05	2,51	5,47	12,48	28,59
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,73	-9,93	-3,53	-5,36	-11,36	-15,24	-10,69
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	-8,81	-15,27	-18,88	-14,02	-4,84	0,39	52,80
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-4,32	-10,60	-12,28	-12,51	-24,42	-7,46	-12,03
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	-4,78	16,09	0,67	9,25	28,99		
Var. IBOVESPA p.p.	1,79	22,85	13,15	14,10	11,68		
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-6,49	-7,26	-10,65	-4,65	15,95	7,86	66,44
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-2,00	-2,59	-4,05	-3,14	-3,63	0,01	1,61
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-4,64	17,47	1,14	9,99	30,71	42,05	
Var. S&P 500 p.p.	-5,36	-2,57	-7,86	6,48	7,20	-46,96	
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	-6,56	-6,91	-12,44	-4,94	16,86	5,56	38,58
Var. IBOVESPA p.p.	0,01	-0,15	0,04	-0,09	-0,45	-0,40	-1,29
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-6,75	-5,50	-13,47	-4,90	17,56	7,93	46,90
Var. IBOVESPA p.p.	-0,18	1,26	-0,99	-0,05	0,25	1,97	7,02
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-0,25	16,72	7,72	3,03	18,25	90,64	101,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Varição da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	6,32	23,48	20,20	7,87	0,94	84,69	61,54
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	0,62	17,77	9,07	3,96	18,60	85,75	81,06
Var. IBOVESPA p.p.	7,19	24,53	21,55	8,81	1,29	79,79	41,19
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	-0,81	19,04	7,72	6,60	20,62	79,55	105,43
Var. IBOVESPA p.p.	5,76	25,79	20,20	11,44	3,31	73,59	65,56
VILA VELHA - CONSOLIDADO	-1,16	1,42	-0,52	1,90	7,95	10,70	31,95
Var. IPCA + 5,87% p.p.	-2,80	-10,13	-5,07	-5,90	-8,74	-16,72	-6,82
CDI	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35
IBOVESPA	-6,57	-6,75	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87
INPC + 6,00%	1,69	11,97	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02
IPCA + 6,00%	1,65	11,65	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28

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	0,40	1,78	0,96	1,65	2,49	7,15	15,12	22,90	38,45
IRF-M 1+	-0,73	-5,87	-2,65	-1,15	-3,14	4,23	25,92	32,64	58,13
IRF-M TOTAL	-0,33	-2,95	-1,39	-0,15	-1,02	5,48	23,23	30,30	53,03
IMA-B 5	1,00	2,48	1,18	2,64	5,95	13,62	31,12	39,68	58,47
IMA-B 5+	-1,26	-6,63	-4,19	-1,61	3,20	1,48	46,98	45,78	70,99
IMA-B TOTAL	-0,13	-2,30	-1,59	0,52	4,71	6,92	40,46	44,04	66,75
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,02	-0,76	-0,42	0,89	2,05	6,02	23,59	29,99	49,60
IMA-GERAL TOTAL	-0,01	-0,38	-0,52	0,96	2,48	6,93	24,87	31,60	51,09
IDKA 2	1,10	3,07	1,18	3,12	6,21	14,71	29,45	40,48	59,67
IDKA 20	-3,03	-11,97	-8,65	-5,13	2,03	-7,04	59,98	49,40	80,44
CDI	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,90	34,86

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-6,57	-6,75	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87	49,38	90,14
IBRX 100	-6,99	-5,99	-13,61	-5,31	17,82	7,71	45,23	53,72	95,90
IBRX 50	-7,47	-6,33	-14,15	-5,58	18,46	6,59	37,53	47,56	87,32
SMALL CAP	-6,43	-5,54	-15,22	-4,70	15,75	13,69	78,82	65,15	133,65
IFIX	-1,24	-5,38	-1,42	-4,61	-2,83	1,17	27,21	22,27	49,54
Índice Consumo - ICON	-5,95	-11,50	-14,34	-7,48	-1,67	-2,69	50,48	25,77	51,19
Índice Dividendos - IDIV	-4,48	-4,67	-6,59	-1,51	19,58	7,85	64,83	56,04	121,60

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	1,16	6,90	3,02	4,75	10,25	13,70	16,99	22,29	25,39
INPC	1,20	7,21	3,13	5,14	10,78	15,09	18,46	23,16	25,17
IGPM	-0,64	16,00	0,80	7,15	24,86	47,25	52,21	67,49	65,07
SELIC	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,91	34,89

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	0,73	20,04	8,99	3,52	23,52	89,01	100,82	193,57	232,88
MSCI ACWI	1,23	14,91	7,16	0,61	21,06	78,00	83,86	150,21	184,12
MSCI World	1,22	16,99	8,36	2,09	22,47	80,14	87,02	158,04	191,94

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,49	10,07	4,07	6,84	14,64	22,96	31,56	42,95	52,39
IPCA + 5,00%	1,57	10,86	4,32	7,36	15,74	25,33	35,38	48,50	59,82
IPCA + 5,50%	1,61	11,26	4,45	7,61	16,29	26,53	37,32	51,33	63,64
IPCA + 5,89%	1,64	11,56	4,55	7,81	16,71	27,46	38,84	53,57	66,67
IPCA + 6,00%	1,65	11,65	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28	54,21	67,53
INPC + 4,00%	1,53	10,39	4,18	7,24	15,20	24,46	33,20	43,97	52,12
INPC + 6,00%	1,69	11,97	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02	55,31	67,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1050	01/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	33.146,97	0,00	4.046,97948757	8,1905455900
1090	01/09/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	33.146,97	17.364,50829400	1,9088920000
1046	03/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.960,00	6.981,28494900	2,1428719940
1064	03/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.100,00	0,00	134,27125893	8,1923712400
1089	06/09/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	81.005,18	42.416,59509400	1,9097520000
1065	08/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.004,51	0,00	122,58794967	8,1941985500
1045	09/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	13.372,60	6.237,66832700	2,1438459530
1078	09/09/2021	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	0,00	1.816.111,31	758.535,94288086	2,3942323800
1082	09/09/2021	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	0,00	1.568.487,99	655.111,01290155	2,3942323800
1079	09/09/2021	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	0,00	3.036.203,29	1.268.132,25315036	2,3942323701
1083	09/09/2021	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	0,00	1.121.750,55	468.522,00442542	2,3942323800
1080	09/09/2021	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	0,00	1.221.326,15	510.111,78688429	2,3942323800
1084	09/09/2021	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	0,00	14.188,74	5.926,21674680	2,3942323800
1081	09/09/2021	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	0,00	1.221.931,93	510.364,80438762	2,3942323599
1044	14/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	20.323,55	9.475,49451500	2,1448537560
1051	14/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	175,41	0,00	21,39698799	8,1978828100
1066	15/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	9.999.999,96	0,00	1.219.708,21142475	8,1986821700
1048	15/09/2021	BB PREV RF IDKA2	0,00	5.000.000,00	1.689.990,09205100	2,9585972270
1047	15/09/2021	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	10.000.000,00	1.555.939,57430500	6,4269848040
1043	16/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.870,60	871,85692400	2,1455355210
1052	16/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	263.487,17	0,00	32.133,86388454	8,1996728100
1070	16/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.100,98	134,27125893	8,1996728100
1071	16/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.005,18	122,58794967	8,1996728100
1072	16/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	8.573.289,80	1.045.564,86555267	8,1996728100
1068	16/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	109.626,48	13.369,61655065	8,1996728100
1069	16/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	739,31	90,16287037	8,1996728100
1076	16/09/2021	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	10.080.000,00	0,00	5.667.487,53030482	1,7785658900
1049	16/09/2021	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	15.000.000,00	0,00	9.704.136,65239400	1,5457325610

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

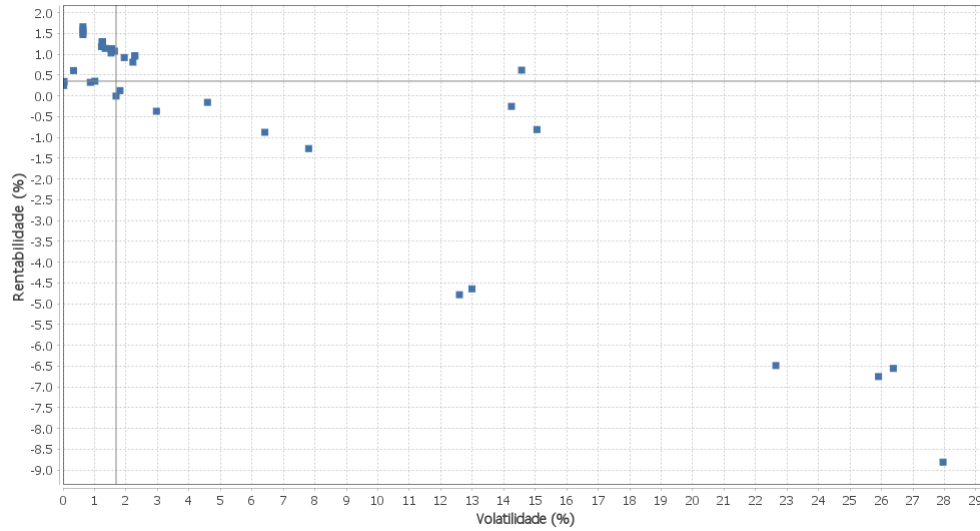
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1053	17/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	77.751,21	0,00	9.481,17284364	8,2005898700
1073	17/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	513.108,21	62.569,67096073	8,2005898700
1077	17/09/2021	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	1.500.000,00	0,00	843.199,52629581	1,7789383800
1085	17/09/2021	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	0,00	5.000.000,00	1.984.004,15734700	2,5201560095
1040	20/09/2021	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	2.000.000,00	0,00	2.870,18855700	696,8183310000
1039	21/09/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.000.000,00	0,00	2.031.725,80478600	2,4609620000
1054	24/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	3.061,55	0,00	373,11302331	8,2054225100
1055	27/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	5.455.912,15	0,00	664.817,85196012	8,2066270200
1067	27/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	737,99	0,00	89,92610458	8,2066270200
1088	27/09/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	301.484,80	0,00	157.521,74197000	1,9139250000
1042	29/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	409.277,94	0,00	190.459,00988200	2,1489030120
1059	29/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	263.784,61	32.133,86388454	8,2089289700
1056	29/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	402.791,88	49.067,53087231	8,2089289700
1060	29/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	77.830,27	9.481,17284364	8,2089289700
1057	29/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	33.221,37	4.046,97948757	8,2089289700
1061	29/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.062,86	373,11302331	8,2089289700
1058	29/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	175,65	21,39698799	8,2089289700
1062	29/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	4.392.085,33	535.037,56018732	8,2089289700
1074	29/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	855.561,67	104.223,30034890	8,2089289700
1087	29/09/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	87.490,97	0,00	45.695,92412900	1,9146340000
1041	30/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	44.686,41	20.790,87202500	2,1493283180
1063	30/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	677.931,50	82.572,33699497	8,2101527500
1075	30/09/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	32.486,87	3.956,91419790	8,2101527500
1086	30/09/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	304.707,86	159.117,20626500	1,9149900000

Total

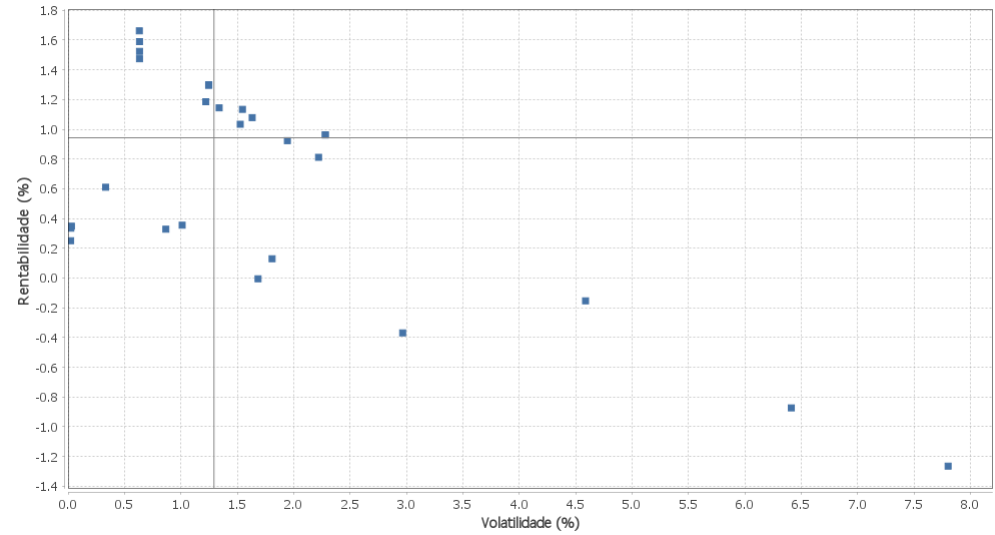
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

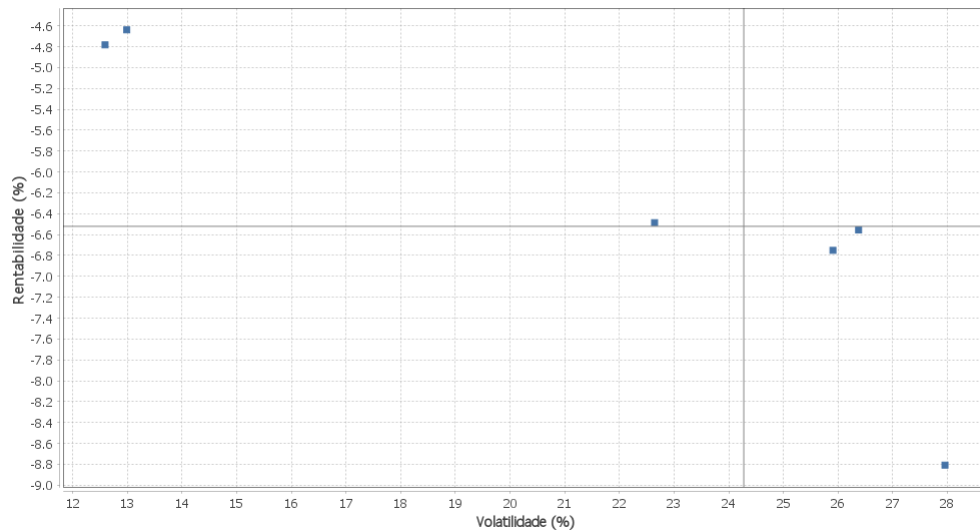
VILA VELHA - CONSOLIDADO - No Mês



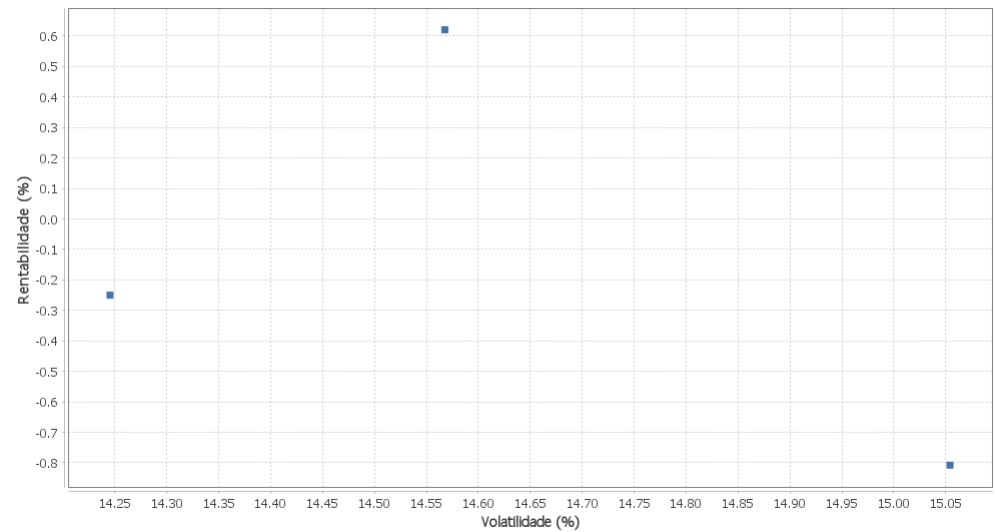
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 9.250.951,44

Value-At-Risk: 2,10%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	-0,00	-8,17	0,25	416.183,66	0,09
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	-0,00	-4,27	0,33	588.457,33	0,13
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	-0,00	-3,03	0,35	2.918.147,45	0,66
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,33	0,06	-0,00	0,52	0,61	21.715.504,00	4,93
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,63	0,13	-0,00	1,94	1,66	7.063.659,02	1,60
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,63	0,13	-0,00	1,82	1,59	13.734.299,90	3,12
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,63	0,13	-0,00	1,71	1,52	354.054,88	0,08
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,63	0,13	-0,00	1,63	1,47	6.956.805,23	1,58
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	0,87	0,42	0,00	-0,13	0,33	7.963.009,39	1,81
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,01	1,46	0,03	-0,08	0,35	21.839.979,74	4,96
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,22	0,72	0,00	0,61	1,19	2.446.364,22	0,56
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,25	0,55	0,00	0,69	1,30	1.559.430,28	0,35
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	Artigo 7º I, Alínea b	1,25	0,55	0,00	0,69	1,30	6.610.100,82	1,50
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,25	0,55	0,00	0,69	1,30	3.502.682,41	0,80
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,34	0,91	0,00	0,53	1,14	5.526.528,40	1,26
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,53	1,07	0,04	0,39	1,03	39.838.681,78	9,05
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	1,55	0,95	0,00	0,45	1,13	4.165.761,77	0,95
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,63	1,04	0,02	0,39	1,08	24.929.477,87	5,66
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,68	1,11	0,02	-0,26	-0,01	17.021.404,87	3,87
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	1,81	1,23	0,01	-0,17	0,13	8.464.782,61	1,92
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	1,94	1,27	0,01	0,25	0,92	7.196.082,79	1,63
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	Artigo 7º VII, Alínea b	2,22	1,87	0,00	0,17	0,81	1.324.670,20	0,30
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,28	1,63	0,02	0,23	0,96	14.683.546,80	3,34
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,28	1,63	0,03	0,23	0,96	19.547.179,74	4,44
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,97	1,49	0,00	-0,27	-0,37	2.646.258,32	0,60
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,59	2,97	0,02	-0,13	-0,15	6.232.963,47	1,42
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	6,41	3,54	0,08	-0,20	-0,87	21.882.678,43	4,97
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,80	4,07	0,01	-0,22	-1,27	2.406.446,19	0,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,59	5,95	0,72	-0,41	-4,78	58.110.397,81	13,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	12,99	6,26	0,55	-0,39	-4,64	42.177.116,05	9,58
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	14,25	6,65	0,11	-0,05	-0,25	21.424.060,77	4,87
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	14,57	6,16	0,11	0,01	0,62	19.988.166,65	4,54
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	15,05	6,34	0,01	-0,08	-0,81	1.993.953,04	0,45
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	22,64	7,63	0,13	-0,31	-6,49	12.080.806,48	2,74
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	25,91	8,65	0,00	-0,28	-6,75	293.711,06	0,07
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	26,38	10,03	0,02	-0,27	-6,56	1.502.654,01	0,34
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	27,96	10,65	0,14	-0,33	-8,81	9.082.680,14	2,06