



LDB
EMPRESAS

VILA VELHA - CONSOLIDADO
MAIO 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 31.05.2022.

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 83,72%

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%)	2,93	1,45	7,42	20.968.068,10	4,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,840000%)	2,93	1,46	7,49	15.877.412,29	3,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (6,000000%)	2,94	1,47	2,35	39.762.797,12	8,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (3,680000%) ..	0,52	1,28	6,59	7.386.398,50	1,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,290000%) ..	0,52	1,33	6,84	375.980,46	0,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,100000%) ..	0,52	1,40	7,18	14.583.572,59	2,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	4,55	1,45	6,87	25.933.405,59	5,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,260000%)	0,52	1,41	7,25	21.059.898,43	4,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,250000%)	2,82	1,41	7,25	26.569.877,05	5,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,270000%)	2,74	1,41	7,25	31.914.935,59	6,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,290000%)	2,69	1,41	7,26	26.607.077,28	5,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,71	1,43	7,30	231.039.423,00	46,54

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
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,24	0,89	5,94	20.600.350,59	4,15	2.159.396.684,37	0,95
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,24	0,89	5,94	15.438.367,50	3,11	474.241.047,59	3,26

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 RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	1,54	0,65	6,85	3.705.549,21	0,75	494.067.990,12	0,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,52	1,48	7,57	7.728.951,30	1,56	99.963.884,07	7,73
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,59	0,77	6,17	6.106.566,07	1,23	9.450.283.491,65	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,70	0,85	6,17	42.951.765,62	8,65	11.182.665.779,99	0,38
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,16	0,89	3,68	664.160,63	0,13	764.814.820,33	0,09
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,32	0,51	6,78	4.393.337,06	0,88	2.293.984.372,74	0,19
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	1,83	0,73	6,54	2.582.617,07	0,52	306.111.363,56	0,84
BB	BB	BB PREV RF VII	1,54	0,65	6,84	1.648.353,44	0,33	257.494.076,66	0,64
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,04	0,76	6,43	5.830.099,61	1,17	449.188.281,67	1,30
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	1,54	0,65	6,84	6.992.458,17	1,41	214.031.444,23	3,27
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,17	0,24	0,24	7.901.521,02	1,59	3.429.876.365,58	0,23
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,65	0,86	6,27	126.544.097,29	25,49		

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	0,15	0,78	3,17	1.331.426,05	0,27	969.768.049,29	0,14
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	1,07	3,54	3.856.575,66	0,78	9.967.340.356,95	0,04
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,18	0,95	3,90	1.111.717,66	0,22	3.180.026.553,36	0,03
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,22	1,12	4,62	46.766.650,69	9,42	3.265.938.021,00	1,43
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,23	1,09	2,66	5.020.044,29	1,01	2.216.581.148,40	0,23
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,14	1,09	4,38	58.086.414,35	11,70		
Renda Fixa			1,96	1,22	6,51	415.669.934,64	83,72		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

3,02%

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	18,09	4,03	0,25	3.523.670,08	0,71	246.992.960,33	1,43
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	19,75	2,93	5,66	290.501,32	0,06	974.253.508,27	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVSPA	19,53	3,16	6,13	11.135.810,86	2,24	532.929.443,89	2,09
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	18,23	0,70	-11,21	22.262,85	0,00	1.775.533.709,26	0,00
Sub-total Artigo 8º I			18,90	3,35	-8,06	14.972.245,11	3,02		
Renda Variável			15,46	3,35	-8,06	14.972.245,11	3,02		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,67%

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	20,04	-4,44	-28,42	14.977.486,02	3,02	2.266.073.116,40	0,66
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	20,74	-4,24	-30,78	3.631.604,95	0,73	1.571.612.909,63	0,23
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	19,17	-3,76	-27,38	4.598.070,06	0,93	806.752.698,51	0,57
Sub-total Artigo 9º III			19,47	-4,27	-28,54	23.207.161,03	4,67		
Investimentos no Exterior			19,47	-4,27	-28,54	23.207.161,03	4,67		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

8,59%

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	18,35	0,97	-10,62	42.627.110,99	8,59	2.423.271.241,40	1,76
Sub-total Artigo 10º I			18,35	0,97	-10,62	42.627.110,99	8,59		
Investimentos Estruturados			24,19	0,97	-10,62	42.627.110,99	8,59		
Total			5,15	0,98	0,02	496.476.451,77	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	231.039.423,00	46,54	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	126.544.097,29	25,49	0,00	14,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	58.086.414,35	11,70	0,00	14,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	415.669.934,64	83,72					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	14.972.245,11	3,02	0,00	16,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	14.972.245,11	3,02					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	23.207.161,03	4,67	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	23.207.161,03	4,67					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	42.627.110,99	8,59	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	42.627.110,99	8,59					15,00
Total		496.476.451,77	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	1,43 138,57	7,30 168,01	5,13 182,15	8,61 167,58	17,74 224,77	3.290.684,87	14.006.886,74
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,86 83,57	6,27 144,28	4,94 175,64	7,15 139,14	8,24 104,44	1.028.768,43	5.809.643,23
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,09 106,12	4,38 100,88	2,83 100,66			652.206,12	2.187.179,18
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	0,45 10,32	0,00 0,00			0,00	30.909,22
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	3,35 0,13	-8,06 -14,29	-2,24 -0,66			485.994,59	-4.084.497,27
Artigo 9º III % do CDI	-4,27 -414,47	-28,54 -657,03	-14,68 -521,40	-26,79 -521,22	-14,68 -186,00	-1.035.968,31	-12.385.106,38
Artigo 10º I % do CDI	0,97 94,41	-10,62 -244,42	-3,59 -127,65			410.916,52	-5.063.514,54
VILA VELHA - CONSOLIDADO (Total)						4.832.602,22	501.500,18

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%)	21.278.104,01	0,00	0,00	614.374,21	20.968.068,10	304.338,30	1.487.166,57
NTN-B 150523 (5,840000%)	16.110.564,33	0,00	0,00	465.952,06	15.877.412,29	232.800,02	1.136.638,93
NTN-B 150523 (6,000000%)	40.343.105,27	0,00	0,00	1.168.561,48	39.762.797,12	588.253,33	932.885,90
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	7.452.561,56	0,00	0,00	160.693,27	7.386.398,50	94.530,21	465.865,97
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	379.852,59	0,00	0,00	8.881,96	375.980,46	5.009,83	24.616,28
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	14.761.818,27	0,00	0,00	382.742,16	14.583.572,59	204.496,48	1.001.213,40
NTN-B 150545 (5,730000%)	26.292.008,30	0,00	0,00	736.267,36	25.933.405,59	377.664,65	1.709.841,94
NTN-B 150555 (5,260000%)	21.316.907,63	0,00	0,00	555.122,22	21.059.898,43	298.113,02	1.458.487,02
NTN-B 150830 (5,250000%)	26.200.137,81	0,00	0,00	0,00	26.569.877,05	369.739,24	1.806.332,69
NTN-B 150840 (5,270000%)	31.470.322,06	0,00	0,00	0,00	31.914.935,59	444.613,53	2.171.627,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150850 (5,290000%)	26.235.951,02	0,00	0,00	0,00	26.607.077,28	371.126,26	1.812.210,71
					231.039.423,00	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	3.681.653,35	0,00	0,00	0,00	3.705.549,21	23.895,86	238.682,85
BB PREV RF IDKA2	6.059.604,28	0,00	0,00	0,00	6.106.566,07	46.961,79	355.106,46
BB PREV RF IPCA	4.370.925,63	123.041,52	-123.041,52	0,00	4.393.337,06	22.411,43	278.972,81
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	2.563.964,04	0,00	0,00	0,00	2.582.617,07	18.653,03	159.284,19
BB PREV RF VII	1.637.741,61	0,00	0,00	0,00	1.648.353,44	10.611,83	106.099,23
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUB X FI	5.786.253,32	0,00	0,00	0,00	5.830.099,61	43.846,29	353.829,44
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	6.947.478,82	0,00	0,00	0,00	6.992.458,17	44.979,35	449.856,54
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.616.400,47	0,00	0,00	0,00	7.728.951,30	112.550,83	547.641,61
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.302.369,10	0,00	0,00	0,00	15.438.367,50	135.998,40	868.528,52
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.419.092,73	0,00	0,00	0,00	20.600.350,59	181.257,86	1.158.105,22
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	653.237,52	446.378,24	-440.776,45	0,00	664.160,63	5.321,32	23.224,06
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	42.588.411,48	0,00	0,00	0,00	42.951.765,62	363.354,14	1.308.142,33
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,00	7.882.594,72	0,00	0,00	7.901.521,02	18.926,30	18.926,30
					126.544.097,29	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	1.317.412,69	15.701.088,17	-15.716.095,12	0,00	1.331.426,05	29.020,31	112.734,73
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	46.247.074,89	0,00	0,00	0,00	46.766.650,69	519.575,80	1.615.308,83
BB PREV RF FLUXO FIC	913.409,75	310.184,28	-120.572,78	0,00	1.111.717,66	8.696,41	43.195,94
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.815.891,51	0,00	0,00	0,00	3.856.575,66	40.684,15	131.827,28
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	4.965.814,84	0,00	0,00	0,00	5.020.044,29	54.229,45	130.189,25
					58.086.414,35	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	22.108,16	0,00	0,00	0,00	22.262,85	154,69	-4.227.645,35
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	282.239,90	0,00	0,00	0,00	290.501,32	8.261,42	15.554,17
FIA CAIXA BRASIL IBOVESA	10.794.579,43	0,00	0,00	0,00	11.135.810,86	341.231,43	-282.817,13
FIA CAIXA DIVIDENDOS	3.387.323,03	0,00	0,00	0,00	3.523.670,08	136.347,05	8.670,08
					14.972.245,11	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	4.777.716,08	0,00	0,00	0,00	4.598.070,06	-179.646,02	-4.823.117,48
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	15.672.890,83	0,00	0,00	0,00	14.977.486,02	-695.404,81	-5.947.071,41
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	3.792.522,43	0,00	0,00	0,00	3.631.604,95	-160.917,48	-1.614.917,49
					23.207.161,03	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	42.216.194,47	0,00	0,00	0,00	42.627.110,99	410.916,52	-5.063.514,54
					42.627.110,99	0,00	0,00

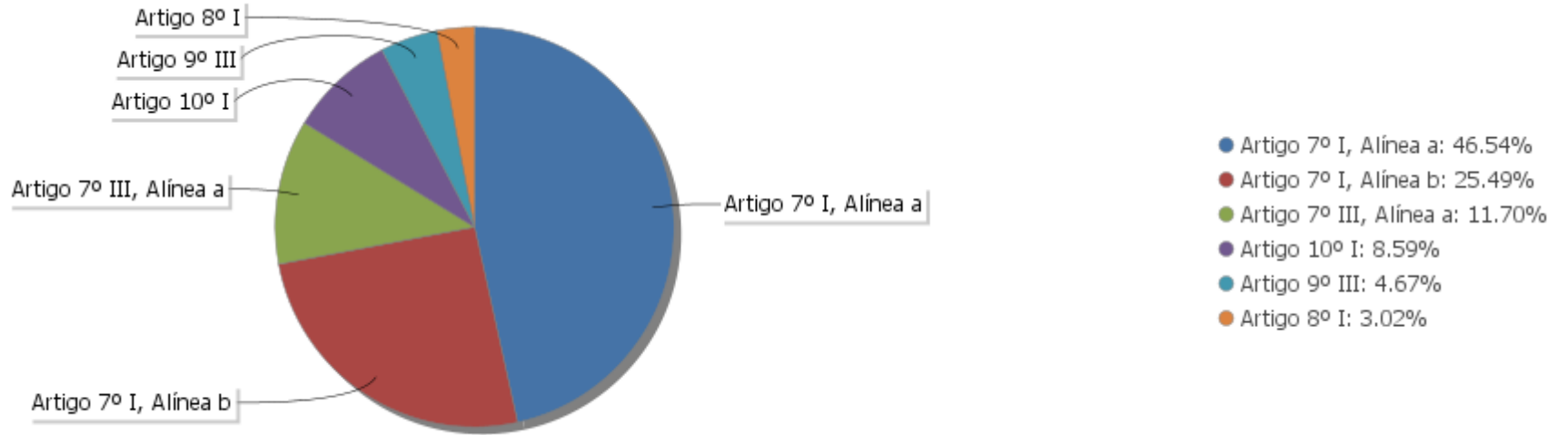
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

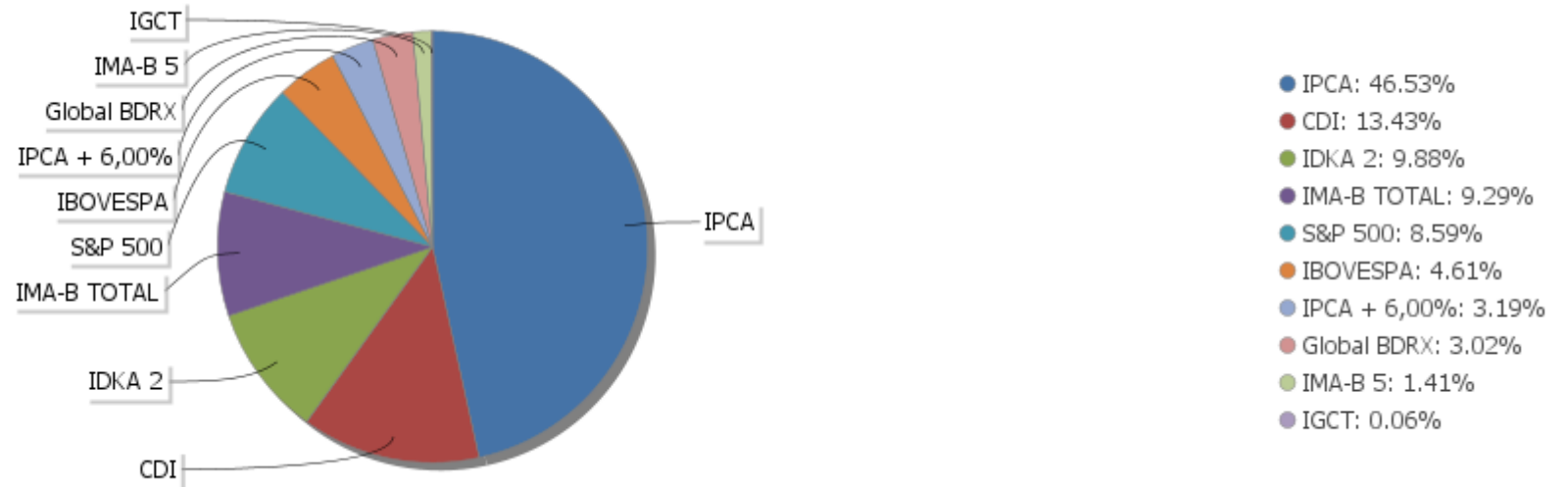
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	216.592.256,94	43,63	216.592.256,94	43,63
de 31 a 365 dias	81.001.614,57	16,32	297.593.871,51	59,94
acima de 365 dias	198.882.580,26	40,06	496.476.451,77	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

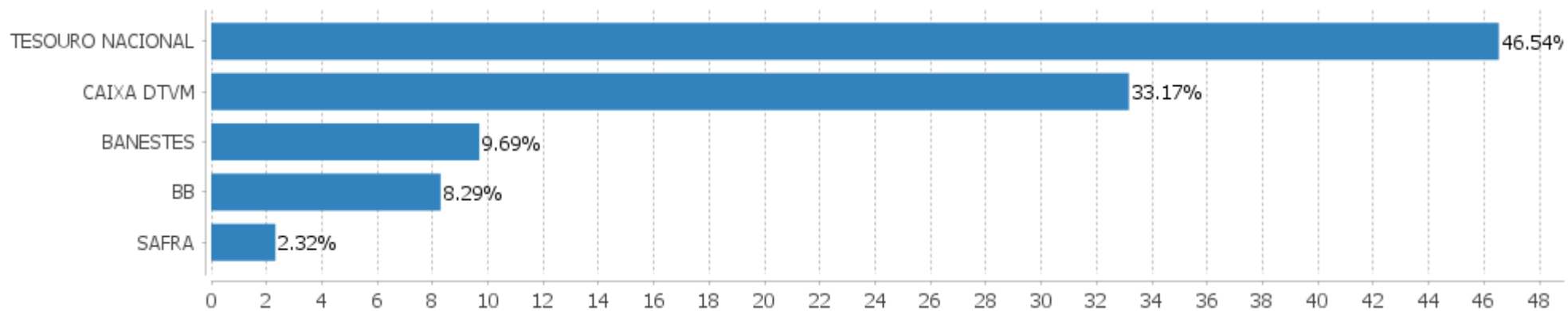


Alocação Por Estratégia



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								0,02
IPCA + 4,92%	0,94	1,38	2,05	1,43	0,89								6,86
p.p. indexador	-2,72	-1,86	-0,16	-1,97	0,09								-6,84
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

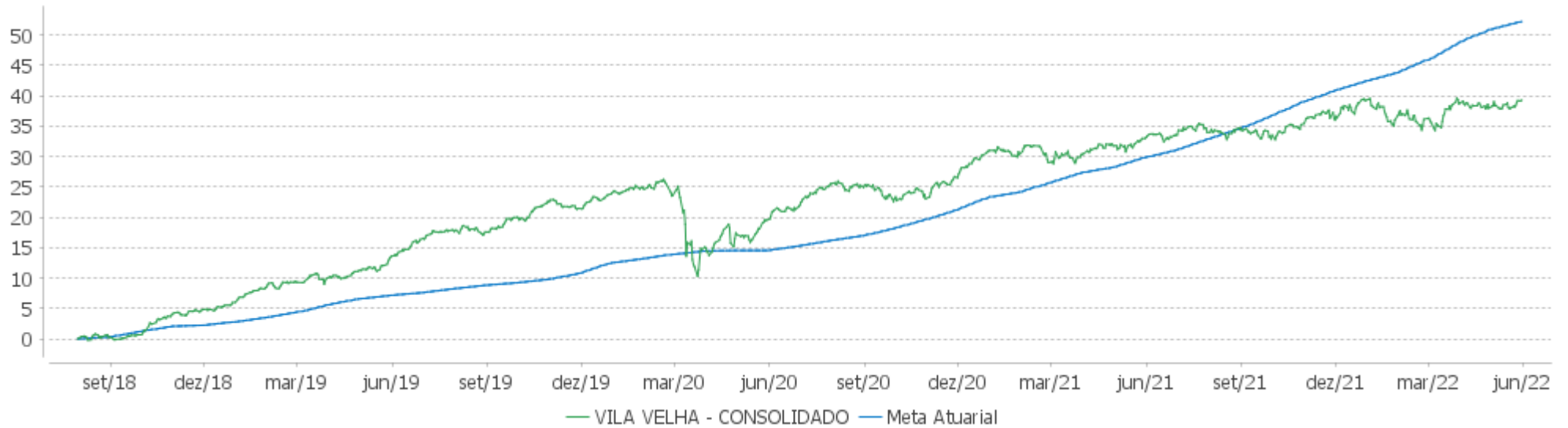
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	21	45,65	03 meses	2,32	4,43	-2,10	5,28
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	54,35	06 meses	2,16	8,16	-6,00	5,77
			12 meses	4,73	17,56	-12,84	5,15
			24 meses	16,52	34,24	-17,72	4,80
			36 meses	22,62	44,86	-22,23	6,26
Maior rentabilidade da Carteira	3,55	2020-12	Desde 31/07/2018	39,28	56,58	-17,30	5,72
Menor rentabilidade da Carteira	-6,98	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

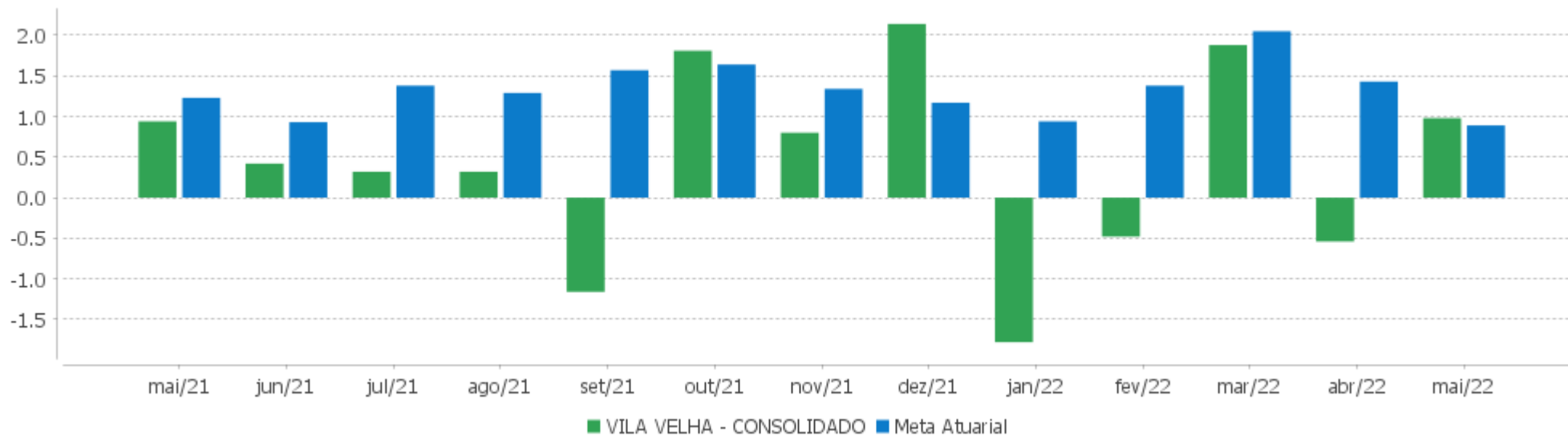


Patrimônio Líquido



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.	1,47 1,00	7,56 2,77	5,13 1,95	8,95 3,40	15,38 3,65	23,87 3,14	26,38 3,38
NTN-B 150545 (5,100000%) .. Var. IPCA p.p.	1,40 0,93	7,18 2,40	4,90 1,72	8,49 2,94	17,78 6,05	32,90 12,16	42,50 19,50
NTN-B 150523 (5,661000%) Var. IPCA p.p.	1,45 0,98	7,42 2,63	5,04 1,86	8,78 3,23	15,03 3,30	23,15 2,41	25,31 2,31
NTN-B 150850 (5,290000%) Var. IPCA p.p.	1,41 0,94	7,26 2,48	4,95 1,77	8,59 3,04	14,92 3,19	23,23 2,50	25,58 2,58
NTN-B 150545 (4,290000%) .. Var. IPCA p.p.	1,33 0,86	6,84 2,06	4,70 1,52	8,07 2,52	16,87 5,14	30,86 10,13	39,23 16,24
NTN-B 150523 (5,840000%) Var. IPCA p.p.	1,46 0,99	7,49 2,71	5,09 1,91	8,87 3,32	15,21 3,48	23,53 2,80	25,87 2,87
NTN-B 150545 (3,680000%) .. Var. IPCA p.p.	1,28 0,81	6,59 1,80	4,55 1,37	7,75 2,20	16,19 4,46	29,34 8,60	36,81 13,81
NTN-B 150840 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	1,41 0,94	7,25 2,47	4,95 1,77	8,58 3,03	14,85 3,12	23,03 2,29	25,25 2,25
NTN-B 150555 (5,260000%) Var. IPCA p.p.	1,41 0,94	7,25 2,47	4,94 1,76	8,57 3,02	17,96 6,23	26,52 5,79	28,96 5,96
NTN-B 150545 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	1,45 0,98	7,45 2,66	6,14 2,96	8,81 3,26	15,20 3,47	23,61 2,88	26,05 3,05
NTN-B 150830 (5,250000%) Var. IPCA p.p.	1,41 0,94	7,25 2,46	4,94 1,76	8,57 3,02	14,73 3,00	22,68 1,95	24,68 1,69
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,73 -0,24	6,54 1,82	5,00 0,07	7,26 2,30	10,72 6,12	18,97 4,79	31,44 9,63
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	0,65 -0,13	6,84 0,59	5,06 0,04	7,46 0,37	11,81 2,26	20,69 3,04	32,30 3,52
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,65 -0,33	6,85 -0,46	5,07 0,37	7,47 -1,20	11,83 -6,60	20,49 -15,13	31,28 -15,15
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI % do CDI	1,05 101,92	4,29 98,77	2,71 96,26	5,07 98,58	7,89 100,00	9,88 96,51	15,02 96,09
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,89 86,14	3,68 84,81	2,41 85,55	4,34 84,36	6,44 81,54	7,84 76,58	12,16 77,80
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,89	5,94	4,86	6,84	8,56	15,61	29,70

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.	-0,08	1,21	-0,07	1,88	3,96	1,43	7,89
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	0,76	6,43	4,97	7,18	10,31	17,93	28,84
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,21	1,71	0,04	2,22	5,72	3,75	7,03
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,48	7,57	5,14	8,97	18,82	35,14	42,28
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,50	0,26	0,44	0,30	0,38	-0,49	-4,14
BB PREV RF VII	0,65	6,84	5,06	7,47	11,81	19,48	27,02
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,32	2,12	0,13	2,50	7,22	5,30	5,21
BB PREV RF IDKA2	0,77	6,17	4,95	6,92	9,45	17,95	27,46
Var. IDKA 2 p.p.	-0,08	-0,17	-0,02	-0,30	0,21	-0,54	-1,73
BB PREV RF IPCA	0,51	6,78	5,23	7,37	9,67	17,81	31,37
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,47	-0,54	0,53	-1,30	-8,76	-17,82	-15,05
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,89	5,94	4,86	6,84	8,56	15,62	29,71
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,08	1,21	-0,07	1,87	3,96	1,44	7,90
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,85	6,17	4,95	6,94	9,11	17,79	27,49
Var. IDKA 2 p.p.	0,00	-0,17	-0,02	-0,29	-0,13	-0,70	-1,70
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	1,12	4,62	2,94	5,45	8,76	12,85	14,10
% do CDI	108,97	106,31	104,33	105,94	110,94	125,45	90,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1,07	4,47	2,84	5,31	8,23	10,70	15,42
% do CDI	103,41	102,93	100,83	103,21	104,30	104,45	98,68
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,78	3,17	2,09	3,72	5,29	5,71	7,67
% do CDI	75,32	73,02	74,26	72,27	66,99	55,72	49,10
BB PREV RF FLUXO FIC	0,95	3,90	2,53	4,60	6,73	7,86	11,92
% do CDI	92,35	89,81	90,00	89,42	85,24	76,73	76,28
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	1,09	4,60	2,83	5,39	8,44	10,88	15,81
% do CDI	105,92	106,00	100,52	104,93	106,94	106,20	101,20
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	3,16	6,13	-1,58	9,17	-11,89	26,55	13,94
Var. IBOVESPA p.p.	-0,06	-0,10	0,01	-0,09	-0,12	-0,85	-0,82
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	0,70	-11,21	-3,66	-6,52	3,03	40,04	
Var. IBOVESPA p.p.	-2,52	-17,43	-2,08	-15,78	14,81	12,65	
FIA CAIXA DIVIDENDOS	4,03	13,48	8,40	15,21	-0,98	24,26	23,56
Var. IBOVESPA p.p.	0,80	7,25	9,98	5,95	10,80	-3,14	8,80
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	2,93	5,66	-1,76	9,29	-13,66	26,13	15,98
Var. IGCT p.p.	-0,13	-0,56	-0,25	-0,62	-0,85	-2,76	-3,44
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-4,44	-28,42	-14,62	-27,20	-14,82	13,58	74,74
Var. Global BDRX p.p.	-0,12	-0,24	-0,09	-0,25	-1,78	-3,06	-4,50
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	-3,76	-27,38	-13,73	-25,28	-13,19	12,47	66,90

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.	-6,98	-33,61	-12,15	-34,54	-1,41	-14,93	52,14
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	-4,24	-30,78	-15,43	-28,39	-16,29	9,34	59,51
Var. IBOVESPA p.p.	-7,46	-37,01	-13,85	-37,65	-4,51	-18,06	44,75
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,97	-10,62	-3,59	-5,65	4,99	42,87	57,03
Var. S&P 500 p.p.	4,83	15,92	9,69	18,22	16,16	24,59	-23,15
VILA VELHA - CONSOLIDADO	0,98	0,02	2,32	2,16	4,73	16,52	22,62
Var. IPCA + 4,92% p.p.	0,09	-6,84	-2,10	-5,95	-12,50	-16,36	-19,38
CDI	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63
IBOVESPA	3,22	6,23	-1,58	9,26	-11,78	27,40	14,76
INPC + 6,00%	0,96	7,49	4,75	8,85	18,61	36,88	48,04
IPCA + 6,00%	0,98	7,31	4,69	8,67	18,43	35,62	46,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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 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
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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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	0,95	4,02	2,61	4,93	6,43	8,67	15,54	23,85	33,97
IRF-M 1+	0,39	0,65	0,67	2,95	-0,89	-1,17	12,32	30,13	44,56
IRF-M TOTAL	0,58	1,82	1,31	3,74	1,60	2,33	13,90	29,08	42,46
IMA-B 5	0,78	6,25	5,02	7,09	9,55	17,65	28,78	45,80	60,12
IMA-B 5+	1,16	3,17	4,84	2,82	-0,25	10,41	15,02	52,46	63,45
IMA-B TOTAL	0,96	4,73	4,93	4,96	4,59	14,18	21,81	50,71	63,86
IMA-GERAL TOTAL	0,92	4,04	3,06	4,94	5,26	9,68	18,01	34,24	46,62
IDKA 2	0,85	6,35	4,97	7,23	9,24	18,49	29,19	44,76	60,19
IDKA 20	1,21	0,35	3,98	-1,94	-10,01	4,21	1,84	54,09	61,61
CDI	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63	22,99	32,44

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,22	6,23	-1,58	9,26	-11,78	27,40	14,76	45,08	77,56
IBRX 100	3,23	6,61	-1,68	9,95	-12,43	29,27	17,73	50,94	83,12
IBRX 50	3,30	6,74	-2,55	10,76	-11,91	31,55	16,59	45,38	78,31
SMALL CAP	-1,82	-4,02	-2,10	-0,37	-26,87	15,36	13,41	44,72	71,86
IFIX	0,26	0,56	2,89	9,39	0,14	6,12	10,49	27,39	37,13
Índice Consumo - ICON	-3,02		-12,01	-12,30	-36,86	-19,27	-13,06	7,05	10,44
Índice Dividendos - IDIV	4,26	14,16	8,74	15,99	2,41	41,18	33,41	82,88	105,54

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	0,47	4,78	3,18	5,55	11,73	20,73	23,00	28,73	32,40
INPC	0,45	4,96	3,23	5,73	11,90	21,85	24,35	30,30	32,59
IGPM	0,52	7,54	3,71	8,47	10,72	51,73	61,61	73,96	81,38
SELIC	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63	23,00	32,46

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	-3,86	-26,53	-13,29	-23,87	-11,17	18,29	80,18	91,96	149,78
MSCI ACWI	-3,99	-26,71	-14,01	-24,39	-17,07	11,67	59,19	61,99	105,20

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,81	6,48	4,20	7,64	16,20	30,56	38,31	50,52	60,94
IPCA + 5,00%	0,90	6,90	4,45	8,16	17,32	33,08	42,33	56,38	68,79
IPCA + 5,50%	0,94	7,10	4,57	8,41	17,88	34,35	44,37	59,37	72,83
IPCA + 5,89%	0,97	7,26	4,67	8,61	18,31	35,34	45,97	61,73	76,03
IPCA + 6,00%	0,98	7,31	4,69	8,67	18,43	35,62	46,43	62,40	76,94
INPC + 4,00%	0,79	6,66	4,25	7,82	16,37	31,77	39,83	52,36	61,17
INPC + 6,00%	0,96	7,49	4,75	8,85	18,61	36,88	48,04	64,38	77,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1496	02/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	666,00	0,00	78,25522796	8,5106135100
1475	02/05/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	81.331,14	40.704,25939856	1,9980990000
1466	03/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	17.931,68	7.973,52848700	2,2489014780
1483	03/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.027,25	0,00	120,65942404	8,5136325500
1467	04/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	698,02	0,00	310,25863500	2,2498003930
1468	05/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	93,70	41,63154600	2,2506971250
1498	06/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	416,68	0,00	48,89368813	8,5221634100
1492	10/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	230.113,08	26.982,46900831	8,5282440200
1479	10/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	27.176,64	3.186,66303780	8,5282440200
1469	11/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	40.413,29	17.924,29985900	2,2546649140
1493	11/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	22.664,11	2.656,55248176	8,5313993100
1480	11/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	249,25	29,21560590	8,5313993100
1500	16/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	455.169,93	0,00	53.295,46420960	8,5405003400
1485	16/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	5.672.665,73	0,00	664.207,65811948	8,5405003400
1464	16/05/2022	BB PREV RF IPCA	0,00	123.041,52	44.365,59786000	2,7733542640
1465	18/05/2022	BB PREV RF IPCA	123.041,52	0,00	44.444,63165000	2,7684225390
1470	20/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2,40	1,06118500	2,2616233310
1502	20/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	84.121,81	0,00	9.835,65997195	8,5527367000
1487	20/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	3.393.702,88	0,00	396.797,30587713	8,5527367000
1482	24/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	943,00	110,17778333	8,5588534000
1488	24/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.750.331,92	204.505,42134506	8,5588534000
1481	24/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	445.431,12	52.043,31687921	8,5588534000
1486	24/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	5.684.855,97	664.207,65841501	8,5588534000
1484	24/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.032,71	120,65942411	8,5588534000
1474	24/05/2022	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	7.882.594,72	0,00	15.159,71602152	519,9698140000
1491	25/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	837,30	0,00	97,79324645	8,5619409400
1471	26/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	309.486,26	0,00	136.605,55495700	2,2655466690
1504	26/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	6.092.480,59	0,00	711.329,93528293	8,5649152200

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1476	26/05/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	412.201,88	0,00	204.808,59774821	2,0126200000
1489	26/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	381.134,40	44.499,49475934	8,5649152200
1472	27/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.303,10	1.898,53669500	2,2665350690
1494	27/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	176.840,99	20.639,85450802	8,5679377300
1499	27/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	418,92	48,89368813	8,5679377300
1505	27/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	4.530.504,59	528.774,21997790	8,5679377300
1497	27/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	670,49	78,25522796	8,5679377300
1503	27/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	84.271,32	9.835,65971832	8,5679377300
1495	27/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	421.509,63	49.196,15910070	8,5679377300
1501	27/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	456.632,22	53.295,46420960	8,5679377300
1477	27/05/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	359.445,31	178.522,80323943	2,0134420000
1507	27/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	726.064,57	84.742,04562175	8,5679377300
1473	31/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	57.828,61	25.492,09115600	2,2684922020
1506	31/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	746.355,81	87.048,25831786	8,5740464500
1478	31/05/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	34.176,36	0,00	16.960,22359310	2,0150890000
1490	31/05/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	28.894,38	3.369,98174393	8,5740464500
Total			24.463.286,93	16.400.485,87		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 8.868.579,97

Value-At-Risk: 1,79%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VILA VELHA - CONSOLIDADO		1,79	1,79			496.476.451,77	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,37%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150523 (5,661000%)		0,26	0,00	0,27			20.968.068,10	4,22
NTN-B 150523 (5,840000%)		0,26	0,00	0,27			15.877.412,29	3,20
NTN-B 150523 (6,000000%)		0,26	0,00	0,27			39.762.797,12	8,01
NTN-B 150545 (3,680000%) ..		0,26	0,00	0,27			7.386.398,50	1,49
NTN-B 150545 (4,290000%) ..		0,26	0,00	0,27			375.980,46	0,08
NTN-B 150545 (5,100000%) ..		0,26	0,00	0,27			14.583.572,59	2,94
NTN-B 150545 (5,730000%)		0,47	0,00	0,48			25.933.405,59	5,22
NTN-B 150555 (5,260000%)		0,26	0,00	0,27			21.059.898,43	4,24
NTN-B 150830 (5,250000%)		0,26	0,00	0,27			26.569.877,05	5,35
NTN-B 150840 (5,270000%)		0,26	0,00	0,27			31.914.935,59	6,43
NTN-B 150850 (5,290000%)		0,26	0,00	0,27			26.607.077,28	5,36
Sub-total	0,44	0,25	0,01		0,90	1,43	231.039.423,00	46,54

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,46	0,02	1,10			20.600.350,59	4,15
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,47	0,02	1,10			15.438.367,50	3,11
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI		0,69	0,00	0,65			3.705.549,21	0,75
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,26	0,00	0,27			7.728.951,30	1,56
BB PREV RF IDKA2		1,26	0,01	0,25			6.106.566,07	1,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,35	0,04	0,33			42.951.765,62	8,65
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,03	0,00	0,00			664.160,63	0,13
BB PREV RF IPCA		0,88	0,00	0,85			4.393.337,06	0,88
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI		0,80	0,00	1,70			2.582.617,07	0,52
BB PREV RF VII		0,69	0,00	2,06			1.648.353,44	0,33
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI		0,88	0,00	1,57			5.830.099,61	1,17
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP		0,69	0,00	0,94			6.992.458,17	1,41
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI		0,04	0,00	0,03			7.901.521,02	1,59
Sub-total	2,11	1,04	0,09		-0,08	0,86	126.544.097,29	25,49

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		0,03	0,00	0,01			1.331.426,05	0,27
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,04	0,00	0,03			3.856.575,66	0,78
BB PREV RF FLUXO FIC		0,03	0,00	0,01			1.111.717,66	0,22
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI		0,05	0,00	0,04			46.766.650,69	9,42
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,04	-0,00	0,04			5.020.044,29	1,01
Sub-total	0,06	0,05	0,00		1,12	1,09	58.086.414,35	11,70

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 13,22%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		13,22	1,10	8,23			42.627.110,99	8,59
Sub-total	30,63	13,22	1,10		-0,00	0,97	42.627.110,99	8,59

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,97%

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		10,80	0,26	1,87			14.977.486,02	3,02
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		13,50	0,08	14,14			3.631.604,95	0,73
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I		10,70	0,08	12,64			4.598.070,06	0,93
Sub-total	24,10	10,97	0,41		-0,22	-4,27	23.207.161,03	4,67

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,05%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA DIVIDENDOS		8,46	0,03	5,30			3.523.670,08	0,71
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		9,86	0,00	0,17			290.501,32	0,06
FIA CAIXA BRASIL IBOVSPA		9,57	0,14	0,13			11.135.810,86	2,24
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA		11,45	0,00	9,59			22.262,85	0,00
Sub-total	18,94	9,05	0,17		0,12	3,35	14.972.245,11	3,02