



LDB
EMPRESAS

VILA VELHA - CONSOLIDADO
DEZEMBRO 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 30.12.2022.

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

87,15%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,661000%)	0,62	0,04	0,85	11,75	21.189.014,97	3,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,840000%)	0,62	0,04	0,86	11,94	16.060.292,57	2,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (6,000000%)	0,62	0,04	0,87	6,68	40.255.656,44	7,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (6,760000%)	2,97	0,05	0,94	4,19	22.258.454,54	4,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (7,950000%)	3,00	0,05	1,04	3,50	83.870.670,32	15,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (3,680000%) ..	0,62	0,03	0,68	9,66	7.436.381,65	1,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,290000%) ..	0,62	0,04	0,73	10,31	379.139,86	0,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,100000%) ..	0,62	0,04	0,80	11,16	14.735.483,14	2,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	3,62	0,04	0,85	11,22	26.240.976,05	4,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,260000%)	0,62	0,04	0,81	11,33	21.296.235,84	3,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,250000%)	0,62	0,04	0,81	11,32	26.822.415,20	4,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,270000%)	0,62	0,04	0,81	11,34	32.250.921,07	5,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,290000%)	0,62	0,04	0,82	11,36	26.902.714,29	4,89
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,77	0,04	0,89	12,12	339.698.355,94	61,72

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,08	0,04	0,86	2,27	1.427.364,07	0,26	2.857.261.377,11	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,91	0,04	1,32	9,05	20.575.216,14	3,74	3.307.767.205,35	0,62
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,91	0,04	1,32	9,03	15.446.985,11	2,81	474.505.817,58	3,26
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,82	0,04	1,22	9,32	6.287.572,37	1,14	7.489.389.892,90	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,92	0,04	1,23	9,04	65.705,61	0,01	6.893.208.496,34	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,08	0,04	0,96	10,58	4.880.684,65	0,89	918.894.770,10	0,53
BB	BB	BB PREV RF IPCA	1,93	0,04	0,95	11,41	4.452.852,34	0,81	3.745.902.538,43	0,12
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	2,19	0,04	1,31	10,50	860.153,60	0,16	101.951.928,50	0,84
BB	BB	BB PREV RF VII	1,41	0,05	1,11	13,98	1.758.391,73	0,32	70.566.747,04	2,49
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,26	0,04	1,31	10,23	2.664.483,42	0,48	205.288.898,90	1,30
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,09	0,05	1,12	7,95	5.209.547,97	0,95	3.484.971.718,10	0,15
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,01	0,04	1,26	10,75	63.628.957,01	11,56		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,09	0,05	1,12	11,58	4.156.174,19	0,76	12.858.761.791,29	0,03
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,08	0,05	1,03	11,26	2.075.248,66	0,38	3.841.990.026,28	0,05
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,13	0,05	1,11	6,22	35.495.115,47	6,45	3.275.697.229,55	1,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,10	0,05	1,13	10,66	34.615.435,18	6,29	6.034.941.409,44	0,57
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,12	0,05	1,12	12,40	76.341.973,50	13,87		
Renda Fixa			0,73	0,04	0,97	11,43	479.669.286,45	87,15		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

2,68%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	18,35	-0,01	-1,57	-1,56	3.460.082,74	0,63	233.749.193,12	1,48
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21,38	-0,01	-2,62	2,43	281.616,44	0,05	844.496.837,07	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	20,68	-0,00	-2,28	4,93	11.009.904,56	2,00	479.558.546,97	2,30
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	23,65	0,00	-4,58	-13,32	21.731,72	0,00	1.307.589.645,54	0,00
Sub-total Artigo 8º I			20,43	-0,00	-2,13	-9,28	14.773.335,46	2,68		
Renda Variável			20,43	-0,00	-2,13	-9,28	14.773.335,46	2,68		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,23%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	26,84	-0,00	-4,79	-28,54	14.952.934,60	2,72	1.938.590.167,99	0,77
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	26,80	0,01	-4,67	-30,39	3.652.009,52	0,66	910.995.998,19	0,40
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	25,37	-0,48	-4,87	-25,89	4.692.395,93	0,85	670.077.868,22	0,70
Sub-total Artigo 9º III			26,13	-0,10	-4,79	-28,26	23.297.340,05	4,23		
Investimentos no Exterior			26,13	-0,10	-4,79	-28,26	23.297.340,05	4,23		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

5,93%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	24,18	0,05	-4,90	-11,97	32.649.671,98	5,93	1.723.160.287,50	1,89
Sub-total Artigo 10º I			24,18	0,05	-4,90	-11,97	32.649.671,98	5,93		
Investimentos Estruturados			24,18	0,05	-4,90	-11,97	32.649.671,98	5,93		
Total			4,29	0,04	0,26	3,95	550.389.633,94	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	339.698.355,94	61,72	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	63.628.957,01	11,56	0,00	14,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	76.341.973,50	13,87	0,00	14,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	479.669.286,45	87,15					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	14.773.335,46	2,68	0,00	16,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	14.773.335,46	2,68					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	23.297.340,05	4,23	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	23.297.340,05	4,23					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	32.649.671,98	5,93	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	32.649.671,98	5,93					15,00
Total		550.389.633,94	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	0,89 79,02	12,12 97,99	2,59 81,05	3,49 52,77	12,12 97,99	2.988.612,05	27.892.475,60
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,26 112,16	10,75 86,88	2,94 91,79	3,85 58,17	10,75 86,88	800.649,06	8.815.168,74
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,12 99,40	12,40 100,26	3,21 100,34	6,60 99,82	12,40 100,26	819.070,35	5.920.291,28
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	0,45 3,62	0,00 0,00	0,00 0,00	0,45 3,62	0,00	30.909,22
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-2,13 0,32	-9,28 -13,97	0,54 0,81	10,33 -1,03	-9,28 -13,97	-321.073,24	-4.283.406,92
Artigo 9º III % do CDI	-4,79 -426,38	-28,26 -228,42	3,98 124,43	-0,36 -5,44	-28,26 -228,42	-1.171.987,34	-12.294.927,36
Artigo 10º I % do CDI	-4,90 -435,97	-11,97 -96,77	9,70 303,23	6,79 102,67	-11,97 -96,77	-1.681.308,01	-5.040.949,94
VILA VELHA - CONSOLIDADO (Total)						1.433.962,87	21.039.560,62

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%)	21.011.106,17	0,00	0,00	0,00	21.189.014,97	177.908,80	2.324.898,80
NTN-B 150523 (5,840000%)	15.923.098,63	0,00	0,00	0,00	16.060.292,57	137.193,94	1.787.299,93
NTN-B 150523 (6,000000%)	39.906.494,87	0,00	0,00	0,00	40.255.656,44	349.161,57	2.598.892,79
NTN-B 150523 (6,760000%)	22.051.626,71	0,00	0,00	0,00	22.258.454,54	206.827,83	911.701,24
NTN-B 150523 (7,950000%)	83.010.992,12	0,00	0,00	0,00	83.870.670,32	859.678,20	2.885.103,25
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	7.386.135,20	0,00	0,00	0,00	7.436.381,65	50.246,45	677.173,04
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	376.385,44	0,00	0,00	0,00	379.139,86	2.754,42	36.692,49
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	14.618.547,85	0,00	0,00	0,00	14.735.483,14	116.935,29	1.537.368,20
NTN-B 150545 (5,730000%)	26.019.161,43	0,00	0,00	0,00	26.240.976,05	221.814,62	2.756.569,29
NTN-B 150555 (5,260000%)	21.124.433,45	0,00	0,00	0,00	21.296.235,84	171.802,39	2.252.125,26

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150830 (5,250000%)	26.606.264,32	0,00	0,00	0,00	26.822.415,20	216.150,88	2.796.495,64
NTN-B 150840 (5,270000%)	31.990.474,70	0,00	0,00	0,00	32.250.921,07	260.446,37	3.365.337,89
NTN-B 150850 (5,290000%)	26.685.023,00	0,00	0,00	0,00	26.902.714,29	217.691,29	2.810.722,09
					339.698.355,94	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	1.459.992,22	9.562.150,12	-9.617.941,74	0,00	1.427.364,07	23.163,47	56.265,33
BB PREV RF IDKA2	6.211.873,41	0,00	0,00	0,00	6.287.572,37	75.698,96	536.112,76
BB PREV RF IPCA	4.410.731,31	0,00	0,00	0,00	4.452.852,34	42.121,03	468.047,88
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	849.024,96	0,00	0,00	0,00	860.153,60	11.128,64	213.696,28
BB PREV RF VII	1.739.014,20	0,00	0,00	0,00	1.758.391,73	19.377,53	216.137,52
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2.629.963,38	0,00	0,00	0,00	2.664.483,42	34.520,04	484.656,28
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.246.062,79	0,00	0,00	0,00	15.446.985,11	200.922,32	1.308.158,93
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.307.431,30	0,00	0,00	0,00	20.575.216,14	267.784,84	1.748.195,29
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	8.478.552,27	387.724,81	-4.052.843,00	0,00	4.880.684,65	67.250,57	548.379,93
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	64.904,72	0,00	0,00	0,00	65.705,61	800,89	1.322.082,32
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	5.151.667,20	0,00	0,00	0,00	5.209.547,97	57.880,77	425.036,44
					63.628.957,01	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 LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	30.879.575,97	4.250.000,00	0,00	0,00	35.495.115,47	365.539,50	3.380.700,66
BB PREV RF FLUXO FIC	2.043.140,77	285.215,96	-273.809,43	0,00	2.075.248,66	20.701,36	153.732,48
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.110.042,58	0,00	0,00	0,00	4.156.174,19	46.131,61	431.425,81
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	34.228.737,30	0,00	0,00	0,00	34.615.435,18	386.697,88	1.581.573,04
					76.341.973,50	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	22.775,51	0,00	0,00	0,00	21.731,72	-1.043,79	-4.228.176,48
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	289.201,43	0,00	0,00	0,00	281.616,44	-7.584,99	6.669,29
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	11.267.034,64	0,00	0,00	0,00	11.009.904,56	-257.130,08	-408.723,43
FIA CAIXA DIVIDENDOS	3.515.397,12	0,00	0,00	0,00	3.460.082,74	-55.314,38	-54.917,26
					14.773.335,46	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	4.932.675,32	0,00	0,00	0,00	4.692.395,93	-240.279,39	-4.728.791,61
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	15.705.794,55	0,00	0,00	0,00	14.952.934,60	-752.859,95	-5.971.622,83
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	3.830.857,52	0,00	0,00	0,00	3.652.009,52	-178.848,00	-1.594.512,92
					23.297.340,05	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	34.330.979,99	0,00	0,00	0,00	32.649.671,98	-1.681.308,01	-5.040.949,94
					32.649.671,98	0,00	0,00

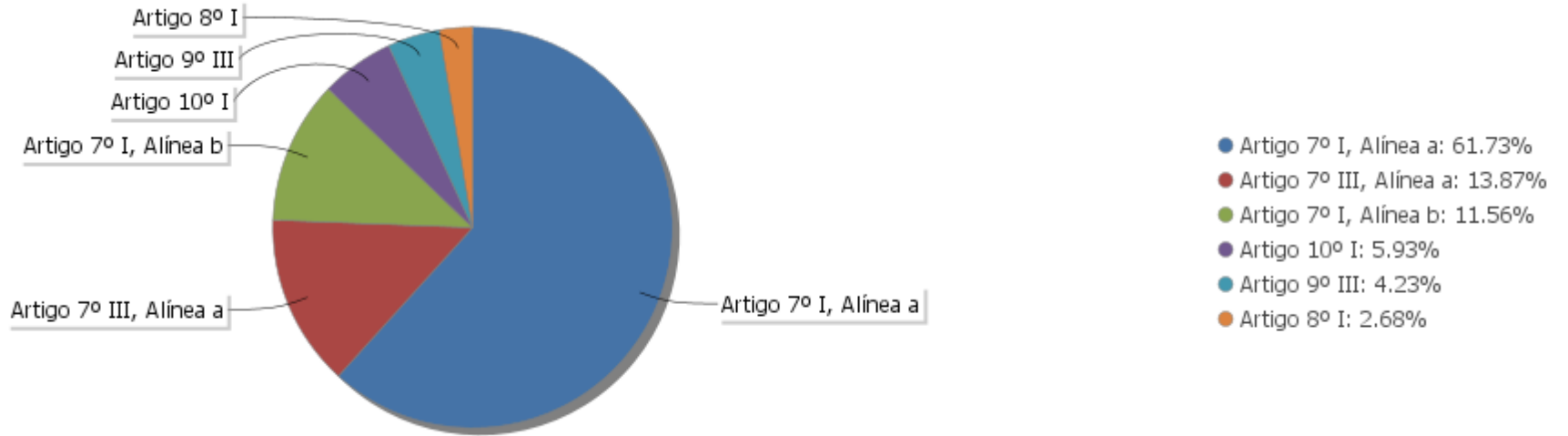
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

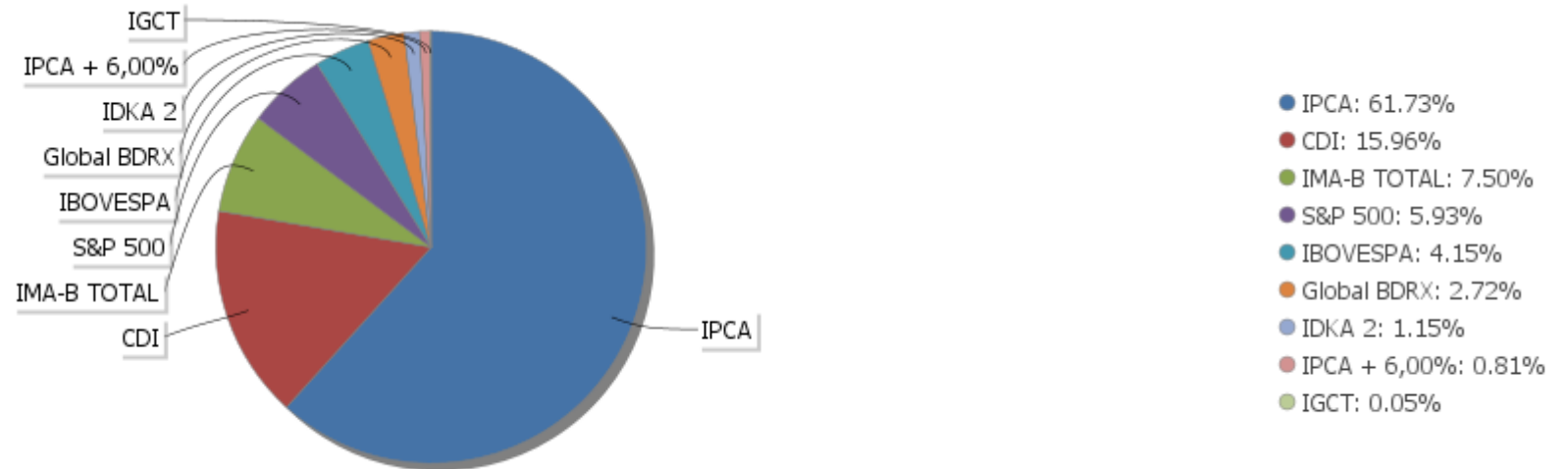
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	166.691.587,39	30,29	166.691.587,39	30,29
de 31 a 365 dias	188.086.941,18	34,17	354.778.528,57	64,46
acima de 365 dias	195.611.105,37	35,54	550.389.633,94	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

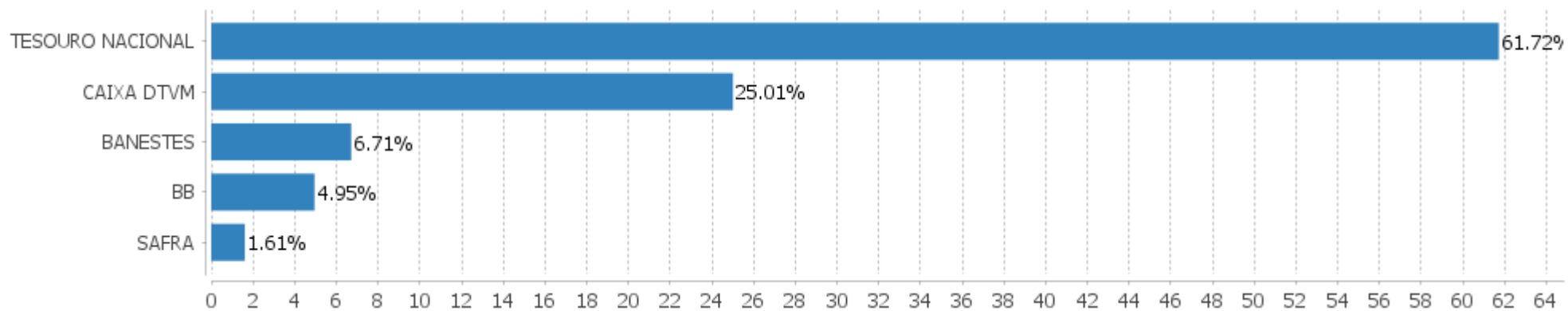


Alocação Por Estratégia



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	1,38	0,26	3,95
IPCA + 4,92%	0,94	1,38	2,05	1,43	0,89	1,07	-0,28	0,08	0,11	0,97	0,79	1,04	10,97
p.p. indexador	-2,72	-1,86	-0,16	-1,97	0,09	-1,35	1,97	-0,08	-0,69	0,43	0,59	-0,78	-7,02
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. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	24	45,28
Meses abaixo - Meta Atuarial	29	54,72

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,55	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-6,98	2020-03

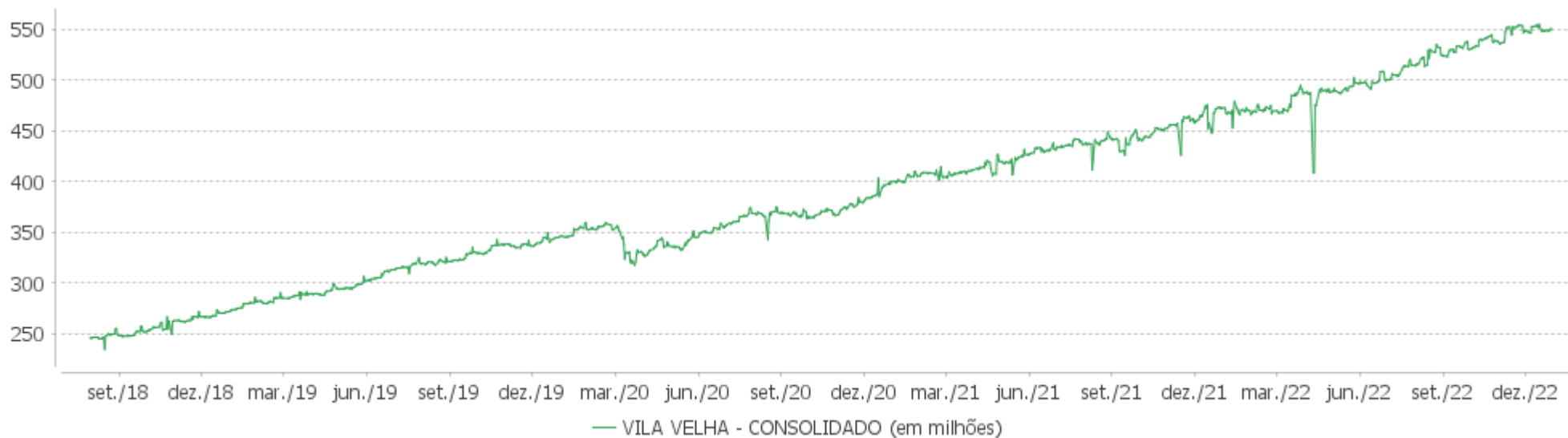
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,08	2,84	0,24	2,74
06 meses	4,21	2,74	1,47	2,66
12 meses	3,95	10,97	-7,02	4,29
24 meses	10,51	28,74	-18,23	4,50
36 meses	16,73	42,42	-25,69	6,24
48 meses	36,54	57,50	-20,96	5,62
Desde 31/07/2018	44,75	62,59	-17,84	5,42

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.	0,87 0,25	12,11 6,32	2,56 0,93	3,19 2,90	12,11 6,32	23,74 7,31	29,19 7,50
NTN-B 150545 (5,100000%) .. Var. IPCA p.p.	0,80 0,18	11,16 5,37	2,34 0,71	2,74 2,46	11,16 5,37	28,95 12,52	41,50 19,81
NTN-B 150850 (5,290000%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,20	11,36 5,57	2,39 0,76	2,84 2,55	11,36 5,57	22,76 6,34	28,02 6,33
NTN-B 150523 (5,840000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,24	11,94 6,15	2,52 0,89	3,11 2,82	11,94 6,15	23,39 6,96	28,66 6,97
NTN-B 150545 (3,680000%) .. Var. IPCA p.p.	0,68 0,06	9,66 3,88	2,00 0,37	2,04 1,76	9,66 3,88	25,50 9,08	35,86 14,17
NTN-B 150523 (7,950000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,42	10,83 5,04	3,02 1,39	4,14 3,86	10,83 5,04	24,35 7,92	31,84 10,16
NTN-B 150830 (5,250000%) Var. IPCA p.p.	0,81 0,19	11,32 5,53	2,38 0,75	2,82 2,53	11,32 5,53	22,36 5,93	27,25 5,57
NTN-B 150555 (5,260000%) Var. IPCA p.p.	0,81 0,19	11,33 5,54	2,38 0,75	2,82 2,54	11,33 5,54	26,01 9,58	31,43 9,75
NTN-B 150523 (5,661000%) Var. IPCA p.p.	0,85 0,23	11,75 5,97	2,47 0,85	3,02 2,74	11,75 5,97	22,99 6,56	28,06 6,37
NTN-B 150545 (4,290000%) .. Var. IPCA p.p.	0,73 0,11	10,31 4,52	2,15 0,52	2,34 2,06	10,31 4,52	26,98 10,55	38,26 16,57
NTN-B 150840 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	0,81 0,19	11,34 5,55	2,38 0,75	2,83 2,54	11,34 5,55	22,61 6,18	27,74 6,05
NTN-B 150545 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	0,85 0,23	11,82 6,04	2,49 0,86	3,05 2,77	11,82 6,04	23,36 6,93	28,72 7,04
NTN-B 150523 (6,760000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,32	9,65 3,86	2,74 1,11	3,56 3,28	9,65 3,86	21,80 5,38	27,94 6,25
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,31 1,51	10,50 4,13	2,69 2,46	3,43 1,49	10,50 4,13	16,40 11,38	26,24 14,49
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA % do CDI	0,86 76,22	9,18 74,18	2,44 76,16	5,02 75,88	9,18 74,18	11,72 67,71	
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,11 1,31	13,98 7,61	3,15 2,92	6,34 4,41	13,98 7,61	21,46 16,44	28,28 16,53
BB PREV RF IDKA2	1,22	9,32	2,42	2,69	9,32	14,40	23,46

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	-0,02	0,17	0,36	-0,02	-0,38	-1,22
BB PREV RF IPCA	0,95	11,41	3,98	4,00	11,41	16,36	26,43
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,18	-0,70	0,88	0,73	-0,70	-14,40	-18,41
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,32	9,05	2,71	2,71	9,05	12,28	22,12
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,51	2,68	2,47	0,77	2,68	7,25	10,36
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,23	9,04	2,36	2,47	9,04	14,12	23,29
Var. IDKA 2 p.p.	-0,01	-0,30	0,11	0,13	-0,30	-0,66	-1,38
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	1,12	12,31	3,18	6,60	12,31	17,14	20,04
% do CDI	100,02	99,47	99,37	99,81	99,47	98,99	97,49
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,32	9,03	2,70	2,69	9,03	12,25	22,08
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,51	2,66	2,47	0,75	2,66	7,23	10,33
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	1,31	10,23	2,69	3,29	10,23	15,62	24,27
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,51	3,86	2,46	1,35	3,86	10,60	12,52
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,96	10,58	2,76	5,72	10,58	14,21	16,39
% do CDI	85,76	85,49	86,23	86,52	85,49	82,10	79,70
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	1,11	12,94	3,24	6,84	12,94	19,15	19,40
% do CDI	98,67	104,56	101,39	103,48	104,56	110,64	94,36
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1,12	12,59	3,22	6,67	12,59	17,79	20,62
% do CDI	99,92	101,73	100,61	100,91	101,73	102,78	100,29
BB PREV RF FLUXO FIC	1,03	11,26	2,95	6,09	11,26	14,89	16,78
% do CDI	92,01	91,00	92,16	92,12	91,00	86,04	81,63
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	1,13	12,76	3,20	6,68	12,76	17,85	20,99
% do CDI	100,57	103,09	100,06	101,07	103,09	103,09	102,09
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	-2,28	4,93	-0,16	11,41	4,93	-7,78	-5,25
Var. IBOVESPA p.p.	0,16	0,25	0,12	0,05	0,25	0,02	-0,13
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	-4,58	-13,32	8,56	5,46	-13,32	12,94	
Var. IBOVESPA p.p.	-2,14	-18,01	8,83	-5,89	-18,01	20,74	
FIA CAIXA DIVIDENDOS	-1,57	11,43	2,90	7,09	11,43	1,01	-6,00
Var. IBOVESPA p.p.	0,87	6,74	3,17	-4,26	6,74	8,81	-0,89
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-2,62	2,43	-1,12	9,89	2,43	-9,39	-7,32
Var. IGCT p.p.	-0,06	-1,11	-0,42	-0,66	-1,11	-1,72	-2,72
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-4,79	-28,54	3,52	-0,98	-28,54	-6,74	44,34
Var. Global BDRX p.p.	-0,58	-0,49	-0,42	-0,37	-0,49	-2,90	-3,76
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	-4,87	-25,89	5,52	2,03	-25,89	-2,06	44,04
Var. IBOVESPA p.p.	-2,43	-30,58	5,80	-9,33	-30,58	5,74	49,15
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	-4,67	-30,39	3,92	-0,79	-30,39	-6,78	34,65

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.	-2,22	-35,08	4,20	-12,15	-35,08	1,02	39,77
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-4,90 2,36	-11,97 12,71	9,70 6,36	6,79 5,75	-11,97 12,71	16,92 14,29	30,01 -23,83
VILA VELHA - CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,92% p.p.	0,26 -0,78	3,95 -7,02	3,08 0,24	4,21 1,47	3,95 -7,02	10,51 -17,61	16,73 -23,74
CDI	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56
IBOVESPA	-2,45	4,69	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11
INPC + 6,00%	1,20	12,26	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46
IPCA + 6,00%	1,13	12,11	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83

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 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	1,18	12,02	3,16	6,70	12,02	15,30	19,73	27,82	36,73
IRF-M 1+	1,62	7,41	1,10	6,63	7,41	2,06	10,68	26,44	41,95
IRF-M TOTAL	1,48	8,82	1,74	6,49	8,82	6,66	13,80	27,49	41,17
IMA-B 5	0,94	9,78	2,53	2,98	9,78	14,79	24,02	40,34	54,18
IMA-B 5+	-1,19	3,30	-1,72	1,24	3,30	-3,47	1,84	32,76	53,22
IMA-B TOTAL	-0,19	6,37	0,23	1,94	6,37	5,02	11,75	37,40	55,34
IMA-GERAL TOTAL	0,77	9,66	1,73	4,95	9,66	10,71	16,62	31,57	44,78
IDKA 2	1,24	9,34	2,25	2,34	9,34	14,78	24,67	39,41	53,01
IDKA 20	-3,32	-1,92	-5,66	0,71	-1,92	-16,13	-14,29	23,65	48,88
CDI	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,96

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,45	4,69	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11	24,86	43,63
IBRX 100	-2,63	4,02	-0,39	10,33	4,02	-7,61	-4,37	27,56	47,23
IBRX 50	-2,55	5,72	0,38	12,12	5,72	-5,43	-2,00	26,57	44,96
SMALL CAP	-3,01	-15,06	-7,61	5,76	-15,06	-28,82	-29,28	11,87	20,97
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	-1,61	12,65	3,15	7,71	12,65	5,43	4,37	51,51	75,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-7,26	-24,68	3,34	1,04	-24,68	2,63	53,84	106,24	126,51

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,00	2,22	-4,14	2,56	2,22	-0,11	-10,33	21,92	28,78

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-5,43	-25,01	5,58	1,05	-25,01	-5,95	38,64	78,90	86,12

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,62	5,79	1,63	0,28	5,79	16,43	21,69	26,93	31,68
INPC	0,69	5,93	1,55	0,30	5,93	16,70	23,05	28,57	32,98
IGPM	0,45	5,45	-1,09	-2,51	5,45	24,20	52,94	64,11	76,48
SELIC	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,97

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,97	10,00	2,61	2,28	10,00	25,89	36,82	48,44	60,11
IPCA + 5,00%	1,05	11,05	2,86	2,78	11,05	28,31	40,79	54,22	67,93
IPCA + 5,50%	1,09	11,58	2,98	3,03	11,58	29,53	42,80	57,17	71,96
IPCA + 5,89%	1,12	11,99	3,07	3,22	11,99	30,49	44,38	59,51	75,15
IPCA + 6,00%	1,13	12,11	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83	60,17	76,06
INPC + 4,00%	1,04	10,15	2,53	2,31	10,15	26,18	38,35	50,36	61,69
INPC + 6,00%	1,20	12,26	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46	62,24	77,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1841	01/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.352,68	978,06247600	2,4054496090
1842	02/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	59.689,83	24.802,80567500	2,4065757230
1828	02/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	232.268,15	26.166,76448717	8,8764566300
1827	02/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	511.487,18	57.622,90029929	8,8764566300
1826	02/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	3.930,83	442,83781344	8,8764566300
1825	02/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	18.290,39	2.060,55079523	8,8764566300
1852	02/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	51.305,14	24.082,24842300	2,1304130000
1810	02/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	30.261,82	3.409,22299029	8,8764566300
1814	05/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	1.369,66	0,00	154,24216702	8,8799322900
1843	06/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	17.677,00	7.338,42750800	2,4088266840
1829	06/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	63.075,76	7.100,44109153	8,8833579800
1811	06/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	5.902,97	664,49759385	8,8833579800
1844	07/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.383,83	574,21537500	2,4099494020
1831	08/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	513.178,96	0,00	57.723,72533526	8,8902605800
1816	08/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	5.364.812,32	0,00	603.448,26458762	8,8902605800
1853	09/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	7.839,41	3.671,73612600	2,1350690000
1845	15/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	53.611,39	22.183,91475900	2,4166785070
1832	15/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	204.508,49	22.959,14434521	8,9074961600
1830	15/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	61.076,14	6.856,71284686	8,9074961600
1812	15/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	536.148,60	60.190,71946338	8,9074961600
1813	15/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	841,55	94,47651024	8,9074961600
1815	15/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	1.373,91	154,24216702	8,9074961600
1817	15/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	3.743.547,22	420.269,30513783	8,9074961600
1809	15/12/2022	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	4.250.000,00	0,00	2.078.240,92993311	2,0449987000
1834	16/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	3.374.621,26	0,00	378.707,78467707	8,9108843200
1854	16/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	204.688,09	0,00	95.660,39658100	2,1397370000
1823	16/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	16.908,24	0,00	1.897,48170827	8,9108843200
1846	19/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	247.287,18	0,00	102.230,20799000	2,4189247470

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1835	19/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	1.506.296,98	168.973,68652079	8,9143878600
1833	19/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	309.904,96	34.764,58099005	8,9143878600
1855	19/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	3.345.474,87	1.562.816,72263000	2,1406700000
1818	19/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	1.382.416,31	155.076,97572836	8,9143878600
1847	20/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	20.067,82	8.292,37606700	2,4200325500
1856	20/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	511.320,62	238.756,02881000	2,1416030000
1819	20/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	3.171,12	355,58986003	8,9179145900
1848	21/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	112.224,39	46.351,73928700	2,4211473340
1836	21/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	592.385,66	66.400,84832624	8,9213568000
1857	21/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	71.303,01	0,00	33.279,80318604	2,1425310000
1820	21/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	34.723,04	3.892,12546513	8,9213568000
1839	22/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	54.913,50	0,00	6.152,99291725	8,9246811700
1858	22/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	54.913,50	25.619,06838500	2,1434620000
1824	22/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	1.674,60	0,00	187,63695520	8,9246811700
1849	23/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.216,39	501,93345800	2,4234088830
1850	26/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.586,10	2.303,95234700	2,4245727160
1837	27/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	68.718,40	7.690,81723317	8,9351232700
1859	27/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	81.989,46	38.201,10234800	2,1462590000
1821	27/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	8.655,28	968,68053654	8,9351232700
1838	28/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	267.030,05	29.873,93837471	8,9385619900
1860	28/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	111.733,71	0,00	52.037,17882400	2,1471900000
1822	28/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	31.926,93	3.571,81949864	8,9385619900
1851	29/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	37.928,78	0,00	15.621,38952200	2,4280029600
1840	29/12/2022	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	234.671,58	0,00	26.243,78173646	8,9419879500
Total			14.485.090,89	13.944.594,17		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 6.588.664,10

Value-At-Risk: 1,20%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VILA VELHA - CONSOLIDADO		1,20	1,20			550.389.633,94	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,18%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150523 (5,661000%)		0,17	0,00	0,14			21.189.014,97	3,85
NTN-B 150523 (5,840000%)		0,17	0,00	0,14			16.060.292,57	2,92
NTN-B 150523 (6,000000%)		0,17	0,00	0,14			40.255.656,44	7,31
NTN-B 150523 (6,760000%)		0,17	0,00	0,14			22.258.454,54	4,04
NTN-B 150523 (7,950000%)		0,17	0,01	0,14			83.870.670,32	15,24
NTN-B 150545 (3,680000%) ..		0,17	0,00	0,14			7.436.381,65	1,35
NTN-B 150545 (4,290000%) ..		0,17	0,00	0,14			379.139,86	0,07
NTN-B 150545 (5,100000%) ..		0,17	0,00	0,14			14.735.483,14	2,68
NTN-B 150545 (5,730000%)		0,17	0,00	0,14			26.240.976,05	4,77
NTN-B 150555 (5,260000%)		0,17	0,00	0,14			21.296.235,84	3,87
NTN-B 150830 (5,250000%)		0,17	0,00	0,14			26.822.415,20	4,87
NTN-B 150840 (5,270000%)		0,17	0,00	0,14			32.250.921,07	5,86
NTN-B 150850 (5,290000%)		0,17	0,00	0,14			26.902.714,29	4,89
Sub-total	0,39	0,17	0,02		-0,61	0,89	339.698.355,94	61,72

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			1.427.364,07	0,26
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,31	-0,00	2,13			20.575.216,14	3,74
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,31	-0,00	2,12			15.446.985,11	2,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IDKA2		1,48	-0,00	0,39			6.287.572,37	1,14
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,52	-0,00	0,40			65.705,61	0,01
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,00	-0,00	0,00			4.880.684,65	0,89
BB PREV RF IPCA		0,89	0,00	0,86			4.452.852,34	0,81
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI		1,29	-0,00	2,15			860.153,60	0,16
BB PREV RF VII		0,00	-0,00	2,94			1.758.391,73	0,32
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI		1,29	-0,00	2,14			2.664.483,42	0,48
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI		0,01	-0,00	0,01			5.209.547,97	0,95
Sub-total	1,46	0,99	-0,01		0,09	1,26	63.628.957,01	11,56

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	-0,00	0,01			4.156.174,19	0,76
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			2.075.248,66	0,38
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI		0,06	-0,00	0,06			35.495.115,47	6,45
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,02	-0,00	0,02			34.615.435,18	6,29
Sub-total	0,03	0,03	-0,00		-0,25	1,12	76.341.973,50	13,87

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 11,49%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		11,49	0,67	7,74			32.649.671,98	5,93
Sub-total	17,61	11,49	0,67		-0,34	-4,90	32.649.671,98	5,93

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 13,00%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		13,54	0,30	1,33			14.952.934,60	2,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		12,25	0,07	18,40			3.652.009,52	0,66
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I		12,47	0,08	18,84			4.692.395,93	0,85
Sub-total	21,71	13,00	0,45		-0,27	-4,79	23.297.340,05	4,23

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,36%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA DIVIDENDOS		9,32	0,01	3,33			3.460.082,74	0,63
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		11,26	0,00	0,19			281.616,44	0,05
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA		10,78	0,06	0,16			11.009.904,56	2,00
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA		10,74	0,00	13,46			21.731,72	0,00
Sub-total	19,21	10,36	0,07		-0,17	-2,13	14.773.335,46	2,68