



LDB
EMPRESAS

VILA VELHA - CONSOLIDADO
DEZEMBRO 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 31.12.2021.

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 61,19%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,661000%)	4,13	0,48	0,48	20.095.275,74	4,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,840000%)	4,14	0,33	0,33	15.206.725,42	3,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (3,680000%) ..	0,48	1,09	14,44	7.081.225,80	1,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,290000%) ..	0,48	1,15	15,12	360.246,14	0,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,100000%) ..	0,48	1,22	16,01	13.965.101,35	2,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,260000%)	2,69	1,23	3,42	20.156.533,63	4,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,250000%)	3,96	1,23	1,89	25.471.390,14	5,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,270000%)	3,84	1,23	1,89	30.566.405,72	6,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,290000%)	3,78	1,23	1,89	25.469.364,85	5,39
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,49	1,23	15,63	158.372.268,79	33,54

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
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,79	0,42	-1,30	0,00	0,00	7.081.253.604,41	0,00
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,61	0,71	4,65	5.751.459,61	1,22	9.277.694.744,55	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,76	0,72	4,66	4.441.850,49	0,94	10.998.710.156,34	0,04
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,63	0,55	4,44	4.114.364,25	0,87	347.953.592,87	1,18
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	2,18	0,67	5,34	2.492.636,98	0,53	295.446.240,49	0,84

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,88	0,42	1,44	0,00	0,00	262.649.572,79	0,00
BB	BB	BB PREV RF VII	1,63	0,58	6,57	1.587.818,56	0,34	248.037.532,98	0,64
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,46	0,71	4,89	5.632.601,66	1,19	433.971.771,76	1,30
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	1,63	0,58	6,57	6.730.352,68	1,43	206.008.683,99	3,27
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,84	0,91	-0,40	17.190.643,15	3,64	7.701.081.218,58	0,22
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,33	0,44	-0,50	0,00	0,00	12.561.638.596,69	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,83	0,85	2,96	19.945.123,52	4,22	1.446.702.120,00	1,38
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,83	0,85	2,95	14.982.296,10	3,17	460.231.370,14	3,26
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	1,63	0,58	6,59	3.566.587,84	0,76	475.539.012,24	0,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,94	1,30	16,93	7.387.747,22	1,56	95.550.883,96	7,73
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,12	0,83	1,83	93.823.482,06	19,87		

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	0,11	0,53	2,33	592.777,25	0,13	983.826.614,17	0,06
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,13	0,67	3,27	3.714.776,55	0,79	3.073.023.342,66	0,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,12	0,63	3,29	532.943,52	0,11	877.330.736,27	0,06
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,26	0,79	2,94	14.561.483,20	3,08	2.584.228.578,26	0,56
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,48	0,70	0,89	8.611.455,32	1,82	141.132.202,49	6,10
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,44	0,73	0,70	28.013.435,84	5,93		

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	3,28	0,85	4,08	7.363.072,14	1,56	619.522.449,09	1,19
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	3,24	0,70	2,37	1.343.477,10	0,28	217.421.452,59	0,62
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			3,25	0,83	3,81	8.706.549,24	1,84		

Renda Fixa			2,71	0,99	2,91	288.915.735,93	61,19		
-------------------	--	--	-------------	-------------	-------------	-----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

29,15%

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	20,64	3,44	-11,53	274.947,15	0,06	994.621.415,62	0,03
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	20,75	2,86	-12,11	1.418.627,99	0,30	570.416.481,31	0,25
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			20,70	2,96	-11,76	1.693.575,14	0,36		

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	18,72	-0,32	-10,50	11.659.268,43	2,47	924.501.793,20	1,26
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	23,77	-0,67	-31,65	7.326.170,25	1,55	162.780.188,13	4,50
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	13,46	5,28	16,66	69.249.908,20	14,67	2.828.008.571,13	2,45
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			15,38	3,99	2,56	88.235.346,88	18,69		

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	13,38	5,56	26,59	47.690.625,53	10,10	3.768.911.648,33	1,27
Sub-total Artigo 8º III			13,38	5,56	26,59	47.690.625,53	10,10		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			15,14	4,51	7,86	137.619.547,55	29,15		
--	--	--	--------------	-------------	-------------	-----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

9,66%

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	17,57	1,70	30,51	20.924.557,43	4,43	3.890.658.229,39	0,54
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	17,53	3,45	12,16	5.246.522,44	1,11	3.983.843.860,12	0,13
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	17,27	2,90	32,16	19.421.187,54	4,11	1.468.389.548,66	1,32
Sub-total Artigo 9º A, III			17,21	2,44	31,62	45.592.267,41	9,66		
Investimentos no Exterior			17,21	2,44	31,62	45.592.267,41	9,66		
Total			4,71	2,14	6,31	472.127.550,89	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	158.372.268,79	33,54	0,00	35,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	93.823.482,06	19,87	0,00	30,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	28.013.435,84	5,93	0,00	2,50	40,00	0,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	8.706.549,24	1,84	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	288.915.735,93	61,19					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	1.693.575,14	0,36	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	88.235.346,88	18,69	0,00	15,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	47.690.625,53	10,10	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	137.619.547,55	29,15					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	45.592.267,41	9,66	0,00	8,50	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	45.592.267,41	9,66					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	1,23 160,69	15,63 355,52	4,38 237,69	8,49 275,04	15,63 355,52	1.633.197,71	5.286.364,89
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,83 109,12	1,83 41,57	1,64 89,14	1,77 57,41	1,83 41,57	855.294,65	1.803.971,66
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,73 95,92	0,70 16,00	1,84 99,91	2,41 78,21	0,70 16,00	224.404,92	266.262,28
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,83 108,61	3,81 86,64	2,18 118,40	3,02 97,68	3,81 86,64	71.610,40	319.382,04
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	2,96 0,10	-11,76 0,16	-5,72 -0,17	-17,53 -0,20	-11,76 0,16	48.639,82	-91.817,51
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	3,99 1,13	2,56 14,48	6,30 11,85	-0,93 16,40	2,56 14,48	3.382.709,71	1.972.185,49
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	5,56 2,71	26,59 38,08	13,07 18,62	14,36 31,69		2.512.581,89	7.228.677,65
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,00 -2,85	32,63 44,56	0,00 5,55	26,71 44,04	32,63 44,56	0,00	318.040,04
Artigo 9º A, III % do CDI	2,44 320,11	31,62 719,41	12,15 659,94	21,47 695,50	31,62 719,41	1.068.682,58	10.042.258,65
VILA VELHA - CONSOLIDADO (Total)						9.797.121,68	27.145.325,19

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 150523 (5,661000%)	0,00	19.998.813,94	0,00	0,00	20.095.275,74	96.461,80	96.461,80
NTN-B 150523 (5,840000%)	0,00	15.156.521,18	0,00	0,00	15.206.725,42	50.204,23	50.204,23
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	7.004.714,93	0,00	0,00	0,00	7.081.225,80	76.510,87	916.685,90
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	356.162,84	0,00	0,00	0,00	360.246,14	4.083,30	48.623,78
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	13.797.062,45	0,00	0,00	0,00	13.965.101,35	168.038,90	1.986.801,68
NTN-B 150555 (5,260000%)	19.911.239,62	0,00	0,00	0,00	20.156.533,63	245.294,01	674.900,15
NTN-B 150830 (5,250000%)	25.161.622,75	0,00	0,00	0,00	25.471.390,14	309.767,39	472.115,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150840 (5,270000%)	30.194.186,49	0,00	0,00	0,00	30.566.405,72	372.219,23	567.272,60
NTN-B 150850 (5,290000%)	25.158.746,88	0,00	0,00	0,00	25.469.364,85	310.617,97	473.299,48
					158.372.268,79	0,00	0,00

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	8.020.974,66	0,00	-8.055.017,27	0,00	0,00	34.042,61	85.737,14
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	3.545.879,98	0,00	0,00	0,00	3.566.587,84	20.707,86	223.853,67
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	17.034.926,82	0,00	0,00	0,00	17.190.643,15	155.716,33	-68.768,05
BB PREV RF IDKA2	5.711.127,51	0,00	0,00	0,00	5.751.459,61	40.332,10	1.338.179,69
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	6.280.914,05	0,00	-6.307.149,06	0,00	0,00	26.235,01	-660.018,81
BB PREV RF IPCA	4.091.697,97	0,00	0,00	0,00	4.114.364,25	22.666,28	179.653,94
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	2.476.012,50	0,00	0,00	0,00	2.492.636,98	16.624,48	127.741,72
BB PREV RF VII	1.578.620,24	0,00	0,00	0,00	1.587.818,56	9.198,32	99.428,04
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	5.593.163,81	0,00	0,00	0,00	5.632.601,66	39.437,85	265.027,84
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	6.691.470,63	0,00	0,00	0,00	6.730.352,68	38.882,05	420.972,91
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.292.931,89	0,00	0,00	0,00	7.387.747,22	94.815,33	1.094.493,84
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.855.980,80	0,00	0,00	0,00	14.982.296,10	126.315,30	427.401,83
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.776.897,87	0,00	0,00	0,00	19.945.123,52	168.225,65	570.087,99
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.546.799,18	0,00	-5.137.290,88	0,00	4.441.850,49	32.342,19	814.171,53
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	6.832.955,83	0,00	-6.862.709,12	0,00	0,00	29.753,29	-248.937,79
					93.823.482,06	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	8.551.177,84	0,00	0,00	0,00	8.611.455,32	60.277,48	75.989,09
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	3.970.892,14	28.126.477,46	-31.526.085,56	0,00	592.777,25	21.493,21	75.910,22
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	13.686.441,45	10.760.017,27	-10.000.000,00	0,00	14.561.483,20	115.024,48	456.465,93
BB PREV RF FLUXO FIC	3.529.255,23	422.489,69	-260.432,56	0,00	3.714.776,55	23.464,19	101.745,27

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	521.078,88	676.586,58	-668.867,50	0,00	532.943,52	4.145,56	15.030,49
					28.013.435,84	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	7.300.774,54	0,00	0,00	0,00	7.363.072,14	62.297,60	288.322,34
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	1.334.164,30	0,00	0,00	0,00	1.343.477,10	9.312,80	31.059,70
					8.706.549,24	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	265.806,42	0,00	0,00	0,00	274.947,15	9.140,73	209.571,21
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	1.379.128,90	0,00	0,00	0,00	1.418.627,99	39.499,09	-301.388,72
					1.693.575,14	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	7.375.850,18	0,00	0,00	0,00	7.326.170,25	-49.679,93	-4.300.613,41
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	65.779.605,08	0,00	0,00	0,00	69.249.908,20	3.470.303,12	7.858.390,23
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	11.697.181,91	0,00	0,00	0,00	11.659.268,43	-37.913,48	-1.367.801,30
					88.235.346,88	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	45.178.043,64	0,00	0,00	0,00	47.690.625,53	2.512.581,89	7.228.677,65
					47.690.625,53	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	21.798.380,21	0,00	-3.000.000,00	0,00	19.421.187,54	622.807,33	4.332.278,52
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	23.553.459,66	0,00	-3.000.000,00	0,00	20.924.557,43	371.097,77	5.466.762,91
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	2.168.439,74	3.003.305,22	0,00	0,00	5.246.522,44	74.777,48	243.217,22
					45.592.267,41	0,00	0,00

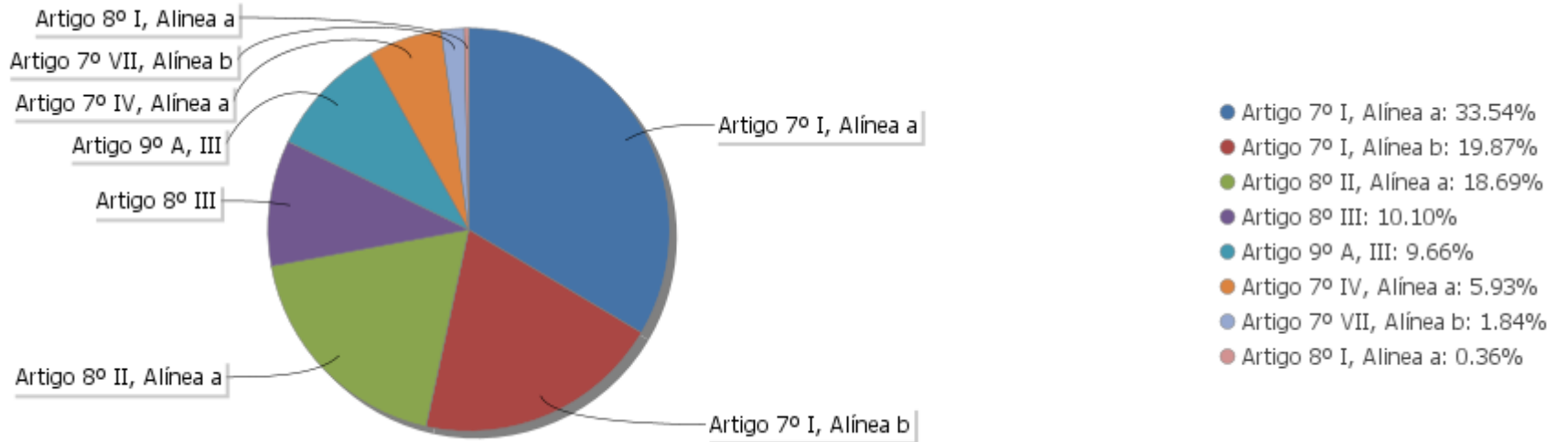
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

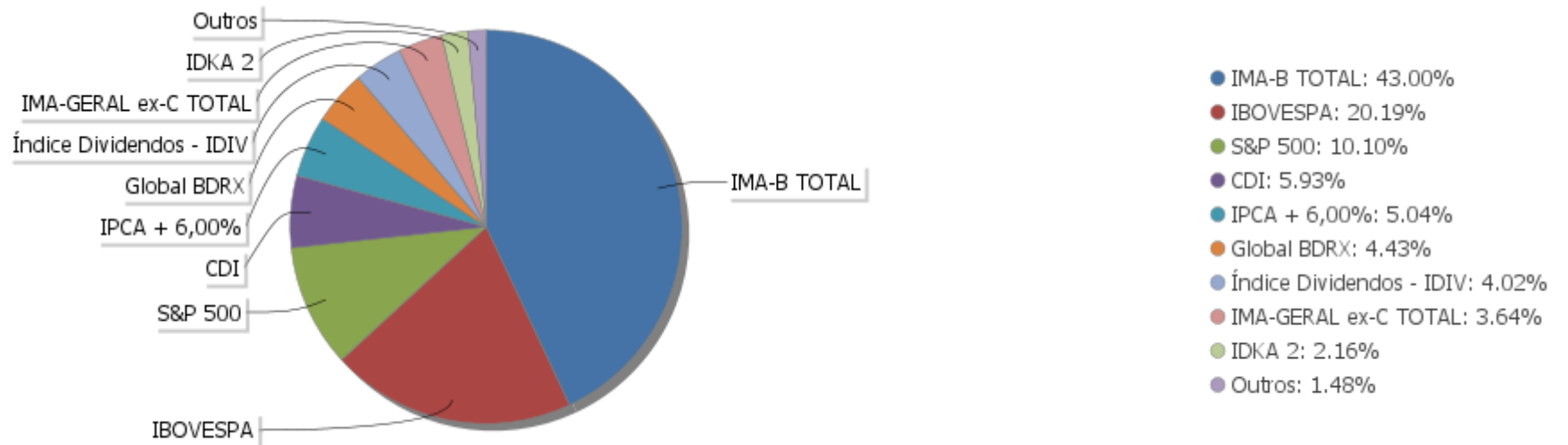
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	220.967.242,47	46,80	220.967.242,47	46,80
de 31 a 365 dias	38.257.944,98	8,10	259.225.187,45	54,91
acima de 365 dias	212.902.363,44	45,09	472.127.550,89	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

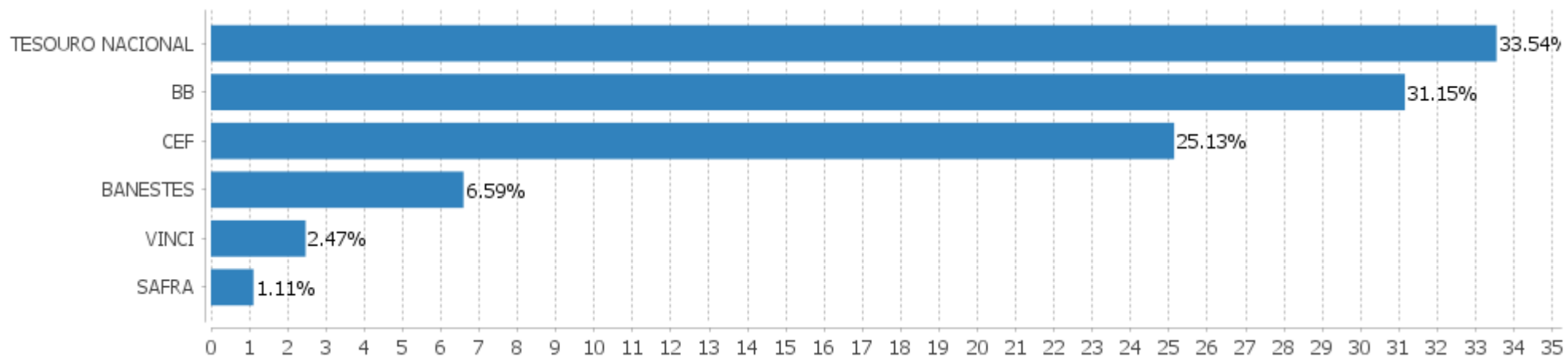


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

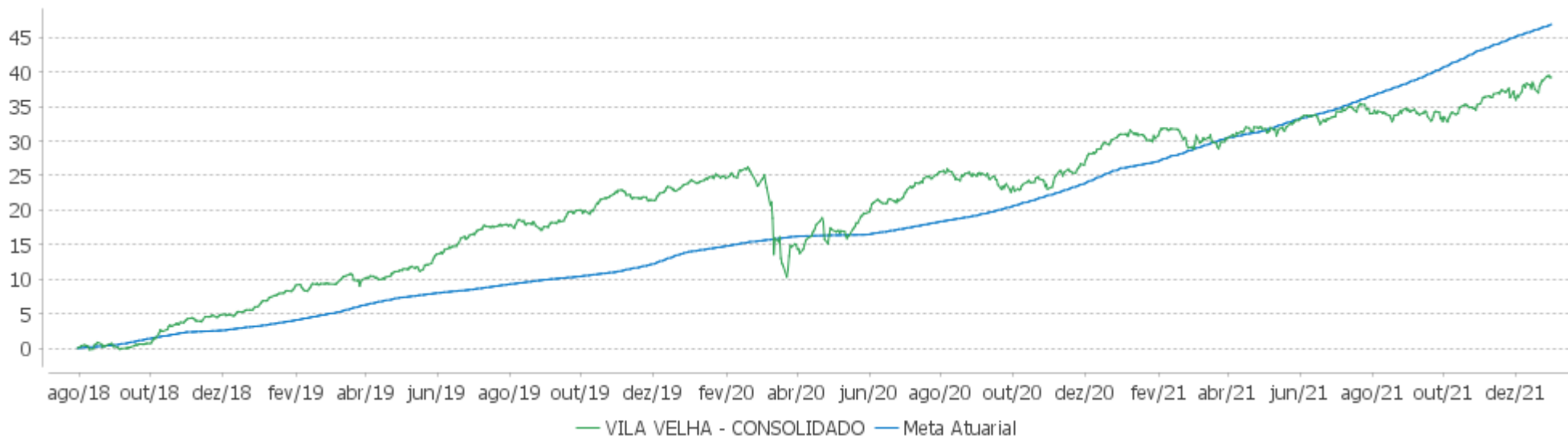
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,48	-1,03	1,05	1,06	0,94	0,42	0,32	0,32	-1,16	1,81	0,80	2,14	6,31
IPCA + 5,87%	0,70	1,27	1,46	0,77	1,31	1,01	1,46	1,37	1,64	1,71	1,41	1,28	16,53
p.p. indexador	-1,19	-2,30	-0,41	0,30	-0,37	-0,59	-1,14	-1,06	-2,80	0,10	-0,60	0,86	-10,22
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

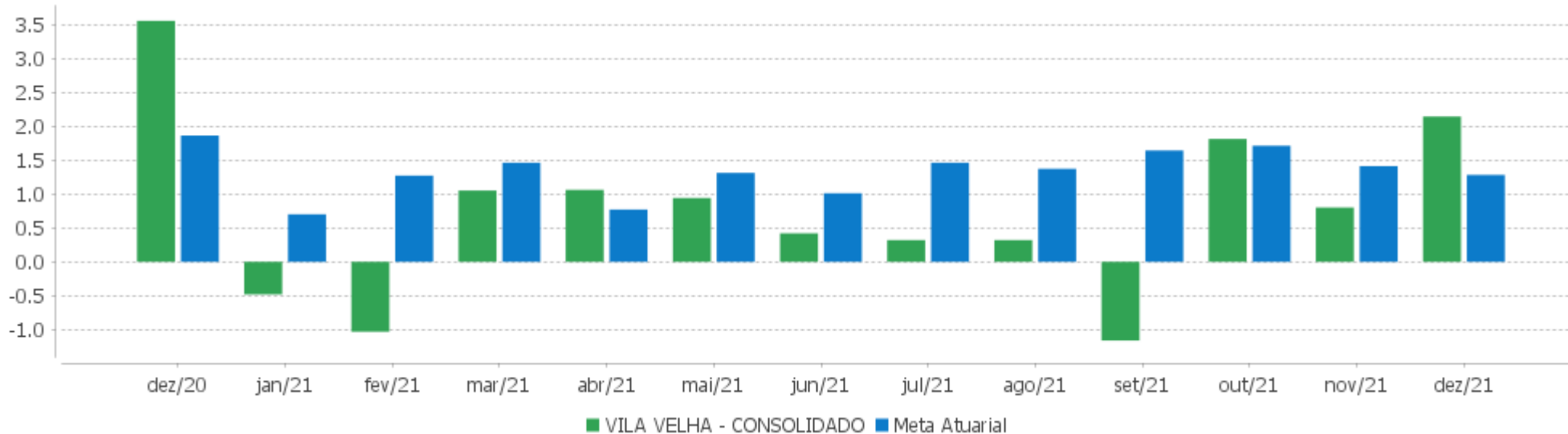
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	20	48,78	03 meses	4,82	4,46	0,36	5,35
Meses abaixo - Meta Atuarial	21	51,22	06 meses	4,27	9,21	-4,94	4,89
			12 meses	6,31	16,53	-10,22	4,71
			24 meses	12,29	28,91	-16,62	7,02
Maior rentabilidade da Carteira	3,55	2020-12	36 meses	31,35	42,56	-11,21	6,00
Menor rentabilidade da Carteira	-6,98	2020-03	Desde 31/07/2018	39,25	47,17	-7,92	5,71

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
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,79 103,64	5,50 125,23	1,99 108,10	3,57 115,67	5,50 125,23	5,72 78,55	12,15 88,79
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	0,70 92,32	0,89 20,26	1,73 94,08	1,62 52,34	0,89 20,26	2,61 35,77	21,13 154,36
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,67 87,65	3,27 74,33	1,58 85,85	2,49 80,68	3,27 74,33	4,96 68,13	10,02 73,22
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO % do CDI	0,53 68,95	2,33 52,94	1,22 66,32	1,88 61,02	2,33 52,94	2,83 38,79	5,77 42,14
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,63 82,41	3,29 74,83	1,49 80,81	2,41 78,18	3,29 74,83	5,25 72,11	10,59 77,39
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,67 0,45	5,34 6,60	1,89 0,83	3,79 4,34	5,34 6,60	14,24 9,18	31,62 2,45
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	0,58 -0,21	6,57 2,00	1,82 -0,21	4,29 1,05	6,57 2,00	15,40 2,43	31,64 3,81
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,58 -0,71	6,59 -10,08	1,82 -2,67	4,30 -4,98	6,59 -10,08	14,86 -14,37	30,17 -12,74
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,85 0,63	2,95 4,22	2,03 0,97	2,81 3,35	2,95 4,22	11,97 6,91	31,57 2,40
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,71 0,48	4,89 6,16	1,92 0,86	3,61 4,15	4,89 6,16	12,74 7,68	28,36 -0,81
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,30 0,01	16,93 0,26	4,59 0,09	9,08 -0,20	16,93 0,26	29,43 0,21	38,66 -4,25
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,79 -0,08	1,81 -1,11	1,53 0,40	2,22 0,12	1,81 -1,11	8,19 1,31	19,26 5,15
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,58 0,36	6,57 7,83	1,82 0,76	4,29 4,83	6,57 7,83	12,55 7,49	24,32 -4,85
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,71 -0,12	4,65 -0,33	1,86 0,02	3,18 0,13	4,65 -0,33	12,93 -1,09	25,58 -1,92
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,91	-0,40	0,99	0,28	-0,40	4,67	18,35
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,55 -0,74	4,44 -12,23	1,53 -2,97	2,97 -6,31	4,44 -12,23	13,48 -15,74	31,32 -11,59
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,85	2,96	2,04	2,81	2,96	11,98	31,57

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.	0,63	4,22	0,98	3,35	4,22	6,92	2,40
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,83 0,07	-0,11 -10,20	1,07 -1,92	-0,82 -6,92	-0,11 -10,20	6,55 -8,51	24,06 4,04
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,72 -0,11	4,66 -0,31	1,82 -0,02	3,05 0,00	4,66 -0,31	13,07 -0,95	25,72 -1,78
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,20 -0,02	-1,51 -0,25	0,97 -0,09	-0,70 -0,16	-1,51 -0,25	4,53 -0,53	28,20 -0,97
NTN-B 150545 (5,100000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,22 0,99	16,01 17,27	4,36 3,30	8,60 9,15	16,01 17,27	27,29 22,23	38,85 9,68
NTN-B 150523 (5,661000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,27 1,04	10,06 11,32	1,51 0,45	5,78 6,33	10,06 11,32	14,60 9,53	18,64 -10,53
NTN-B 150850 (5,290000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,23 1,01	10,24 11,50	4,41 3,35	5,87 6,42	10,24 11,50	14,96 9,90	19,19 -9,98
NTN-B 150545 (4,290000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,15 0,92	15,12 16,38	4,16 3,10	8,18 8,72	15,12 16,38	25,34 20,28	35,67 6,50
NTN-B 150523 (5,840000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,28 1,06	10,23 11,49	1,55 0,49	5,87 6,41	10,23 11,49	14,94 9,87	19,15 -10,02
NTN-B 150545 (3,680000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,09 0,87	14,44 15,71	4,00 2,94	7,85 8,40	14,44 15,71	23,89 18,83	33,30 4,13
NTN-B 150840 (5,270000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,23 1,01	10,13 11,39	4,40 3,34	5,81 6,36	10,13 11,39	14,73 9,67	18,83 -10,34
NTN-B 150830 (5,250000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,23 1,01	9,92 11,19	4,40 3,34	5,71 6,26	9,92 11,19	14,32 9,26	18,21 -10,96
NTN-B 150555 (5,260000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,23 1,01	13,19 14,45	4,40 3,34	8,69 9,23	13,19 14,45	18,06 13,00	22,43 -6,75
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,85 -0,44	4,08 -12,59	2,32 -2,18	3,40 -5,88	4,08 -12,59	12,36 -16,87	26,07 -16,84
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,70 -0,60	2,37 -14,30	1,42 -3,08	0,97 -8,31	2,37 -14,30	10,13 -19,09	28,29 -14,62
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	2,86 0,01	-12,11 -0,19	-5,59 -0,04	-17,34 -0,00	-12,11 -0,19	-9,70 -0,34	18,30 -0,97
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	3,44 -0,04	-11,53 -0,72	-6,39 -0,19	-19,00 -0,31	-11,53 -0,72	-9,52 -1,66	21,15 -3,27
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,67 -2,28	-31,65 -25,24	-19,34 -17,51	-34,56 -26,26	-31,65 -25,24	-26,35 -19,00	2,48 -32,01
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	5,28	30,30	12,24	12,99	30,30		

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.	2,42	42,22	17,78	30,32	42,22		
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,32 -1,93	-10,50 -4,09	-3,49 -1,66	-13,76 -5,46	-10,50 -4,09	-7,77 -0,42	31,03 -3,46
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	5,56 1,93	32,83 -3,44	13,07 -0,45	14,36 -9,37	32,83 -3,44	47,69 -56,56	94,62 -79,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	1,70 -0,01	30,51 -3,14	11,81 -0,48	20,44 -0,99	30,51 -3,14	101,98 -3,86	171,58 -7,67
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	2,90 0,05	32,16 44,09	12,22 17,76	22,40 39,73	32,16 44,09	94,37 103,73	153,08 133,81
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	3,45 0,60	33,92 45,85	12,50 18,05	21,19 38,52	33,92 45,85	93,45 102,81	165,70 146,43
VILA VELHA - CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,87% p.p.	2,14 0,86	6,31 -10,22	4,82 0,36	4,27 -4,94	6,31 -10,22	12,29 -16,62	31,35 -11,04
CDI	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69
IBOVESPA	2,85	-11,93	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27
INPC + 6,00%							
IPCA + 6,00%	1,29	16,67	4,50	9,28	16,67	29,23	42,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du	0,00	0,50
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	D+1 du	D+0	D+30	D+34	0,00	0,00
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	1,70
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,15
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	0,00	1,60
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	1,00
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du	0,00	0,30
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	D+0	D+0	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)	0,00	0,20
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	1,00
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IPCA	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,15
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BB PREV RF VII	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	1,20
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,80
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	0,50
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	0,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,40
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du	0,00	1,72
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	0,00	1,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,88	2,93	1,13	2,10	2,93	6,88	14,10	22,06	35,63
IRF-M 1+	2,29	-4,99	0,93	-1,74	-4,99	3,04	17,72	32,16	54,19
IRF-M TOTAL	1,89	-1,99	0,98	-0,42	-1,99	4,57	17,15	29,72	49,44
IMA-B 5	0,79	4,57	2,03	3,24	4,57	12,97	27,83	40,44	58,11
IMA-B 5+	-0,34	-6,55	0,09	-4,11	-6,55	-1,41	28,53	48,33	67,24
IMA-B TOTAL	0,22	-1,26	1,06	-0,55	-1,26	5,06	29,17	46,04	64,72
IMA-GERAL TOTAL	0,87	0,96	1,34	0,82	0,96	6,35	19,98	32,02	48,95
IDKA 2	0,83	4,97	1,84	3,05	4,97	14,02	27,50	39,94	58,99
IDKA 20	-2,28	-14,50	-2,87	-11,27	-14,50	-12,61	26,07	51,79	70,27
CDI	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	20,99	33,03

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	2,85	-11,93	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27	37,20	74,05
IBRX 100	3,14	-11,17	-5,51	-18,37	-11,17	-8,07	22,63	41,54	80,53
IBRX 50	3,76	-10,54	-4,49	-18,01	-10,54	-7,30	19,73	37,12	73,89
SMALL CAP	3,80	-16,20	-11,28	-24,79	-16,20	-16,75	31,71	42,41	112,70
IFIX	8,78	-2,28	3,28	1,81	-2,28	-12,28	19,27	25,98	50,42
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	1,60	-6,41	-1,83	-8,30	-6,41	-7,35	34,49	55,95	95,40

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	0,76	10,09	2,99	6,09	10,09	15,06	20,02	24,51	28,18
INPC									
IGPM	0,87	17,78	1,54	2,35	17,78	45,04	55,63	67,36	66,49
SELIC	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	21,00	33,06

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	3,63	36,26	13,52	23,73	36,26	104,25	173,82	200,73	264,52
MSCI ACWI	3,17	25,42	9,15	16,96	25,42	84,89	138,58	148,21	206,39
MSCI World									

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,12	14,48	4,00	8,23	14,48	24,41	34,98	45,59	55,81
IPCA + 5,00%	1,21	15,57	4,25	8,76	15,57	26,81	38,91	51,26	63,41
IPCA + 5,50%	1,25	16,12	4,37	9,02	16,12	28,01	40,90	54,15	67,32
IPCA + 5,89%	1,28	16,55	4,47	9,22	16,55	28,96	42,47	56,44	70,42
IPCA + 6,00%	1,29	16,67	4,50	9,28	16,67	29,23	42,91	57,09	71,30
INPC + 4,00%									
INPC + 6,00%									

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1192	02/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.705.000,00	327.077,50650499	8,2702110200
1193	02/12/2021	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	2.705.000,00	0,00	1.496.496,97771755	1,8075546000
1194	03/12/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	86.720,84	44.870,09582400	1,9327090000
1195	03/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.960,00	6.892,55176000	2,1704588550
1196	08/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.004,51	0,00	121,36748116	8,2765992200
1197	09/12/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	256.393,96	0,00	132.534,22890800	1,9345490000
1199	10/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	35.785,24	16.465,88587200	2,1732957630
1198	10/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.691,54	0,00	325,05409071	8,2802834300
1201	13/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	8.397.547,79	0,00	1.013.908,93499320	8,2823491300
1202	13/12/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	388.823,69	0,00	200.873,54520200	1,9356640000
1203	13/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	99,00	45,53873100	2,1739735990
1200	13/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	493.834,29	0,00	59.624,90617002	8,2823491300
1205	14/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	215.941,33	26.066,13714294	8,2843625400
1206	14/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.462,31	0,00	672,43858100	2,1746372670
1204	14/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	21.811,94	2.632,90505525	8,2843625400
1208	15/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	27.787,00	3.353,39387474	8,2862321100
1209	15/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	119.426,15	54.901,07651300	2,1752970540
1207	15/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.650,00	199,12548650	8,2862321100
1210	16/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	6.856.748,74	827.283,59764152	8,2882686900
1211	16/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	81.192,13	9.796,03007616	8,2882686900
1212	16/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	19.180.381,85	0,00	2.314.160,23872067	8,2882686900
1213	16/12/2021	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	1.529.253,27	843.199,52629581	1,8136315600
1214	16/12/2021	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	1.829.721,60	1.008.871,72413908	1,8136315600
1215	16/12/2021	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	6.641.025,13	3.661.727,81159089	1,8136315600
1216	16/12/2021	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,00	1.876.457,24	991.239,46330160	1,8930413000
1217	16/12/2021	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,00	6.178.560,03	3.263.827,38164257	1,8930413000
1218	16/12/2021	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	0,00	3.000.000,00	1.075.978,90080300	2,7881587620
1219	16/12/2021	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	6.307.149,06	976.929,76285900	6,4560926500

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1220	16/12/2021	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	6.862.709,12	4.554.304,98315200	1,5068620000
1221	17/12/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	497.858,19	256.906,29508100	1,9378980000
1222	17/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.006,18	121,36748116	8,2903570000
1223	17/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	262,31	31,63990800	8,2903570000
1224	17/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	10.528.785,05	1.270.003,81924699	8,2903570000
1225	17/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.694,81	325,05409071	8,2903570000
1226	17/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	921.715,18	111.179,19065265	8,2903570000
1227	17/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	494.311,76	59.624,90617002	8,2903570000
1228	17/12/2021	NTN-B 150523 (5,661000%)	19.998.813,94	0,00	5.257,00000000	3.804,2255930000
1229	20/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	79.899,47	36.696,68590300	2,1772938900
1230	20/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	8.055.017,27	971.382,86656811	8,2923196900
1231	20/12/2021	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	8.055.017,27	0,00	4.438.431,58638341	1,8148341623
1232	20/12/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.137.290,88	2.062.099,88184300	2,4912910000
1233	20/12/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,00	3.000.000,00	442.306,82470584	6,7826220000
1234	21/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.951,07	895,82205300	2,1779660290
1235	21/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	737,99	0,00	88,97430689	8,2944169600
1236	22/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	48.270,47	0,00	5.818,10411336	8,2965978400
1237	22/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.311,63	3.815,07057400	2,1786307330
1238	22/12/2021	NTN-B 150523 (5,840000%)	15.156.521,18	0,00	3.987,00000000	3.801,4851240000
1239	23/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	756.875,90	91.205,60163282	8,2985681400
1240	23/12/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	31.368,93	0,00	16.168,42642300	1,9401350000
1241	23/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	421.027,38	0,00	193.194,04445000	2,1792979240
1242	23/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	326.566,28	39.352,12369742	8,2985681400
1243	24/12/2021	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	3.003.305,22	0,00	3.842,57322700	781,5869840000
1244	27/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	272.605,12	32.834,13223367	8,3024919900
1245	27/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	16.763,53	2.019,09619571	8,3024919900
1246	28/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.009,02	0,00	241,91819833	8,3045426700
1247	30/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	215.972,63	25.993,84866352	8,3086053500
1248	30/12/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	84.288,47	43.382,12133000	1,9429310000
1249	30/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	23.378,40	2.813,75742656	8,3086053500

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 10.675.998,60

Value-At-Risk: 2,26%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VILA VELHA - CONSOLIDADO		2,26	2,26			472.127.550,89	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,46%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150523 (5,661000%)		0,23	-0,00	2,95			20.095.275,74	4,26
NTN-B 150523 (5,840000%)		0,23	-0,00	2,95			15.206.725,42	3,22
NTN-B 150545 (3,680000%) ..		0,10	-0,00	2,95			7.081.225,80	1,50
NTN-B 150545 (4,290000%) ..		0,10	-0,00	2,95			360.246,14	0,08
NTN-B 150545 (5,100000%) ..		0,10	-0,00	2,95			13.965.101,35	2,96
NTN-B 150555 (5,260000%)		0,10	-0,00	2,95			20.156.533,63	4,27
NTN-B 150830 (5,250000%)		0,29	0,00	2,95			25.471.390,14	5,40
NTN-B 150840 (5,270000%)		0,28	0,00	2,95			30.566.405,72	6,47
NTN-B 150850 (5,290000%)		0,28	0,00	2,95			25.469.364,85	5,39
Sub-total	0,37	0,16	-0,00		1,25	1,23	158.372.268,79	33,54

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BB PREV RF IDKA2		1,37	0,00	0,38			5.751.459,61	1,22
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,62	0,00	0,26			4.441.850,49	0,94
BB PREV RF IPCA		1,34	0,00	1,35			4.114.364,25	0,87
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI		0,92	0,00	2,41			2.492.636,98	0,53
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BB PREV RF VII		0,73	0,00	2,84			1.587.818,56	0,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI		0,98	0,00	2,29			5.632.601,66	1,19
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP		0,73	0,00	0,98			6.730.352,68	1,43
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,19	0,01	1,85			17.190.643,15	3,64
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,72	0,01	1,65			19.945.123,52	4,22
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,72	0,01	1,65			14.982.296,10	3,17
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI		0,73	0,00	0,74			3.566.587,84	0,76
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF			0,10	-0,00	0,11		7.387.747,22	1,56
Sub-total	1,72	1,18	0,04		0,04	0,83	93.823.482,06	19,87

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO		0,04	0,00	0,01			592.777,25	0,13
BB PREV RF FLUXO FIC		0,04	0,00	0,01			3.714.776,55	0,79
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,04	0,00	0,00			532.943,52	0,11
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI		0,08	-0,00	0,08			14.561.483,20	3,08
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF			0,80	0,80			8.611.455,32	1,82
Sub-total	0,19	0,25	0,00		-0,16	0,73	28.013.435,84	5,93

Artigo 7º VII, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI		1,22	0,00	1,23			7.363.072,14	1,56
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO			1,60	0,00	1,61		1.343.477,10	0,28
Sub-total	2,34	1,27	0,00		0,03	0,83	8.706.549,24	1,84

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 6,20%

Artigo 8º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		10,65	0,00	0,08			274.947,15	0,06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA		10,09	0,02	0,15			1.418.627,99	0,30
Sub-total	18,83	10,17	0,02		0,12	2,96	1.693.575,14	0,36

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS		9,84	0,11	2,29			11.659.268,43	2,47
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL		15,80	0,10	9,03			7.326.170,25	1,55
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA		6,15	0,87	9,40			69.249.908,20	14,67
Sub-total	15,33	6,22	1,08		0,21	3,99	88.235.346,88	18,69

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,48	0,63	5,81			47.690.625,53	10,10
Sub-total	16,74	6,48	0,63		0,29	5,56	47.690.625,53	10,10

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,07%

Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		8,18	0,22	0,67			20.924.557,43	4,43
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		8,41	0,06	13,95			5.246.522,44	1,11
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I		8,39	0,20	14,02			19.421.187,54	4,11
Sub-total	17,23	8,07	0,49		0,10	2,44	45.592.267,41	9,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de dezembro de 2021, vale observar que:

- O Instituto está com 10,10% dos recursos garantidores alocados no Artigo 8º III "Fundos Multimercados", limite este superior ao permitido pela Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010.
- O Instituto está com 10,10% dos recursos garantidores alocados no Artigo 9º III "Fundos Multimercados", limite este, superior ao limite estipulado em política de investimentos.