



LDB
EMPRESAS

VILA VELHA - CONSOLIDADO
ABRIL 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 29.04.2022.

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 83,40%

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%)	4,14	1,77	5,89	21.278.104,01	4,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,840000%)	4,15	1,78	5,94	16.110.564,33	3,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (6,000000%)	4,16	0,86	0,86	40.343.105,27	8,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (3,680000%) ..	0,52	1,62	5,24	7.452.561,56	1,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,290000%) ..	0,52	1,67	5,44	379.852,59	0,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,100000%) ..	0,52	1,73	5,71	14.761.818,27	3,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	5,37	4,11	5,34	26.292.008,30	5,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,260000%)	2,70	1,74	5,76	21.316.907,63	4,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,250000%)	2,82	1,74	5,75	26.200.137,81	5,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,270000%)	2,74	1,74	5,76	31.470.322,06	6,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,290000%)	2,70	1,74	5,77	26.235.951,02	5,38
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,71	2,06	5,79	231.841.332,85	47,54

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 IDKA2	2,56	1,48	5,36	6.059.604,28	1,24	9.105.588.612,67	0,07
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,68	1,40	5,28	42.588.411,48	8,73	11.053.598.876,15	0,39

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,15	0,71	2,77	653.237,52	0,13	956.356.979,66	0,07
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,31	2,23	6,24	4.370.925,63	0,90	2.006.763.440,73	0,22
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	1,85	1,78	5,77	2.563.964,04	0,53	303.900.464,82	0,84
BB	BB	BB PREV RF VII	1,55	2,05	6,16	1.637.741,61	0,34	255.836.372,37	0,64
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,07	1,68	5,63	5.786.253,32	1,19	445.810.081,65	1,30
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	1,55	2,05	6,15	6.947.478,82	1,42	212.654.676,06	3,27
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,27	1,25	5,00	20.419.092,73	4,19	1.805.286.612,95	1,13
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,27	1,25	5,01	15.302.369,10	3,14	470.063.460,73	3,26
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	1,55	2,05	6,16	3.681.653,35	0,75	490.881.908,79	0,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,51	1,79	6,01	7.616.400,47	1,56	98.508.203,69	7,73
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,69	1,53	5,36	117.627.132,35	24,12		

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	0,62	2,38	1.317.412,69	0,27	963.617.236,90	0,14
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	0,78	2,45	3.815.891,51	0,78	9.511.719.590,81	0,04
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,17	0,73	2,92	913.409,75	0,19	3.457.499.653,78	0,03
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,22	0,83	3,46	46.247.074,89	9,48	3.121.239.880,63	1,48
CAIXA DTVM	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,23	0,79	1,55	4.965.814,84	1,02	2.009.410.878,01	0,25
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,14	0,81	3,25	57.259.603,68	11,74		
Renda Fixa			2,06	1,73	5,23	406.728.068,88	83,40		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL

2,97%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	17,94	-3,63	-3,63	3.387.323,03	0,69	239.530.517,47	1,41
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	19,46	-10,04	2,65	282.239,90	0,06	952.137.332,23	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	19,26	-9,99	2,88	10.794.579,43	2,21	527.430.882,47	2,05
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	16,46	-8,65	-11,82	22.108,16	0,00	1.891.730.410,66	0,00
Sub-total Artigo 8º I			18,88	-9,71	-11,04	14.486.250,52	2,97		
Renda Variável			15,03	-9,71	-11,04	14.486.250,52	2,97		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,97%

Artigo 9º III (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	19,09	-6,82	-25,10	15.672.890,83	3,21	2.463.741.029,36	0,64
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	19,60	-7,50	-27,71	3.792.522,43	0,78	1.950.047.603,96	0,19
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	18,49	-6,31	-24,55	4.777.716,08	0,98	874.364.073,51	0,55
Sub-total Artigo 9º III			18,54	-6,91	-25,35	24.243.129,34	4,97		
Investimentos no Exterior			18,54	-6,91	-25,35	24.243.129,34	4,97		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

8,66%

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	16,64	-8,69	-11,48	42.216.194,47	8,66	2.579.874.392,90	1,64
Sub-total Artigo 10º I			16,64	-8,69	-11,48	42.216.194,47	8,66		
Investimentos Estruturados			22,31	-8,69	-11,48	42.216.194,47	8,66		
Total			5,19	-0,54	-0,95	487.673.643,21	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	231.841.332,85	47,54	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	117.627.132,35	24,12	0,00	14,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	57.259.603,68	11,74	0,00	14,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	406.728.068,88	83,40					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	14.486.250,52	2,97	0,00	16,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	14.486.250,52	2,97					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	24.243.129,34	4,97	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	24.243.129,34	4,97					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	42.216.194,47	8,66	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	42.216.194,47	8,66					15,00

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	2,06 247,43	5,79 176,48	4,68 185,03	8,89 190,10	17,13 242,08	4.209.082,23	10.716.201,87
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,53 183,48	5,36 163,45	5,20 205,52	8,54 182,57	8,03 113,51	1.626.453,36	4.780.874,80
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,81 96,90	3,25 99,19	2,57 101,63			445.888,80	1.534.973,06
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	0,45 13,67	0,37 14,75			0,00	30.909,22
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-9,71 0,39	-11,04 -13,96	-7,61 -3,80			-2.805.245,47	-4.570.491,86
Artigo 9º III % do CDI	-6,91 -828,21	-25,35 -773,11	-16,74 -662,00	-24,34 -520,19	-13,82 -195,26	-2.317.484,38	-11.349.138,07
Artigo 10º I % do CDI	-8,69 -1.042,09	-11,48 -350,07	-6,52 -257,96			-4.019.958,55	-5.474.431,06
VILA VELHA - CONSOLIDADO (Total)						-2.861.264,01	-4.331.102,04

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%)	20.908.437,74	0,00	0,00	0,00	21.278.104,01	369.666,27	1.182.828,27
NTN-B 150523 (5,840000%)	15.828.647,55	0,00	0,00	0,00	16.110.564,33	281.916,78	903.838,91
NTN-B 150523 (6,000000%)	0,00	39.998.472,70	0,00	0,00	40.343.105,27	344.632,57	344.632,57
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	7.333.540,73	0,00	0,00	0,00	7.452.561,56	119.020,83	371.335,76
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	373.620,83	0,00	0,00	0,00	379.852,59	6.231,76	19.606,45
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	14.511.173,77	0,00	0,00	0,00	14.761.818,27	250.644,50	796.716,92
NTN-B 150545 (5,730000%)	25.254.045,07	0,00	0,00	0,00	26.292.008,30	1.037.963,23	1.332.177,29
NTN-B 150555 (5,260000%)	20.952.556,29	0,00	0,00	0,00	21.316.907,63	364.351,34	1.160.374,00
NTN-B 150830 (5,250000%)	25.752.536,22	0,00	0,00	0,00	26.200.137,81	447.601,59	1.436.593,45
NTN-B 150840 (5,270000%)	30.932.225,04	0,00	0,00	0,00	31.470.322,06	538.097,02	1.727.013,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150850 (5,290000%)	25.786.994,68	0,00	0,00	0,00	26.235.951,02	448.956,34	1.441.084,45
					231.841.332,85	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	3.607.793,86	0,00	0,00	0,00	3.681.653,35	73.859,49	214.786,99
BB PREV RF IDKA2	5.971.001,49	0,00	0,00	0,00	6.059.604,28	88.602,79	308.144,67
BB PREV RF IPCA	4.275.636,28	0,00	0,00	0,00	4.370.925,63	95.289,35	256.561,38
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	2.519.107,38	0,00	0,00	0,00	2.563.964,04	44.856,66	140.631,16
BB PREV RF VII	1.604.906,34	0,00	0,00	0,00	1.637.741,61	32.835,27	95.487,40
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	5.690.546,14	0,00	0,00	0,00	5.786.253,32	95.707,18	309.983,15
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	6.808.222,16	0,00	0,00	0,00	6.947.478,82	139.256,66	404.877,19
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.482.140,49	0,00	0,00	0,00	7.616.400,47	134.259,98	435.090,78
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.113.814,00	0,00	0,00	0,00	15.302.369,10	188.555,10	732.530,12
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.167.478,97	0,00	0,00	0,00	20.419.092,73	251.613,76	976.847,36
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	650.094,07	399.392,49	-400.729,41	0,00	653.237,52	4.480,37	17.902,74
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	17.111.274,73	25.000.000,00	0,00	0,00	42.588.411,48	477.136,75	944.788,19
					117.627.132,35	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	1.358.830,07	5.588.331,57	-5.642.008,04	0,00	1.317.412,69	12.259,09	83.714,42
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	45.885.035,07	40.000.000,00	-39.998.472,70	0,00	46.247.074,89	360.512,52	1.095.733,03
BB PREV RF FLUXO FIC	682.285,43	320.688,89	-94.358,55	0,00	913.409,75	4.793,98	34.499,53
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.786.278,34	0,00	0,00	0,00	3.815.891,51	29.613,17	91.143,13
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	4.927.104,80	0,00	0,00	0,00	4.965.814,84	38.710,04	75.959,80
					57.259.603,68	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	66.841.377,05	0,00	-65.000.000,00	0,00	22.108,16	-1.819.268,89	-4.227.800,04
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	313.737,20	0,00	0,00	0,00	282.239,90	-31.497,30	7.292,75
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	1.621.381,74	10.000.000,00	0,00	0,00	10.794.579,43	-826.802,31	-624.048,56
FIA CAIXA DIVIDENDOS	0,00	3.515.000,00	0,00	0,00	3.387.323,03	-127.676,97	-127.676,97
					14.486.250,52	0,00	0,00

Artigo 9º III (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	15.640.787,49	0,00	-10.000.000,00	0,00	4.777.716,08	-863.071,41	-4.643.471,46
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	16.819.954,58	0,00	0,00	0,00	15.672.890,83	-1.147.063,75	-5.251.666,60
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	4.099.871,65	0,00	0,00	0,00	3.792.522,43	-307.349,22	-1.454.000,01
					24.243.129,34	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	46.236.153,02	0,00	0,00	0,00	42.216.194,47	-4.019.958,55	-5.474.431,06
					42.216.194,47	0,00	0,00

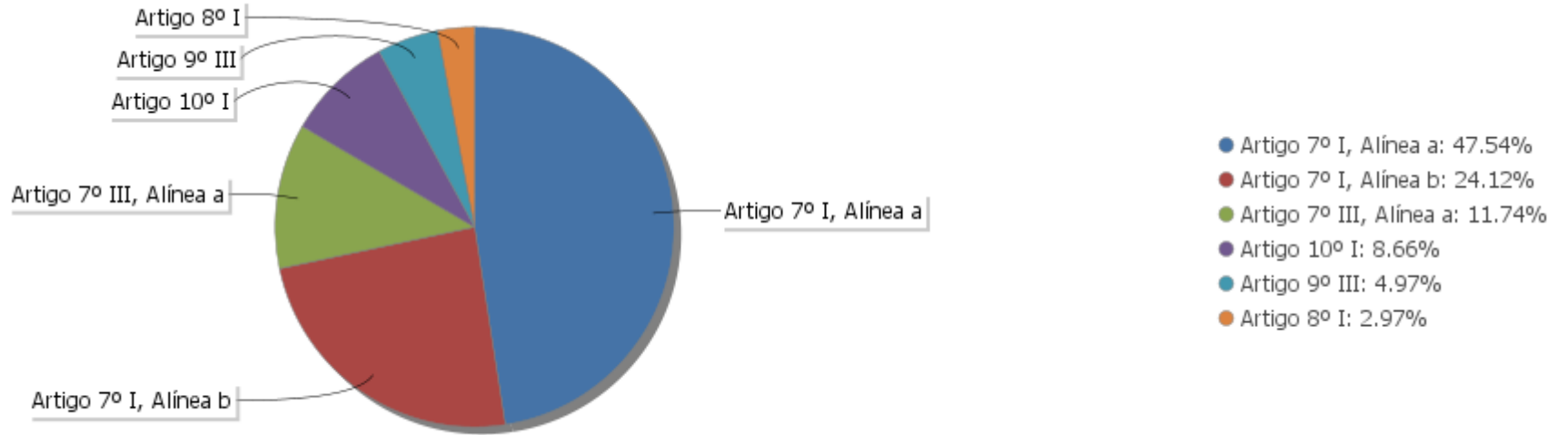
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

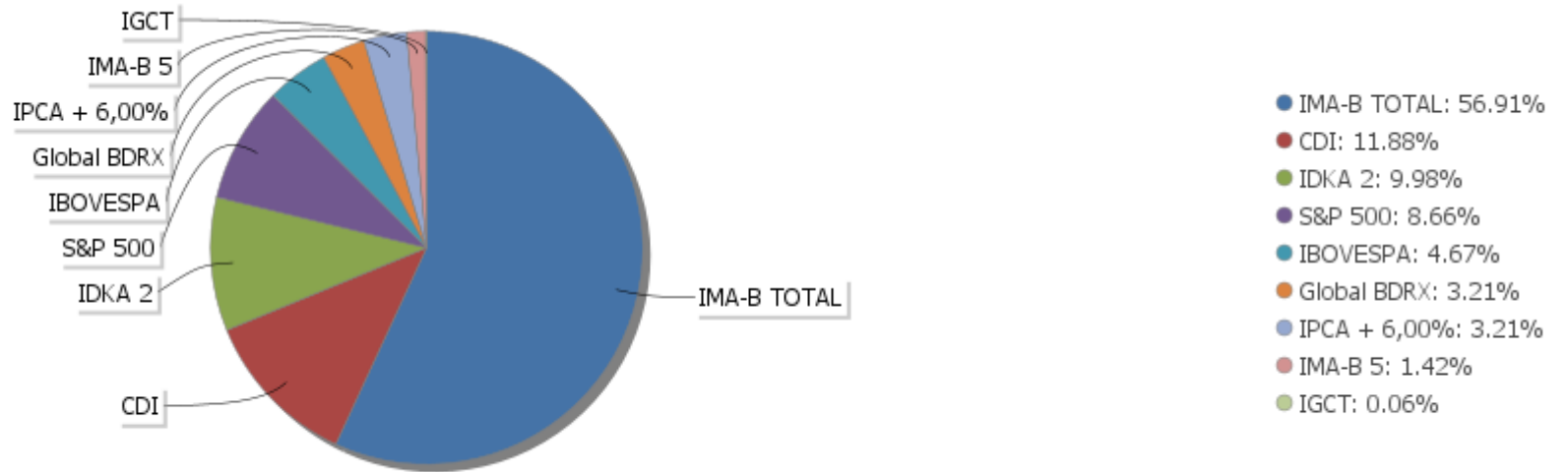
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	187.506.431,29	38,45	187.506.431,29	38,45
de 31 a 365 dias	19.883.274,25	4,08	207.389.705,54	42,53
acima de 365 dias	280.283.937,67	57,47	487.673.643,21	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

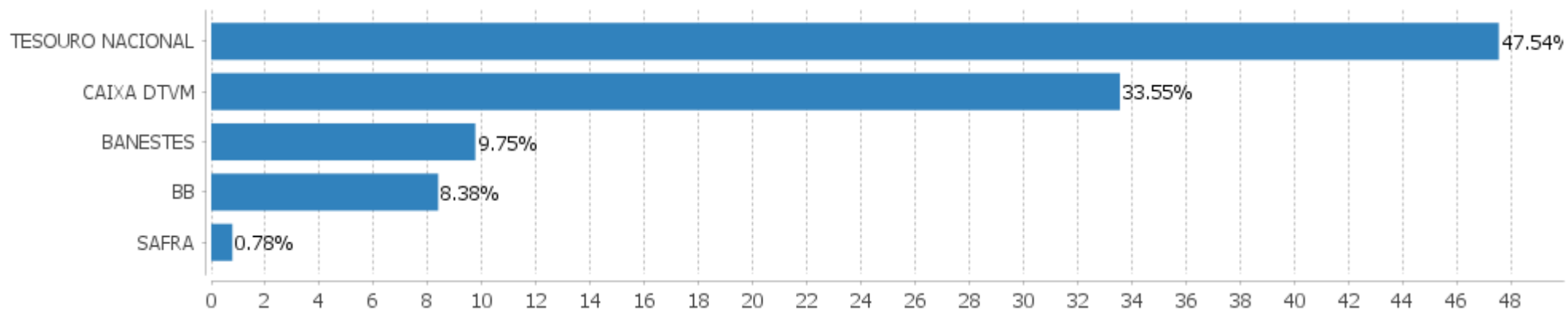


Alocação Por Estratégia



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									-0,95
IPCA + 4,92%	0,94	1,38	2,05	1,43									5,92
p.p. indexador	-2,72	-1,86	-0,16	-1,97									-6,87
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	20	44,44	03 meses	0,85	4,93	-4,08	6,16
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	55,56	06 meses	1,99	8,68	-6,69	6,02
			12 meses	4,69	18,01	-13,32	5,19
			24 meses	17,72	33,14	-15,42	4,86
Maior rentabilidade da Carteira	3,55	2020-12	36 meses	23,95	44,49	-20,54	6,25
Menor rentabilidade da Carteira	-6,98	2020-03	Desde 31/07/2018	37,93	55,19	-17,26	5,75

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

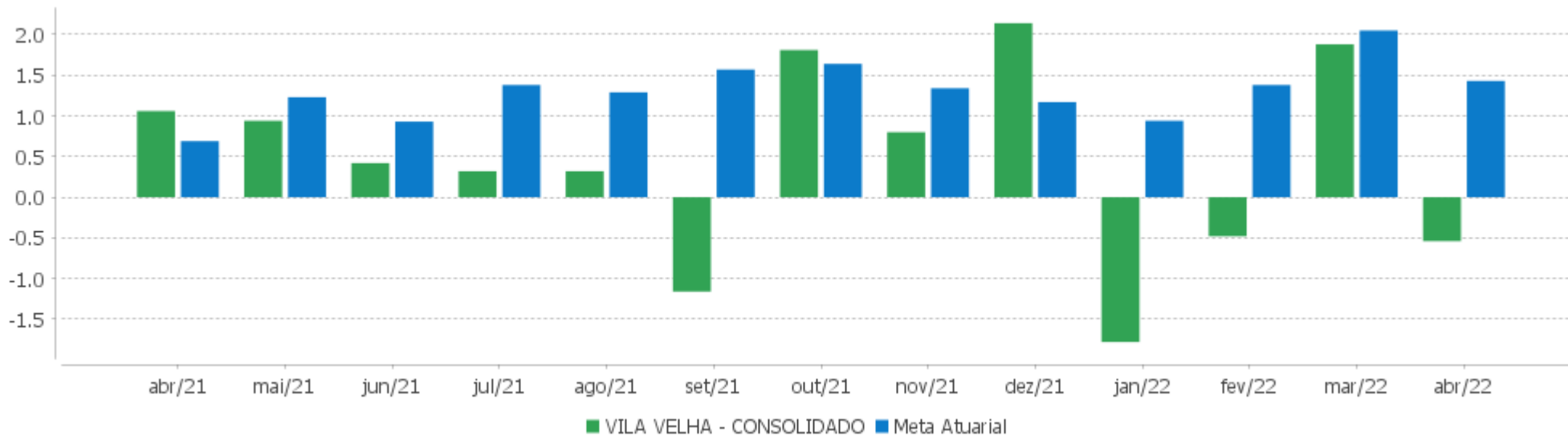


Patrimônio Líquido



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
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,83 99,30	3,46 105,38	2,68 106,02	4,97 106,31	7,92 111,93	11,88 126,64	13,49 89,54
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,78 93,74	3,37 102,74	2,57 101,47	4,85 103,71	7,39 104,48	9,81 104,61	14,81 98,27
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,73 87,17	2,92 89,09	2,25 89,17	4,13 88,36	5,92 83,70	7,01 74,75	11,36 75,41
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO % do CDI	0,62 74,18	2,38 72,49	1,86 73,37	3,32 70,98	4,61 65,10	4,92 52,50	7,15 47,43
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,79 94,17	3,47 105,97	2,61 103,07	4,93 105,27	7,56 106,88	10,16 108,35	15,21 100,93
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,78 0,95	5,77 2,05	5,39 0,89	8,67 1,11	10,66 5,97	21,01 6,20	33,01 7,95
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,79 0,29	6,01 -0,26	4,79 -0,40	9,23 0,09	18,28 -0,55	33,22 -1,20	41,48 -4,45
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	2,05 0,49	6,15 0,72	5,56 0,25	8,62 -0,29	11,92 2,47	22,42 3,21	33,69 4,14
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,05 1,21	6,16 2,43	5,56 1,07	8,63 1,06	11,92 7,24	20,19 5,39	27,38 2,31
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,48 -0,02	5,36 -0,09	5,35 -0,04	8,68 -0,31	9,34 0,07	19,39 -0,16	27,68 -2,17
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	2,23 0,72	6,24 -0,03	6,14 0,96	9,06 -0,08	10,09 -8,74	20,14 -14,27	33,30 -12,63
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,25 0,42	5,00 1,28	5,04 0,54	8,77 1,20	8,17 3,48	18,22 3,41	31,64 6,57
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	2,05 0,54	6,16 -0,11	5,56 0,38	8,64 -0,50	11,95 -6,89	22,02 -12,40	32,44 -13,49
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,40 -0,11	5,28 -0,17	5,26 -0,14	8,60 -0,39	9,10 -0,17	19,01 -0,54	27,75 -2,10
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,25 0,42	5,01 1,28	5,04 0,55	8,77 1,20	8,17 3,48	18,21 3,40	31,64 6,57
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,71 85,68	2,77 84,52	2,15 85,04	3,91 83,56	5,71 80,64	7,08 75,47	11,69 77,59
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	1,68	5,63	5,32	8,69	10,19	19,56	29,97

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.	0,85	1,91	0,83	1,13	5,51	4,76	4,91
NTN-B 150523 (6,000000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,79 0,96	6,00 2,27	4,78 0,29	6,08 -1,48	11,56 6,87	18,61 3,80	22,06 -3,00
NTN-B 150545 (5,100000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,73 0,90	5,71 1,98	4,57 0,08	8,76 1,19	17,25 12,56	31,02 16,21	41,69 16,63
NTN-B 150523 (5,661000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,77 0,94	5,89 2,16	4,70 0,21	5,93 -1,64	11,24 6,55	17,95 3,14	21,07 -4,00
NTN-B 150850 (5,290000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,74 0,91	5,77 2,04	4,61 0,12	8,85 1,29	14,40 9,71	21,48 6,68	24,87 -0,19
NTN-B 150545 (4,290000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,67 0,84	5,44 1,72	4,38 -0,12	8,34 0,78	16,35 11,66	29,02 14,21	38,45 13,39
NTN-B 150523 (5,840000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,78 0,95	5,94 2,22	4,74 0,25	6,01 -1,55	11,41 6,72	18,30 3,49	21,59 -3,47
NTN-B 150545 (3,680000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,62 0,79	5,24 1,52	4,23 -0,26	8,03 0,47	15,67 10,98	27,52 12,71	36,04 10,98
NTN-B 150840 (5,270000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,74 0,91	5,76 2,03	4,61 0,12	8,84 1,28	14,33 9,64	21,28 6,48	24,54 -0,52
NTN-B 150545 (5,730000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,11 3,28	5,91 2,18	5,06 0,56	6,05 -1,51	11,50 6,81	18,48 3,67	21,87 -3,20
NTN-B 150830 (5,250000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,74 0,91	5,75 2,03	4,60 0,11	8,83 1,27	14,21 9,52	20,94 6,13	23,98 -1,08
NTN-B 150555 (5,260000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,74 0,91	5,76 2,03	4,61 0,11	8,84 1,28	14,40 9,71	21,51 6,71	24,93 -0,13
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-9,99 0,12	2,88 -0,03	-3,79 0,02	4,20 -0,03	-9,40 -0,13	33,09 -0,91	11,24 -0,72
FIA CAIXA DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	-5,06 5,04	9,09 6,17	1,72 5,53	11,65 7,42	2,90 12,17	23,23 -10,76	20,21 8,25
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA Var. IBOVESPA p.p.	-8,65 1,46	-11,82 -14,74	-6,78 -2,98	-7,67 -11,90	2,63 11,90		
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	-10,04 -0,03	2,65 -0,41	-3,79 -0,26	4,30 -0,50	-11,49 -0,81	32,60 -2,87	14,12 -3,26
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-6,82 0,14	-25,10 -0,16	-17,01 -0,25	-24,50 -0,33	-14,24 -1,64	22,16 -3,29	70,60 -4,39
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-6,31 3,79	-24,55 -27,46	-15,58 -11,78	-23,42 -27,65	-12,24 -2,98	18,63 -15,36	61,42 49,46
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	-7,50	-27,71	-18,11	-25,06	-15,56	17,96	57,86

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.	2,61	-30,63	-14,31	-29,29	-6,30	-16,04	45,90
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-8,69	-11,48	-6,52	-7,01	4,48	48,89	45,55
Var. S&P 500 p.p.	-3,39	12,10	9,46	14,78	14,52	20,29	-29,33
VILA VELHA - CONSOLIDADO	-0,54	-0,95	0,85	1,99	4,69	17,72	23,95
Var. IPCA + 4,92% p.p.	-1,97	-6,87	-4,08	-6,60	-12,93	-13,98	-17,58
CDI	0,83	3,28	2,53	4,68	7,08	9,38	15,07
IBOVESPA	-10,10	2,91	-3,81	4,23	-9,27	34,00	11,96
INPC + 6,00%	1,48	6,47	5,25	9,23	19,19	35,86	47,59
IPCA + 6,00%	1,50	6,27	5,18	9,14	18,83	34,41	45,93

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
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
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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

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	0,75	3,04	2,40	4,76	5,63	8,09	15,23	22,93	33,92
IRF-M 1+	-0,53	0,26	0,76	4,79	-1,08	0,34	14,30	26,22	44,13
IRF-M TOTAL	-0,12	1,23	1,31	4,98	1,22	3,18	15,24	25,96	42,07
IMA-B 5	1,56	5,43	5,31	8,92	9,45	19,21	29,55	42,42	59,01
IMA-B 5+	0,08	1,99	3,65	6,19	-0,03	10,27	19,61	43,70	58,71
IMA-B TOTAL	0,83	3,73	4,49	7,56	4,69	14,81	25,06	44,56	60,36
IMA-GERAL TOTAL	0,54	3,09	2,88	5,86	4,95	9,79	19,09	31,12	45,31
IDKA 2	1,51	5,45	5,39	8,99	9,27	19,55	29,85	42,08	59,55
IDKA 20	-1,21	-0,85	2,14	2,79	-8,97	3,42	9,22	42,00	53,49
CDI	0,83	3,28	2,53	4,68	7,08	9,38	15,07	22,37	32,30

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-10,10	2,91	-3,81	4,23	-9,27	34,00	11,96	25,27	64,94
IBRX 100	-10,11	3,27	-3,37	4,71	-10,15	35,89	15,35	30,27	70,90
IBRX 50	-10,51	3,33	-4,01	5,29	-9,44	38,94	13,39	25,43	65,73
SMALL CAP	-8,36	-2,23	-5,46	-0,84	-20,81	23,46	17,79	30,74	73,22
IFIX	1,19	0,29	1,30	5,13	-1,68	8,04	12,14	20,36	38,18
Índice Consumo - ICON	-14,19		-11,54	-16,34	-30,65	-10,38	-9,46	-1,52	13,09
Índice Dividendos - IDIV	-5,19	9,49	1,87	12,24	3,76	42,18	31,97	56,94	85,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	1,06	4,29	3,73	6,05	12,13	19,71	22,58	28,64	32,19
INPC	1,04	4,49	3,80	6,14	12,47	21,00	23,98	30,27	32,47
IGPM	1,41	6,98	5,07	7,93	14,66	51,37	61,49	75,44	78,75
SELIC	0,83	3,28	2,53	4,68	7,08	9,38	15,07	22,37	32,32

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-5,31	-23,58	-15,98	-21,79	-10,04	28,59	74,88	120,49	166,54
MSCI ACWI	-4,62	-23,67	-16,34	-23,54	-15,21	21,12	55,29	81,22	120,87

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,36	5,62	4,71	8,12	16,60	29,42	37,85	50,40	60,68
IPCA + 5,00%	1,43	5,94	4,95	8,63	17,72	31,90	41,85	56,24	68,52
IPCA + 5,50%	1,47	6,10	5,07	8,89	18,27	33,16	43,88	59,23	72,55
IPCA + 5,89%	1,50	6,23	5,16	9,08	18,71	34,14	45,48	61,58	75,75
IPCA + 6,00%	1,50	6,27	5,18	9,14	18,83	34,41	45,93	62,25	76,66
INPC + 4,00%	1,34	5,82	4,77	8,21	16,95	30,82	39,42	52,30	61,02
INPC + 6,00%	1,48	6,47	5,25	9,23	19,19	35,86	47,59	64,31	77,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1431	01/04/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	38.516,74	4.553,62556035	8,4584776400
1418	04/04/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	21.284,68	9.533,53105400	2,2326124370
1426	04/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	81.177,99	40.902,69843100	1,9846610000
1419	05/04/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	46,85	20,97614600	2,2334893680
1437	05/04/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.027,25	0,00	121,36850169	8,4638929000
1457	08/04/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	258.816,58	30.548,70575993	8,4722600700
1432	08/04/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	35.618,73	4.204,15918641	8,4722600700
1420	11/04/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	32.353,41	14.463,83634700	2,2368484560
1427	11/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.438,22	1.226,23755300	1,9883750000
1414	11/04/2022	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	0,00	65.000.000,00	41.315.324,40547600	1,5732661170
1413	11/04/2022	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	0,00	10.000.000,00	4.680.851,81177000	2,1363632950
1447	12/04/2022	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	7.163.253,85	3.821.509,41466409	1,8744566800
1450	12/04/2022	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	3.504.098,99	1.869.394,49239846	1,8744566800
1445	12/04/2022	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	8.319.647,72	4.438.431,57794396	1,8744566800
1448	12/04/2022	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	7.304.801,08	3.897.023,15233020	1,8744566800
1451	12/04/2022	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	2.755.773,01	1.470.171,62060986	1,8744566800
1446	12/04/2022	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	7.900.592,36	4.214.870,60453166	1,8744566800
1449	12/04/2022	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	3.030.413,23	1.616.688,86295714	1,8744566800
1444	12/04/2022	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	19.892,46	10.612,38583913	1,8744566800
1462	12/04/2022	NTN-B 150523 (6,000000%)	39.998.472,70	0,00	9.999,00000000	4.000,2472947290
1452	13/04/2022	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	40.000.000,00	0,00	21.329.078,66559866	1,8753740200
1417	13/04/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.000.000,00	0,00	9.554.927,64817686	2,6164510000
1421	14/04/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	320,62	143,17369600	2,2393778200
1459	18/04/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	527.781,23	0,00	62.195,11862576	8,4858947400
1439	18/04/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	4.640.157,09	0,00	546.808,23055845	8,4858947400
1416	18/04/2022	FIA CAIXA BRASIL IBOVSPA	10.000.000,00	0,00	3.828.926,62168444	2,6116980000
1422	19/04/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.680,84	1.642,46686800	2,2410436840
1428	19/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	94.192,67	0,00	47.283,05578700	1,9921020000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1434	19/04/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	994,77	117,18688960	8,4887670800
1440	19/04/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.112.144,91	366.619,18988594	8,4887670800
1435	19/04/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	841,67	99,15131468	8,4887670800
1438	19/04/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.030,27	121,36850169	8,4887670800
1433	19/04/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	393.110,84	46.309,53349175	8,4887670800
1436	19/04/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	4.370,61	514,86982253	8,4887670800
1423	20/04/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	378,00	168,60944000	2,2418673550
1415	20/04/2022	FIA CAIXA DIVIDENDOS	3.515.000,00	0,00	841.347,27584199	4,1778230000
1443	27/04/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	936,80	0,00	110,17778333	8,5026216000
1424	28/04/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	320.688,89	0,00	142.770,41660200	2,2461858530
1461	28/04/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	418.429,20	0,00	49.196,15911285	8,5053225200
1429	28/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	305.199,82	0,00	152.859,84817100	1,9965990000
1441	28/04/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.024.522,57	120.456,63963217	8,5053225200
1425	29/04/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	36.294,15	16.151,57139400	2,2470971470
1460	29/04/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	101.383,12	11.916,24260082	8,5079771700
1458	29/04/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	632.599,30	74.353,66684229	8,5079771700
1430	29/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	317.113,20	158.766,89074400	1,9973510000
1442	29/04/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	38.057,93	4.473,20546560	8,5079771700
Total			124.821.885,65	121.135.568,70		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 7.371.931,39

Value-At-Risk: 1,51%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VILA VELHA - CONSOLIDADO		1,51	1,51			487.673.643,21	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,30%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150523 (5,661000%)		0,12	0,00	2,04			21.278.104,01	4,36
NTN-B 150523 (5,840000%)		0,12	0,00	2,04			16.110.564,33	3,30
NTN-B 150523 (6,000000%)		0,12	0,00	2,04			40.343.105,27	8,27
NTN-B 150545 (3,680000%) ..		0,12	0,00	2,04			7.452.561,56	1,53
NTN-B 150545 (4,290000%) ..		0,12	0,00	2,04			379.852,59	0,08
NTN-B 150545 (5,100000%) ..		0,12	0,00	2,04			14.761.818,27	3,03
NTN-B 150545 (5,730000%)		0,34	0,00	2,00			26.292.008,30	5,39
NTN-B 150555 (5,260000%)		0,12	0,00	2,04			21.316.907,63	4,37
NTN-B 150830 (5,250000%)		0,12	0,00	2,04			26.200.137,81	5,37
NTN-B 150840 (5,270000%)		0,12	0,00	2,04			31.470.322,06	6,45
NTN-B 150850 (5,290000%)		0,12	0,00	2,04			26.235.951,02	5,38
Sub-total	1,45	0,12	0,00		0,85	2,06	231.841.332,85	47,54

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IDKA2		1,11	0,00	0,21			6.059.604,28	1,24
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,17	0,04	0,23			42.588.411,48	8,73
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,02	0,00	0,02			653.237,52	0,13
BB PREV RF IPCA		0,86	0,00	0,83			4.370.925,63	0,90
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI		0,74	0,00	1,67			2.563.964,04	0,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF VII		0,63	0,00	2,00			1.637.741,61	0,34
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI		0,86	0,00	1,53			5.786.253,32	1,19
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP		0,63	0,00	0,91			6.947.478,82	1,42
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,34	0,02	1,14			20.419.092,73	4,19
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,34	0,01	1,14			15.302.369,10	3,14
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI		0,63	0,00	0,60			3.681.653,35	0,75
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,12	0,00	0,14			7.616.400,47	1,56
Sub-total	1,98	0,99	0,08		0,35	1,53	117.627.132,35	24,12

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		0,02	-0,00	0,02			1.317.412,69	0,27
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,03	0,00	0,03			3.815.891,51	0,78
BB PREV RF FLUXO FIC		0,02	-0,00	0,02			913.409,75	0,19
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI		0,05	0,00	0,05			46.247.074,89	9,48
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,05	-0,00	0,05			4.965.814,84	1,02
Sub-total	0,07	0,05	0,00		-0,37	0,81	57.259.603,68	11,74

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 10,02%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		10,02	0,84	7,99			42.216.194,47	8,66
Sub-total	26,83	10,02	0,84		-0,36	-8,69	42.216.194,47	8,66

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,88%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		11,09	0,28	1,05			15.672.890,83	3,21
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		12,24	0,08	13,27			3.792.522,43	0,78
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I		10,39	0,08	12,63			4.777.716,08	0,98
Sub-total	23,84	10,88	0,44		-0,32	-6,91	24.243.129,34	4,97

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,62%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA DIVIDENDOS		8,02	0,03	5,04			3.387.323,03	0,69
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		9,33	0,00	0,12			282.239,90	0,06
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA		9,12	0,12	0,12			10.794.579,43	2,21
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA		9,97	0,00	8,97			22.108,16	0,00
Sub-total	15,66	8,62	0,15		-0,67	-9,71	14.486.250,52	2,97