



LDB
EMPRESAS

CUBATÃO
JANEIRO 2022



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.01.2022.

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 81,23%

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
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOUREO IPCA GERAL FI RF	5,67	-0,76	-0,76	20.706.544,50	2,37	373.950.038,31	5,54
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,67	-0,75	-0,75	28.999.159,97	3,31	320.131.317,42	9,06
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,68	0,61	0,61	142.546.646,96	16,29	5.049.727.685,75	2,82
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	6,37	-1,03	-1,03	58.099.547,52	6,64	520.504.631,06	11,16
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,71	-0,77	-0,77	30.749.693,97	3,51	6.778.952.570,88	0,45
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,68	-0,76	-0,76	32.059.657,22	3,66	591.516.478,08	5,42
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,68	-0,76	-0,76	62.494.577,31	7,14	4.513.989.587,78	1,38
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,67	0,63	0,63	17.545,82	0,00	38.040.907,80	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,67	0,61	0,61	45.933.560,31	5,25	6.296.869.255,71	0,73
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,68	0,62	0,62	1.062.032,88	0,12	654.984.418,79	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,71	0,04	0,04	16.118.167,22	1,84	848.732.387,83	1,90
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,35	-0,12	-0,12	438.787.133,68	50,15		

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
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	3,09	0,19	0,19	69.155.452,92	7,90	415.856.419,22	16,63
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	5,78	-0,74	-0,74	33.169.952,58	3,79	914.824.688,72	3,63
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,71	-0,76	-0,76	33.455.115,90	3,82	2.422.224.309,42	1,38
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	5,71	-0,76	-0,76	39.946.163,61	4,57	815.943.738,86	4,90
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,18	0,80	0,80	54.025.772,97	6,18	1.520.814.282,19	3,55
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,17	0,78	0,78	13.979.071,25	1,60	3.821.913.743,91	0,37
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	3,43	0,25	0,25	18.372.664,03	2,10	337.348.014,62	5,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			5,62	-0,04	-0,04	262.104.193,26	29,96		
Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRPP	GENIAL	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		
Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	0,49	0,79	0,79	9.739.427,61	1,11	7.404.894.456,53	0,13
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			0,49	0,79	0,79	9.739.427,61	1,11		
Renda Fixa			3,33	-0,08	-0,08	710.630.754,55	81,23		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

17,90%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	18,27	6,87	6,87	8.801.179,88	1,01	1.063.688.808,08	0,83
4UM	BEM	4UM SMALL CAPS FIA	21,51	-1,36	-1,36	14.443.758,53	1,65	422.779.606,93	3,42
4UM	BEM	4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	17,09	4,85	4,85	20.381.816,91	2,33	224.552.987,09	9,08
ITAU	ITAU	ITAU INDEX IBOVESPA 1	20,41	6,96	6,96	5.330.097,89	0,61	47.171.864,92	11,30
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	19,25	6,52	6,52	36.822.894,20	4,21	1.086.880.565,71	3,39
GERAÇÃO FUTURO	BRB	GERAÇÃO FI EM AÇÕES	18,97	5,48	5,48	19.814.966,27	2,26	263.444.381,80	7,52
ARX	BEM	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	19,20	6,90	6,90	28.043.373,20	3,21	281.685.140,61	9,96
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	13,57	-4,36	-4,36	19.127.517,90	2,19	2.567.862.425,36	0,74
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	26,77	5,19	5,19	3.798.222,70	0,43	411.017.688,89	0,92
Sub-total Artigo 8º I			16,99	3,93	3,93	156.563.827,48	17,90		
Renda Variável			17,51	3,93	3,93	156.563.827,48	17,90		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,67%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	13,45	-5,18	-5,18	5.880.669,51	0,67	2.092.931.115,94	0,28
Sub-total Artigo 10º I			13,45	-5,18	-5,18	5.880.669,51	0,67		
Investimentos Estruturados			17,80	-5,18	-5,18	5.880.669,51	0,67		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,21%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	19,14	2,99	2,99	1.810.000,00	0,21	0,00	
Sub-total Artigo 11º			19,14	2,99	2,99	1.810.000,00	0,21		
Fundos Imobiliários			31,18	2,99	2,99	1.810.000,00	0,21		
Total			4,84	0,59	0,59	874.885.251,54	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 b	Fundos 100% Títulos Públicos	438.787.133,68	50,15					100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	262.104.193,26	29,96					60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	0,00	0,00					5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	9.739.427,61	1,11					5,00
	Total Renda Fixa	710.630.754,55	81,23					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	156.563.827,48	17,90					30,00
	Total Renda Variável	156.563.827,48	17,90					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	5.880.669,51	0,67					10,00
	Total Investimentos Estruturados	5.880.669,51	0,67					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	1.810.000,00	0,21					5,00
	Total Fundos Imobiliários	1.810.000,00	0,21					5,00

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 b % do CDI	-0,12 -16,27	-0,12 -16,27	2,52 120,30	0,27 7,74	0,29 5,86	-716.646,49	-716.646,49
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,04 -5,32	-0,04 -5,32	3,59 171,23	-0,33 -9,49	-0,66 -13,16	-95.592,95	-95.592,95
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,79 108,20	0,79 108,20				76.562,94	76.562,94
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	3,93 -3,06	3,93 -3,06				6.065.855,00	6.065.855,00
Artigo 10º I % do CDI	-5,18 -708,03	-5,18 -708,03				-321.570,02	-321.570,02
Artigo 11º % do CDI	2,99 408,74	2,99 408,74				53.107,27	53.107,27
CUBATÃO (Total)						5.061.715,75	5.061.715,75

RESULTADO POR ATIVO

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 RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	30.987.644,18	0,00	0,00	0,00	30.749.693,97	-237.950,21	-237.950,21
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	158.554.239,50	11.924.792,56	-28.864.090,00	0,00	142.546.646,96	931.704,90	931.704,90
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	1.055.523,69	0,00	0,00	0,00	1.062.032,88	6.509,19	6.509,19
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	32.305.689,73	0,00	0,00	0,00	32.059.657,22	-246.032,51	-246.032,51
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	20.864.830,24	0,00	0,00	0,00	20.706.544,50	-158.285,74	-158.285,74
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	62.971.356,86	0,00	0,00	0,00	62.494.577,31	-476.779,55	-476.779,55
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.111.727,95	0,00	0,00	0,00	16.118.167,22	6.439,27	6.439,27
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	45.631.272,90	222.500,00	-199.125,00	0,00	45.933.560,31	278.912,41	278.912,41
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	29.217.109,36	0,00	0,00	0,00	28.999.159,97	-217.949,39	-217.949,39
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	58.702.872,08	0,00	0,00	0,00	58.099.547,52	-603.324,56	-603.324,56
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.436,12	0,00	0,00	0,00	17.545,82	109,70	109,70
					438.787.133,68	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B	40.250.960,84	0,00	0,00	0,00	39.946.163,61	-304.797,23	-304.797,23
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	13.871.481,88	0,00	0,00	0,00	13.979.071,25	107.589,37	107.589,37
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	69.021.204,04	0,00	0,00	0,00	69.155.452,92	134.248,88	134.248,88
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	33.415.684,38	0,00	0,00	0,00	33.169.952,58	-245.731,80	-245.731,80
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	18.327.092,83	0,00	0,00	0,00	18.372.664,03	45.571,20	45.571,20
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	33.712.483,47	0,00	0,00	0,00	33.455.115,90	-257.367,57	-257.367,57
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	52.600.878,77	1.000.000,00	0,00	0,00	54.025.772,97	424.894,20	424.894,20
					262.104.193,26	0,00	0,00

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
					0,00	0,00	0,00

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	9.662.864,67	0,00	0,00	0,00	9.739.427,61	76.562,94	76.562,94
					9.739.427,61	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	19.439.097,77	0,00	0,00	0,00	20.381.816,91	942.719,14	942.719,14
4UM SMALL CAPS FIA	14.642.869,38	0,00	0,00	0,00	14.443.758,53	-199.110,85	-199.110,85
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	26.232.150,16	0,00	0,00	0,00	28.043.373,20	1.811.223,04	1.811.223,04
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	0,00	20.000.000,00	0,00	0,00	19.127.517,90	-872.482,10	-872.482,10
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	18.785.981,91	0,00	0,00	0,00	19.814.966,27	1.028.984,36	1.028.984,36
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	8.235.400,17	0,00	0,00	0,00	8.801.179,88	565.779,71	565.779,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU INDEX IBOVESPA 1	4.983.111,06	0,00	0,00	0,00	5.330.097,89	346.986,83	346.986,83
OCCAM FIC FIA	34.568.427,39	0,00	0,00	0,00	36.822.894,20	2.254.466,81	2.254.466,81
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	3.610.934,64	0,00	0,00	0,00	3.798.222,70	187.288,06	187.288,06
					156.563.827,48	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	6.202.239,53	0,00	0,00	0,00	5.880.669,51	-321.570,02	-321.570,02
					5.880.669,51	0,00	0,00

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	1.767.750,00	0,00	0,00	0,00	10.857,27	1.810.000,00	53.107,27	53.107,27
						1.810.000,00	0,00	0,00

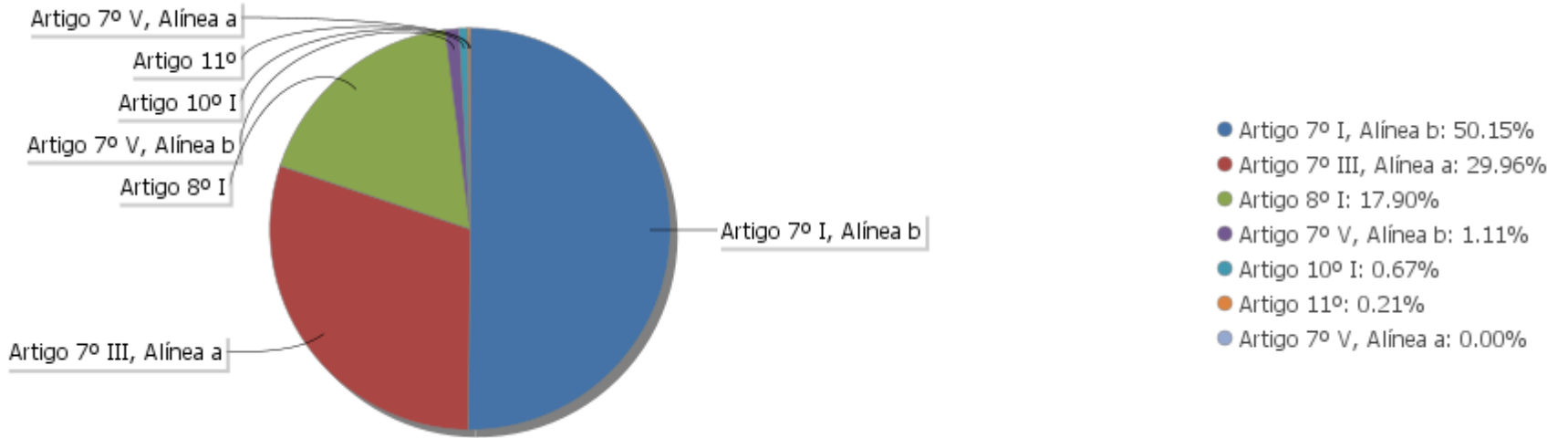
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

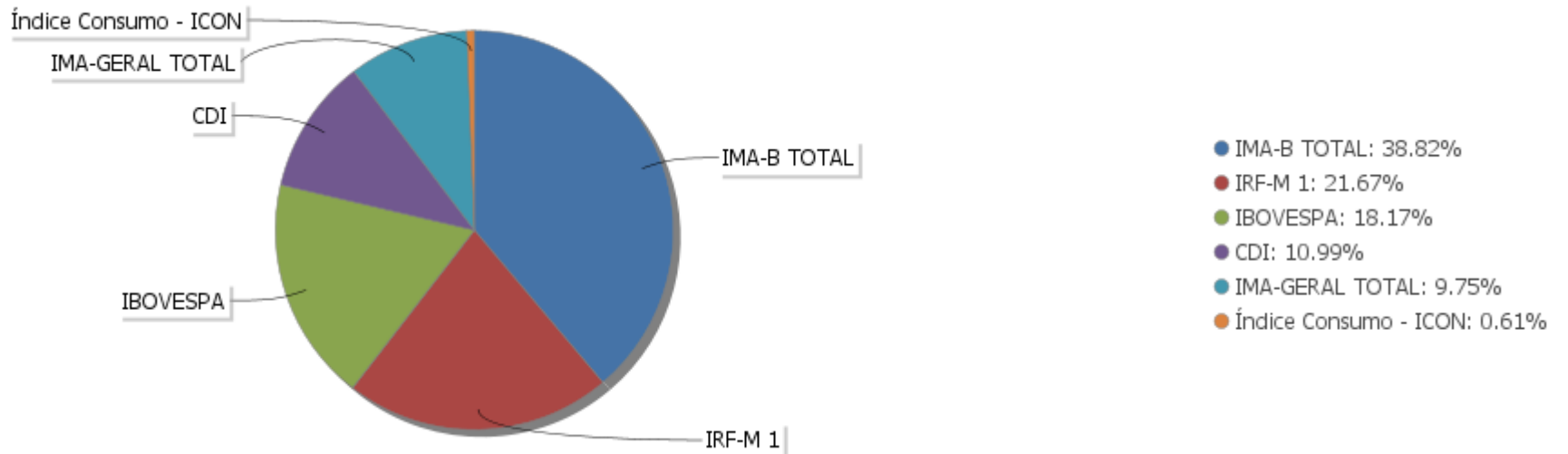
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	871.087.028,84	99,57	871.087.028,84	99,57
de 31 a 365 dias	3.798.222,70	0,43	874.885.251,54	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	874.885.251,54	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

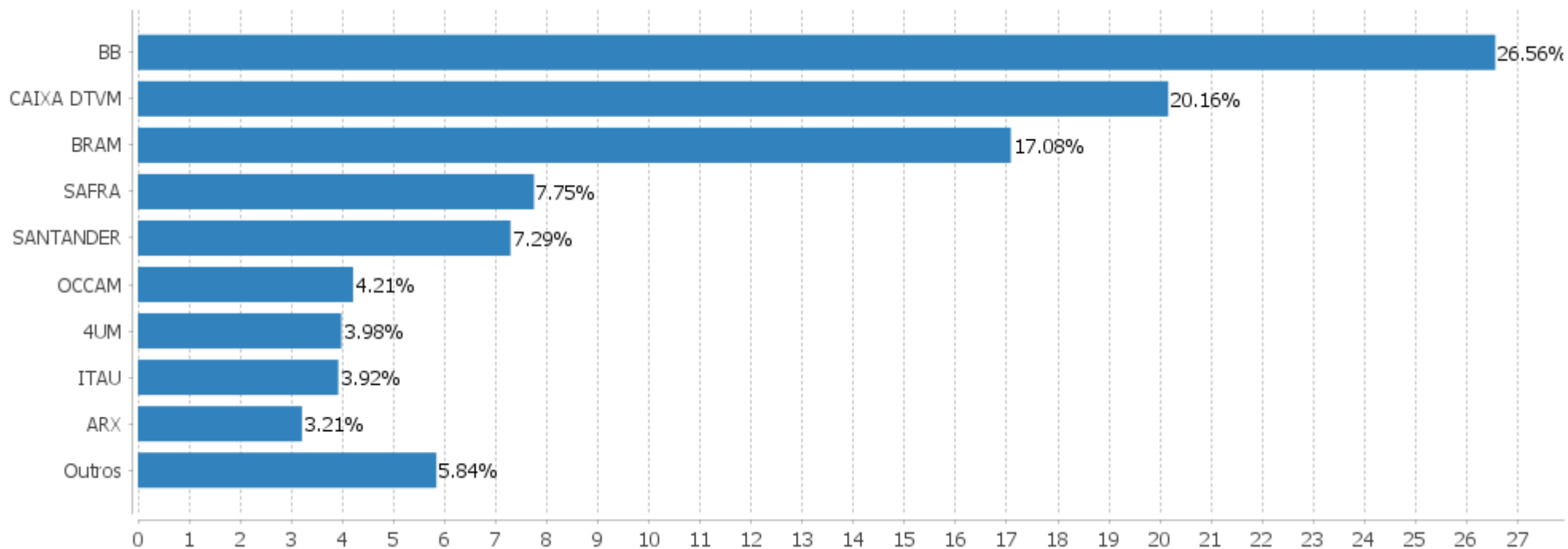


Alocação Por Estratégia



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	0,59												0,59
INPC + 5,86%	1,15												1,15
p.p. indexador	-0,56												-0,56
2021	-0,95	-1,27	0,53	0,92	1,42	0,34	-0,84	-0,77	-0,97	-2,23	1,55	0,95	-1,41
INPC + 5,86%	0,72	1,23	1,39	0,83	1,44	1,08	1,52	1,38	1,68	1,62	1,30	1,25	16,59
p.p. indexador	-1,67	-2,50	-0,86	0,08	-0,02	-0,74	-2,37	-2,15	-2,65	-3,85	0,25	-0,31	-18,00
2020	0,23	-0,94	-7,44	1,84	1,81	2,26	3,20	-1,32	-1,40	-0,05	2,65	3,68	4,09
INPC + 5,86%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,96	0,84	1,35	1,37	1,41	1,97	11,60
p.p. indexador	-0,46	-1,52	-8,12	1,61	1,61	1,48	2,24	-2,16	-2,75	-1,42	1,25	1,71	-7,52
2019	3,58	0,24	0,31	1,07	2,11	2,57	1,17	0,27	1,76	2,17	-0,86	2,58	18,27
INPC + 6,00%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,44	0,57	1,01	1,71	10,78
p.p. indexador	2,70	-0,76	-0,90	-0,02	1,45	2,12	0,54	-0,36	1,33	1,60	-1,86	0,87	7,49

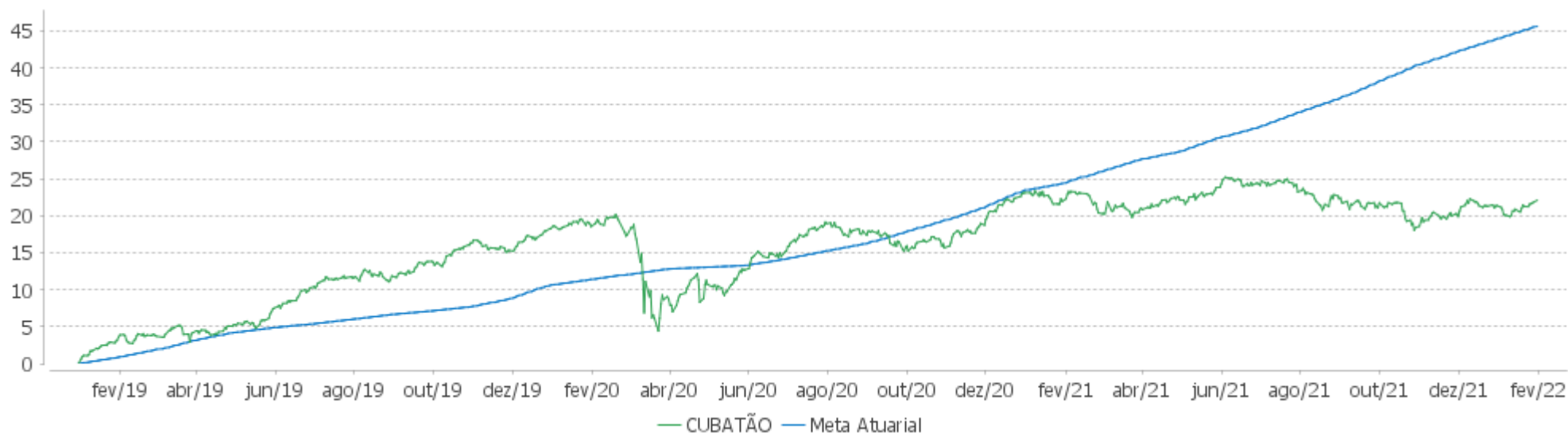
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

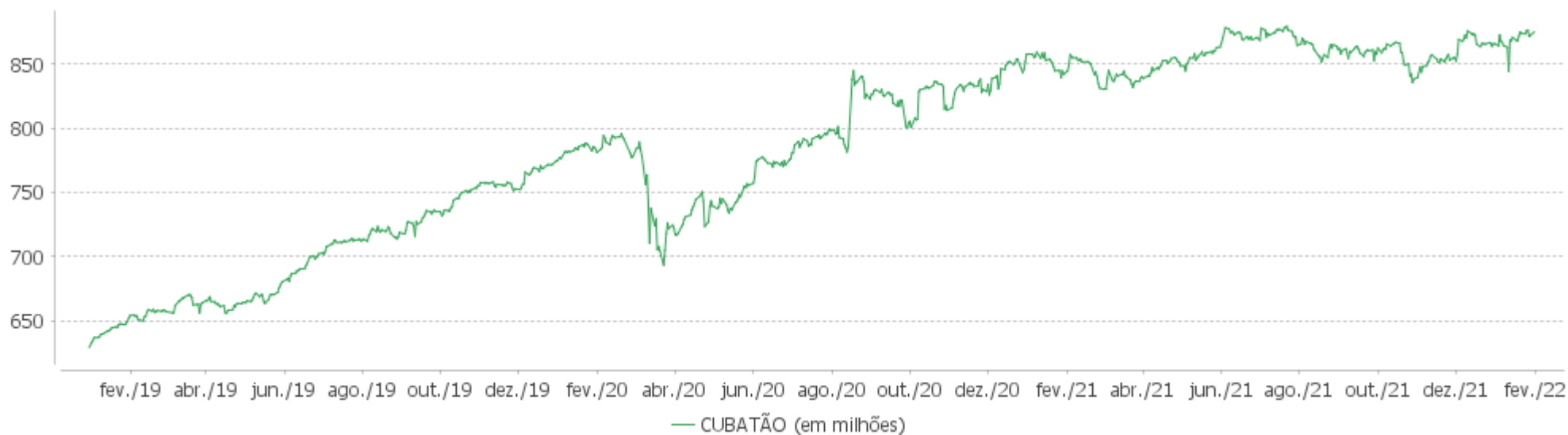
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	15	40,54	03 meses	3,12	3,75	-0,63	4,35
Meses abaixo - Meta Atuarial	22	59,46	06 meses	-0,93	8,68	-9,61	5,05
			12 meses	0,12	17,08	-16,96	4,84
			24 meses	2,98	30,71	-27,73	8,42
			36 meses	17,86	44,53	-26,67	7,25
Maior rentabilidade da Carteira	3,68	2020-12	Desde 31/12/2018	22,08	45,79	-23,71	7,17
Menor rentabilidade da Carteira	-7,44	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

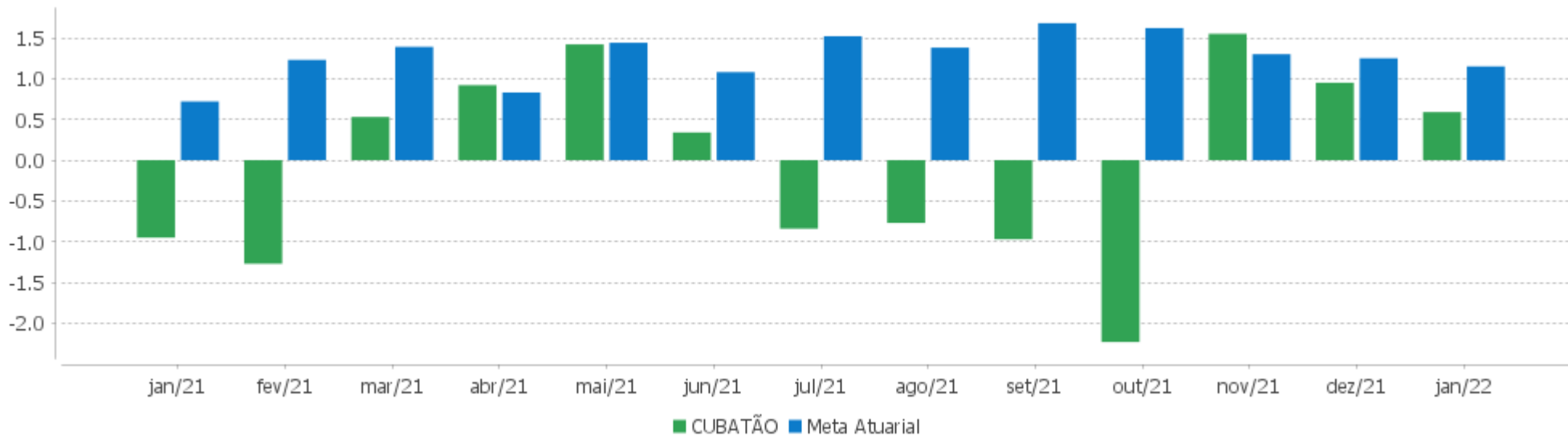


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP % do CDI	0,25 33,96	0,25 33,96	3,31 157,76	1,86 53,53	2,59 51,71	9,77 127,41	22,25 160,09
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,74 -0,00	-0,74 -0,00	2,81 -0,13	-1,28 -0,37	-2,06 -0,91	2,77 -1,25	21,19 -1,67
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,78 105,92	0,78 105,92	2,24 106,88	3,85 110,71	5,59 111,79	7,61 99,28	13,70 98,56
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,76 -0,02	-0,76 -0,02	2,89 -0,05	-1,02 -0,12	-1,37 -0,23	3,29 -0,73	21,64 -1,22
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,76 -0,03	-0,76 -0,03	2,84 -0,10	-1,05 -0,15	-1,38 -0,23	3,43 -0,59	21,70 -1,16
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,80 108,73	0,80 108,73	2,25 107,49	3,87 111,52	5,65 112,86	7,66 99,90	13,72 98,68
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,19 -0,01	0,19 -0,01	2,99 0,09	0,61 -0,52	0,52 -0,89	5,53 -0,45	17,53 -0,44
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	0,79 108,20	0,79 108,20	2,26 107,94	4,18 120,24	6,38 127,61	8,38 109,34	14,38 103,46
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,75 -0,01	-0,75 -0,01	2,88 -0,05	-1,01 -0,10	-1,36 -0,21	3,50 -0,52	21,90 -0,96
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,76 -0,02	-0,76 -0,02	2,87 -0,07	-1,06 -0,15	-1,42 -0,27	3,39 -0,62	21,71 -1,15
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,62 -0,01	0,62 -0,01	2,26 -0,05	2,46 -0,08	3,26 -0,27	6,44 -0,64	13,18 -0,98
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,61 -0,01	0,61 -0,01	2,25 -0,06	2,43 -0,11	3,24 -0,29	6,41 -0,67	13,14 -1,02
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,76 -0,02	-0,76 -0,02	2,87 -0,07	-1,04 -0,13	-1,45 -0,31	3,45 -0,57	21,69 -1,17
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,61 -0,02	0,61 -0,02	2,25 -0,06	2,44 -0,10	3,30 -0,23	6,63 -0,45	13,45 -0,71
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,03 -0,29	-1,03 -0,29	2,01 -0,93	-3,48 -2,57	-4,53 -3,39	0,32 -3,70	18,33 -4,53
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,77 -0,03	-0,77 -0,03	2,85 -0,08	-1,09 -0,18	-1,42 -0,27	3,46 -0,56	21,90 -0,96
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,04	0,04	2,85	0,97	0,85	4,72	16,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,17	-0,17	-0,05	-0,16	-0,57	-1,26	-1,98
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	-0,76	-0,76	2,86	-1,07	-1,50	3,29	21,60
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,03	-0,08	-0,17	-0,35	-0,73	-1,26
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,63	0,63	2,22	2,42	3,17	6,09	12,58
Var. IRF-M 1 p.p.	0,00	0,00	-0,09	-0,13	-0,36	-0,99	-1,58
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	-74,30	-97,31
% do CDI	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	-969,36	-700,05
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	5,48	5,48	4,70	-11,36	-8,83	-9,94	6,46
Var. IBOVESPA p.p.	-1,51	-1,51	-3,65	-3,43	-6,28	-8,52	-8,69
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	6,90	6,90	10,60	-3,24	3,15		
Var. IBOVESPA p.p.	-0,08	-0,08	2,25	4,69	5,70		
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	5,19	5,19	0,87	-26,22	-18,49	-9,81	
Var. IBOVESPA p.p.	-1,80	-1,80	-7,48	-18,29	-15,95	-8,39	
4UM SMALL CAPS FIA	-1,36	-1,36	6,23	-5,85	0,88	-5,98	42,04
Var. IBOVESPA p.p.	-8,34	-8,34	-2,12	2,08	3,42	-4,56	26,89
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	-5,41	-5,41	-0,96	4,38	23,74		
Var. IBOVESPA p.p.	-12,39	-12,39	-9,31	12,31	26,28		
ITAU INDEX IBOVESPA 1	6,96	6,96	8,32	-8,10	-2,99	-2,54	12,29
Var. Índice Consumo - ICON p.p.			13,75	14,73	20,46	23,97	6,99
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	6,87	6,87	5,50	-11,03	-9,08	-21,38	0,45
Var. IBOVESPA p.p.	-0,11	-0,11	-2,85	-3,10	-6,54	-19,96	-14,70
OCCAM FIC FIA	6,52	6,52	7,30	-7,34	-4,05	-0,69	24,60
Var. IBOVESPA p.p.	-0,46	-0,46	-1,05	0,58	-1,51	0,73	9,46
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	4,85	4,85	4,71	-2,94	5,30	-2,30	23,93
Var. IBOVESPA p.p.	-2,13	-2,13	-3,64	4,99	7,84	-0,87	8,78
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-5,18	-5,18	-0,55	5,46	25,48	40,50	73,01
Var. IBOVESPA p.p.	-12,17	-12,17	-8,90	13,39	28,02	41,92	57,87
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	2,99	2,99	8,53	-6,00	-16,67	-21,90	-5,87
Var. IBOVESPA p.p.	-3,99	-3,99	0,18	1,93	-14,13	-20,48	-21,01
CUBATÃO	0,59	0,59	3,12	-0,93	0,12	2,98	17,86
Var. INPC + 5,86% p.p.	-0,56	-0,56	-0,63	-9,61	-16,96	-27,73	-26,49
CDI	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90
IBOVESPA	6,98	6,98	8,35	-7,93	-2,54	-1,42	15,14
INPC + 6,00%	1,16	1,16	3,78	8,75	17,24	31,05	44,93
IPCA + 6,00%	1,03	1,03	3,76	8,77	17,00	29,59	43,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	-	2,00
4UM SMALL CAPS FIA			D+17 du	D+20 du	-	2,00
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du	-	
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,30
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,25
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BTG PACTUAL TESOUREO IPCA GERAL FI RF	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du		0,20
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	Não se aplica	Não se aplica				
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	Não se aplica	Não se aplica				
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	-	3,00
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
ITAU INDEX IBOVESPA 1	D+0	D+0	D+1 du	D+4 du		0,80
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,18
OCCAM FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+15 (isento)	D+3 du ou D+17 (isento)	-	3,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização de taxa de resgate)	Liquidação de taxa de resgate)	Performance	Administração
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32	Método Passivo.	0,00
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+0	D+0	D+3 du	D+4 du		0,30
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+2 du		1,00
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,30
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

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	0,63	0,63	2,31	2,54	3,53	7,08	14,16	22,11	34,75
IRF-M 1+	-0,50	-0,50	4,01	-1,41	-4,13	1,40	15,16	29,50	49,44
IRF-M TOTAL	-0,08	-0,08	3,63	-0,03	-1,28	3,58	15,45	27,96	45,98
IMA-B 5	0,11	0,11	3,42	3,32	4,57	12,47	26,04	38,75	56,48
IMA-B 5+	-1,61	-1,61	2,45	-4,92	-6,47	-3,03	18,62	39,06	60,95
IMA-B TOTAL	-0,73	-0,73	2,94	-0,91	-1,15	4,02	22,86	40,20	60,52
IMA-GERAL TOTAL	0,21	0,21	2,90	1,13	1,42	5,98	17,98	30,01	46,61
IDKA 2	0,05	0,05	3,41	3,29	4,87	13,47	25,98	38,94	57,36
IDKA 20	-2,92	-2,92	0,64	-12,61	-14,59	-13,99	10,19	35,73	59,77
CDI	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90	21,17	32,56

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,98	6,98	8,35	-7,93	-2,54	-1,42	15,14	32,07	73,41
IBRX 100	6,87	6,87	8,36	-9,14	-2,11	-0,51	18,37	36,58	79,96
IBRX 50	7,65	7,65	9,69	-8,20	-0,93	1,71	16,71	32,14	74,76
SMALL CAP	3,42	3,42	4,89	-17,43	-10,25	-14,29	24,49	41,16	97,42
IFIX	-0,99	-0,99	3,78	-1,67	-3,56	-9,76	15,24	21,52	43,53
Índice Consumo - ICON			-5,43	-22,83	-23,46	-26,51	5,30	5,50	37,84
Índice Dividendos - IDIV	7,47	7,47	10,17	0,27	5,96	1,18	28,50	52,53	93,40

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	0,54	0,54	2,24	5,63	10,38	15,41	20,25	24,79	28,35
INPC	0,67	0,67	2,26	5,61	10,60	16,72	21,74	26,09	28,45
IGPM	1,82	1,82	2,72	3,40	16,91	46,97	58,45	69,12	68,43
SELIC	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90	21,18	32,59

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	-9,05	-9,05	-6,91	7,47	18,94	75,67	144,98	170,90	239,48
MSCI ACWI	-8,76	-8,76	-8,61	3,62	9,17	61,14	114,25	124,36	183,76

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	0,87	3,26	7,73	14,79	24,77	35,22	45,90	55,99
IPCA + 5,00%	0,95	0,95	3,51	8,26	15,90	27,17	39,15	51,57	63,59
IPCA + 5,50%	0,99	0,99	3,64	8,51	16,45	28,37	41,14	54,46	67,50
IPCA + 5,89%	1,02	1,02	3,73	8,72	16,88	29,32	42,71	56,75	70,61
IPCA + 6,00%	1,03	1,03	3,76	8,77	17,00	29,59	43,15	57,40	71,49
INPC + 4,00%	1,00	1,00	3,28	7,71	15,02	26,18	36,90	47,41	56,11
INPC + 6,00%	1,16	1,16	3,78	8,75	17,24	31,05	44,93	59,03	71,61

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
301	04/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	6.050.000,00	0,00	2.164.009,23090000	2,7957366880
289	04/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	4.205.000,00	0,00	1.504.075,83734500	2,7957366880
281	07/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	76.000,00	27.141,95733800	2,8000928250
302	07/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	3.010.000,00	1.074.964,36301200	2,8000928250
295	07/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	178.000,00	0,00	66.259,70304400	2,6863990000
299	07/01/2022	SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	500.000,00	0,00	2.543,12981400	196,6081312000
290	07/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	561.000,00	200.350,50088100	2,8000928250
284	07/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	44.500,00	0,00	16.564,92576100	2,6863990000
287	07/01/2022	SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	500.000,00	0,00	2.543,12981400	196,6081312000
303	11/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	8.300,00	2.962,57515400	2,8016166910
291	11/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	20.000.000,00	7.138.735,31102546	2,8016166910
288	12/01/2022	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	20.000.000,00	0,00	12.068.505,38882700	1,6572060380
304	14/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	612.000,00	0,00	218.103,75499900	2,8060039590
296	14/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.000,00	2.228,76658200	2,6920720000
285	14/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.500,00	557,19160600	2,6920720000
282	19/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	16.500,00	0,00	5.875,22611100	2,8084025510
305	19/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	175.000,00	0,00	62.313,00421500	2,8084025510
300	19/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	10.832,56	0,00	3.857,19632500	2,8084025510
292	19/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	5.000,00	0,00	1.780,37154900	2,8084025510
306	21/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	88.000,00	0,00	31.289,23460000	2,8124689250
293	21/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	113.000,00	0,00	40.178,22170200	2,8124689250
307	27/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	5.000.000,00	1.777.808,25178200	2,8124517900
297	27/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	58.000,00	21.496,13004200	2,6981600000
294	27/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	208.790,00	74.237,71697800	2,8124517900
280	28/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.965,00	728,02480700	2,6990840000
298	28/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	103.520,00	38.353,75233600	2,6990840000
286	28/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.140,00	10.425,75925800	2,6990840000
283	31/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	30.510,00	0,00	10.841,14793900	2,8142776180

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
308	31/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	618.950,00	0,00	219.932,10479300	2,8142776180
Total			33.147.292,56	29.063.215,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 19.745.214,03

Value-At-Risk: 2,26%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CUBATÃO		2,26	2,26			874.885.251,54	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,34%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF		2,15	0,03	0,01			20.706.544,50	2,37
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI		2,15	0,05	0,01			28.999.159,97	3,31
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,63	0,05	0,03			142.546.646,96	16,29
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA		2,53	0,12	0,48			58.099.547,52	6,64
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,14	0,05	0,03			30.749.693,97	3,51
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		2,15	0,05	0,01			32.059.657,22	3,66
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,15	0,10	0,01			62.494.577,31	7,14
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,63	0,00	0,04			17.545,82	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,63	0,02	0,02			45.933.560,31	5,25
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS		0,63	0,00	0,02			1.062.032,88	0,12
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,22	0,02	0,10			16.118.167,22	1,84
Sub-total	2,52	1,41	0,50		-0,34	-0,12	438.787.133,68	50,15

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL		1,23	0,07	0,11			69.155.452,92	7,90
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B		2,22	0,06	0,20			33.169.952,58	3,79
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		2,19	0,06	0,07			33.455.115,90	3,82
BB PREV RF IMA-B		2,14	0,07	0,03			39.946.163,61	4,57
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,05	0,00	0,04			54.025.772,97	6,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,04	0,00	0,03			13.979.071,25	1,60
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP		1,37	0,02	1,37			18.372.664,03	2,10
Sub-total	2,34	1,28	0,27		-0,33	-0,04	262.104.193,26	29,96

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
Sub-total	0,00	NaN	0,00		0,00	0,00	0,00	0,00

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO		0,05	0,00	0,06			9.739.427,61	1,11
Sub-total	0,04	0,05	0,00		1,58	0,79	9.739.427,61	1,11

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,21%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA		10,99	0,10	4,37			8.801.179,88	1,01
4UM SMALL CAPS FIA		11,38	0,15	7,39			14.443.758,53	1,65
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA		9,15	0,19	4,67			20.381.816,91	2,33
ITAU INDEX IBOVESPA 1		10,77	0,06	8,61			5.330.097,89	0,61
OCCAM FIC FIA		10,27	0,34	2,89			36.822.894,20	4,21
GERAÇÃO FI EM AÇÕES		10,18	0,20	2,18			19.814.966,27	2,26
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA		10,87	0,31	2,26			28.043.373,20	3,21
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA		8,00	0,07	11,03			19.127.517,90	2,19
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		18,38	0,07	11,71			3.798.222,70	0,43
Sub-total	16,99	9,21	1,46		0,19	3,93	156.563.827,48	17,90

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 8,00%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		8,00	0,02	10,95			5.880.669,51	0,67
Sub-total	17,80	8,00	0,02		-0,33	-5,18	5.880.669,51	0,67

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 12,68%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS		12,68	0,01	13,98			1.810.000,00	0,21
Sub-total	31,18	12,68	0,01		0,07	2,99	1.810.000,00	0,21