



LDB
EMPRESAS

CUBATÃO
FEVEREIRO 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 25.02.2022.

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 81,51%

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	5,60	0,50	-0,26	20.810.895,67	2,36	369.209.747,10	5,64
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,59	0,53	-0,22	29.153.488,95	3,30	239.259.525,29	12,18
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,70	0,74	1,36	148.268.891,66	16,79	5.025.689.167,39	2,95
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	6,25	0,48	-0,55	58.378.032,15	6,61	487.108.509,29	11,98
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,63	0,53	-0,24	30.913.765,87	3,50	6.297.272.158,07	0,49
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,61	0,52	-0,25	32.225.090,16	3,65	586.146.541,58	5,50
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,61	0,53	-0,23	62.823.948,32	7,11	4.318.650.723,31	1,45
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,70	0,73	1,37	17.674,58	0,00	39.661.726,11	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,70	0,72	1,34	46.245.271,94	5,24	5.808.584.551,28	0,80
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,70	0,75	1,37	1.069.986,01	0,12	657.915.935,27	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,69	0,72	0,76	16.233.459,14	1,84	769.331.691,35	2,11
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,31	0,62	0,50	446.140.504,45	50,52		

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	3,05	0,69	0,89	69.633.749,93	7,89	395.363.930,40	17,61
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	5,63	0,54	-0,20	33.348.257,30	3,78	898.293.883,59	3,71
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,64	0,48	-0,28	33.616.668,79	3,81	2.339.591.507,81	1,44
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	5,64	0,55	-0,21	40.165.644,52	4,55	778.022.116,28	5,16
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,19	0,82	1,62	54.469.311,83	6,17	1.947.121.660,31	2,80
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,18	0,83	1,61	14.094.879,81	1,60	4.480.068.592,43	0,31
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	3,41	1,00	1,25	18.556.269,10	2,10	325.189.024,66	5,71

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			5,48	0,68	0,64	263.884.781,28	29,88		
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	0,80	1,60	9.817.624,36	1,11	7.176.808.911,53	0,14
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			0,49	0,80	1,60	9.817.624,36	1,11		
Renda Fixa			3,28	0,64	0,56	719.842.910,09	81,51		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

17,64%

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	17,89	0,74	7,66	8.865.957,64	1,00	1.024.930.838,04	0,87
4UM	BEM	4UM SMALL CAPS FIA	21,17	-3,99	-5,29	13.867.928,18	1,57	407.152.866,45	3,41
4UM	BEM	4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	16,44	-1,77	3,00	20.021.679,02	2,27	224.228.281,79	8,93
ITAU	ITAU	ITAU INDEX IBOVESPA 1	19,31	0,85	7,88	5.375.638,57	0,61	46.684.637,07	11,51
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	18,25	1,05	7,64	37.208.833,92	4,21	1.097.636.218,28	3,39
GERAÇÃO FUTURO	BRB	GERAÇÃO FI EM AÇÕES	18,10	0,03	5,51	19.821.240,14	2,24	262.289.613,72	7,56
ARX	BEM	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	18,33	1,00	7,97	28.323.016,86	3,21	299.494.056,41	9,46
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	14,27	-2,56	-6,81	18.637.377,83	2,11	2.257.981.164,09	0,83
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	26,96	-3,01	2,02	3.683.785,65	0,42	376.825.006,17	0,98
Sub-total Artigo 8º I			14,35	-0,48	3,43	155.805.457,81	17,64		
Renda Variável			16,71	-0,48	3,43	155.805.457,81	17,64		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,65%

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	14,20	-2,17	-7,24	5.752.938,00	0,65	1.617.262.478,88	0,36
Sub-total Artigo 10º I			14,20	-2,17	-7,24	5.752.938,00	0,65		
Investimentos Estruturados			19,59	-2,17	-7,24	5.752.938,00	0,65		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,19%

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	19,57	-5,21	-2,38	1.705.000,00	0,19	0,00	
Sub-total Artigo 11º			19,57	-5,21	-2,38	1.705.000,00	0,19		
Fundos Imobiliários			25,56	-5,21	-2,38	1.705.000,00	0,19		
Total			4,65	0,41	1,00	883.106.305,90	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	446.140.504,45	50,52					100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	263.884.781,28	29,88					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	9.817.624,36	1,11					5,00
	Total Renda Fixa	719.842.910,09	81,51					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	155.805.457,81	17,64					30,00
	Total Renda Variável	155.805.457,81	17,64					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	5.752.938,00	0,65					10,00
	Total Investimentos Estruturados	5.752.938,00	0,65					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	1.705.000,00	0,19					5,00
	Total Fundos Imobiliários	1.705.000,00	0,19					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	0,62 82,70	0,50 33,62	0,98 43,45	1,42 37,40	1,85 32,77	2.717.510,73	2.000.864,24
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,68 90,63	0,64 43,04	0,86 38,14	1,49 39,02	1,59 28,19	1.780.588,02	1.684.995,07
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,80 107,11	1,60 107,68				78.196,75	154.759,69
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,48 -1,37	3,43 -4,51				-758.369,67	5.307.485,33
Artigo 10º I % do CDI	-2,17 -289,77	-7,24 -487,06				-127.731,51	-449.301,53
Artigo 11º % do CDI	-5,21 -695,68	-2,38 -159,86				-94.200,00	-41.092,73
CUBATÃO (Total)						3.595.994,32	8.657.710,07

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	30.749.693,97	0,00	0,00	0,00	30.913.765,87	164.071,90	-73.878,31
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	142.546.646,96	6.771.325,04	-2.113.590,00	0,00	148.268.891,66	1.064.509,66	1.996.214,56
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	1.062.032,88	0,00	0,00	0,00	1.069.986,01	7.953,13	14.462,32
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	32.059.657,22	0,00	0,00	0,00	32.225.090,16	165.432,94	-80.599,57
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	20.706.544,50	0,00	0,00	0,00	20.810.895,67	104.351,17	-53.934,57
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	62.494.577,31	0,00	0,00	0,00	62.823.948,32	329.371,01	-147.408,54
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.118.167,22	0,00	0,00	0,00	16.233.459,14	115.291,92	121.731,19
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	45.933.560,31	209.300,00	-231.175,00	0,00	46.245.271,94	333.586,63	612.499,04
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	28.999.159,97	0,00	0,00	0,00	29.153.488,95	154.328,98	-63.620,41
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	58.099.547,52	0,00	0,00	0,00	58.378.032,15	278.484,63	-324.839,93
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.545,82	0,00	0,00	0,00	17.674,58	128,76	238,46
					446.140.504,45	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	39.946.163,61	0,00	0,00	0,00	40.165.644,52	219.480,91	-85.316,32
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	13.979.071,25	0,00	0,00	0,00	14.094.879,81	115.808,56	223.397,93
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	69.155.452,92	0,00	0,00	0,00	69.633.749,93	478.297,01	612.545,89
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	33.169.952,58	0,00	0,00	0,00	33.348.257,30	178.304,72	-67.427,08
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	18.372.664,03	0,00	0,00	0,00	18.556.269,10	183.605,07	229.176,27
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	33.455.115,90	0,00	0,00	0,00	33.616.668,79	161.552,89	-95.814,68
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	54.025.772,97	0,00	0,00	0,00	54.469.311,83	443.538,86	868.433,06
					263.884.781,28	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	9.739.427,61	0,00	0,00	0,00	9.817.624,36	78.196,75	154.759,69
					9.817.624,36	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	20.381.816,91	0,00	0,00	0,00	20.021.679,02	-360.137,89	582.581,25
4UM SMALL CAPS FIA	14.443.758,53	0,00	0,00	0,00	13.867.928,18	-575.830,35	-774.941,20
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	28.043.373,20	0,00	0,00	0,00	28.323.016,86	279.643,66	2.090.866,70
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	19.127.517,90	0,00	0,00	0,00	18.637.377,83	-490.140,07	-1.362.622,17
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	19.814.966,27	0,00	0,00	0,00	19.821.240,14	6.273,87	1.035.258,23
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	8.801.179,88	0,00	0,00	0,00	8.865.957,64	64.777,76	630.557,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU INDEX IBOVESPA 1	5.330.097,89	0,00	0,00	0,00	5.375.638,57	45.540,68	392.527,51
OCCAM FIC FIA	36.822.894,20	0,00	0,00	0,00	37.208.833,92	385.939,72	2.640.406,53
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	3.798.222,70	0,00	0,00	0,00	3.683.785,65	-114.437,05	72.851,01
					155.805.457,81	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	5.880.669,51	0,00	0,00	0,00	5.752.938,00	-127.731,51	-449.301,53
					5.752.938,00	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	1.810.000,00	0,00	0,00	0,00	10.800,00	1.705.000,00	-94.200,00	-41.092,73
						1.705.000,00	0,00	0,00

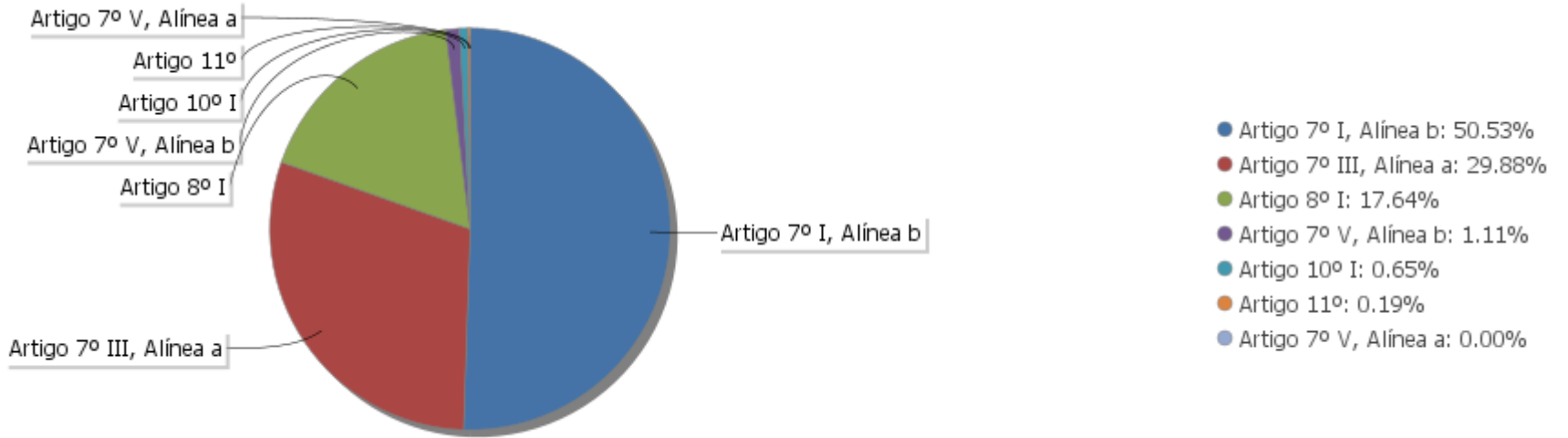
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

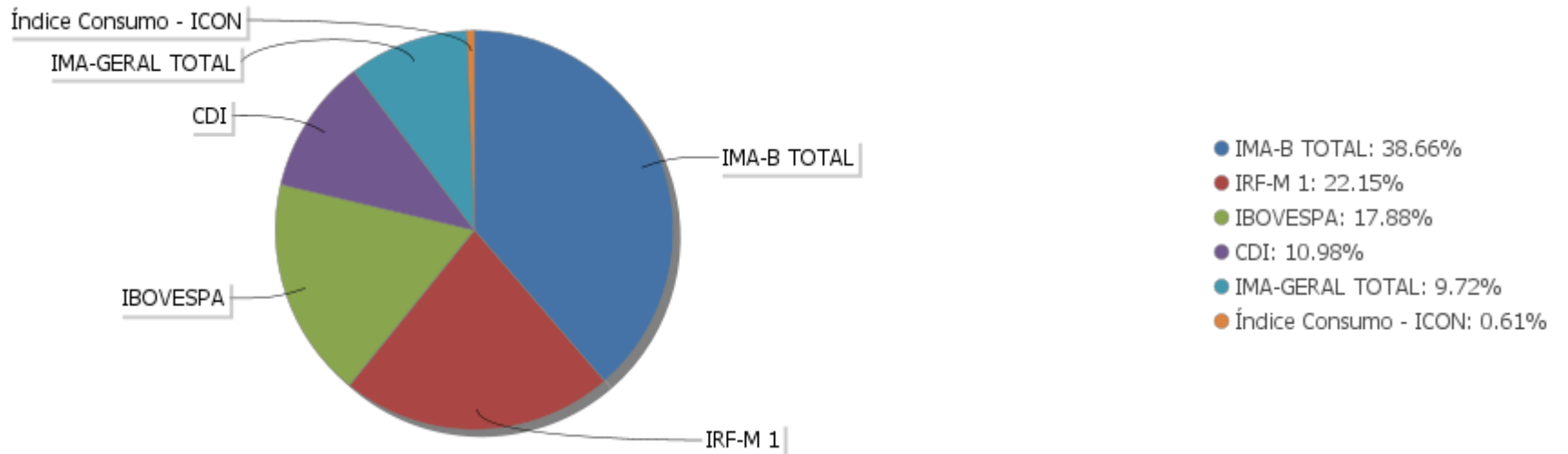
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	879.422.520,25	99,58	879.422.520,25	99,58
de 31 a 365 dias	3.683.785,65	0,42	883.106.305,90	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	883.106.305,90	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

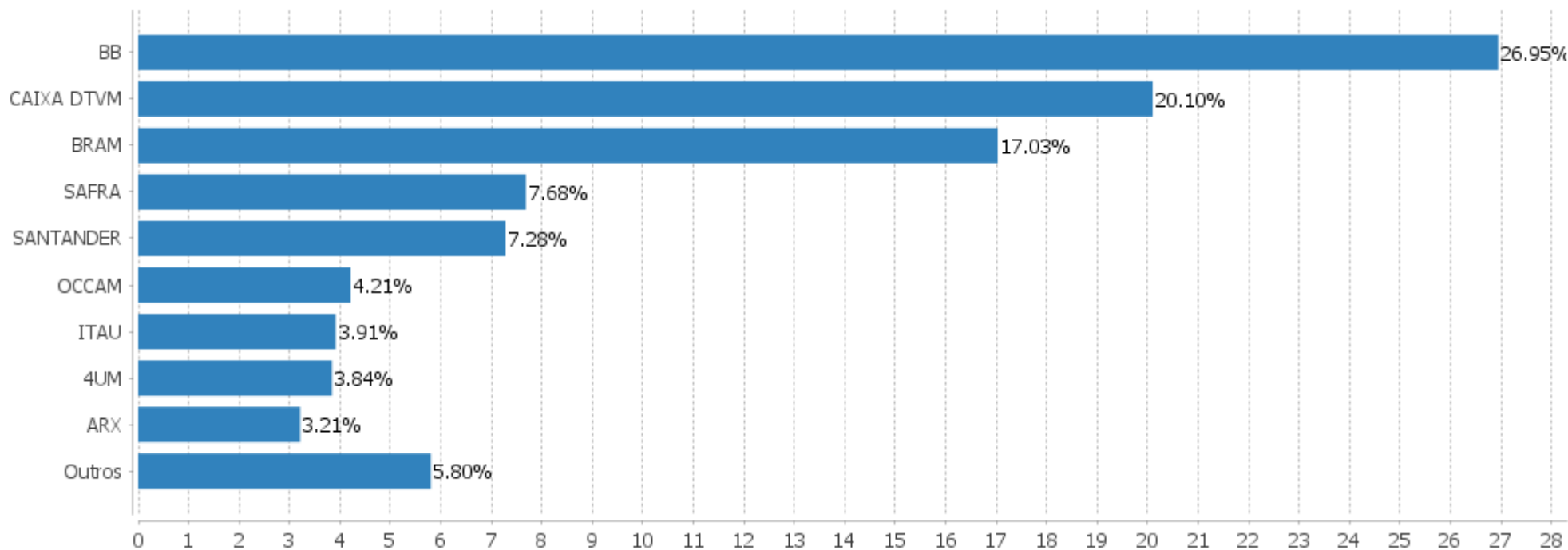


Alocação Por Estratégia



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	0,41											1,00
INPC + 5,86%	1,15	1,43											2,60
p.p. indexador	-0,56	-1,02											-1,60
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

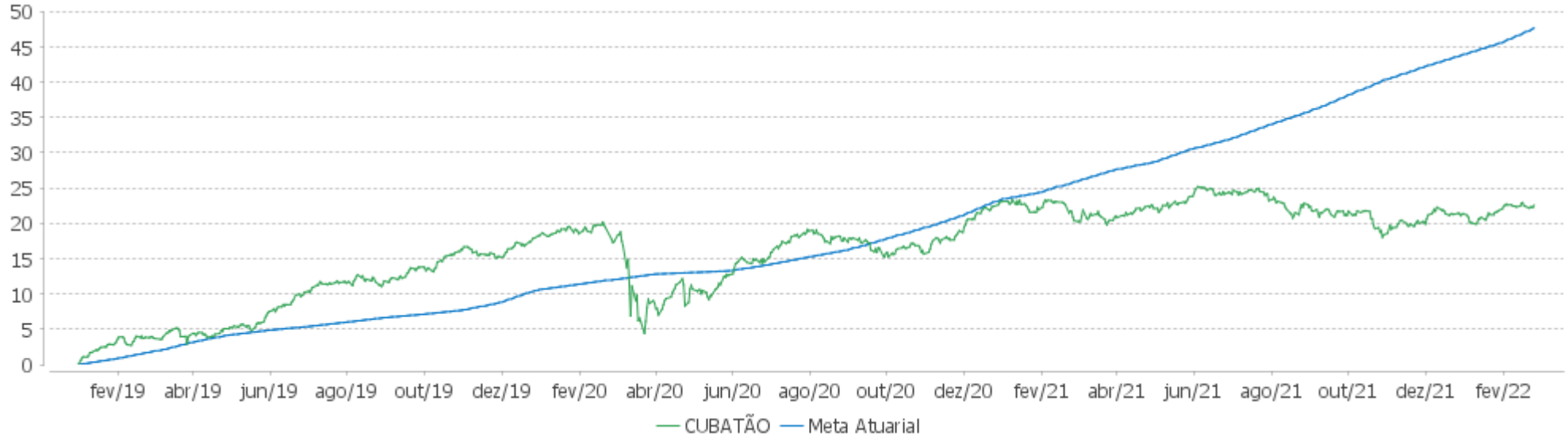
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	15	39,47	03 meses	1,96	3,89	-1,93	3,60
Meses abaixo - Meta Atuarial	23	60,53	06 meses	0,25	8,74	-8,49	4,72
			12 meses	1,83	17,32	-15,49	4,65
			24 meses	4,39	31,82	-27,44	8,32
Maior rentabilidade da Carteira	3,68	2020-12	36 meses	18,06	45,15	-27,09	7,24
Menor rentabilidade da Carteira	-7,44	2020-03	Desde 31/12/2018	22,58	47,88	-25,30	7,09

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

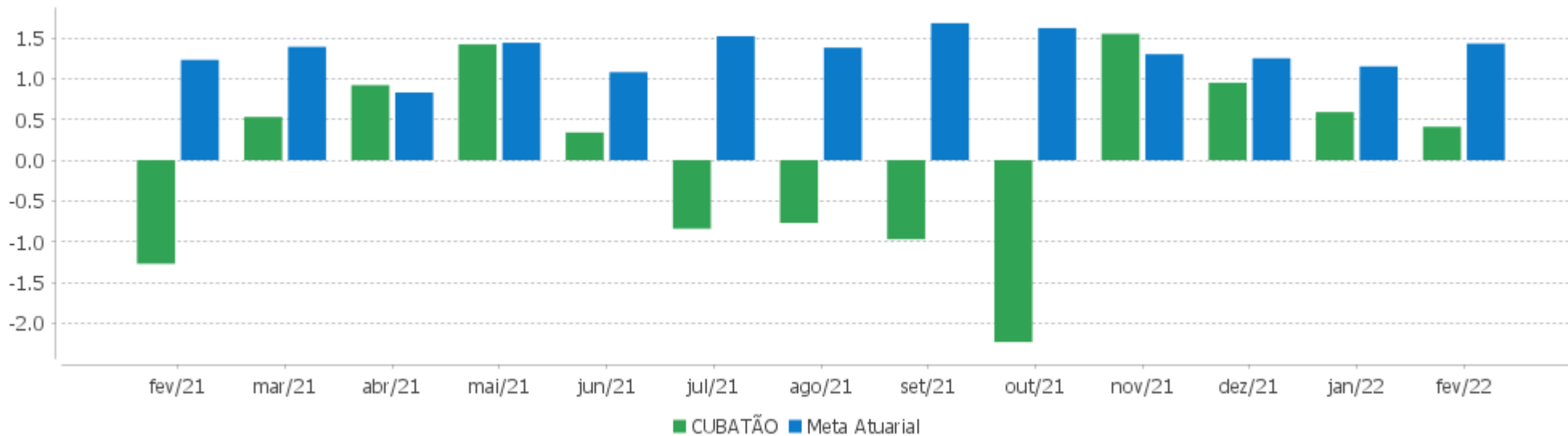


Patrimônio Líquido



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
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	0,80 107,11	1,60 107,68	2,42 107,16	4,35 114,09	7,08 125,29	8,95 109,72	14,72 103,71
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,53 -0,01	-0,22 -0,02	-0,01 -0,04	0,64 -0,09	0,71 -0,21	3,60 -0,52	21,95 -0,91
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,53 -0,02	-0,23 -0,04	-0,03 -0,06	0,61 -0,12	0,65 -0,27	3,48 -0,63	21,73 -1,13
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,75 0,00	1,37 -0,01	2,23 -0,03	2,87 -0,06	4,05 -0,21	6,86 -0,61	13,52 -0,95
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,74 -0,01	1,36 -0,02	2,21 -0,05	2,84 -0,09	4,00 -0,26	6,81 -0,65	13,48 -1,00
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,72 -0,02	1,34 -0,04	2,20 -0,07	2,83 -0,10	4,03 -0,23	7,01 -0,46	13,76 -0,71
BTG PACTUAL TESOUREO IPCA GERAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,50 -0,04	-0,26 -0,06	-0,06 -0,09	0,57 -0,16	0,56 -0,36	3,55 -0,56	21,70 -1,16
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,48 -0,07	-0,55 -0,36	-0,69 -0,72	-1,45 -2,18	-2,23 -3,16	0,18 -3,94	18,38 -4,48
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,53 -0,01	-0,24 -0,04	-0,04 -0,07	0,58 -0,15	0,65 -0,27	3,56 -0,56	21,95 -0,91
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,72 -0,03	0,76 -0,20	1,70 -0,13	2,08 -0,22	2,42 -0,46	5,00 -1,28	16,34 -1,94
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,52 -0,03	-0,25 -0,06	-0,05 -0,08	0,56 -0,17	0,56 -0,36	3,38 -0,73	21,59 -1,27
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,73 -0,01	1,37 -0,01	2,20 -0,07	2,84 -0,10	3,97 -0,29	6,51 -0,96	12,92 -1,55
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP % do CDI	1,00 133,32	1,25 84,07	1,92 84,80	3,53 92,68	4,29 75,90	10,17 124,70	22,79 160,61
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,54 -0,01	-0,20 -0,01	-0,04 -0,07	0,42 -0,31	0,20 -0,72	2,85 -1,26	21,21 -1,64
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,83 110,52	1,61 108,28	2,43 107,58	4,20 110,16	6,28 111,26	8,23 100,96	14,09 99,29
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,55 0,00	-0,21 -0,02	-0,01 -0,04	0,64 -0,09	0,73 -0,19	3,44 -0,68	21,68 -1,18
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	0,48	-0,28	-0,06	0,55	0,66	3,48	21,62

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.	-0,06	-0,09	-0,09	-0,18	-0,26	-0,64	-1,24
BRADERCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	0,69	0,89	1,68	2,00	1,97	5,77	17,78
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,05	-0,07	-0,15	-0,30	-0,91	-0,52	-0,50
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,82	1,62	2,45	4,23	6,40	8,24	14,06
% do CDI	109,53	109,17	108,23	110,98	113,30	101,03	99,09
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	-97,09
% do CDI	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	-684,13
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	0,03	5,51	7,52	-8,52	-5,98	-1,36	7,65
Var. IBOVESPA p.p.	-0,86	-2,43	-3,49	-3,77	-8,81	-9,97	-10,72
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	1,00	7,97	11,64	0,33	8,12		
Var. IBOVESPA p.p.	0,11	0,03	0,62	5,08	5,30		
4UM SMALL CAPS FIA	-3,99	-5,29	2,23	-8,95	-2,52	-3,21	35,68
Var. IBOVESPA p.p.	-4,88	-13,23	-8,78	-4,20	-5,34	-11,82	17,31
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	-3,01	2,02	5,47	-25,25	-20,89	-2,71	
Var. IBOVESPA p.p.	-3,90	-5,92	-5,55	-20,50	-23,71	-11,32	
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	-2,56	-7,83	-2,97	-1,50	17,44		
Var. IBOVESPA p.p.	-3,45	-15,77	-13,98	3,25	14,62		
ITAU INDEX IBOVESPA 1	0,85	7,88	10,98	-4,91	2,36	7,37	15,57
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	3,36		11,31	16,81	23,57	27,77	8,30
OCCAM FIC FIA	1,05	7,64	11,40	-4,03	0,33	10,91	27,43
Var. IBOVESPA p.p.	0,16	-0,30	0,38	0,72	-2,50	2,30	9,06
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	0,74	7,66	8,65	-7,65	-4,79	-14,84	3,22
Var. IBOVESPA p.p.	-0,15	-0,28	-2,36	-2,91	-7,61	-23,45	-15,15
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	-1,77	3,00	4,06	-5,92	8,87	2,35	21,76
Var. IBOVESPA p.p.	-2,66	-4,94	-6,95	-1,18	6,05	-6,26	3,39
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-2,17	-7,24	-2,21	-0,15	19,65	48,51	63,71
Var. IBOVESPA p.p.	-3,06	-15,18	-13,23	4,60	16,83	39,89	45,35
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	-5,21	-2,38	7,04	-4,04	-21,69	-24,45	-5,42
Var. IBOVESPA p.p.	-6,10	-10,31	-3,98	0,71	-24,52	-33,06	-23,79
CUBATÃO	0,41	1,00	1,96	0,25	1,83	4,39	18,06
Var. INPC + 5,86% p.p.	-1,02	-1,60	-1,93	-8,49	-15,49	-27,44	-26,93
CDI	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19
IBOVESPA	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	18,37
INPC + 6,00%	1,44	2,62	3,92	8,81	17,47	32,17	45,56
IPCA + 6,00%	1,45	2,50	3,80	8,85	17,20	30,60	43,95

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 TESOURO 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	0,74	1,38	2,27	2,93	4,26	7,47	14,48	22,35	34,40
IRF-M 1+	0,48	-0,02	2,26	0,18	-1,69	1,08	15,45	28,42	46,68
IRF-M TOTAL	0,58	0,50	2,40	1,16	0,48	3,51	15,79	27,30	43,94
IMA-B 5	1,06	1,18	1,97	4,26	6,32	12,94	26,68	39,47	55,81
IMA-B 5+	0,01	-1,60	-1,93	-2,75	-4,23	-3,33	17,98	38,31	53,22
IMA-B TOTAL	0,54	-0,19	0,03	0,73	0,92	4,12	22,86	40,19	55,41
IMA-GERAL TOTAL	0,74	0,95	1,83	2,30	2,88	6,29	18,28	30,05	44,43
IDKA 2	1,26	1,31	2,15	4,31	6,70	14,12	26,89	39,82	57,21
IDKA 20	-0,58	-3,49	-5,69	-9,10	-12,75	-14,41	8,86	34,44	45,63
CDI	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19	21,51	32,41

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	18,37	32,56	69,72
IBRX 100	1,46	8,43	11,83	-4,71	2,87	9,99	22,25	38,00	76,75
IBRX 50	1,74	9,53	13,65	-3,21	4,78	13,29	20,78	33,87	72,89
SMALL CAP	-5,19	-1,95	1,77	-18,60	-13,32	-11,41	20,21	34,33	77,03
IFIX	-1,29	-2,27	6,31	-0,32	-5,04	-7,51	12,59	18,59	35,11
Índice Consumo - ICON	-2,51		-0,33	-21,72	-21,21	-20,40	7,27	6,67	33,15
Índice Dividendos - IDIV	-2,32	4,98	6,66	-1,56	9,19	5,34	28,12	49,91	76,56

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	1,01	1,56	2,30	5,77	10,54	16,29	20,94	25,65	29,22
INPC	1,00	1,68	2,42	5,73	10,80	17,68	22,30	27,12	29,42
IGPM	1,83	3,68	4,59	4,61	16,12	49,73	59,94	72,10	71,38
SELIC	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19	21,52	32,43

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	-6,85	-15,28	-12,20	-3,13	6,92	69,56	116,47	155,90	207,13
MSCI ACWI	-6,59	-14,77	-12,07	-5,84	-1,21	55,63	90,73	113,55	160,11

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,31	2,19	3,30	7,83	14,98	25,74	35,98	46,92	57,07
IPCA + 5,00%	1,38	2,35	3,55	8,34	16,09	28,16	39,93	52,64	64,73
IPCA + 5,50%	1,42	2,42	3,68	8,60	16,65	29,37	41,93	55,56	68,67
IPCA + 5,89%	1,45	2,48	3,77	8,79	17,08	30,33	43,50	57,86	71,80
IPCA + 6,00%	1,45	2,50	3,80	8,85	17,20	30,60	43,95	58,52	72,69
INPC + 4,00%	1,30	2,31	3,43	7,79	15,25	27,25	37,51	48,64	57,31
INPC + 6,00%	1,44	2,62	3,92	8,81	17,47	32,17	45,56	60,37	72,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
331	03/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	675.000,00	0,00	239.159,52963600	2,8223838750
325	03/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	162.000,00	0,00	59.829,55225300	2,7076920000
312	03/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	75.000,00	26.573,28107100	2,8223838750
309	03/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.300,00	0,00	1.588,06836200	2,7076920000
319	03/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.076.000,00	0,00	735.548,42003900	2,8223838750
316	03/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	43.000,00	0,00	15.880,68362200	2,7076920000
320	07/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	947.300,00	0,00	335.416,82369500	2,8242471250
326	08/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	38.000,00	14.029,37238500	2,7086030000
310	08/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	865,00	319,35287300	2,7086030000
317	08/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.870,00	2.905,55684979	2,7086030000
332	14/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	10.000,00	3.541,51484400	2,8236504550
321	15/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	614.000,00	0,00	217.263,54186200	2,8260608970
333	16/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	1.883.600,00	666.197,49353300	2,8273898030
334	18/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	175.000,00	0,00	61.838,99164400	2,8299297150
313	18/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	16.000,00	0,00	5.653,85066400	2,8299297150
322	18/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	305.000,00	0,00	107.776,52829400	2,8299297150
330	23/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	10.775,04	0,00	3.802,21556200	2,8338845660
327	23/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	60.000,00	22.071,84749300	2,7183950000
323	23/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	82.590,00	29.143,74177100	2,8338845660
335	24/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.279.100,00	0,00	451.314,65367000	2,8341645670
329	24/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	780,00	286,90572300	2,7186630000
328	24/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	94.360,00	34.708,23601000	2,7186630000
314	24/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	113.900,00	0,00	40.188,20972000	2,8341645670
311	24/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.000,00	1.103,48363500	2,7186630000
318	24/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	26.300,00	9.673,87278232	2,7186630000
336	25/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	557.340,00	0,00	196.590,96445800	2,8350234790
315	25/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.910,00	0,00	673,71576000	2,8350234790
324	25/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	62.400,00	22.010,39972400	2,8350234790

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
	Total		6.980.625,04	2.344.765,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 17.842.823,20

Value-At-Risk: 2,02%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CUBATÃO		2,02	2,02			883.106.305,90	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,31%

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		2,14	0,03	0,01			20.810.895,67	2,36
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI		2,13	0,05	0,00			29.153.488,95	3,30
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,57	0,06	0,02			148.268.891,66	16,79
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA		2,35	0,11	0,34			58.378.032,15	6,61
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,14	0,05	0,02			30.913.765,87	3,50
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		2,13	0,05	0,01			32.225.090,16	3,65
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,15	0,11	0,03			62.823.948,32	7,11
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,57	0,00	0,03			17.674,58	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,57	0,02	0,02			46.245.271,94	5,24
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS		0,57	0,00	0,01			1.069.986,01	0,12
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,21	0,02	0,10			16.233.459,14	1,84
Sub-total	2,28	1,37	0,50		-0,06	0,62	446.140.504,45	50,52

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		1,22	0,07	0,11			69.633.749,93	7,89
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B		2,13	0,06	0,16			33.348.257,30	3,78
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		2,19	0,06	0,08			33.616.668,79	3,81
BB PREV RF IMA-B		2,12	0,07	0,03			40.165.644,52	4,55
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,05	0,00	0,04			54.469.311,83	6,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,05	-0,00	0,03			14.094.879,81	1,60
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP		1,35	0,02	1,35			18.556.269,10	2,10
Sub-total	2,13	1,27	0,27		-0,03	0,68	263.884.781,28	29,88

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	0,05			9.817.624,36	1,11
Sub-total	0,04	0,05	-0,00		1,20	0,80	9.817.624,36	1,11

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,09%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA		10,14	0,09	4,52			8.865.957,64	1,00
4UM SMALL CAPS FIA		11,22	0,13	7,90			13.867.928,18	1,57
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA		8,09	0,15	5,00			20.021.679,02	2,27
ITAU INDEX IBOVESPA 1		9,79	0,05	9,47			5.375.638,57	0,61
OCCAM FIC FIA		8,15	0,25	3,25			37.208.833,92	4,21
GERAÇÃO FI EM AÇÕES		9,01	0,16	2,27			19.821.240,14	2,24
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA		10,19	0,28	2,40			28.323.016,86	3,21
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA		8,83	0,07	11,35			18.637.377,83	2,11
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		18,66	0,06	12,60			3.683.785,65	0,42
Sub-total	10,91	8,09	1,23		-0,11	-0,48	155.805.457,81	17,64

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 8,59%

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		8,59	0,02	11,17			5.752.938,00	0,65
Sub-total	21,85	8,59	0,02		-0,13	-2,17	5.752.938,00	0,65

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 13,06%

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		13,06	0,01	13,19			1.705.000,00	0,19
Sub-total	17,61	13,06	0,01		-0,34	-5,21	1.705.000,00	0,19