



LDB
EMPRESAS

CUBATÃO
SETEMBRO 2022



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 30.09.2022.

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 83,33%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	6,55	0,53	1,18	0,50	73.734.106,61	7,80	686.647.428,69	10,74
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,20	0,11	0,49	1,31	33.421.831,90	3,53	2.902.138.561,58	1,15
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOUREO IPCA GERAL FI RF	5,46	0,56	1,47	5,87	22.088.807,87	2,34	384.205.865,89	5,75
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,45	0,56	1,46	5,95	30.954.535,04	3,27	234.933.424,23	13,18
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,73	0,05	1,09	8,39	43.438.091,92	4,59	6.071.749.354,31	0,72
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	5,85	0,44	1,34	5,33	61.834.270,10	6,54	357.276.654,08	17,31
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,46	0,55	1,45	5,92	32.821.506,30	3,47	5.858.339.074,80	0,56
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,46	0,56	1,45	5,84	34.192.652,12	3,62	539.353.622,97	6,34
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,49	0,56	1,50	6,09	66.804.154,66	7,06	3.871.147.074,69	1,73
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,72	0,05	1,08	8,27	18.878,33	0,00	40.253.270,05	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,72	0,05	1,09	8,39	17.236.935,48	1,82	5.416.816.231,94	0,32
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,73	0,05	1,10	8,42	1.144.377,88	0,12	538.088.084,67	0,21
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,68	0,26	1,28	7,52	17.323.401,01	1,83	523.329.450,42	3,31
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	3,01	0,11	0,49	0,04	130.296.240,14	13,78	2.223.594.947,35	5,86
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,44	0,35	1,08	5,76	565.309.789,36	59,77		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	5,41	0,54	1,46	5,92	35.394.063,06	3,74	606.861.076,05	5,83
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,57	0,57	1,52	6,08	35.761.577,64	3,78	1.761.108.354,50	2,03
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	5,50	0,56	1,45	5,87	42.614.998,81	4,51	730.227.548,87	5,84
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,14	0,05	1,12	9,30	63.602.358,94	6,72	2.713.701.445,40	2,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BRAM	BRASESCO	BRASESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,14	0,05	1,12	9,35	15.168.538,20	1,60	7.044.059.635,23	0,22
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	2,67	0,12	0,54	7,38	19.680.186,59	2,08	271.755.834,22	7,24
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			4,17	0,33	1,26	7,30	212.221.723,24	22,44		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	0,17	0,05	1,17	9,68	10.597.878,00	1,12	6.058.322.129,98	0,17
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			0,17	0,05	1,17	9,68	10.597.878,00	1,12		
Renda Fixa			3,28	0,34	1,13	6,34	788.129.390,60	83,33		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

15,95%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	18,55	1,94	0,48	4,90	8.639.102,81	0,91	921.258.829,17	0,94
4UM	BEM	4UM SMALL CAPS FIA	24,75	1,43	-0,08	-3,85	14.079.843,85	1,49	349.712.307,82	4,03
4UM	BEM	4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	16,54	1,42	-0,83	7,02	20.804.067,38	2,20	196.994.662,59	10,56
ITAU	ITAU	ITAU INDEX IBOVESPA 1	19,98	2,20	0,43	4,75	5.220.046,50	0,55	41.557.671,74	12,56
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	18,57	1,86	-0,13	6,17	36.701.763,17	3,88	989.847.865,28	3,71
PLURAL	BEM	PLURAL AÇÕES FIC FIIA	18,63	1,98	1,40	3,24	19.393.807,71	2,05	302.844.288,34	6,40
ARX	BEM	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	19,21	1,45	-0,75	0,13	26.266.748,99	2,78	306.343.577,94	8,57
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	21,83	-1,32	-8,03	-19,27	16.145.263,24	1,71	1.316.041.552,71	1,23
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	30,69	2,21	0,73	-0,25	3.601.852,70	0,38	237.020.075,64	1,52
Sub-total Artigo 8º I			17,12	1,38	-0,97	0,14	150.852.496,35	15,95		
Renda Variável			17,74	1,38	-0,97	0,14	150.852.496,35	15,95		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,53%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	21,77	-1,32	-8,56	-19,58	4.987.660,60	0,53	706.287.111,00	0,71
Sub-total Artigo 10º I			21,77	-1,32	-8,56	-19,58	4.987.660,60	0,53		
Investimentos Estruturados			23,58	-1,32	-8,56	-19,58	4.987.660,60	0,53		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,19%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	18,82	0,11	0,46	6,49	1.792.000,00	0,19	0,00	
Sub-total Artigo 11º			18,82	0,11	0,46	6,49	1.792.000,00	0,19		
Fundos Imobiliários			17,04	0,11	0,46	6,49	1.792.000,00	0,19		
Total			4,76	0,49	0,73	5,10	945.761.547,55	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	565.309.789,36	59,77	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	212.221.723,24	22,44	0,00	4,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	10.597.878,00	1,12	0,00	1,50	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	788.129.390,60	83,33					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	150.852.496,35	15,95	0,00	20,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	150.852.496,35	15,95					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	4.987.660,60	0,53	0,00	9,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	4.987.660,60	0,53					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	1.792.000,00	0,19	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	1.792.000,00	0,19					5,00
Total		945.761.547,55	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,08 101,02	5,76 64,83	1,41 42,51	3,16 50,05	6,72 61,66	6.047.758,64	26.472.023,66
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,26 117,22	7,30 82,06	2,38 71,88	4,44 70,27	8,35 76,66	2.633.721,69	18.617.052,72
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,17 109,61	9,68 108,84	3,53 106,51	6,87 108,89		123.076,85	935.013,33
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,97 -1,44	0,14 -4,84	9,90 -1,76	-7,58 0,72		-1.483.503,49	354.523,87
Artigo 10º I % do CDI	-8,56 -798,39	-19,58 -220,27	-2,60 -78,41	-17,10 -270,85		-466.830,96	-1.214.578,93
Artigo 11º % do CDI	0,46 42,78	6,49 73,02	13,79 416,48	10,16 160,99		8.200,00	108.407,27
CUBATÃO (Total)						6.862.422,73	45.272.441,92

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	32.352.253,34	0,00	0,00	0,00	32.821.506,30	469.252,96	1.833.862,12
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	40.320.291,15	4.416.625,13	-1.754.370,00	0,00	43.438.091,92	455.545,64	7.690.165,59
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	129.666.968,13	0,00	0,00	0,00	130.296.240,14	629.272,01	70.124,58
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	1.131.963,48	0,00	0,00	0,00	1.144.377,88	12.414,40	88.854,19
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	33.702.921,22	0,00	0,00	0,00	34.192.652,12	489.730,90	1.886.962,39
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	21.768.475,62	0,00	0,00	0,00	22.088.807,87	320.332,25	1.223.977,63
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.259.549,92	0,00	0,00	0,00	33.421.831,90	162.281,98	448.248,08
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	72.874.580,34	0,00	0,00	0,00	73.734.106,61	859.526,27	368.520,92
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	65.819.208,40	0,00	0,00	0,00	66.804.154,66	984.946,26	3.832.797,80
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	17.104.225,66	0,00	0,00	0,00	17.323.401,01	219.175,35	1.211.673,06
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.138.491,19	1.194.000,00	-281.280,00	0,00	17.236.935,48	185.724,29	2.946.571,39
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	30.510.063,87	0,00	0,00	0,00	30.954.535,04	444.471,17	1.737.425,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	61.019.386,96	0,00	0,00	0,00	61.834.270,10	814.883,14	3.131.398,02
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.676,31	0,00	0,00	0,00	18.878,33	202,02	1.442,21
					565.309.789,36	6.047.758,64	

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	42.005.302,02	0,00	0,00	0,00	42.614.998,81	609.696,79	2.364.037,97
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	15.001.267,64	0,00	0,00	0,00	15.168.538,20	167.270,56	1.297.056,32
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	34.883.228,59	0,00	0,00	0,00	35.394.063,06	510.834,47	1.978.378,68
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	19.574.727,64	0,00	0,00	0,00	19.680.186,59	105.458,95	1.353.093,76
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	35.225.624,65	0,00	0,00	0,00	35.761.577,64	535.952,99	2.049.094,17
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	62.897.851,01	0,00	0,00	0,00	63.602.358,94	704.507,93	5.231.010,17
					212.221.723,24	2.633.721,69	

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	10.474.801,15	0,00	0,00	0,00	10.597.878,00	123.076,85	935.013,33
					10.597.878,00	123.076,85	

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	20.978.578,81	0,00	0,00	0,00	20.804.067,38	-174.511,43	1.364.969,61
4UM SMALL CAPS FIA	14.091.596,55	0,00	0,00	0,00	14.079.843,85	-11.752,70	-563.025,53
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	26.464.615,31	0,00	0,00	0,00	26.266.748,99	-197.866,32	34.598,83
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	17.555.236,06	0,00	0,00	0,00	16.145.263,24	-1.409.972,82	-3.854.736,76
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	8.598.051,89	0,00	0,00	0,00	8.639.102,81	41.050,92	403.702,64
ITAU INDEX IBOVESPA 1	5.197.598,41	0,00	0,00	0,00	5.220.046,50	22.448,09	236.935,44
OCCAM FIC FIA	36.748.127,28	0,00	0,00	0,00	36.701.763,17	-46.364,11	2.133.335,78
PLURAL AÇÕES FIC FIA	19.126.616,84	0,00	0,00	0,00	19.393.807,71	267.190,87	607.825,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	3.575.578,69	0,00	0,00	0,00	3.601.852,70	26.274,01	-9.081,94
					150.852.496,35	-1.483.503,49	

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	5.454.491,56	0,00	0,00	0,00	4.987.660,60	-466.830,96	-1.214.578,93
					4.987.660,60	-466.830,96	

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	1.795.000,00	0,00	0,00	0,00	11.200,00	1.792.000,00	8.200,00	108.407,27
						1.792.000,00	8.200,00	

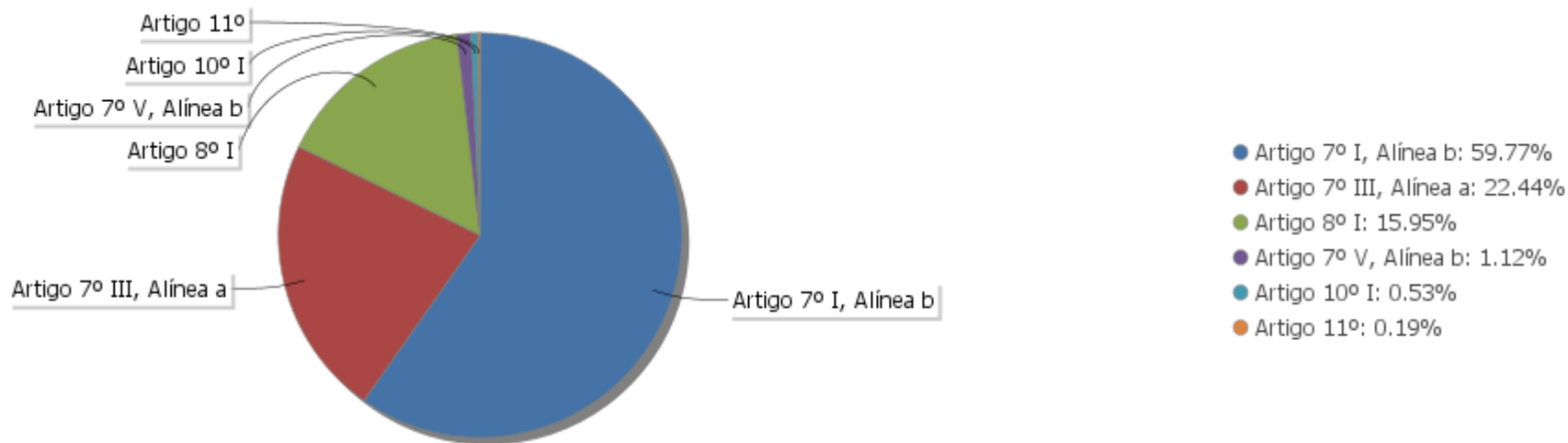
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

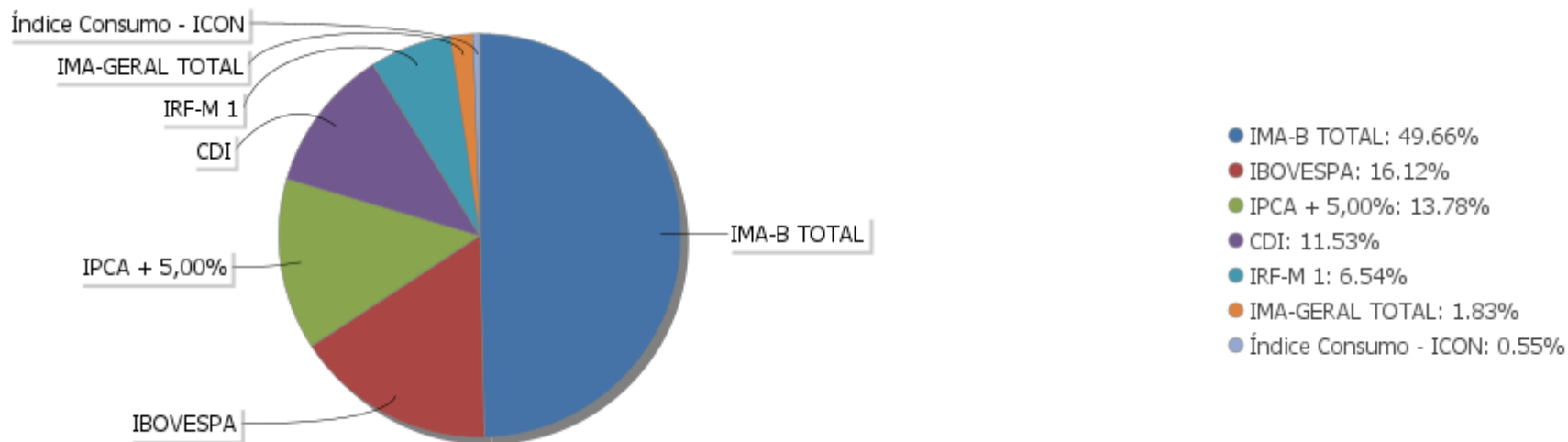
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	704.707.516,20	74,51	704.707.516,20	74,51	
de 31 dias a 365 dias	3.601.852,70	0,38	708.309.368,90	74,89	
acima de 365 dias	237.452.178,65	25,11	945.761.547,55	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

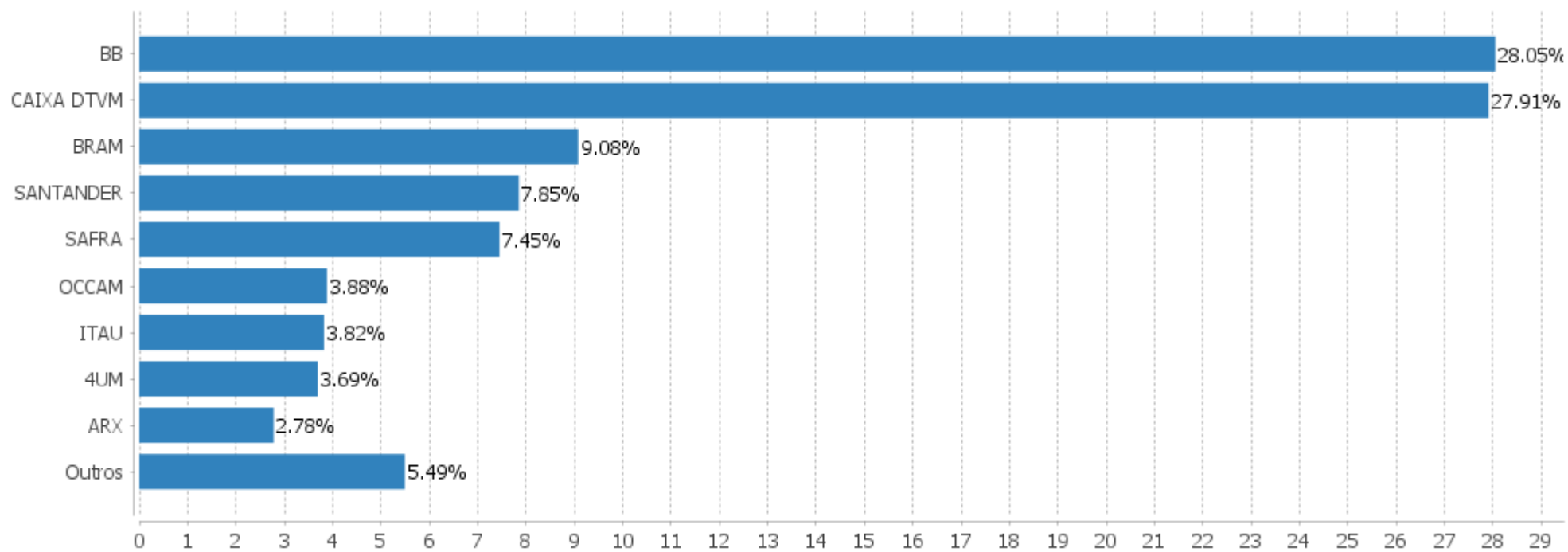


Alocação Por Estratégia



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	2,52	-0,97	1,09	-1,55	0,64	1,58	0,73				5,10
INPC + 5,45%	1,12	1,40	2,18	1,45	0,92	1,07	-0,16	0,17	0,12				8,55
p.p. indexador	-0,53	-0,99	0,33	-2,41	0,18	-2,61	0,79	1,41	0,61				-3,45
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	20	44,44	03 meses	2,98	0,14	2,84	4,99
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	55,56	06 meses	1,50	3,61	-2,11	4,78
			12 meses	5,34	13,14	-7,81	4,76
			24 meses	10,22	32,66	-22,43	4,74
			36 meses	12,07	45,94	-33,87	7,30
Maior rentabilidade da Carteira	3,68	2020-12	Desde 31/12/2018	27,55	56,47	-28,91	6,79
Menor rentabilidade da Carteira	-7,44	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

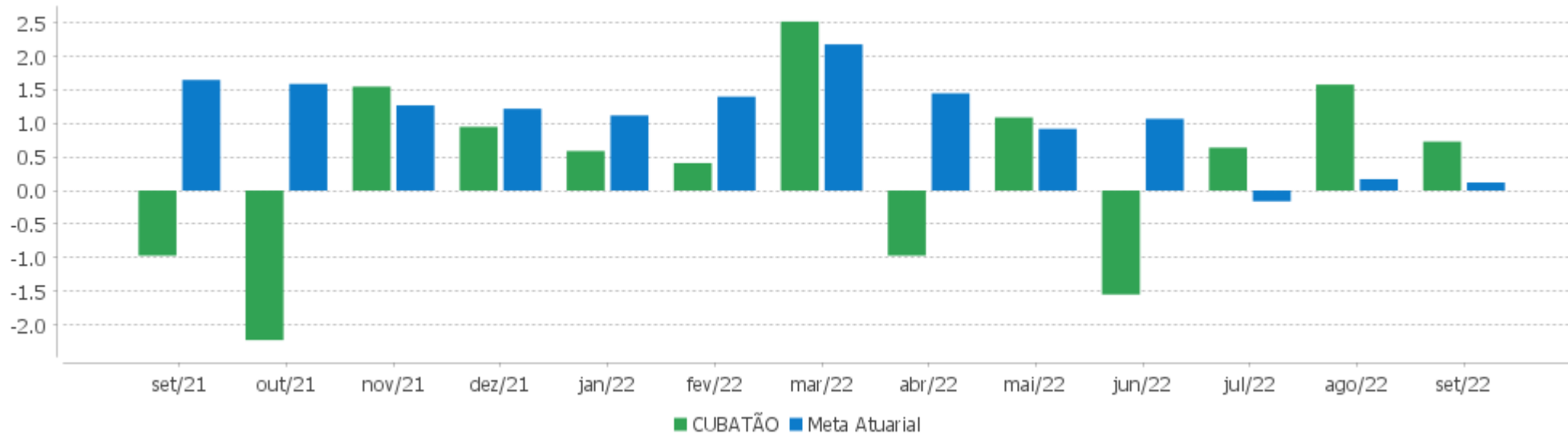


Patrimônio Líquido



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
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	1,17 109,61	9,68 108,84	3,53 106,51	6,87 108,89	12,00 110,10	16,87 118,72	19,58 107,15
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,50 0,02	6,09 -0,03	1,76 0,06	3,18 0,02	7,15 -0,10	11,91 -0,38	13,79 -0,88
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,09 -0,03	8,39 -0,21	3,37 -0,06	6,02 -0,16	9,57 -0,24	11,94 -0,61	16,61 -1,05
BTG PACTUAL TESOIRO IPCA GERAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,47 -0,01	5,87 -0,25	1,63 -0,07	3,00 -0,16	6,92 -0,32	11,57 -0,73	13,69 -0,97
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,49 0,37	5,73 -1,46	-0,02 0,06	2,35 -1,02			
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,34 -0,14	5,33 -0,79	1,70 -0,00	2,88 -0,28	5,04 -2,21	7,36 -4,94	10,46 -4,21
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	1,28 0,02	7,52 -0,28	3,19 0,02	5,08 -0,05	8,95 -0,29	10,96 -0,98	15,18 -1,63
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,45 -0,03	5,84 -0,28	1,62 -0,08	2,98 -0,17	6,87 -0,38	11,51 -0,79	13,49 -1,18
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,08 -0,03	8,27 -0,32	3,35 -0,08	5,92 -0,25	9,45 -0,37	11,83 -0,73	16,05 -1,61
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,46 -0,02	5,95 -0,17	1,64 -0,06	3,04 -0,12	7,02 -0,23	11,76 -0,54	13,84 -0,83
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	1,10 -0,02	8,42 -0,17	3,38 -0,05	6,03 -0,15	9,59 -0,22	12,05 -0,51	16,68 -0,98
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,49 -0,99	6,18 0,06	0,00 -1,70	2,38 -0,78	8,34 1,09	13,62 1,32	22,33 7,67
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,18 -0,30	5,60 -0,52	1,08 -0,62	3,02 -0,14	7,87 0,62	11,04 -1,26	14,10 -0,57
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,09 -0,02	8,39 -0,20	3,37 -0,07	6,04 -0,13	9,57 -0,25	12,03 -0,52	16,89 -0,78
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,45 -0,03	5,92 -0,20	1,63 -0,07	3,07 -0,09	6,95 -0,30	11,76 -0,54	13,80 -0,87
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP % do CDI	0,54 50,26	7,38 83,04	0,82 24,66	3,50 55,47	9,02 82,81	13,44 94,59	21,09 115,42
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	1,46	5,92	1,64	3,02	6,80	10,85	13,10

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.	-0,01	-0,20	-0,06	-0,14	-0,45	-1,45	-1,56
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,12 104,02	9,35 105,17	3,44 103,94	6,62 104,79	11,58 106,31	15,22 107,12	18,56 101,56
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,45 -0,03	5,87 -0,25	1,55 -0,15	2,93 -0,22	6,92 -0,33	11,66 -0,64	13,57 -1,10
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,52 0,04	6,08 -0,04	1,80 0,10	3,22 0,06	7,12 -0,12	11,91 -0,38	13,85 -0,82
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	1,12 104,49	9,30 104,59	3,41 103,01	6,53 103,43	11,54 105,92	15,48 108,94	18,47 101,05
PLURAL AÇÕES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,40 0,93	3,24 -1,74	14,12 2,45	-6,09 2,21	-4,39 -3,54	5,65 -10,66	-4,68 -9,73
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,75 -1,22	0,13 -4,84	10,37 -1,29	-11,83 -3,52	-3,48 -2,63		
4UM SMALL CAPS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,08 -0,55	-3,85 -8,82	15,44 3,77	-1,41 6,89	-2,01 -1,16	12,25 -4,06	13,72 8,67
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,73 0,27	-0,25 -5,23	16,08 4,41	-8,56 -0,26	-19,74 -18,89	-9,26 -25,57	-2,23 -7,28
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA Var. IBOVESPA p.p.	-8,03 -8,50	-20,16 -25,13	-2,85 -14,51	-17,28 -8,98	-10,39 -9,54	15,59 -0,73	
ITAU INDEX IBOVESPA 1 Var. Índice Consumo - ICON p.p.	0,43 1,61	4,75 18,24	11,58 -3,50	-8,41 9,51	-1,11 26,66	15,31 44,28	3,49 33,20
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,13 -0,60	6,17 1,20	10,62 -1,05	-5,02 3,28	1,71 2,56	13,78 -2,54	7,08 2,02
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,48 0,01	4,90 -0,07	10,25 -1,42	-7,39 0,91	-3,65 -2,80	3,03 -13,28	-14,57 -19,62
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,83 -1,30	7,02 2,05	10,32 -1,34	-2,68 5,62	3,08 3,93	26,67 10,35	14,77 9,72
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-8,56 -9,03	-19,58 -24,56	-2,60 -14,26	-17,10 -8,80	-9,29 -8,44	18,31 2,00	30,09 25,04
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS Var. IBOVESPA p.p.	0,46 -0,01	6,49 1,52	13,79 2,12	10,16 18,47	4,68 5,53	-11,80 -28,12	-8,57 -13,63
CUBATÃO Var. INPC + 5,45% p.p.	0,73 0,61	5,10 -3,45	2,98 2,84	1,50 -2,11	5,34 -7,70	10,22 -21,79	12,07 -32,56
CDI	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28
IBOVESPA	0,47	4,97	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
INPC + 6,00%	0,17	8,98	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90
IPCA + 6,00%	0,20	8,74	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10

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
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
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 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 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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
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
PLURAL AÇÕES FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	-	3,00
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 RF REF 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	1,11	8,59	3,43	6,17	9,81	12,55	17,67	26,42	34,96
IRF-M 1+	1,58	6,25	5,47	5,41	7,24	3,87	11,78	35,04	42,24
IRF-M TOTAL	1,40	6,96	4,66	5,53	8,01	6,91	13,92	33,10	40,74
IMA-B 5	0,42	7,07	0,43	3,14	9,25	15,75	24,13	43,24	52,60
IMA-B 5+	2,39	5,10	3,01	3,14	5,19	8,56	6,75	54,62	53,36
IMA-B TOTAL	1,48	6,12	1,70	3,16	7,25	12,30	14,67	50,64	54,48
IMA-GERAL TOTAL	1,26	7,80	3,17	5,13	9,24	11,95	16,81	36,41	43,76
IDKA 2	0,62	6,94	0,09	2,94	8,91	15,68	24,94	40,99	52,99
IDKA 20	5,00	3,97	6,75	3,59	0,98	3,03	-6,12	61,55	50,87
CDI	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,07

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,47	4,97	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05	38,69	48,11
IBRX 100	-0,05	4,43	10,77	-9,10	-1,33	16,26	6,28	43,30	51,68
IBRX 50	0,48	5,31	11,70	-8,80	0,58	19,15	7,21	38,32	48,42
SMALL CAP	-1,84	-8,06	14,47	-13,82	-18,43	-5,58	-7,27	45,86	34,71
Índice Consumo - ICON	-1,18	-13,48	15,08	-17,92	-27,77	-28,97	-29,71	8,70	-9,15
Índice Dividendos - IDIV	-1,80	9,21	4,42	-5,43	7,21	28,20	15,63	76,72	67,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-5,36	-27,11	-2,23	-9,68	-17,26	2,19	56,39	66,16	142,89

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,49	6,63	6,98	7,58	10,13	7,01	11,42	40,10	34,66

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-5,78	-28,97	-4,29	-11,25	-22,48	-6,15	37,99	42,53	93,97

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,29	4,09	-1,32	0,86	7,17	18,15	21,85	25,38	31,05
INPC	-0,32	4,32	-1,23	0,87	7,19	18,75	23,37	26,97	32,02
IGPM	-0,95	6,61	-1,43	1,07	8,25	35,16	59,40	64,77	81,31
SELIC	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,08

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,04	7,20	-0,32	2,87	11,46	27,77	37,05	46,63	59,32
IPCA + 5,00%	0,12	7,97	-0,07	3,37	12,53	30,23	41,03	52,34	67,10
IPCA + 5,50%	0,16	8,35	0,05	3,62	13,06	31,48	43,06	55,26	71,10
IPCA + 5,89%	0,19	8,65	0,14	3,81	13,48	32,45	44,65	57,56	74,27
IPCA + 6,00%	0,20	8,74	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10	58,22	75,18
INPC + 4,00%	0,01	7,43	-0,22	2,89	11,48	28,42	38,75	48,49	60,50
INPC + 6,00%	0,17	8,98	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90	60,23	76,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
515	06/09/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	123.000,00	40.936,90848700	3,0046235670
513	06/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	45.000,00	0,00	15.610,13811868	2,8827419500
539	06/09/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	534.000,00	0,00	177.726,09050400	3,0046235670
519	06/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	348.000,00	0,00	120.718,40145100	2,8827419500
533	06/09/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.820.000,00	0,00	605.733,11744900	3,0046235670
529	06/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	801.000,00	0,00	277.860,45851200	2,8827419500
525	09/09/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	1.180.000,00	392.263,76042100	3,0081800030
520	09/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	38.000,00	13.166,24916800	2,8861671500
530	09/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.000,00	3.464,80277000	2,8861671500
521	15/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.700,00	1.279,94326900	2,8907530800
531	15/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.000,00	691,86120100	2,8907530800
534	16/09/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	663.000,00	0,00	219.951,47467700	3,0143012270
518	19/09/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.175,13	0,00	3.705,25993400	3,0160178230
535	19/09/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	340.000,00	0,00	112.731,42930600	3,0160178230
516	22/09/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	17.000,00	0,00	5.624,58155000	3,0224470650
526	22/09/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	290.000,00	0,00	95.948,74410100	3,0224470650
536	22/09/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	115.000,00	0,00	38.048,63990200	3,0224470650
522	28/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	80.000,00	27.533,40598800	2,9055612900
537	28/09/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	326.000,00	107.646,18940300	3,0284397600
517	29/09/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	118.020,00	0,00	38.949,96808000	3,0300409940
514	29/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.600,00	1.238,34415018	2,9071078500
527	29/09/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	508.430,00	0,00	167.796,40968700	3,0300409940
523	29/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	112.710,00	38.770,50369600	2,9071069307
538	29/09/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	59.580,00	19.663,10030700	3,0300409940
532	29/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	31.270,00	10.756,39488700	2,9071078500
528	30/09/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	65.790,00	21.701,03622200	3,0316524670
Total			5.610.625,13	2.035.650,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 22.705.040,11

Value-At-Risk: 2,40%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CUBATÃO		2,40	2,40			945.761.547,55	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,73%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF		2,87	0,18	0,80			73.734.106,61	7,80
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,60	0,04	1,52			33.421.831,90	3,53
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF		2,46	0,05	0,07			22.088.807,87	2,34
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI		2,42	0,06	0,01			30.954.535,04	3,27
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,18	0,00	0,01			43.438.091,92	4,59
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA		2,58	0,14	0,30			61.834.270,10	6,54
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,44	0,07	0,05			32.821.506,30	3,47
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		2,44	0,07	0,02			34.192.652,12	3,62
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,46	0,14	0,06			66.804.154,66	7,06
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,18	0,00	0,01			18.878,33	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,17	0,00	0,01			17.236.935,48	1,82
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS		0,18	0,00	0,01			1.144.377,88	0,12
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,14	0,02	0,05			17.323.401,01	1,83
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,60	0,15	1,60			130.296.240,14	13,78
Sub-total	3,83	1,89	0,93		0,00	1,08	565.309.789,36	59,77

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B		2,37	0,07	0,20			35.394.063,06	3,74
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		2,51	0,08	0,11			35.761.577,64	3,78

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA-B		2,46	0,09	0,07			42.614.998,81	4,51
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,01	-0,00	0,01			63.602.358,94	6,72
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,01	0,00	0,01			15.168.538,20	1,60
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP		1,03	0,02	1,03			19.680.186,59	2,08
Sub-total	2,98	1,39	0,26		0,06	1,26	212.221.723,24	22,44

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		0,02	-0,00	0,02			10.597.878,00	1,12
Sub-total	0,07	0,02	-0,00		1,41	1,17	10.597.878,00	1,12

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,82%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA		9,88	0,07	2,13			8.639.102,81	0,91
4UM SMALL CAPS FIA		9,27	0,10	8,00			14.079.843,85	1,49
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA		6,77	0,12	5,85			20.804.067,38	2,20
ITAU INDEX IBOVESPA 1		10,37	0,05	7,88			5.220.046,50	0,55
OCCAM FIC FIA		10,13	0,31	2,32			36.701.763,17	3,88
PLURAL AÇÕES FIC FIA		10,06	0,17	2,39			19.393.807,71	2,05
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA		9,13	0,21	2,54			26.266.748,99	2,78
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA		13,50	0,12	10,96			16.145.263,24	1,71
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		12,49	0,04	7,37			3.601.852,70	0,38
Sub-total	19,47	8,82	1,18		-0,11	-0,97	150.852.496,35	15,95

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 13,28%

Artigo 10º I

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
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		13,28	0,04	10,82			4.987.660,60	0,53
Sub-total	24,59	13,28	0,04		-0,39	-8,56	4.987.660,60	0,53

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 7,34%

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		7,34	0,00	11,53			1.792.000,00	0,19
Sub-total	10,46	7,34	0,00		-0,06	0,46	1.792.000,00	0,19