



LDB
EMPRESAS

LINHARES
DEZEMBRO 2021



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.12.2021.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 86,02%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,850000%)	4,14	0,38	0,38	2.509.349,75	0,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (3,200000%)	0,50	1,05	13,92	1.064.476,61	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,410000%)	0,50	1,16	15,25	1.051.194,71	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,200000%)	3,98	1,23	1,23	4.045.586,05	1,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,270000%)	4,00	1,23	3,26	1.989.377,46	0,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,500000%)	4,05	1,25	2,95	5.144.361,25	1,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,800000%)	3,84	1,19	4,28	5.212.647,63	1,60
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,51	1,21	14,87	21.016.993,46	6,44

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
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	8,18	0,07	-7,16	27.413.914,84	8,41	199.547.694,03	13,74
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,64	0,84	2,64	2.939.937,32	0,90	6.208.104.156,65	0,05
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,79	0,20	-1,51	17.552.725,57	5,38	7.081.253.604,41	0,25
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,76	0,21	-1,53	17.852.225,48	5,47	4.689.992.155,11	0,38
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,64	0,85	2,70	367.486,08	0,11	6.465.382.741,43	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,78	0,77	4,31	20.564.977,60	6,31	12.444.051.491,75	0,17
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,61	0,71	4,65	14.914.153,90	4,57	9.277.694.744,55	0,16
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	5,10	2,27	-5,31	2.173.000,08	0,67	1.203.780.064,86	0,18
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,76	0,72	4,66	27.329.563,95	8,38	10.998.710.156,34	0,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
LP									
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	4,01	0,81	0,00	146.106,16	0,04	942.926.867,08	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,80	0,76	4,27	10.863.838,80	3,33	6.458.635.592,00	0,17
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,88	0,79	1,81	991.926,46	0,30	262.649.572,79	0,38
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,46	0,71	4,89	3.098.446,11	0,95	433.971.771,76	0,71
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,84	0,91	-0,40	13.523.443,93	4,15	7.701.081.218,58	0,18
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,33	0,83	-0,11	2.645.341,77	0,81	12.561.638.596,69	0,02
BANCO DO NORDESTE	SANTANDER	BNB IMA-B FI RF	5,19	0,19	-0,98	1.043.082,17	0,32	236.175.767,92	0,44
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,60	0,54	0,17	163.420.170,22	50,11		
Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,35	0,73	5,05	14.685.723,36	4,50	289.696.608,52	5,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,15	0,78	4,34	1.191.200,13	0,37	13.602.429.580,61	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,20	0,75	4,60	10.796.761,65	3,31	8.765.736.063,59	0,12
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	8,19	0,43	-5,86	15.312.806,48	4,70	222.360.588,48	6,89
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,15	0,80	4,62	25.775.201,24	7,90	7.206.695.128,79	0,36
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,26	0,79	1,39	8.256.846,08	2,53	2.584.228.578,26	0,32
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,48	0,70	0,89	12.956.064,41	3,97	141.132.202,49	9,18
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,79	0,76	0,53	6.476.523,62	1,99	4.514.029.795,13	0,14
BANCO DO NORDESTE	SANTANDER	BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,19	0,73	4,23	647.508,20	0,20	960.348.512,17	0,07
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,92	0,71	2,01	96.098.635,17	29,47		
Renda Fixa			2,94	0,65	0,90	280.535.798,85	86,02		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

10,55%

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	19,87	1,52	-9,35	1.655.267,48	0,51	268.685.769,68	0,62
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	19,16	2,31	-20,08	767.066,63	0,24	1.378.837.386,58	0,06
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,72	-0,32	-10,50	15.925.583,62	4,88	924.501.793,20	1,72
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	23,77	-0,67	-31,65	5.860.398,75	1,80	162.780.188,13	3,60
BANESTES	BANESTES	BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	18,94	0,72	-18,67	1.612.289,01	0,49	14.755.221,59	10,93
BB	BB	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	19,63	3,56	-6,26	3.631.848,35	1,11	1.417.181.864,81	0,26
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			18,93	0,30	-15,81	29.452.453,84	9,03		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	5,87	1,27	-0,82	2.895.712,22	0,89	1.426.442.696,60	0,20
CEF	CEF	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO	2,22	1,36	1,70	2.046.204,12	0,63	113.902.231,09	1,80
Sub-total Artigo 8º III			3,61	1,31	0,20	4.941.916,34	1,52		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			16,87	0,44	-13,83	34.394.370,18	10,55		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,43%

Artigo 9º A, II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRPP	BNP PARIBAS	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	18,06	4,72	12,89	2.822.192,51	0,87	163.649.857,59	1,72
BRPP	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	32,74	-12,95	-4,09	2.393.838,29	0,73	405.432.577,37	0,59
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21,30	-2,60	0,23	954.107,05	0,29	1.410.026.256,25	0,07
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	17,42	1,64	15,56	5.019.997,79	1,54	360.428.150,55	1,39
Sub-total Artigo 9º A, II			25,10	-1,53	-2,31	11.190.135,64	3,43		
Investimentos no Exterior			25,10	-1,53	-2,31	11.190.135,64	3,43		
Total			3,71	0,55	-0,80	326.120.304,67	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	21.016.993,46	6,44	0,00	3,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	163.420.170,22	50,11	0,00	55,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	96.098.635,17	29,47	0,00	19,00	45,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	280.535.798,85	86,02					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	29.452.453,84	9,03	0,00	13,00	25,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	4.941.916,34	1,52	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	34.394.370,18	10,55					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	11.190.135,64	3,43	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	11.190.135,64	3,43					10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,21 158,94	14,87 338,24	4,30 233,42	8,19 265,30	14,87 338,24	230.974,27	759.917,07
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,54 71,14	0,17 3,88	1,40 75,76	0,79 25,47	0,17 3,88	882.885,00	-349.455,02
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	96.098.635,17	96.098.635,17
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,71 92,66	2,01 45,82	1,69 91,54	2,01 64,96	2,01 45,82	-95.426.518,50	-94.253.803,12
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,30 -2,56	-15,81 -3,89	-7,57 -2,03	-19,05 -1,72	-15,81 -3,89	-29.365.288,55	-34.962.965,35
Artigo 8º III % do CDI	1,31 171,27	0,20 4,63	0,63 33,98	-0,58 -18,86	0,20 4,63	-4.878.123,77	-4.931.737,55
Artigo 9º A, II % do CDI	-1,53 -199,88	-2,31 -53,95	4,94 268,29	10,17 329,37		-173.430,27	623.212,01
LINHARES (Total)						-32.630.866,65	-37.016.196,79

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150523 (5,850000%)	0,00	2.499.746,98	0,00	0,00	2.509.349,75	9.602,77	9.602,77
NTN-B 150535 (3,200000%)	1.053.420,71	0,00	0,00	0,00	1.064.476,61	11.055,90	133.525,46
NTN-B 150535 (4,410000%)	1.039.170,92	0,00	0,00	0,00	1.051.194,71	12.023,79	143.261,47
NTN-B 150828 (5,200000%)	3.996.562,15	0,00	0,00	0,00	4.045.586,05	49.023,90	49.023,90
NTN-B 150828 (5,270000%)	1.965.149,88	0,00	0,00	0,00	1.989.377,46	24.227,58	62.722,24
NTN-B 150828 (5,500000%)	5.080.699,74	0,00	0,00	0,00	5.144.361,25	63.661,51	147.619,83
NTN-B 150830 (4,800000%)	5.151.268,81	0,00	0,00	0,00	5.212.647,63	61.378,82	214.161,40
					21.016.993,46	0,00	0,00

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	27.395.371,82	0,00	0,00	0,00	27.413.914,84	18.543,02	-2.675.929,53
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	984.103,53	0,00	0,00	0,00	991.926,46	7.822,93	69.129,73
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	13.400.945,83	0,00	0,00	0,00	13.523.443,93	122.498,10	-48.133,45
BB PREV RF IDKA2	14.809.568,44	0,00	0,00	0,00	14.914.153,90	104.585,46	451.026,68
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	10.781.659,18	0,00	0,00	0,00	10.863.838,80	82.179,62	358.364,36
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	17.517.098,48	0,00	0,00	0,00	17.552.725,57	35.627,09	-269.955,25
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.915.320,47	0,00	0,00	0,00	2.939.937,32	24.616,85	246.813,73
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	3.076.751,69	0,00	0,00	0,00	3.098.446,11	21.694,42	145.789,55
BNB IMA-B FI RF	1.041.076,49	0,00	0,00	0,00	1.043.082,17	2.005,68	-10.352,64
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	27.134.275,51	0,00	0,00	0,00	27.329.563,95	195.288,44	748.775,19
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	20.408.356,69	0,00	0,00	0,00	20.564.977,60	156.620,91	616.860,86
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	17.814.931,09	0,00	0,00	0,00	17.852.225,48	37.294,39	-277.437,40
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	364.394,01	0,00	0,00	0,00	367.486,08	3.092,07	419.036,81
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	2.124.819,99	0,00	0,00	0,00	2.173.000,08	48.180,09	-121.905,60
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2.623.678,42	0,00	0,00	0,00	2.645.341,77	21.663,35	-3.104,06
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	144.933,58	0,00	0,00	0,00	146.106,16	1.172,58	1.566,00
					163.420.170,22	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	12.865.376,04	0,00	0,00	0,00	12.956.064,41	90.688,37	117.767,12
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	15.247.990,05	0,00	0,00	0,00	15.312.806,48	64.816,43	-952.959,29
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	7.862.708,35	331.208,92	0,00	0,00	8.256.846,08	62.928,81	93.632,54
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	14.578.964,45	0,00	0,00	0,00	14.685.723,36	106.758,91	861.788,09
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	6.427.600,98	0,00	0,00	0,00	6.476.523,62	48.922,64	42.853,80
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	25.570.921,20	0,00	0,00	0,00	25.775.201,24	204.280,04	1.139.178,68
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	519.098,45	124.340,33	0,00	0,00	647.508,20	4.069,42	21.472,69
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.651.299,73	64.993,95	0,00	0,00	10.796.761,65	80.467,97	471.566,08
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.182.016,05	0,00	0,00	0,00	1.191.200,13	9.184,08	49.532,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					96.098.635,17	0,00	0,00
Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)							
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	749.714,34	0,00	0,00	0,00	767.066,63	17.352,29	-192.720,74
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	1.600.761,94	0,00	0,00	0,00	1.612.289,01	11.527,07	-371.914,34
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	5.900.139,04	0,00	0,00	0,00	5.860.398,75	-39.740,29	-2.702.802,78
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	3.506.890,83	0,00	0,00	0,00	3.631.848,35	124.957,52	-203.966,91
FIA CAIXA DIVIDENDOS	1.630.412,14	0,00	0,00	0,00	1.655.267,48	24.855,34	-170.804,81
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	15.977.370,26	0,00	0,00	0,00	15.925.583,62	-51.786,64	-1.868.301,93
					29.452.453,84	0,00	0,00
Artigo 8º III (Fundos Multimercados)							
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	2.859.314,53	0,00	0,00	0,00	2.895.712,22	36.397,69	-24.056,90
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO	2.018.809,24	0,00	0,00	0,00	2.046.204,12	27.394,88	34.235,69
					4.941.916,34	0,00	0,00
Artigo 9º A, II (Fundos de Investimento no Exterior)							
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	2.694.951,01	0,00	0,00	0,00	2.822.192,51	127.241,50	322.192,51
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	2.750.106,55	0,00	0,00	0,00	2.393.838,29	-356.268,26	-106.161,71
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	979.539,33	0,00	0,00	0,00	954.107,05	-25.432,28	2.196,30
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	4.938.969,02	0,00	0,00	0,00	5.019.997,79	81.028,77	404.984,91
					11.190.135,64	0,00	0,00

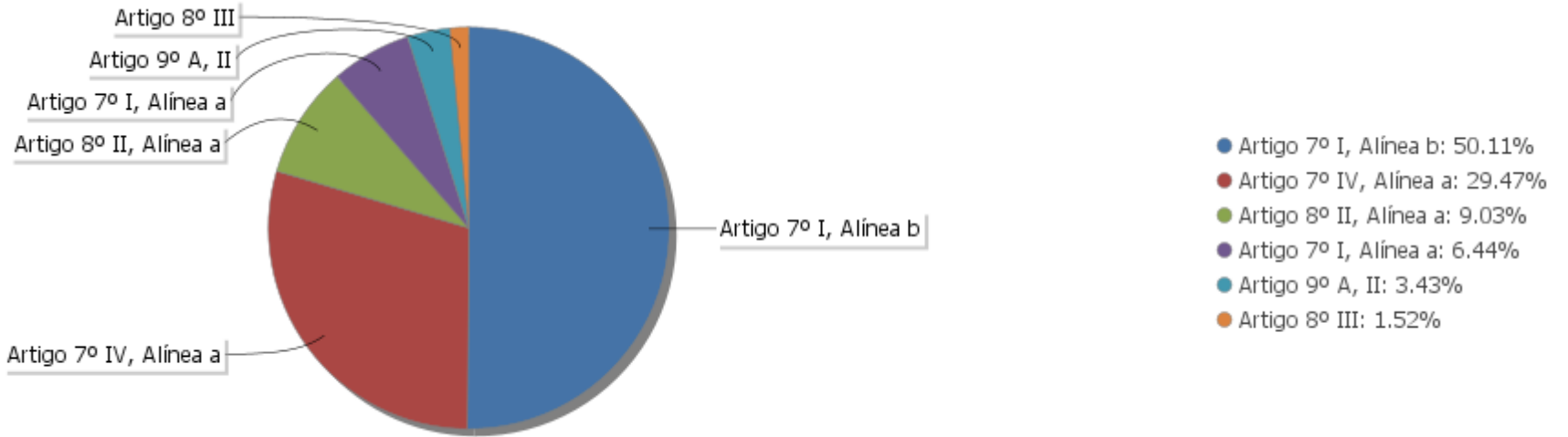
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

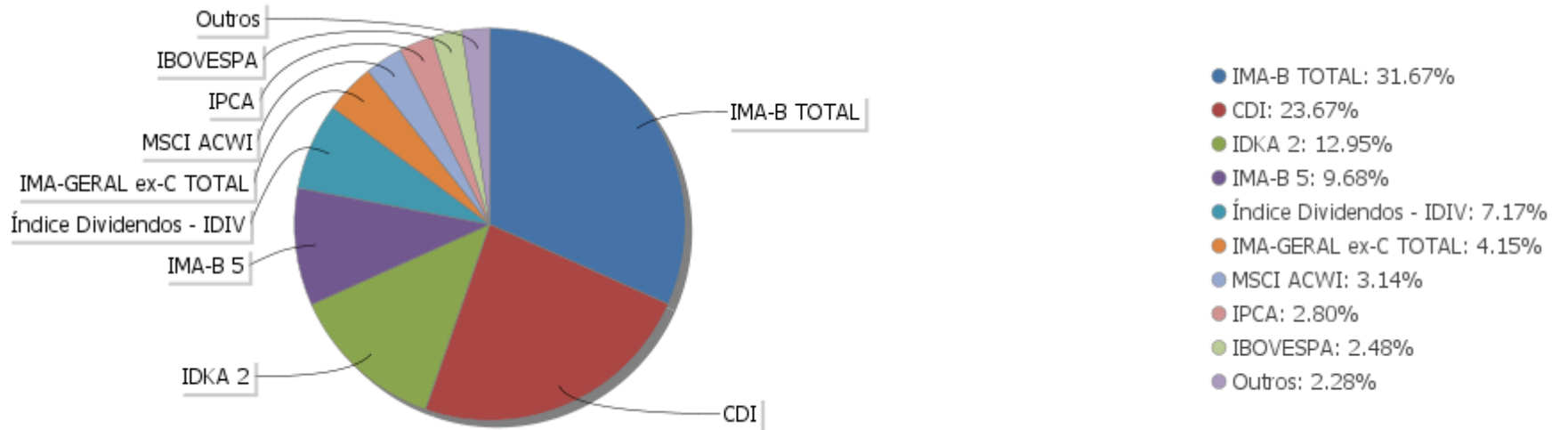
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	278.172.678,61	85,30	278.172.678,61	85,30
de 31 a 365 dias	23.832.186,49	7,31	302.004.865,10	92,61
acima de 365 dias	24.115.439,57	7,39	326.120.304,67	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

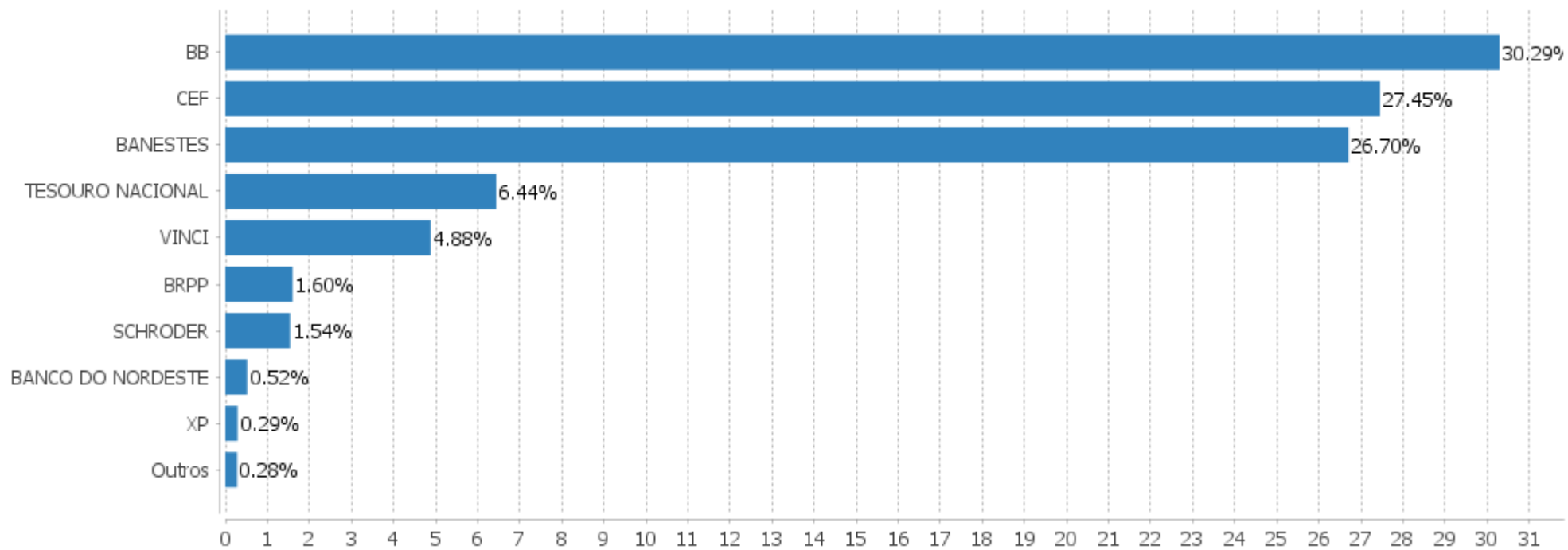


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,93	-1,16	0,23	0,72	1,07	0,17	-0,44	-0,62	-0,56	-1,41	1,62	0,55	-0,80
INPC + 5,45%	0,69	1,20	1,35	0,80	1,41	1,05	1,49	1,35	1,65	1,59	1,27	1,22	16,14
p.p. indexador	-1,63	-2,36	-1,12	-0,08	-0,34	-0,87	-1,93	-1,97	-2,21	-3,00	0,35	-0,67	-16,94
2020	0,49	-0,30	-6,00	1,19	1,40	1,41	2,77	-1,09	-1,53	0,16	1,96	3,27	3,46
INPC + 6,00%	0,70	0,59	0,69	0,23	0,21	0,79	0,98	0,85	1,36	1,38	1,42	1,98	11,75
p.p. indexador	-0,21	-0,89	-6,69	0,96	1,19	0,63	1,79	-1,94	-2,89	-1,22	0,55	1,29	-8,29
2019	2,03	0,57	0,45	0,98	2,17	2,28	1,23	-0,12	1,94	2,06	-1,14	1,47	14,79
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	1,15	-0,43	-0,77	-0,11	1,51	1,83	0,60	-0,75	1,50	1,49	-2,14	-0,25	4,02
2018	3,06	0,59	0,52	0,09	-2,34	-0,08	1,29	0,01	0,40	3,08	0,67	1,06	8,56
INPC + 6,00%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	0,74	0,91	0,21	0,60	9,59
p.p. indexador	2,32	-0,01	-0,04	-0,60	-3,25	-2,00	0,53	-0,53	-0,34	2,17	0,46	0,46	-1,03

Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

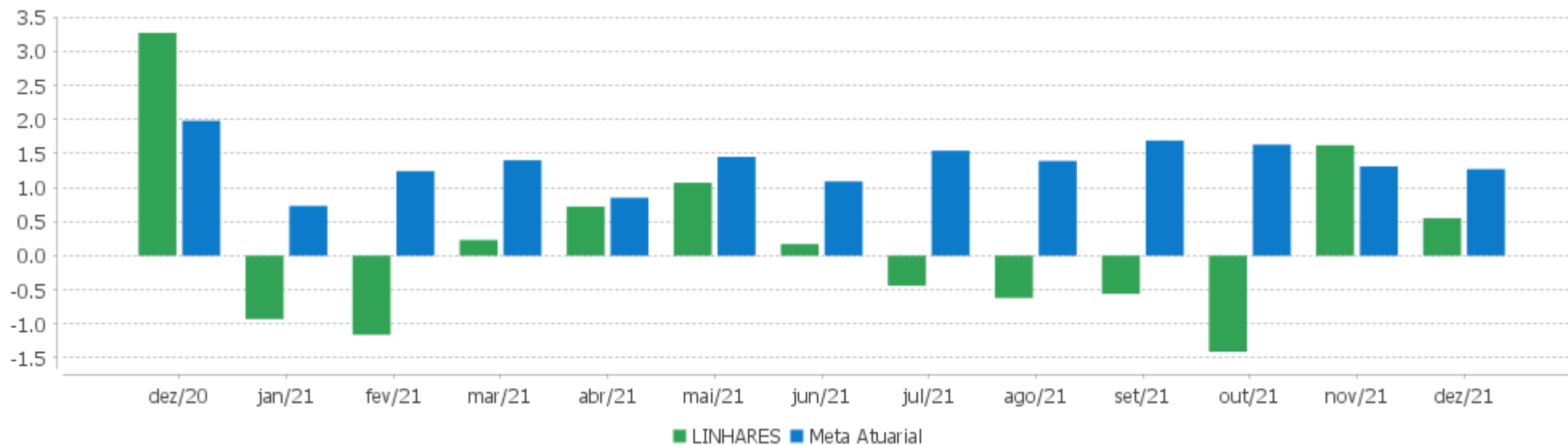
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	18	37,50	03 meses	0,73	4,13	-3,39	3,82
Meses abaixo - Meta Atuarial	30	62,50	06 meses	-0,89	8,87	-9,76	3,79
			12 meses	-0,80	16,14	-16,94	3,71
			24 meses	2,63	29,78	-27,16	5,34
Maior rentabilidade da Carteira	3,27	2020-12	36 meses	17,81	43,77	-25,96	4,53
Menor rentabilidade da Carteira	-6,00	2020-03	48 meses	27,89	57,56	-29,66	4,13
			Desde 29/12/2017	27,89	57,56	-29,66	4,13

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150535 (4,410000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,16 0,93	15,25 16,51	4,19 3,13	8,24 8,78	15,25 16,51	15,54 10,47	36,14 6,96
NTN-B 150828 (5,200000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,23 1,00	9,83 11,09	4,38 3,32	5,67 6,21	9,83 11,09	14,13 9,07	17,93 -11,24
NTN-B 150830 (4,800000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,19 0,97	9,64 10,90	4,28 3,22	5,57 6,12	9,64 10,90	13,74 8,68	17,34 -11,84
NTN-B 150535 (3,200000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,05 0,82	13,92 15,18	3,88 2,82	7,60 8,15	13,92 15,18	23,21 18,15	25,84 -3,33
NTN-B 150828 (5,270000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,23 1,01	9,88 11,14	4,40 3,34	5,69 6,24	9,88 11,14	14,23 9,17	18,08 -11,09
NTN-B 150828 (5,500000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,25 1,03	10,04 11,30	4,46 3,40	5,77 6,32	10,04 11,30	14,55 9,49	18,57 -10,60
NTN-B 150523 (5,850000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,28 1,06	10,24 11,50	1,55 0,49	5,87 6,42	10,24 11,50	14,95 9,89	19,18 -9,99
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,73 95,90	5,05 115,00	1,83 99,11	3,23 104,62	5,05 115,00	4,83 66,28	10,88 79,53
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,43 0,20	-5,86 -4,59	1,09 0,03	-1,73 -1,18	-5,86 -4,59	-6,55 -11,61	20,29 -8,88
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,79 103,64	5,50 125,23	1,99 108,10	3,57 115,67	5,50 125,23	5,72 78,55	12,15 88,79
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	0,70 92,32	0,89 20,26	1,73 94,08	1,62 52,34	0,89 20,26	2,61 35,77	21,13 154,36
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,80 104,63	4,62 105,21	1,93 104,82	3,26 105,62	4,62 105,21	7,13 97,94	13,29 97,07
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,76 0,03	0,53 -9,53	1,40 -1,56	0,93 -5,14	0,53 -9,53		
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,75 98,81	4,60 104,55	1,89 102,69	3,40 110,10	4,60 104,55	7,12 97,76	13,24 96,76
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,78 101,76	4,34 98,71	1,90 103,34	3,14 101,86	4,34 98,71	6,90 94,74	13,22 96,61
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO % do CDI	0,73 96,19	4,23 96,22	1,85 100,50	3,17 102,62	4,23 96,22	6,62 90,82	12,79 93,44
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,21	-1,53	1,00	-0,70	-1,53	4,44	28,03

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.	-0,02	-0,27	-0,06	-0,15	-0,27	-0,62	-1,14
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	0,81	0,00	1,46	1,23	0,00	10,18	27,76
Var. IMA-B 5 p.p.	0,02	-4,57	-0,57	-2,01	-4,57	-2,79	-0,08
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,77	4,31	1,97	3,12	4,31	12,39	26,84
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,25	-0,06	-0,12	-0,25	-0,58	-0,99
BNB IMA-B FI RF	0,19	-0,98	0,98	-0,31	-0,98	4,15	26,06
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	0,28	-0,08	0,24	0,28	-0,91	-3,12
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,84	2,64	1,10	1,97	2,64	6,20	13,10
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,29	-0,03	-0,12	-0,29	-0,68	-1,01
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,76	4,27	1,94	3,06	4,27	12,38	26,87
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,30	-0,09	-0,17	-0,30	-0,59	-0,97
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	0,71	4,89	1,92	3,61	4,89	12,74	28,36
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,48	6,16	0,86	4,15	6,16	7,68	-0,81
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	2,27	-5,31	0,86	-1,95	-5,31	2,47	16,70
Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,02	-0,32	-0,07	-0,20	-0,32	-0,58	-1,02
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,07	-7,16	0,08	-3,43	-7,16	-7,19	21,62
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,16	-5,89	-0,98	-2,89	-5,89	-12,25	-7,55
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,79	1,81	1,53	2,22	1,81	8,19	19,26
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,08	-1,11	0,40	0,12	-1,11	1,31	5,15
BB PREV RF IDKA2	0,71	4,65	1,86	3,18	4,65	12,93	25,58
Var. IDKA 2 p.p.	-0,12	-0,33	0,02	0,13	-0,33	-1,09	-1,92
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,91	-0,40	0,99	0,28	-0,40	4,67	18,35
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.							
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,83	-0,11	1,07	-0,82	-0,11	6,55	24,06
Var. IPCA p.p.	0,10	-10,17	-1,89	-6,89	-10,17	-8,48	4,07
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,72	4,66	1,82	3,05	4,66	13,07	25,72
Var. IDKA 2 p.p.	-0,11	-0,31	-0,02	0,00	-0,31	-0,95	-1,78
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,20	-1,51	0,97	-0,70	-1,51	4,53	28,20
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,25	-0,09	-0,16	-0,25	-0,53	-0,97
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,85	2,70	1,09	1,99	2,70	6,43	13,40
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,23	-0,04	-0,11	-0,23	-0,45	-0,70
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	1,27	-0,82	-0,10	-3,05	-0,82	1,68	15,61
% do CDI	166,71	-18,77	-5,48	-98,68	-18,77	23,02	114,05
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO	1,36	1,70	1,67	3,13	1,70		
Var. IBOVESPA p.p.	-1,50	13,63	7,22	20,46	13,63		
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	-0,67	-31,65	-19,34	-34,56	-31,65	-26,35	2,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-2,28	-25,24	-17,51	-26,26	-25,24	-19,00	-32,01
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,31 -0,54	-9,66 2,27	-8,26 -2,71	-20,26 -2,92	-9,66 2,27	-12,51 -3,16	30,94 11,67
FIA CAIXA DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	1,52 -1,33	-9,35 2,57	-2,03 3,51	-10,96 6,37	-9,35 2,57	-15,64 -6,28	19,58 0,31
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	3,56 0,71	-6,26 5,66	-3,10 2,44	-11,41 5,92	-6,26 5,66	6,88 16,24	
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,32 -1,93	-10,50 -4,09	-3,49 -1,66	-13,76 -5,46	-10,50 -4,09	-7,77 -0,42	31,03 -3,46
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,72 -0,88	-18,67 -12,26	-11,68 -9,85	-20,95 -12,65	-18,67 -12,26		
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	4,72 1,56	23,24 -2,19	11,58 2,43	22,76 5,80	23,24 -2,19		
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	1,64 -1,53	28,48 3,05	6,78 -2,37	17,53 0,57	28,48 3,05		
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-12,95 -16,12	5,29 -20,14	-3,32 -12,47	-0,55 -17,52	5,29 -20,14		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-2,60 -3,86	7,25 -9,39	1,63 -2,84	4,93 -4,32	7,25 -9,39	105,18 75,99	
LINHARES Var. INPC + 6,00% p.p.	0,55 -0,72	-0,80 -17,55	0,73 -3,53	-0,89 -10,05	-0,80 -17,55	2,63 -27,83	17,81 -26,71
CDI	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69
IBOVESPA	2,85	-11,93	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27
INPC + 6,00%	1,27	16,74	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52
IPCA + 6,00%	1,27	16,64	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	20.0000000000000	2,00
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du	-	
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du	0,00	0,50
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	D+1 du	D+0	D+30	D+34	0,00	0,00
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,15
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,80
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	2,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du	0,00	0,30
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0		D+3 du		
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,10
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BNB IMA-B FI RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,20
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,50
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	1,00
FIA CAIXA DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	1,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,40
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du	0,00	1,72
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO	D+0	D+0		D+2		
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du	0,00	0,80
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	D+1 du	D+0				
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

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

Renda Variável

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,73	10,06	2,96	6,07	10,06	15,03	19,99	24,48	28,15
INPC	0,73	10,16	2,75	5,97	10,16	16,16	21,37	25,53	28,13
IGPM	0,87	17,78	1,54	2,35	17,78	45,04	55,63	67,36	66,49
SELIC	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	21,00	33,06

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,63	36,26	13,52	23,73	36,26	104,25	173,82	200,73	264,52
MSCI ACWI	3,17	25,42	9,15	16,96	25,42	84,89	138,58	148,21	206,39
MSCI World									

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,09	14,45	3,97	8,20	14,45	24,38	34,95	45,56	55,77
IPCA + 5,00%	1,18	15,54	4,22	8,73	15,54	26,77	38,87	51,22	63,36
IPCA + 5,50%	1,22	16,09	4,35	8,99	16,09	27,98	40,86	54,11	67,27
IPCA + 5,89%	1,26	16,52	4,44	9,20	16,52	28,92	42,43	56,40	70,37
IPCA + 6,00%	1,27	16,64	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87	57,04	71,26
INPC + 4,00%	1,09	14,55	3,77	8,10	14,55	25,60	36,50	46,79	55,74
INPC + 6,00%	1,27	16,74	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52	58,37	71,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
72	21/12/2021	NTN-B 150523 (5,850000%)	2.499.746,98	0,00	658,00000000	3.799,0075610000
71	23/12/2021	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	331.208,92	0,00	182.304,97784207	1,8167848400
70	23/12/2021	BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	124.340,33	0,00	22.596,90500000	5,5025380000
69	24/12/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	64.993,95	0,00	16.644,02868000	3,9049410000

Total

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.611.476,38

Value-At-Risk: 1,72%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LINHARES		1,72	1,72			326.120.304,67	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,39%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150523 (5,850000%)		0,23	0,00	2,95			2.509.349,75	0,77
NTN-B 150535 (3,200000%)		0,10	0,00	2,95			1.064.476,61	0,33
NTN-B 150535 (4,410000%)		0,10	0,00	2,95			1.051.194,71	0,32
NTN-B 150828 (5,200000%)		0,22	0,00	2,95			4.045.586,05	1,24
NTN-B 150828 (5,270000%)		0,22	0,00	2,95			1.989.377,46	0,61
NTN-B 150828 (5,500000%)		0,22	0,00	2,95			5.144.361,25	1,58
NTN-B 150830 (4,800000%)		0,22	0,00	2,95			5.212.647,63	1,60
Sub-total	0,37	0,18	0,00		1,21	1,21	21.016.993,46	6,44

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B		3,75	0,27	0,93			27.413.914,84	8,41
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,62	0,00	0,03			2.939.937,32	0,90
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,99	0,14	0,04			17.552.725,57	5,38
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,98	0,14	0,03			17.852.225,48	5,47
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,62	0,00	0,02			367.486,08	0,11
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,20	0,06	0,02			20.564.977,60	6,31
BB PREV RF IDKA2		1,37	0,05	0,38			14.914.153,90	4,57
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		2,44	0,01	0,02			2.173.000,08	0,67
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,62	0,10	0,26			27.329.563,95	8,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF		1,72	0,00	0,60			146.106,16	0,04
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,20	0,03	0,04			10.863.838,80	3,33
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1		0,23	0,00	0,46			991.926,46	0,30
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI		0,98	0,01	2,29			3.098.446,11	0,95
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,19	0,04	1,85			13.523.443,93	4,15
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,06	0,01	1,07			2.645.341,77	0,81
BNB IMA-B FI RF		2,68	0,01	0,30			1.043.082,17	0,32
Sub-total	2,93	1,99	0,87		-0,08	0,54	163.420.170,22	50,11

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI		0,08	-0,00	0,08			14.685.723,36	4,50
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,05	0,00	0,02			1.191.200,13	0,37
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,06	0,00	0,06			10.796.761,65	3,31
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF		3,21	0,13	0,64			15.312.806,48	4,70
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,05	0,00	0,03			25.775.201,24	7,90
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI		0,08	-0,00	0,08			8.256.846,08	2,53
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF		0,80	0,03	0,80			12.956.064,41	3,97
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		0,96	0,02	0,97			6.476.523,62	1,99
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO		0,04	0,00	0,03			647.508,20	0,20
Sub-total	0,89	0,68	0,17		-0,06	0,71	96.098.635,17	29,47

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 9,39%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA DIVIDENDOS		10,44	0,04	3,48			1.655.267,48	0,51
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,30	0,02	5,27			767.066,63	0,24
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS		9,84	0,37	2,29			15.925.583,62	4,88
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL		15,80	0,22	9,03			5.860.398,75	1,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA		10,63	0,04	3,95			1.612.289,01	0,49
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI		10,16	0,08	1,96			3.631.848,35	1,11
Sub-total	17,51	10,70	0,76		-0,03	0,30	29.452.453,84	9,03

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO		2,90	0,02	2,89			2.895.712,22	0,89
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO		0,89	0,00	10,28			2.046.204,12	0,63
Sub-total	3,46	1,72	0,02		0,16	1,31	4.941.916,34	1,52

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,08%

Artigo 9º A, II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE		8,76	-0,04	8,23			2.822.192,51	0,87
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		14,41	-0,00	14,44			2.393.838,29	0,73
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		10,93	-0,01	10,92			954.107,05	0,29
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		8,08	-0,06	8,45			5.019.997,79	1,54
Sub-total	15,58	8,08	-0,11		-0,15	-1,53	11.190.135,64	3,43