



LDB
EMPRESAS

LINHARES
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 84,96%

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%)	4,12	1,13	2,29	2.566.750,23	0,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (6,050000%)	4,13	1,14	1,55	3.043.801,58	0,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (3,200000%)	0,47	0,94	1,88	1.084.452,36	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,410000%)	0,48	1,02	2,07	1.072.905,36	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822 (6,750000%)	2,96	1,19	1,48	1.968.931,89	0,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,800000%)	4,11	0,00	0,00	1.379.740,49	0,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,200000%)	2,81	1,08	2,19	4.020.202,34	1,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,270000%)	2,82	1,09	2,20	1.976.904,30	0,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,500000%)	2,86	1,10	2,23	5.112.176,66	1,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,800000%)	2,71	1,05	2,13	5.181.943,59	1,56
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,48	1,09	2,20	27.407.808,80	8,26

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
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,20	0,88	1,68	1.211.189,76	0,37	16.227.045.266,95	0,01
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	7,42	0,41	-0,54	20.174.384,67	6,08	189.307.422,05	10,66
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,70	0,74	1,36	2.979.795,31	0,90	5.025.689.167,39	0,06
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,63	0,53	-0,24	17.510.877,74	5,28	6.297.272.158,07	0,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,61	0,53	-0,23	17.810.435,55	5,37	4.318.650.723,31	0,41
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,70	0,72	1,34	372.403,80	0,11	5.808.584.551,28	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,75	1,05	1,14	20.799.881,50	6,27	11.612.568.005,11	0,18
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,63	1,16	1,17	15.088.116,47	4,55	9.012.864.987,26	0,17
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	5,10	0,45	-0,09	2.171.058,98	0,65	912.609.648,90	0,24
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,75	1,15	1,17	27.648.029,63	8,34	10.680.932.817,60	0,26
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	3,84	0,93	0,77	147.224,68	0,04	764.407.302,54	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,77	1,05	1,13	10.986.815,73	3,31	6.375.804.434,87	0,17
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,76	0,71	1,38	1.005.585,22	0,30	273.789.264,47	0,37
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,36	1,10	1,39	3.055.158,99	0,92	427.908.930,22	0,71
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,74	0,62	0,65	13.611.918,94	4,10	6.887.287.977,51	0,20
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,24	0,81	1,48	2.684.459,22	0,81	10.665.837.627,38	0,03
BANCO DO NORDESTE	SANTANDER	BNB IMA-B FI RF	5,04	0,60	-0,04	1.042.715,75	0,31	216.098.275,46	0,48
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,55	0,82	0,53	158.300.051,94	47,73		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,35	0,82	1,53	14.909.950,75	4,50	291.552.370,35	5,11
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,22	0,82	1,61	10.970.854,41	3,31	10.660.917.138,14	0,10
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	7,25	0,42	-0,24	15.276.460,47	4,61	201.878.031,30	7,57
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,80	1,59	26.184.493,19	7,90	7.639.104.845,31	0,34
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,26	0,87	1,63	8.391.708,09	2,53	2.907.017.295,14	0,29
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,16	0,79	1,35	13.131.469,24	3,96	140.645.511,93	9,34
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,59	0,67	0,86	6.532.288,76	1,97	4.159.933.633,04	0,16
BANCO DO NORDESTE	SANTANDER	BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,20	0,79	1,54	657.494,85	0,20	984.323.396,37	0,07
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,36	0,74	1,21	96.054.719,76	28,96		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

2,82

0,82

0,89

281.762.580,50

84,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL

9,50%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	18,37	-2,38	4,68	1.732.807,48	0,52	239.297.616,68	0,72
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	17,37	-1,47	1,13	775.711,22	0,23	1.428.707.503,72	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,33	-0,71	8,04	17.206.694,51	5,19	985.463.082,71	1,75
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	23,97	-2,06	2,74	6.021.076,15	1,82	159.417.690,23	3,78
BANESTES	BANESTES	BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	18,16	-0,90	4,29	1.681.487,77	0,51	15.123.966,27	11,12
BB	BB	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	17,85	-0,34	6,13	4.096.510,86	1,24	1.491.112.952,73	0,27
Sub-total Artigo 8º I			15,74	-1,05	6,18	31.514.287,99	9,50		
Renda Variável			16,37	-1,05	6,18	31.514.287,99	9,50		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,67%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	16,93	-5,65	-16,23	2.364.257,58	0,71	184.161.184,80	1,28
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	40,08	-7,99	-33,87	1.583.100,61	0,48	266.514.218,75	0,59
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	24,84	-9,75	-25,87	707.259,80	0,21	923.354.073,39	0,08
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	18,04	-5,52	-16,04	4.214.683,25	1,27	314.493.098,59	1,34
Sub-total Artigo 9º II			23,92	-6,35	-20,74	8.869.301,24	2,67		
Investimentos no Exterior			23,92	-6,35	-20,74	8.869.301,24	2,67		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,86%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	5,48	0,96	3,66	3.001.648,13	0,91	1.211.723.304,43	0,25
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO	2,12	1,03	1,65	2.079.947,78	0,63	115.780.576,34	1,80
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	5,87	-1,98	-1,87	4.415.661,99	1,33	123.808.243,84	3,57
Sub-total Artigo 10º I			3,32	-0,41	1,35	9.497.257,90	2,86		
Investimentos Estruturados			3,32	-0,41	1,35	9.497.257,90	2,86		
Total			3,59	0,39	0,62	331.643.427,63	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	27.407.808,80	8,26	0,00	34,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	158.300.051,94	47,73	0,00	15,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	96.054.719,76	28,96	0,00	28,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	281.762.580,50	84,96					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	31.514.287,99	9,50	0,00	11,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	31.514.287,99	9,50					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	8.869.301,24	2,67	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	8.869.301,24	2,67					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	9.497.257,90	2,86	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	9.497.257,90	2,86					15,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,09 145,67	2,20 147,73	3,44 151,95	8,17 214,52	15,32 271,27	283.715,25	530.147,76
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,82 108,98	0,53 35,34	1,07 47,37	2,05 53,75	2,45 43,41	1.283.210,48	774.678,21
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,74 98,84	1,21 81,28	1,21 53,44	1,21 31,73	1,21 21,40	706.410,43	1.147.284,72
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-1,05 -1,94	6,18 -1,76				-331.196,27	1.819.697,44
Artigo 9º II % do CDI	-6,35 -847,19	-20,74 -1.394,43	-21,95 -970,26	-16,93 -444,31	-21,56 -381,76	-601.426,78	-2.320.834,40
Artigo 10º I % do CDI	-0,41 -55,07	1,35 90,52				-39.363,82	55.341,56
LINHARES (Total)						1.301.349,29	2.006.315,29

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%)	2.538.113,54	0,00	0,00	0,00	2.566.750,23	28.636,69	57.400,48
NTN-B 150523 (6,050000%)	3.009.416,03	0,00	0,00	0,00	3.043.801,58	34.385,55	46.544,38
NTN-B 150535 (3,200000%)	1.074.406,03	0,00	0,00	0,00	1.084.452,36	10.046,33	19.975,75
NTN-B 150535 (4,410000%)	1.062.032,11	0,00	0,00	0,00	1.072.905,36	10.873,25	21.710,65
NTN-B 150822 (6,750000%)	2.003.417,48	0,00	0,00	58.020,15	1.968.931,89	23.534,56	29.212,38
NTN-B 150824 (5,800000%)	0,00	1.379.740,49	0,00	0,00	1.379.740,49	0,00	0,00
NTN-B 150828 (5,200000%)	4.089.860,51	0,00	0,00	113.223,78	4.020.202,34	43.565,61	87.840,07
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.011.260,94	0,00	0,00	55.879,60	1.976.904,30	21.522,96	43.406,44
NTN-B 150828 (5,500000%)	5.201.897,26	0,00	0,00	146.233,30	5.112.176,66	56.512,70	114.048,71
NTN-B 150830 (4,800000%)	5.268.018,93	0,00	0,00	140.712,94	5.181.943,59	54.637,60	110.008,90
					27.407.808,80	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	20.092.131,29	0,00	0,00	0,00	20.174.384,67	82.253,38	-239.530,17
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	998.481,70	0,00	0,00	0,00	1.005.585,22	7.103,52	13.658,76
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	13.528.581,20	0,00	0,00	0,00	13.611.918,94	83.337,74	88.475,01
BB PREV RF IDKA2	14.915.590,37	0,00	0,00	0,00	15.088.116,47	172.526,10	173.962,57
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	17.417.940,41	0,00	0,00	0,00	17.510.877,74	92.937,33	-41.847,83
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	10.872.183,63	0,00	0,00	0,00	10.986.815,73	114.632,10	122.976,93
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.957.990,05	0,00	0,00	0,00	2.979.795,31	21.805,26	39.857,99
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	3.107.498,99	0,00	-85.996,62	0,00	3.055.158,99	33.656,62	42.709,50
BNB IMA-B FI RF	1.036.530,96	0,00	0,00	0,00	1.042.715,75	6.184,79	-366,42
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	27.334.705,41	0,00	0,00	0,00	27.648.029,63	313.324,22	318.465,68
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	20.583.563,78	0,00	0,00	0,00	20.799.881,50	216.317,72	234.903,90
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	17.717.059,64	0,00	0,00	0,00	17.810.435,55	93.375,91	-41.789,93
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	369.724,06	0,00	0,00	0,00	372.403,80	2.679,74	4.917,72
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	2.161.330,42	0,00	0,00	0,00	2.171.058,98	9.728,56	-1.941,10
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.200.659,07	0,00	0,00	0,00	1.211.189,76	10.530,69	19.989,63
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2.663.002,23	0,00	0,00	0,00	2.684.459,22	21.456,99	39.117,45
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	145.864,87	0,00	0,00	0,00	147.224,68	1.359,81	1.118,52
					158.300.051,94	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	13.028.148,34	0,00	0,00	0,00	13.131.469,24	103.320,90	175.404,83
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	15.212.410,70	0,00	0,00	0,00	15.276.460,47	64.049,77	-36.346,01
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	8.319.180,52	0,00	0,00	0,00	8.391.708,09	72.527,57	134.862,01
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	14.788.485,56	0,00	0,00	0,00	14.909.950,75	121.465,19	224.227,39
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	6.488.880,21	0,00	0,00	0,00	6.532.288,76	43.408,55	55.765,14
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	25.977.113,29	0,00	0,00	0,00	26.184.493,19	207.379,90	409.291,95
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	652.365,42	0,00	0,00	0,00	657.494,85	5.129,43	9.986,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.881.725,29	0,00	0,00	0,00	10.970.854,41	89.129,12	174.092,76
					96.054.719,76	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\$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	787.312,04	0,00	0,00	0,00	775.711,22	-11.600,82	8.644,59
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	1.696.772,50	0,00	0,00	0,00	1.681.487,77	-15.284,73	69.198,76
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	6.147.869,86	0,00	0,00	0,00	6.021.076,15	-126.793,71	160.677,40
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	3.867.389,84	242.136,71	0,00	0,00	4.096.510,86	-13.015,69	222.525,80
FIA CAIXA DIVIDENDOS	1.775.069,94	0,00	0,00	0,00	1.732.807,48	-42.262,46	77.540,00
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17.328.933,37	0,00	0,00	0,00	17.206.694,51	-122.238,86	1.281.110,89
					31.514.287,99	0,00	0,00

Artigo 9º 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	2.505.755,18	0,00	0,00	0,00	2.364.257,58	-141.497,60	-457.934,93
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.720.517,81	0,00	0,00	0,00	1.583.100,61	-137.417,20	-810.737,68
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	783.695,30	0,00	0,00	0,00	707.259,80	-76.435,50	-246.847,25
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	4.460.759,73	0,00	0,00	0,00	4.214.683,25	-246.076,48	-805.314,54
					8.869.301,24	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	2.973.075,77	0,00	0,00	0,00	3.001.648,13	28.572,36	105.935,91
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO	2.058.838,00	0,00	0,00	0,00	2.079.947,78	21.109,78	33.743,66
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	4.504.707,95	0,00	0,00	0,00	4.415.661,99	-89.045,96	-84.338,01
					9.497.257,90	0,00	0,00

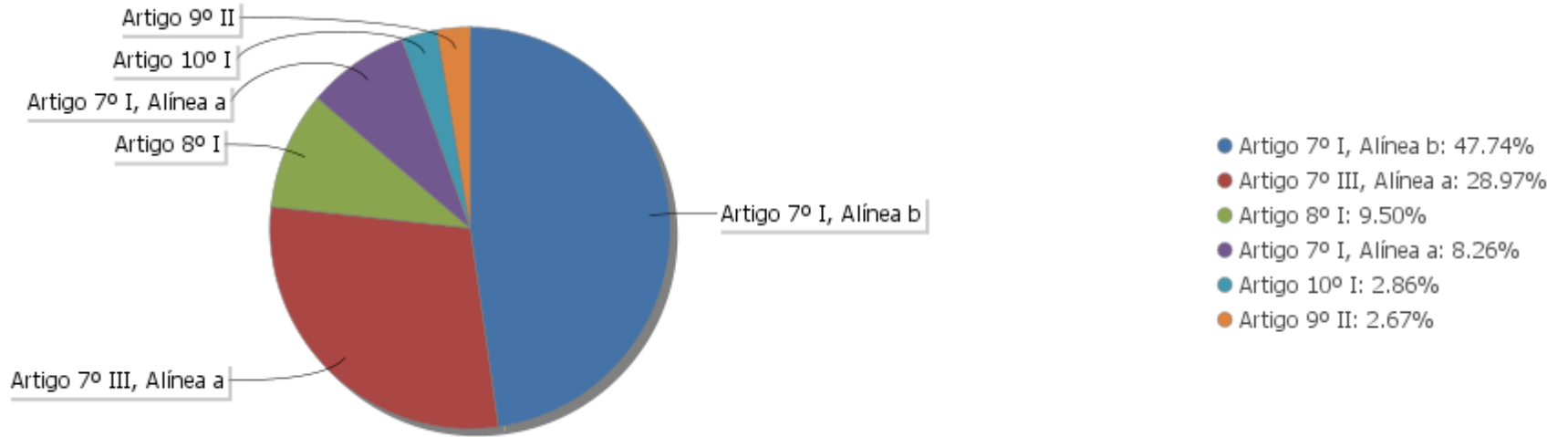
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

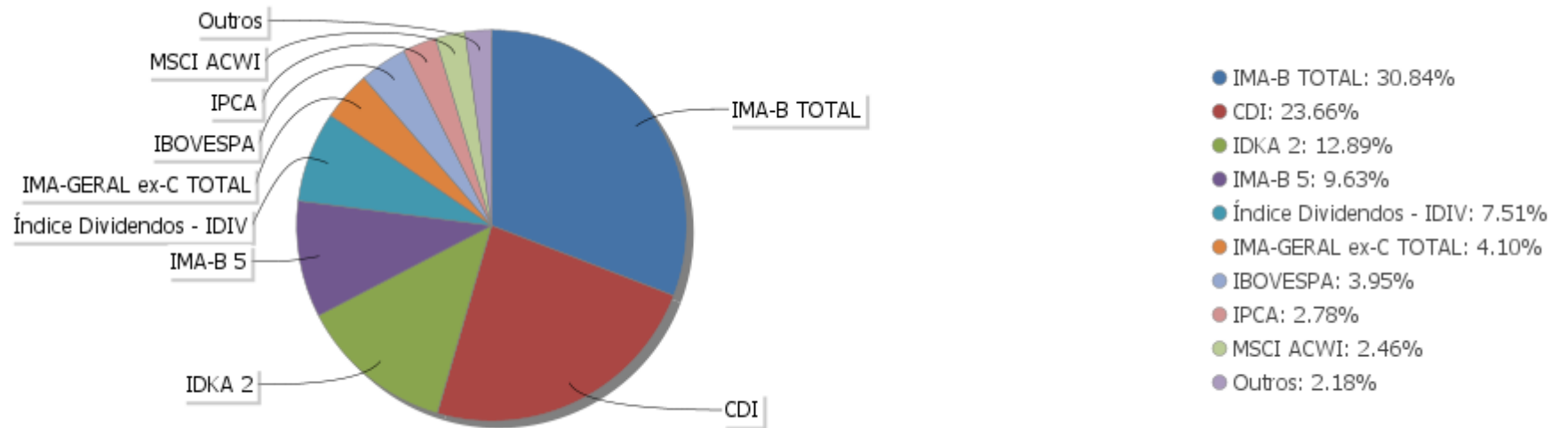
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	275.872.741,40	83,18	275.872.741,40	83,18
de 31 a 365 dias	27.276.650,33	8,22	303.149.391,73	91,41
acima de 365 dias	28.494.035,90	8,59	331.643.427,63	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

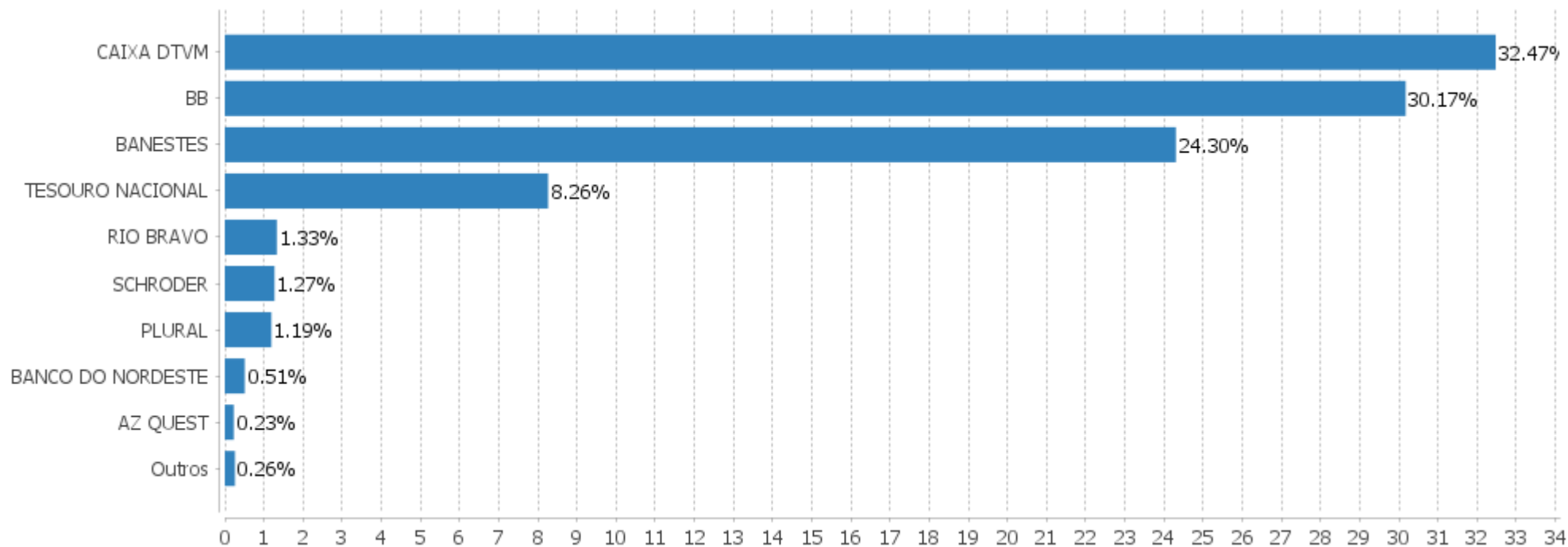


Alocação Por Estratégia



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	0,23	0,39											0,62
INPC + 4,93%	1,07	1,37											2,46
p.p. indexador	-0,85	-0,97											-1,84
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

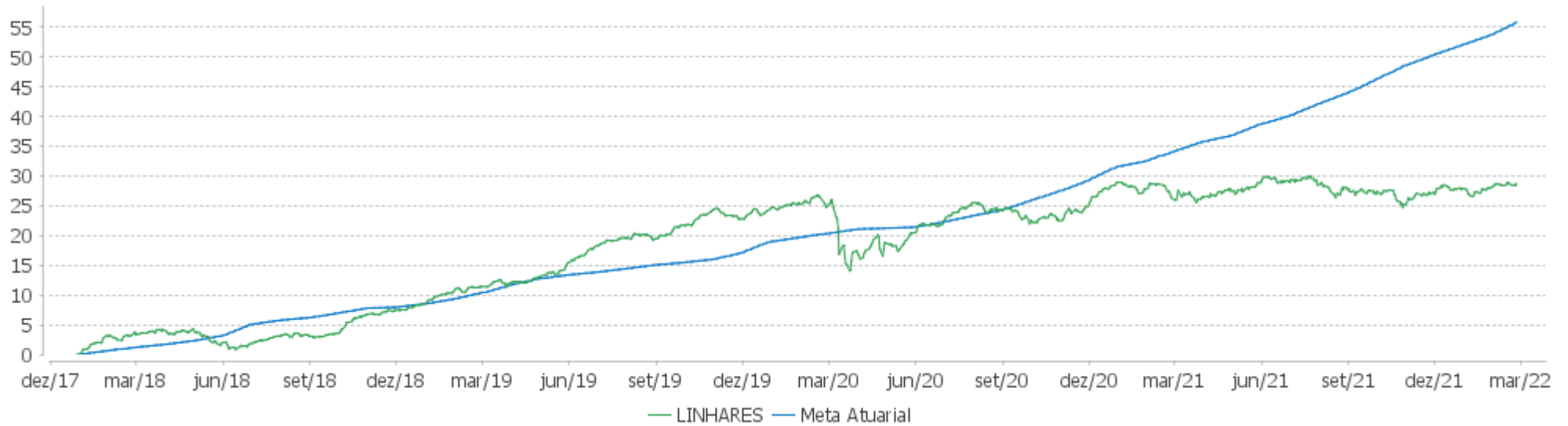
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	18	36,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	32	64,00

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,27	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-6,00	2020-03

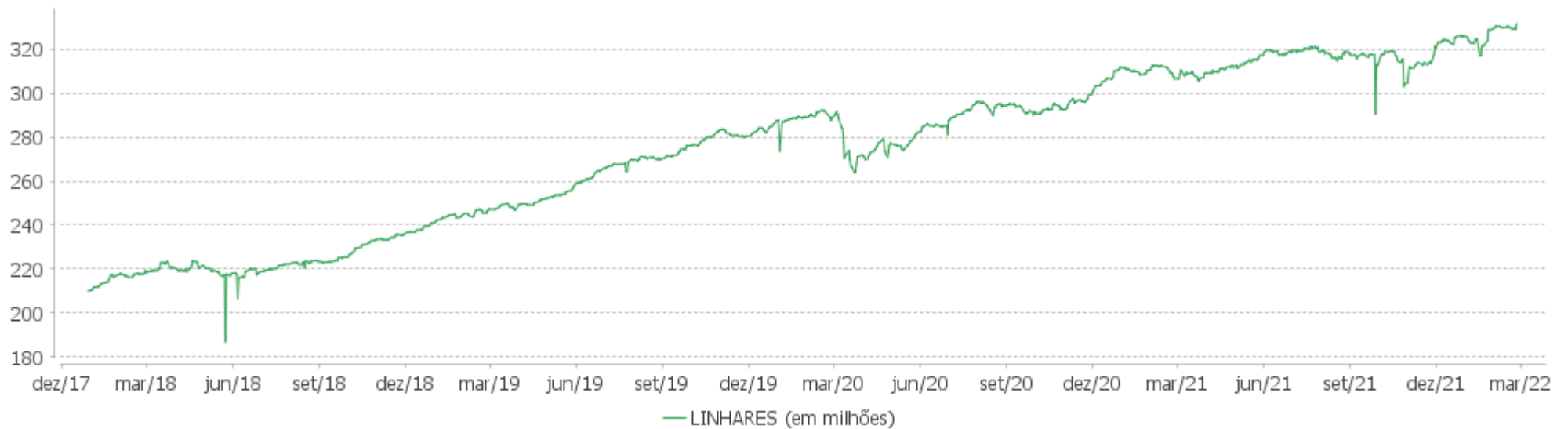
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,17	3,71	-2,53	2,68
06 meses	0,79	8,44	-7,65	3,43
12 meses	1,93	16,77	-14,84	3,59
24 meses	3,07	31,27	-28,20	5,31
36 meses	15,52	44,57	-29,05	4,56
48 meses	24,13	59,29	-35,16	4,12
Desde 29/12/2017	28,69	61,43	-32,74	4,08

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

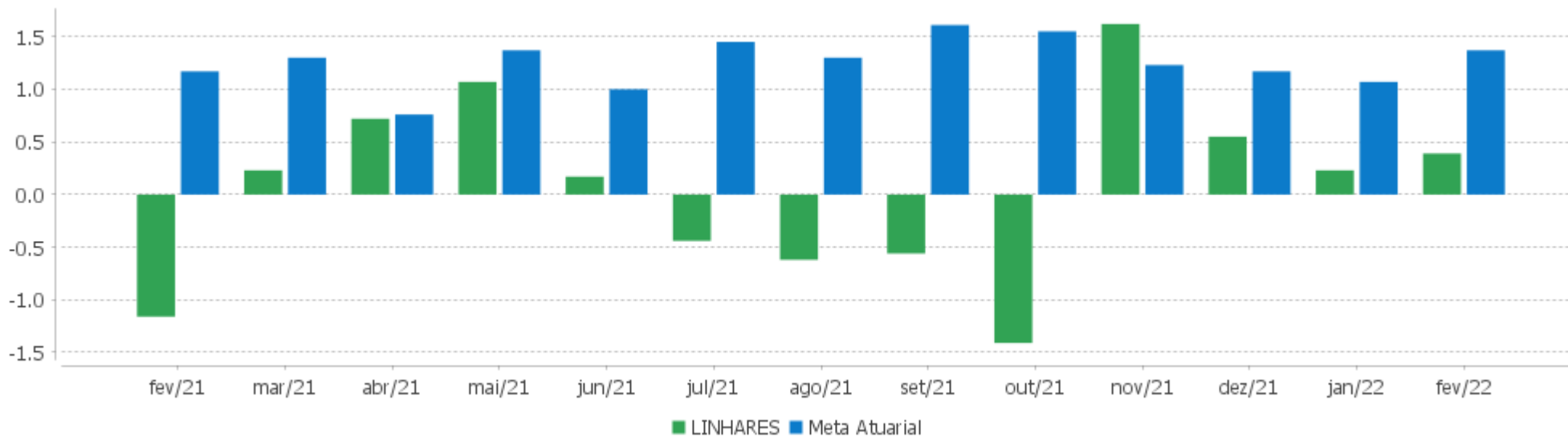


Patrimônio Líquido



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
NTN-B 150822 (6,750000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,19 0,65	2,42 2,62	3,82 3,79	9,15 8,42	14,64 13,72	20,78 16,66	26,43 3,57
NTN-B 150535 (4,410000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,02 0,48	2,07 2,26	3,25 3,22	7,97 7,24	15,45 14,53	15,78 11,67	37,14 14,28
NTN-B 150828 (5,200000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,08 0,54	2,19 2,38	3,44 3,41	8,37 7,64	13,13 12,21	17,88 13,77	22,11 -0,75
NTN-B 150523 (6,050000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,14 0,60	2,32 2,51	3,65 3,62	5,68 4,95	10,63 9,71	15,88 11,76	20,63 -2,23
NTN-B 150824 (5,800000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,76 -2,31	-0,64 -0,45	0,63 0,60	5,57 4,84	10,41 9,49	15,42 11,31	19,94 -2,92
NTN-B 150830 (4,800000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,05 0,51	2,13 2,32	3,34 3,31	8,17 7,44	12,81 11,89	17,35 13,24	21,36 -1,50
NTN-B 150535 (3,200000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,94 0,39	1,88 2,07	2,95 2,92	7,35 6,62	14,11 13,19	23,48 19,36	26,78 3,93
NTN-B 150828 (5,270000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,09 0,54	2,20 2,39	3,46 3,43	8,41 7,68	13,19 12,27	18,00 13,88	22,28 -0,58
NTN-B 150523 (5,850000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,13 0,58	2,29 2,48	3,60 3,57	5,59 4,86	10,44 9,52	15,50 11,38	20,05 -2,81
NTN-B 150828 (5,500000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,10 0,56	2,23 2,43	3,51 3,48	8,52 7,79	13,40 12,48	18,38 14,26	22,84 -0,02
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,82 109,58	1,53 102,66	2,27 100,36	3,95 103,80	6,27 111,08	5,81 71,24	11,44 80,63
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,42 -0,12	-0,24 -0,04	0,19 0,16	0,25 -0,48	-0,68 -1,60	-7,63 -11,75	12,95 -9,91
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,87 116,31	1,63 109,82	2,44 107,75	4,29 112,59	6,73 119,23	6,71 82,32	12,71 89,59
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	0,79 105,80	1,35 91,02	2,07 91,43	3,24 85,14	3,99 70,65	2,92 35,85	19,55 137,78
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,80 106,50	1,59 106,76	2,40 106,07	4,02 105,65	6,01 106,40	8,16 100,10	13,93 98,13
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,67 -0,34	0,86 -0,69	1,63 -0,67	2,38 -3,39	2,83 -7,71		
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82	1,61	2,38	4,08	6,03	8,15	13,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	109,27	108,41	105,17	107,18	106,73	99,97	98,05
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,79	1,54	2,29	3,91	5,64	7,61	13,37
% do CDI	104,90	103,70	101,14	102,63	99,80	93,30	94,21
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	0,93	0,77	1,58	2,93	2,99	8,92	25,52
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,13	-0,41	-0,39	-1,34	-3,33	-4,02	-1,17
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,53	-0,23	-0,03	0,61	0,65	3,48	21,73
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,04	-0,06	-0,12	-0,27	-0,63	-1,13
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,05	1,14	1,92	4,15	6,07	12,36	25,70
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,01	-0,03	-0,05	-0,12	-0,24	-0,59	-0,99
BNB IMA-B FI RF	0,60	-0,04	0,16	0,93	1,21	3,30	20,91
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,05	0,16	0,13	0,20	0,29	-0,82	-1,95
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,74	1,36	2,21	2,84	4,00	6,81	13,48
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,01	-0,02	-0,05	-0,09	-0,26	-0,65	-1,00
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,05	1,13	1,90	4,10	6,00	12,29	25,72
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,01	-0,04	-0,07	-0,17	-0,32	-0,65	-0,96
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,88	1,68	2,47	4,06	5,80	7,96	13,98
% do CDI	117,01	112,83	109,10	106,57	102,66	97,65	98,51
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	1,10	1,39	2,11	4,52	6,99	13,03	27,17
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,55	1,58	2,07	3,79	6,06	8,91	4,32
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	0,45	-0,09	2,18	-0,02	-2,12	0,50	14,45
Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,03	-0,07	-0,09	-0,20	-0,43	-0,57	-1,00
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,41	-0,54	-0,47	-1,33	-2,91	-8,26	13,17
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,14	-0,35	-0,50	-2,06	-3,84	-12,38	-9,69
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,71	1,38	2,18	3,26	3,94	8,13	19,46
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,00	-0,08	0,33	-0,32	0,66	4,98
BB PREV RF IDKA2	1,16	1,17	1,88	4,11	6,26	13,10	24,76
Var. IDKA 2 p.p.	-0,10	-0,14	-0,27	-0,20	-0,44	-1,02	-2,13
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,62	0,65	1,57	1,65	1,74	4,37	16,33
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.							
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,81	1,48	2,32	2,92	1,86	6,59	21,76
Var. IPCA p.p.	-0,20	-0,08	0,02	-2,85	-8,68	-9,70	0,81
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,15	1,17	1,89	4,12	6,30	13,18	24,90
Var. IDKA 2 p.p.	-0,11	-0,14	-0,26	-0,19	-0,40	-0,93	-1,99
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,53	-0,24	-0,04	0,58	0,65	3,56	21,95
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,04	-0,07	-0,15	-0,27	-0,56	-0,91
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,72	1,34	2,20	2,83	4,03	7,01	13,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,04	-0,07	-0,10	-0,23	-0,46	-0,71
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-2,06 0,26	2,74 -2,24	2,05 -4,62	-24,43 -22,87	-27,52 -36,71	-20,16 -25,49	-0,30 -28,42
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-0,34 -1,23	6,13 -1,81	9,91 -1,11	-1,26 3,49	10,01 7,19	20,93 12,32	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,47 -2,36	1,13 -6,81	3,47 -7,55	-11,11 -6,36	-7,61 -10,43	-11,59 -20,20	28,08 9,71
FIA CAIXA DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	-2,38 -3,27	4,68 -3,25	6,28 -4,74	-2,14 2,61	7,80 4,98	-5,06 -13,67	13,99 -4,38
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,71 1,61	8,04 3,06	7,69 1,03	-2,49 -0,93	5,01 -4,18	4,82 -0,51	25,65 -2,47
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,90 1,42	4,29 -0,69	5,04 -1,62	-11,37 -9,81	-8,27 -17,46		
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-5,65 0,94	-16,23 -1,45	-12,27 -0,20	-4,12 1,72	2,88 4,10		
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-5,52 1,07	-16,04 -1,27	-14,66 -2,59	-9,04 -3,21	-3,64 -2,43		
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-7,99 -1,40	-33,87 -19,09	-42,43 -30,36	-36,93 -31,09	-35,75 -34,53		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-9,75 -11,21	-25,87 -28,37	-27,80 -31,59	-24,21 -33,06	-27,00 -44,21	44,06 13,46	
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-2,05 -2,94	-1,84 -5,55					
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	1,03 0,14	1,65 -6,29	3,03 -7,99	4,04 8,78	4,53 1,70		
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO % do CDI	0,96 128,21	3,66 245,97	4,98 220,04	1,92 50,41	4,59 81,26	8,27 101,43	16,29 114,76
LINHARES Var. INPC + 4,93% p.p.	0,39 -0,97	0,62 -1,84	1,17 -2,49	0,79 -7,47	1,93 -14,35	3,07 -26,45	15,52 -25,69
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
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	-	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		0,50
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	D+1 du	D+0	D+30	D+34		0,00
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,15
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		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		0,20
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 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BNB IMA-B FI RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	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 IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
LP						
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
FIA CAIXA DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO	D+0	D+0		D+2		
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE						
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		0,80
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO						
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		0,40

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	0,74	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
13	15/02/2022	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	0,00	85.996,62	41.364,33009000	2,0790042970
12	25/02/2022	NTN-B 150824 (5,800000%)	1.379.740,49	0,00	358,00000000	3.854,0237150800
14	25/02/2022	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	242.136,71	0,00	91.039,98348800	2,6596743620
Total			1.621.877,20	85.996,62		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.874.612,15

Value-At-Risk: 1,47%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LINHARES		1,47	1,47			331.643.427,63	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,02%

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	2,13			2.566.750,23	0,77
NTN-B 150523 (6,050000%)		0,23	0,00	2,13			3.043.801,58	0,92
NTN-B 150535 (3,200000%)		0,09	0,00	2,13			1.084.452,36	0,33
NTN-B 150535 (4,410000%)		0,09	0,00	2,13			1.072.905,36	0,32
NTN-B 150822 (6,750000%)		0,09	0,00	2,13			1.968.931,89	0,59
NTN-B 150824 (5,800000%)		0,23	-0,00	2,16			1.379.740,49	0,42
NTN-B 150828 (5,200000%)		0,09	0,00	2,13			4.020.202,34	1,21
NTN-B 150828 (5,270000%)		0,09	0,00	2,13			1.976.904,30	0,60
NTN-B 150828 (5,500000%)		0,09	0,00	2,13			5.112.176,66	1,54
NTN-B 150830 (4,800000%)		0,09	0,00	2,13			5.181.943,59	1,56
Sub-total	0,23	0,09	0,00		1,51	1,09	27.407.808,80	8,26

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,06	0,00	0,03			1.211.189,76	0,37
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B		2,40	0,11	0,35			20.174.384,67	6,08
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,57	0,00	0,02			2.979.795,31	0,90
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,14	0,08	0,02			17.510.877,74	5,28
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,15	0,09	0,03			17.810.435,55	5,37
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,57	0,00	0,02			372.403,80	0,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,17	0,05	0,01			20.799.881,50	6,27
BB PREV RF IDKA2		1,35	0,04	0,37			15.088.116,47	4,55
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,53	0,01	0,03			2.171.058,98	0,65
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,60	0,09	0,25			27.648.029,63	8,34
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF		1,79	0,00	0,73			147.224,68	0,04
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,16	0,03	0,03			10.986.815,73	3,31
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1		0,22	0,00	0,37			1.005.585,22	0,30
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI		1,01	0,01	1,50			3.055.158,99	0,92
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,12	0,04	2,02			13.611.918,94	4,10
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,75	0,00	0,78			2.684.459,22	0,81
BNB IMA-B FI RF		1,93	0,00	0,21			1.042.715,75	0,31
Sub-total	2,63	1,54	0,55		0,03	0,82	158.300.051,94	47,73

Artigo 7º III, 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		0,07	0,00	0,06			14.909.950,75	4,50
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,07	0,00	0,06			10.970.854,41	3,31
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF		2,16	0,07	0,24			15.276.460,47	4,61
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,06	0,00	0,03			26.184.493,19	7,90
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI		0,07	0,00	0,06			8.391.708,09	2,53
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF		0,30	0,01	0,29			13.131.469,24	3,96
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		0,85	0,01	0,86			6.532.288,76	1,97
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO		0,06	0,00	0,03			657.494,85	0,20
Sub-total	0,72	0,45	0,10		-0,01	0,74	96.054.719,76	28,96

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,24%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA DIVIDENDOS		8,34	0,03	4,36			1.732.807,48	0,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,83	0,02	5,78			775.711,22	0,23
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		9,37	0,39	2,51			17.206.694,51	5,19
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL		16,77	0,25	11,15			6.021.076,15	1,82
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA		11,17	0,04	5,56			1.681.487,77	0,51
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI		8,45	0,07	2,74			4.096.510,86	1,24
Sub-total	10,89	10,24	0,81		-0,17	-1,05	31.514.287,99	9,50

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 1,43%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO		3,05	0,02	3,04			3.001.648,13	0,91
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO		0,79	0,00	9,72			2.079.947,78	0,63
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO		1,98	0,00	9,83			4.415.661,99	1,33
Sub-total	3,51	1,43	0,02		-0,33	-0,41	9.497.257,90	2,86

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,46%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE		8,98	-0,01	8,64			2.364.257,58	0,71
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		25,55	0,02	24,52			1.583.100,61	0,48
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		14,90	0,00	14,88			707.259,80	0,21
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		9,12	-0,02	9,24			4.214.683,25	1,27
Sub-total	29,07	10,46	-0,02		-0,24	-6,35	8.869.301,24	2,67