



VITÓRIA - CONSOLIDADO
OUTUBRO 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 29.10.2021.

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

RENTA FIXA **65,42%**

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 150555	10,97	-4,87	-6,84	2.695.525,69	0,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (4,410000%)	3,29	1,36	5,60	5.201.887,61	0,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (4,470000%)	3,32	1,38	4,20	2.385.986,38	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (4,870000%)	3,53	1,41	2,85	26.960.938,32	3,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (4,970000%)	3,58	1,42	1,58	2.439.144,32	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,400000%)	3,82	0,33	0,33	25.937.857,29	3,41
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,60	1,10	4,78	65.621.339,61	8,62

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	8,55	-3,13	-10,13	9.962.760,37	1,31	220.868.858,67	4,51
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,59	-1,95	-4,41	0,00	0,00	4.811.776.336,97	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,58	-0,54	1,05	101.709,91	0,01	6.589.712.896,46	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,69	-1,24	1,03	117.745.806,68	15,46	10.998.044.937,35	1,07
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,70	-1,27	0,98	101.270.672,28	13,30	6.081.334.244,20	1,67
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	5,19	-1,49	-5,58	6.650.288,00	0,87	444.321.782,99	1,50
BB	BB	BB PREV IPCA I	1,60	-0,49	4,20	9.759.745,79	1,28	512.630.576,09	1,90
BB	BB	BB PREV RF VII	1,59	-0,50	4,14	849.169,05	0,11	242.394.068,14	0,35
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,84	-1,63	-2,98	81.193.777,71	10,66	7.937.028.591,03	1,02
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,26	-1,50	-1,76	327.533.929,79	43,01		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,34	0,46	3,65	2.003.772,98	0,26	290.776.057,80	0,69
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,08	0,30	1,39	6.146.052,03	0,81	916.137.455,12	0,67
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,19	0,50	3,17	2.112.485,32	0,28	7.402.600.316,43	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	5,61	-2,59	-4,97	35.104.065,74	4,61	1.089.006.458,36	3,22
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	8,78	-2,43	-9,14	24.826.855,44	3,26	217.669.909,17	11,41
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,11	0,49	3,14	93.098,73	0,01	6.213.259.499,94	0,00
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,09	0,40	0,46	382,89	0,00	2.523.785.410,34	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,25	0,52	3,98	1.832.927,79	0,24	2.378.882.308,44	0,08
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,70	0,02	-0,81	8.166.226,20	1,07	141.164.905,96	5,78
PORTO SEGURO	INTRAG	PORTO SEGURO IMA-B5 FIC FI RF LP	2,87	-1,23	-0,86	24.785.651,36	3,25	139.365.398,94	17,78
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			4,58	-1,63	-4,41	105.071.518,48	13,80		
Renda Fixa			3,44	-1,32	-2,06	498.226.787,88	65,42		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

23,65%

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
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	19,39	-6,61	-10,62	26.318.318,12	3,46	1.454.533.508,81	1,81
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,84	-4,31	-11,26	8.388.569,16	1,10	970.137.115,48	0,86
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	22,13	-13,00	-26,28	17.292.266,84	2,27	175.293.866,05	9,86
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	20,08	-4,90	-13,38	9.620.542,99	1,26	1.013.856.434,24	0,95
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	19,20	-10,13	-15,27	8.205.052,14	1,08	862.345.754,21	0,95
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	24,34	-9,17	1,61	5.109.651,30	0,67	80.876.611,63	6,32
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	19,24	-2,56	19,23	14.532.236,23	1,91	327.977.554,65	4,43
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	19,70	-8,89	-11,33	13.032.190,43	1,71	166.020.130,72	7,85
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			18,54	-7,59	-11,76	102.498.827,21	13,46		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	13,06	7,55	4,04	7.803.296,98	1,02	2.076.640.371,16	0,38
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,18	7,64	26,45	43.664.930,69	5,73	3.490.527.601,78	1,25
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	13,21	7,63	10,80	24.357.700,67	3,20	2.337.314.930,66	1,04
Sub-total Artigo 8º III			10,49	7,63	19,96	75.825.928,34	9,96		

Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	CEF	BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTIESTRATÉGIA	36,74	-0,11	-1,04	835.570,20	0,11	121.210.426,73	0,69
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			36,74	-0,11	-1,04	835.570,20	0,11		

Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE	22,61	-4,11	-22,52	961.442,07	0,13	49.754.627,38	1,93

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
INVESTIMENTO									
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			22,61	-4,11	-22,52	961.442,07	0,13		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			15,60	-1,68	-1,39	180.121.767,82	23,65		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

10,93%

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
BB	BB	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	19,44	6,76	28,29	10.612.594,90	1,39	2.503.352.041,67	0,42
BB	BB	BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	18,17	4,08	23,36	4.646.881,67	0,61	184.617.141,14	2,52
MONGERAL	BEM	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21,68	8,26	11,13	13.335.889,86	1,75	107.994.159,87	12,35
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	19,23	7,56	29,42	5.824.112,91	0,76	299.258.149,20	1,95
Sub-total Artigo 9º A, II			18,42	7,10	26,36	34.419.479,34	4,52		

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,17	10,93	29,48	30.802.851,40	4,04	3.720.209.176,93	0,83
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	17,15	10,56	30,21	10.064.720,09	1,32	1.374.876.386,35	0,73
BB	BB	BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NÍVEL I FI	17,83	-5,84	-1,57	7.969.367,18	1,05	902.779.443,15	0,88
Sub-total Artigo 9º A, III			15,05	7,72	22,46	48.836.938,67	6,41		

Investimentos no Exterior			14,47	7,46	23,12	83.256.418,01	10,93		
Total			4,47	-0,50	-0,16	761.604.973,71	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								Pró-Gestão Nível 2
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	65.621.339,61	8,62	0,00	0,00	5,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	327.533.929,79	43,01	45,00	66,99	80,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	105.071.518,48	13,80	0,00	0,00	30,00	0,00	50,00
	Total Renda Fixa	498.226.787,88	65,42					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	102.498.827,21	13,46	5,00	13,01	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	75.825.928,34	9,96	5,00	10,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	835.570,20	0,11	0,00	0,00	3,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	961.442,07	0,13	0,00	0,00	3,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	180.121.767,82	23,65					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	34.419.479,34	4,52	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	48.836.938,67	6,41	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	83.256.418,01	10,93					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	1,10 229,64	4,78 159,45	3,38 250,91	4,78 208,68	4,78 143,93	491.373,92	1.078.348,61
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-1,50 -312,11	-1,76 -58,76	-1,33 -98,32	-0,69 -30,18	2,21 66,52	-5.193.714,55	-6.657.689,53
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-1,63 -339,55	-4,41 -146,87	-2,57 -190,67	-1,98 -86,18	0,62 18,80	-1.912.219,57	-5.108.863,47
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-7,59 -0,85	-11,76 1,27	-16,10 -1,08	-14,17 -1,22	7,36 -2,81	-8.413.642,67	-12.811.277,11
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	7,63 14,37	19,96 32,99	6,09 21,11	12,34 25,29	32,65 22,49	5.374.674,75	8.425.991,81
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,11 6,63	-1,04 12,00	-0,35 14,68	-5,94 7,01	-31,01 -41,17	-935,19	-8.757,57
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-4,11 2,63	-22,52 -9,48	-23,38 -8,36	-22,70 -9,75	-20,72 -30,88	-41.242,13	-279.411,00
Artigo 9º A, II % do CDI	7,10 1.477,49	26,36 878,75	10,58 784,50	10,78 470,26	35,74 1.075,46	2.281.100,47	5.018.257,48
Artigo 9º A, III % do CDI	7,72 1.608,05	22,46 748,75	8,02 594,49	8,90 388,37	29,36 883,60	3.502.092,22	8.918.148,53
VITÓRIA - CONSOLIDADO (Total)						-3.912.512,75	-1.425.252,25

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555	1.929.100,64	872.769,87	0,00	0,00	2.695.525,69	-106.344,82	-164.393,58
NTN-B 150555 (4,410000%)	5.132.032,80	0,00	0,00	0,00	5.201.887,61	69.854,81	275.803,36
NTN-B 150555 (4,470000%)	2.353.467,35	0,00	0,00	0,00	2.385.986,38	32.519,03	96.250,69
NTN-B 150555 (4,870000%)	26.585.418,10	0,00	0,00	0,00	26.960.938,32	375.520,22	747.138,97
NTN-B 150555 (4,970000%)	2.404.988,79	0,00	0,00	0,00	2.439.144,32	34.155,53	37.880,02
NTN-B 150555 (5,400000%)	0,00	25.852.188,14	0,00	0,00	25.937.857,29	85.669,15	85.669,15
					65.621.339,61	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	33.057.683,05	0,00	-22.204.001,05	0,00	9.962.760,37	-890.921,63	-3.601.108,00
BB PREV IPCA I	9.808.112,42	0,00	0,00	0,00	9.759.745,79	-48.366,63	402.951,75
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	82.536.088,82	0,00	0,00	0,00	81.193.777,71	-1.342.311,11	-2.494.969,76
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	102.483.475,87	93.111,66	0,00	0,00	101.270.672,28	-1.305.915,25	1.148.219,71
BB PREV RF VII	853.403,98	0,00	0,00	0,00	849.169,05	-4.234,93	34.641,84
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.751.056,00	0,00	0,00	0,00	6.650.288,00	-100.768,00	-393.288,00
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	119.229.065,67	0,00	0,00	0,00	117.745.806,68	-1.483.258,99	1.201.872,97
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	891.134,88	0,00	-873.744,63	0,00	0,00	-17.390,25	-1.461.978,74
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	102.257,67	0,00	0,00	0,00	101.709,91	-547,76	6.194,87
					327.533.929,79	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	8.164.420,67	0,00	0,00	0,00	8.166.226,20	1.805,53	-66.369,97
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	25.444.274,64	0,00	0,00	0,00	24.826.855,44	-617.419,20	-3.147.068,50
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	4.019.676,35	48.905.641,31	-46.792.723,72	0,00	6.146.052,03	13.458,09	69.951,97
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	1.972.928,03	0,00	-150.000,00	0,00	1.832.927,79	9.999,76	399.638,14
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	1.994.523,75	0,00	0,00	0,00	2.003.772,98	9.249,23	114.454,91
BB PREV RF FLUXO FIC	4.145,44	107.111,66	-110.898,70	0,00	382,89	24,49	10.098,18
BB PREV RF IMA-B	39.959.613,00	0,00	-3.822.969,44	0,00	35.104.065,74	-1.032.577,82	-2.342.627,11
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	78.684,11	14.002,72	0,00	0,00	93.098,73	411,90	2.437,67
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.101.916,18	0,00	0,00	0,00	2.112.485,32	10.569,14	64.969,88
PORTO SEGURO IMA-B5 FIC FI RF LP	25.093.392,05	0,00	0,00	0,00	24.785.651,36	-307.740,69	-214.348,64
					105.071.518,48	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	28.182.546,94	0,00	0,00	0,00	26.318.318,12	-1.864.228,82	-3.635.115,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	19.876.259,56	0,00	0,00	0,00	17.292.266,84	-2.583.992,72	-6.165.449,13
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	8.765.998,80	0,00	0,00	0,00	8.388.569,16	-377.429,64	-1.064.051,21
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	9.129.944,50	0,00	0,00	0,00	8.205.052,14	-924.892,36	-1.479.161,65
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	5.625.269,42	0,00	0,00	0,00	5.109.651,30	-515.618,12	-190.348,70
OCCAM FIC FIA	10.116.035,66	0,00	0,00	0,00	9.620.542,99	-495.492,67	-1.511.172,03
TARPON GT 30 FIC FIA	14.913.293,86	0,00	0,00	0,00	14.532.236,23	-381.057,63	341.989,50
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	14.303.121,14	0,00	0,00	0,00	13.032.190,43	-1.270.930,71	-1.754.024,99
					102.498.827,21	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	40.564.775,28	0,00	0,00	0,00	43.664.930,69	3.100.155,41	5.617.974,24
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	22.630.696,74	0,00	0,00	0,00	24.357.700,67	1.727.003,93	2.357.700,67
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	7.255.781,57	0,00	0,00	0,00	7.803.296,98	547.515,41	303.296,98
					75.825.928,34	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTIESTRATÉGIA	836.505,39	0,00	0,00	0,00	835.570,20	-935,19	-8.757,57
					835.570,20	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	1.002.684,20	0,00	0,00	0,00	0,00	961.442,07	-41.242,13	-279.411,00
						961.442,07	0,00	0,00

Artigo 9º A, II

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	9.940.510,01	0,00	0,00	0,00	10.612.594,90	672.084,89	1.655.567,28
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	4.464.738,93	0,00	0,00	0,00	4.646.881,67	182.142,74	879.850,77
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	12.318.437,09	0,00	0,00	0,00	13.335.889,86	1.017.452,77	1.335.889,86
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	5.414.692,84	0,00	0,00	0,00	5.824.112,91	409.420,07	1.146.949,57
					34.419.479,34	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	9.103.139,23	0,00	0,00	0,00	10.064.720,09	961.580,86	1.881.809,40
BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NÍVEL I FI	8.463.589,77	0,00	0,00	0,00	7.969.367,18	-494.222,59	38.015,96
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	27.768.117,45	0,00	0,00	0,00	30.802.851,40	3.034.733,95	6.998.323,17
					48.836.938,67	0,00	0,00

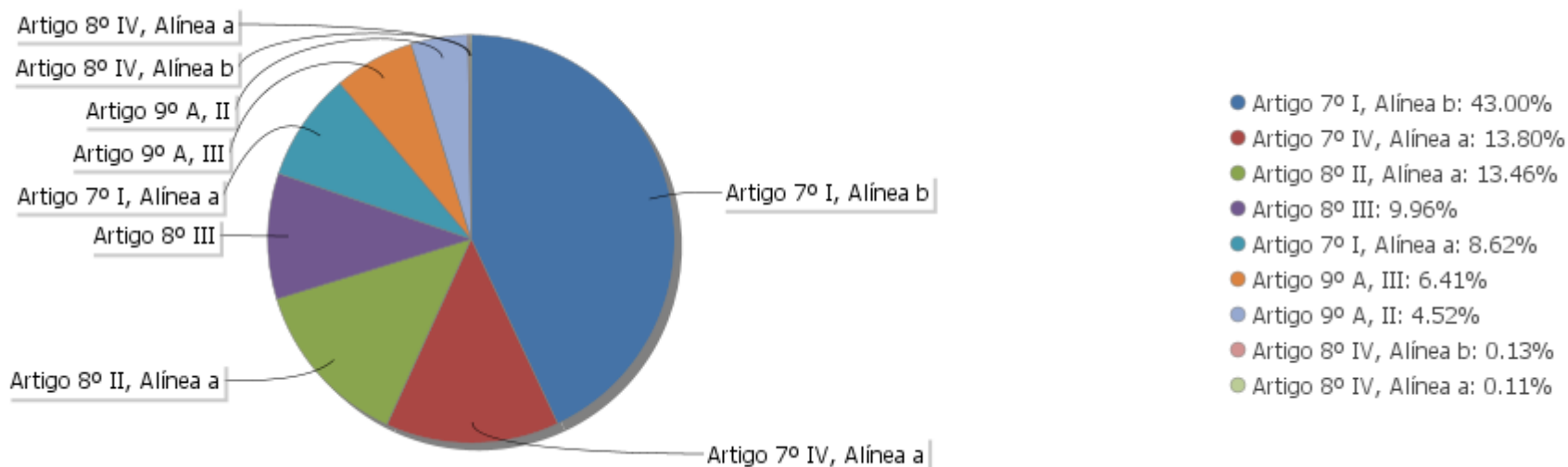
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

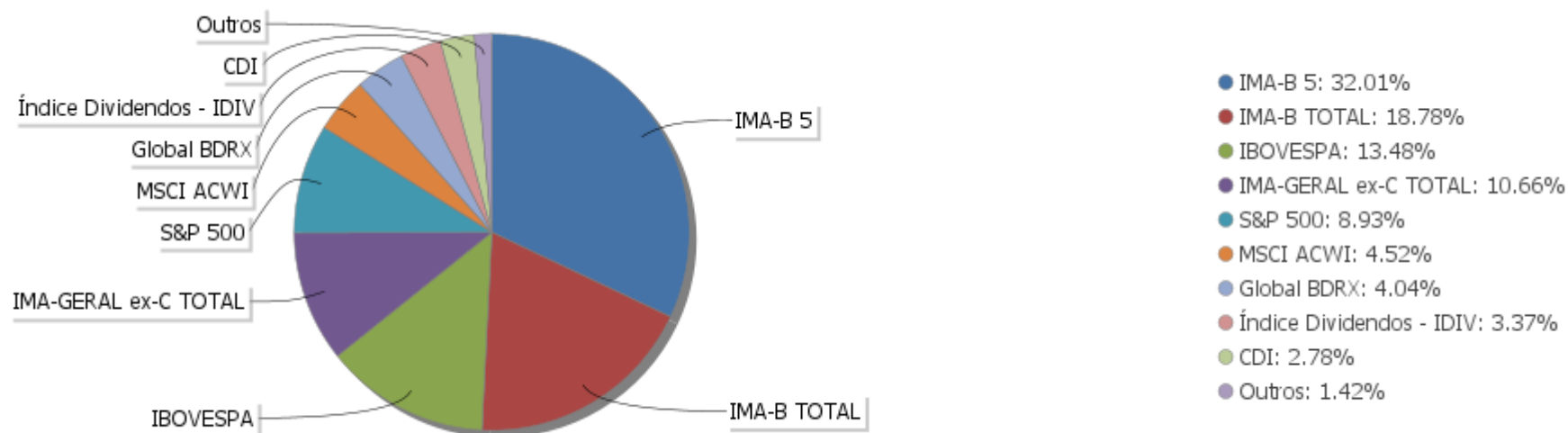
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	643.877.101,05	84,54	643.877.101,05	84,54
de 31 a 365 dias	44.494.802,98	5,84	688.371.904,03	90,38
acima de 365 dias	73.233.069,68	9,62	761.604.973,71	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

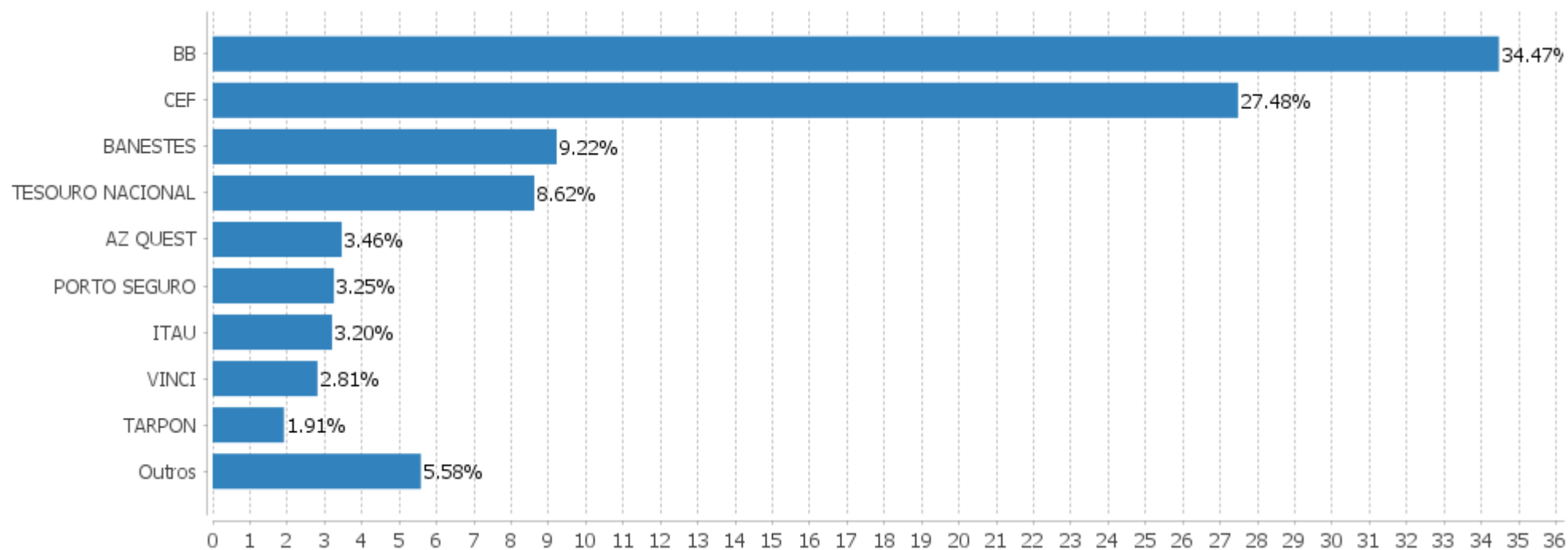


Alocação Por Estratégia



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	-0,60	-1,02	0,71	1,39	0,93	0,34	0,04	-0,52	-0,88	-0,50			-0,16
IPCA + 5,50%	0,68	1,25	1,42	0,74	1,28	0,98	1,43	1,34	1,61	1,68			13,13
p.p. indexador	-1,28	-2,27	-0,71	0,65	-0,35	-0,64	-1,39	-1,87	-2,49	-2,18			-13,28
2020	1,00	-0,08	-5,94	1,40	1,73	1,73	2,87	-0,91	-1,50	0,04	2,73	3,71	6,61
INPC + 5,50%	0,66	0,55	0,65	0,19	0,17	0,75	0,93	0,81	1,32	1,34	1,38	1,94	11,22
p.p. indexador	0,34	-0,64	-6,59	1,21	1,56	0,98	1,94	-1,72	-2,82	-1,30	1,35	1,77	-4,61
2019	2,06	0,56	0,52	1,09	2,39	2,36	1,26	-0,21	2,09	2,21	-0,89	1,62	16,06
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	1,19	-0,45	-0,70	0,00	1,73	1,91	0,62	-0,84	1,65	1,63	-1,90	-0,09	5,29

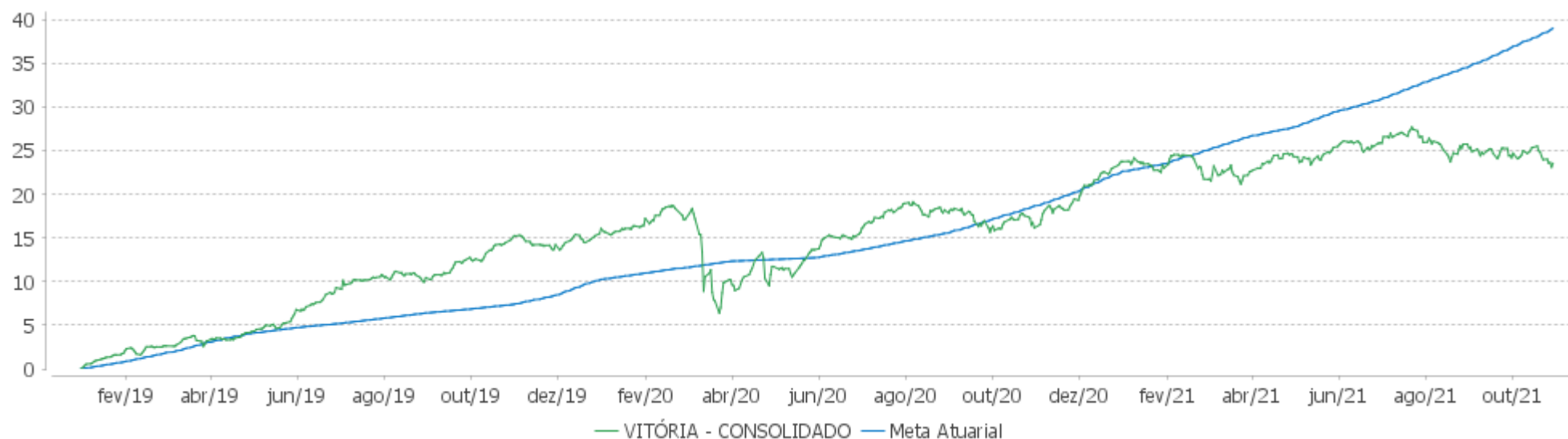
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

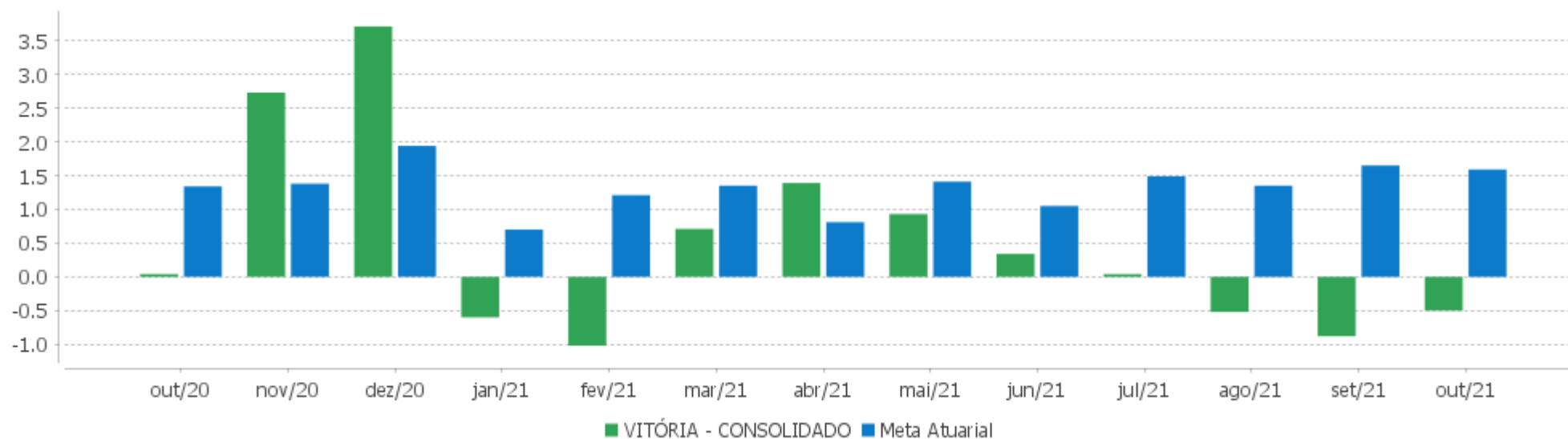
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	15	44,12	03 meses	-1,90	4,71	-6,60	4,76
Meses abaixo - Meta Atuarial	19	55,88	06 meses	-0,61	8,62	-9,23	4,38
			12 meses	6,37	16,91	-10,54	4,47
			24 meses	7,21	29,26	-22,06	6,30
			Desde 31/12/2018	23,54	39,38	-15,84	5,49
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	3,71	2020-12					
Menor rentabilidade da Carteira	-5,94	2020-03					

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
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-3,13 -0,58	-10,13 -5,34	-5,85 -2,11	-4,76 -2,09	-1,26 -3,09	-11,85 -12,66	21,64 -6,12
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,56 -0,02	-5,00 -0,22	-3,82 -0,09	-2,82 -0,14	1,58 -0,26	0,15 -0,66	26,66 -1,11
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-1,24 -0,01	1,03 -0,19	-0,14 -0,05	0,39 -0,10	4,19 -0,24	9,79 -0,60	24,71 -0,90
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,49 -2,21	4,20 -9,37	1,27 -3,57	3,07 -5,81	6,71 -10,55	13,80 -15,30	31,38 -8,94
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,50 2,05	4,14 8,93	1,25 4,99	3,04 5,71	6,63 4,80	11,48 10,67	23,11 -4,66
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,49 1,05	-5,58 -0,80	-3,19 0,55	-3,17 -0,50	-1,69 -3,52	3,18 2,38	20,05 -7,71
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-1,63 -0,27	-2,98 -0,88	-2,07 -0,40	-1,74 -0,78	0,17 -0,50	1,97 -0,88	17,51 -0,37
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-1,27 -0,04	0,98 -0,24	-0,21 -0,11	0,31 -0,18	4,16 -0,27	9,80 -0,59	24,69 -0,92
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	-0,54 0,00	1,05 -0,18	0,18 -0,04	0,71 -0,12	1,55 -0,22	5,47 -0,44	12,78 -0,69
NTN-B 150555 (5,400000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,53 4,07	10,12 14,91	4,51 8,24	5,20 7,87	10,30 8,47	14,07 13,26	17,00 -10,76
NTN-B 150555 (4,870000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,41 3,96	9,81 14,60	4,30 8,04	5,07 7,74	10,12 8,29	13,79 12,98	16,61 -11,15
NTN-B 150555 (4,410000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,36 3,91	9,58 14,37	4,19 7,92	5,00 7,68	10,00 8,17	13,56 12,76	16,28 -11,48
NTN-B 150555 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-4,87 -2,33	-14,28 -9,49	-9,75 -6,02	-7,74 -5,07	-3,46 -5,29	-15,54 -16,35	19,22 -8,54
NTN-B 150555 (4,470000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,38 3,93	9,63 14,41	4,20 7,94	5,03 7,70	10,03 8,20	13,61 12,80	16,34 -11,42
NTN-B 150555 (4,970000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,42 3,96	9,85 14,64	4,33 8,06	5,08 7,76	10,14 8,31	13,83 13,02	16,67 -11,09
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,43 0,12	-9,14 -4,35	-4,61 -0,88	-3,34 -0,67	-0,18 -2,01	-11,80 -12,60	19,90 -7,86
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,46	3,65	1,40	2,47	4,13	4,01	10,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	96,53	121,66	103,79	107,76	124,20	60,31	78,66
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,52	3,98	1,57	2,81	4,57	4,89	11,70
% do CDI	107,40	132,62	116,06	122,54	137,66	73,48	88,11
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	0,02	-0,81	-0,12	0,78	2,38	2,03	21,00
% do CDI	4,60	-26,88	-9,23	33,92	71,53	30,44	158,13
BB PREV RF IMA-B	-2,59	-4,97	-3,80	-2,78	1,54	0,12	26,49
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,05	-0,18	-0,07	-0,10	-0,29	-0,69	-1,27
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,49	3,14	1,40	2,43	3,57	6,36	12,75
% do CDI	101,77	104,82	103,92	105,81	107,34	95,52	96,06
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,30	1,39	0,78	1,25	1,42	2,16	5,34
% do CDI	61,82	46,41	58,04	54,35	42,84	32,54	40,23
BB PREV RF FLUXO FIC	0,40	2,06	1,05	1,72	2,23	4,34	9,63
% do CDI	82,94	68,82	77,72	74,99	67,08	65,28	72,51
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,50	3,17	1,53	2,55	3,70	6,36	12,78
% do CDI	104,67	105,67	113,52	111,29	111,46	95,60	96,27
PORTO SEGURO IMA-B5 FIC FI RF LP	-1,23	1,25	-0,17	0,44	4,53	10,59	25,78
Var. IMA-B 5 p.p.	0,01	0,03	-0,08	-0,05	0,10	0,20	0,17
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	-13,00	-26,28	-26,05	-25,93	-15,76	-14,66	17,70
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-8,77	-17,58	-17,06	-18,38	-29,54	-16,40	-23,96
TARPON GT 30 FIC FIA	-2,56	14,65	-7,77	-0,80	43,94		
Var. IBOVESPA p.p.	4,18	27,69	7,26	12,15	33,78		
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	-9,17	-0,13	-10,33	1,02	24,12		
Var. IBOVESPA p.p.	-2,43	12,91	4,70	13,97	13,96		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	-6,61	-8,04	-15,05	-13,66	9,74	2,78	46,54
Var. IBOVESPA p.p.	0,12	4,99	-0,03	-0,72	-0,42	6,25	28,15
OCCAM FIC FIA	-4,90	-13,38	-13,65	-13,99	6,72	-0,81	27,85
Var. IBOVESPA p.p.	1,84	-0,34	1,38	-1,05	-3,45	2,65	9,46
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	-8,89	-9,95	-17,65	-13,40	6,69	-0,87	34,79
Var. IBOVESPA p.p.	-2,15	3,08	-2,63	-0,46	-3,47	2,60	16,40
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-4,31	-11,26	-11,69	-11,00	10,90	-0,23	41,49
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,07	-2,55	-2,71	-3,45	-2,87	-1,98	-0,17
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	-10,13	-15,27	-17,46	-16,11	2,63	-4,49	
Var. IBOVESPA p.p.	-3,39	-2,24	-2,43	-3,16	-7,53	-1,02	
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	-4,11	-22,52	-23,38	-22,70	-20,72	-41,86	-44,39
Var. IFIX p.p.	-2,64	-15,74	-18,12	-16,22	-17,43	-37,69	-63,71
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	7,64	26,45	6,08	12,36	44,33	49,77	73,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. S&P 500 p.p.	-3,27	-6,69	-9,37	-2,67	6,63	-63,90	-84,22
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	7,55	25,96	6,04	12,17	43,56	51,04	74,88
Var. IBOVESPA p.p.	14,28	38,99	21,07	25,12	33,40	54,51	56,49
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	7,63	26,41	6,12	12,21	44,35	52,17	76,53
Var. S&P 500 p.p.	-3,29	-6,73	-9,33	-2,82	6,65	-61,50	-81,25
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,11	-1,04	-0,35	-5,94	-31,01	-53,44	-56,73
% do CDI	-23,27	-34,58	-25,66	-259,15	-932,97	-803,15	-427,25
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	10,93	29,48	13,35	13,59	33,54	114,42	160,27
Var. Global BDRX p.p.	-0,22	-2,81	-0,14	-1,66	-3,39	-4,34	-6,94
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	10,56	30,21	14,59	14,59	33,62	105,85	134,77
Var. IBOVESPA p.p.	17,30	43,25	29,61	27,54	23,46	109,32	116,38
BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NÍVEL I FI	-5,84	-1,57	-13,87	-10,90	10,74	33,72	95,64
Var. IBOVESPA p.p.	0,90	11,47	1,16	2,05	0,57	37,19	77,25
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	6,76	28,29	10,09	9,85	40,86	107,47	149,88
Var. MSCI ACWI p.p.	-2,20	3,07	-3,29	-1,04	8,63	10,95	16,45
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	4,08	23,36	6,32	5,92	29,13	66,90	97,58
Var. MSCI ACWI p.p.	-4,89	-1,86	-7,06	-4,97	-3,10	-29,63	-35,86
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	7,56	29,42	11,33	12,03	36,11		
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,40	4,20	-2,05	1,14	3,87		
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	8,26	21,07	12,21	12,79	31,97		
Var. MSCI ACWI p.p.	-0,71	-4,15	-1,16	1,90	-0,27		
VITÓRIA - CONSOLIDADO	-0,50	-0,16	-1,90	-0,61	6,37	7,21	
Var. INPC + 5,50% p.p.	-2,09	-13,51	-6,56	-9,47	-10,77	-22,21	
CDI	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28
IBOVESPA	-6,74	-13,04	-15,02	-12,95	10,16	-3,47	18,39
INPC + 6,00%	1,63	13,79	4,79	9,12	17,69	30,64	42,02
IPCA + 6,00%	1,72	13,57	4,83	8,88	17,26	29,10	40,32

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	-0,54	1,23	0,23	0,83	1,78	5,91	13,47	21,48	36,42
IRF-M 1+	-3,44	-9,10	-5,21	-5,61	-5,90	-1,54	16,13	28,17	50,67
IRF-M TOTAL	-2,63	-5,50	-3,53	-3,59	-3,30	0,99	15,83	26,75	47,22
IMA-B 5	-1,24	1,22	-0,10	0,49	4,43	10,39	25,61	37,29	55,80
IMA-B 5+	-3,87	-10,25	-7,19	-5,85	-1,01	-6,80	27,68	41,57	63,18
IMA-B TOTAL	-2,54	-4,79	-3,73	-2,67	1,83	0,81	27,76	40,92	61,47
IMA-GERAL TOTAL	-1,31	-1,68	-1,71	-0,86	1,05	3,75	19,11	29,71	47,78
IDKA 2	-1,47	1,56	-0,12	0,25	4,62	11,66	25,12	37,32	56,68
IDKA 20	-6,31	-17,52	-13,17	-11,45	-5,06	-17,66	27,75	43,34	67,23
CDI	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28	20,70	34,10

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-6,74	-13,04	-15,02	-12,95	10,16	-3,47	18,39	39,29	59,42
IBRX 100	-6,81	-12,40	-16,15	-14,19	10,40	-1,79	22,56	43,44	64,83
IBRX 50	-6,27	-12,20	-16,31	-13,99	11,64	-2,23	17,51	38,33	58,04
SMALL CAP	-12,53	-17,37	-21,28	-20,14	3,62	-2,77	38,93	46,64	90,99
IFIX	-1,47	-6,78	-5,26	-6,48	-3,29	-4,17	19,32	20,19	41,88
Índice Consumo - ICON	-9,73	-20,10	-18,41	-17,11	-8,62	-10,39	29,95	16,52	35,92
Índice Dividendos - IDIV	-4,23	-8,71	-8,99	-7,55	13,78	1,74	41,65	49,00	84,75

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	1,25	8,24	3,32	5,73	10,67	15,01	17,92	23,30	26,63
INPC	1,16	8,45	3,27	5,96	11,08	16,38	19,35	24,13	26,41
IGPM	0,64	16,74	0,66	6,24	21,73	47,21	51,84	68,23	65,87
SELIC	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28	20,71	34,13

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	10,92	33,14	15,45	15,03	37,70	113,67	157,78	207,96	284,24
MSCI ACWI	8,97	25,22	13,38	10,89	32,23	96,53	133,44	158,41	221,64
MSCI World	9,54	28,15	13,97	12,82	35,37	100,32	138,32	168,41	233,05

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,57	11,80	4,33	7,84	15,06	24,32	32,57	44,11	53,90
IPCA + 5,00%	1,64	12,68	4,58	8,36	16,16	26,70	36,41	49,70	61,40
IPCA + 5,50%	1,68	13,13	4,71	8,62	16,71	27,90	38,35	52,55	65,25
IPCA + 5,89%	1,71	13,47	4,80	8,82	17,14	28,84	39,89	54,81	68,31
IPCA + 6,00%	1,72	13,57	4,83	8,88	17,26	29,10	40,32	55,45	69,18
INPC + 4,00%	1,48	12,02	4,29	8,08	15,49	25,80	34,17	45,08	53,62
INPC + 6,00%	1,63	13,79	4,79	9,12	17,69	30,64	42,02	56,50	68,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
583	01/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	545.518,36	66.434,16360683	8,2114130800
602	01/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.093,36	254,93297921	8,2114130800
584	05/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	289.748,70	35.275,75682598	8,2138195200
585	05/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.777.671,34	216.424,44610227	8,2138195200
565	05/10/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.784,32	1.759,63817100	2,1506239540
603	05/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.576,53	435,42836451	8,2138195200
575	06/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	774,48	0,00	94,27630842	8,2150013400
576	07/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.753,16	0,00	213,37760160	8,2162325700
577	08/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	167.693,93	0,00	20.407,11315736	8,2174254000
578	11/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	458,66	0,00	55,80745287	8,2186155500
559	15/10/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	14.000,00	0,00	6.500,79344200	2,1535832700
597	15/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	975,85	0,00	118,68436148	8,2222290100
586	18/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	25.967,59	3.157,77326044	8,2233865000
560	18/10/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.002,72	6.500,79344200	2,1540019310
561	18/10/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	14.002,72	0,00	5.909,47273000	2,3695379670
566	21/10/2021	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	150.000,00	39.929,71794653	3,7566005400
579	22/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	99.316,77	0,00	12.070,36209142	8,2281516700
574	22/10/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	873.744,63	247.435,47005400	3,5312020000
598	22/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	34.596,92	0,00	4.204,70129715	8,2281516700
571	22/10/2021	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	10.348.113,70	2.759.623,81897739	3,7498276500
568	22/10/2021	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	8.766.860,71	2.337.936,97425000	3,7498276500
569	22/10/2021	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	72.025,50	19.207,68278510	3,7498276500
570	22/10/2021	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	2.689.761,39	717.302,67123077	3,7498276500
580	25/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	907.348,47	0,00	110.257,16779520	8,2293830700
599	25/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	25.756.608,63	0,00	3.129.834,69245648	8,2293830700
572	25/10/2021	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	5.727,36	3.195,74407880	1,7921835600
573	25/10/2021	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	144.272,64	80.501,03974841	1,7921835600
558	25/10/2021	BB PREV RF IMA-B	0,00	3.822.969,44	692.919,24059300	5,5171933750

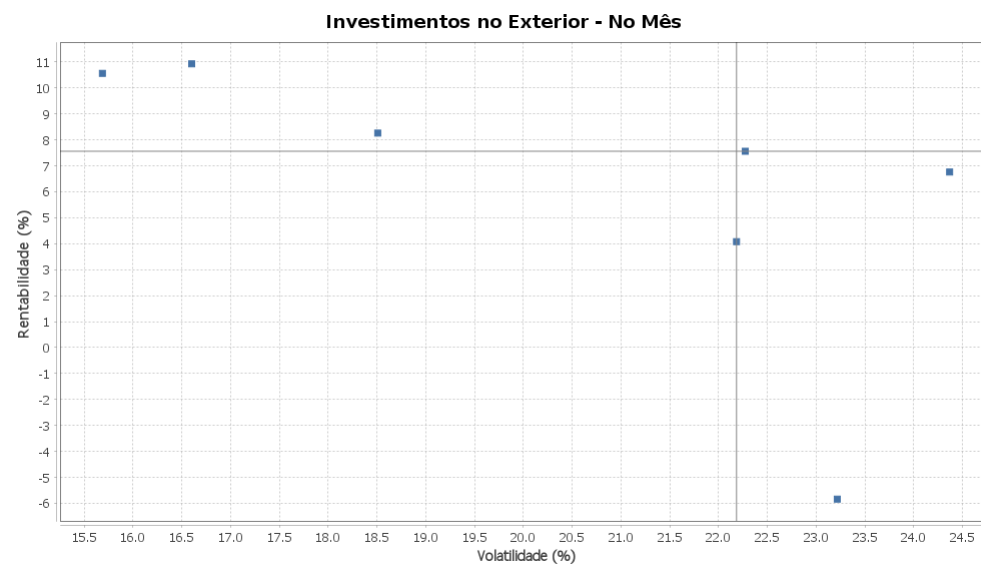
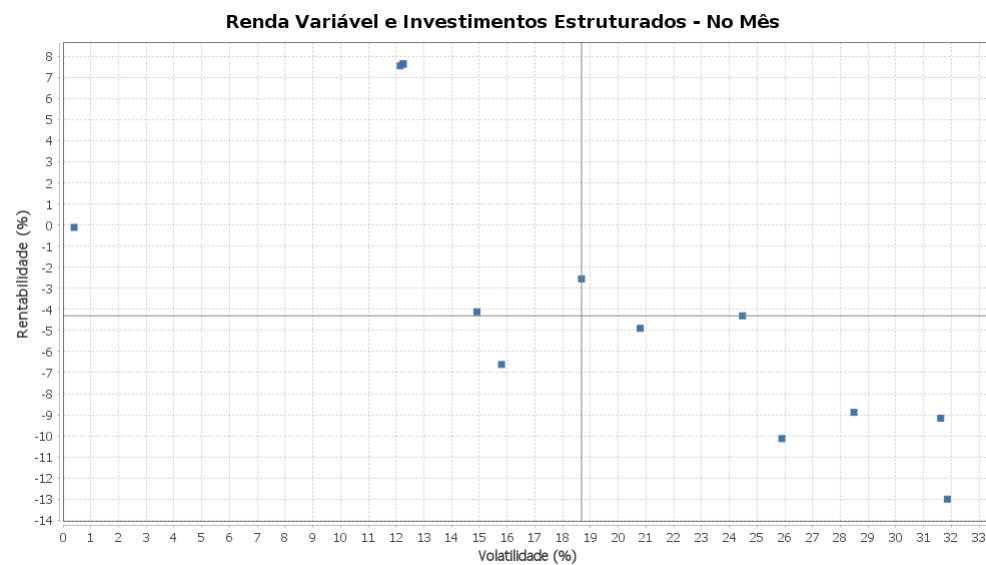
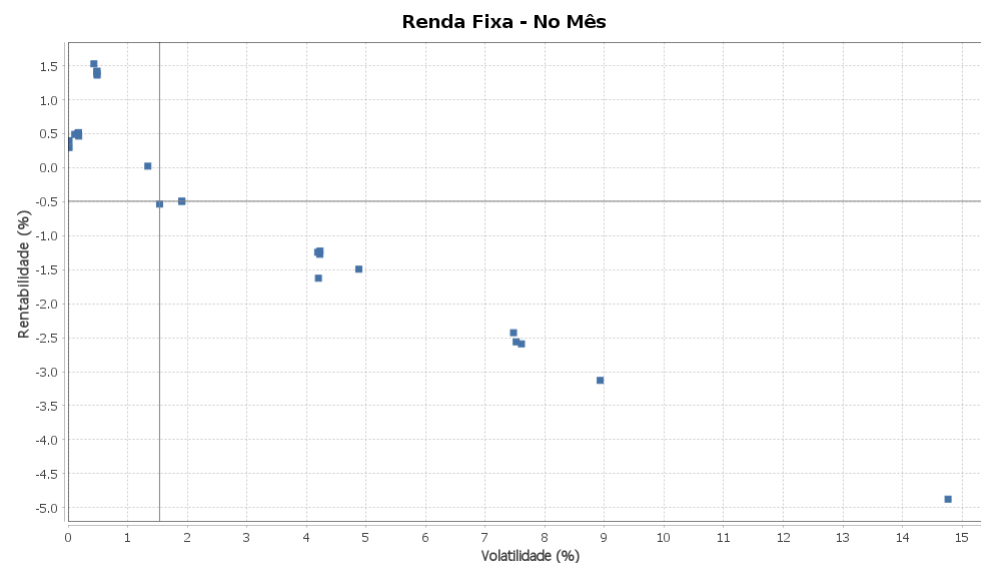
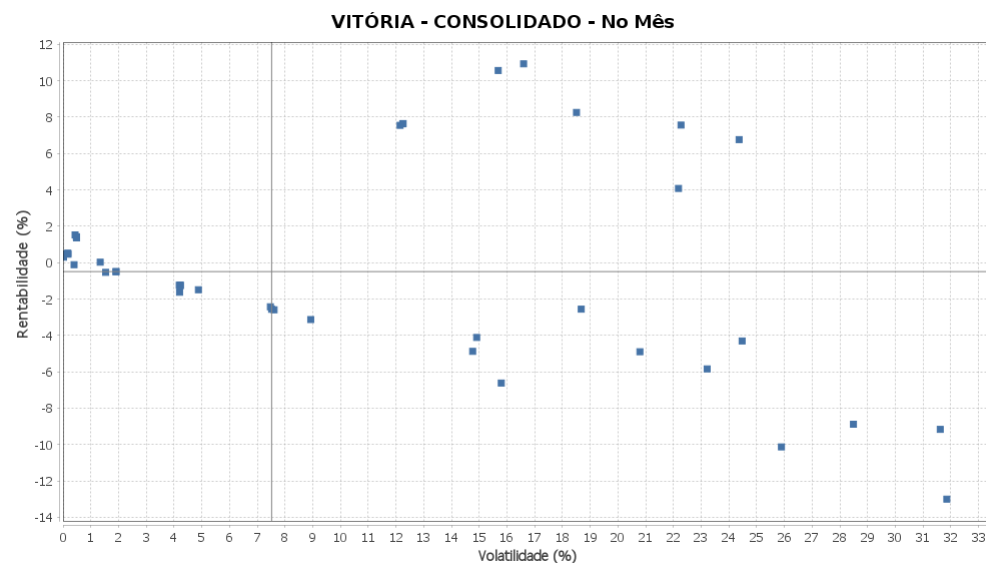
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
587	26/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	872.769,87	106.039,98753618	8,2305731100
605	26/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	16.082,38	1.953,98057767	8,2305731100
606	26/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	976,84	118,68432331	8,2305731100
607	26/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	34.607,10	4.204,70112318	8,2305731100
604	26/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	87.138,05	10.587,11815513	8,2305731100
608	26/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	25.713.383,77	3.124.130,41307642	8,2305731100
557	26/10/2021	NTN-B 150555 (5,400000%)	25.852.188,14	0,00	6.250,00000000	4.136,3501024000
612	26/10/2021	NTN-B 150555	872.769,87	0,00	211,00000000	4.136,3501020000
581	27/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	19.778.140,42	0,00	2.402.666,30118409	8,2317467100
567	27/10/2021	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	177.239,75	47.617,25527214	3,7221748500
600	27/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.121.809,04	0,00	257.759,27209014	8,2317467100
563	27/10/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	93.111,66	0,00	43.168,20636500	2,1569499370
596	28/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	15.786.723,23	1.917.508,51679552	8,2329351300
589	28/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.575,09	434,24245953	8,2329351300
593	28/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	459,46	55,80755742	8,2329351300
590	28/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	776,17	94,27621957	8,2329351300
594	28/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	99.374,51	12.070,36232290	8,2329351300
591	28/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.756,72	213,37712156	8,2329351300
595	28/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	907.740,11	110.257,16778604	8,2329351300
588	28/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	400.124,03	48.600,41087194	8,2329351300
592	28/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	168.010,44	20.407,11330128	8,2329351300
609	28/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	46.962,96	5.704,27912506	8,2329351300
610	28/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	7.687,11	933,70224332	8,2329351300
564	28/10/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	93.111,66	43.159,84682700	2,1573677120
562	28/10/2021	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	93.111,66	0,00	4.490,34391400	20,7359751880
582	29/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	20.122,80	0,00	2.443,70845594	8,2345338500
601	29/10/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	16.042,18	0,00	1.948,15885055	8,2345338500

Total

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 16.118.426,84

Value-At-Risk: 2,12%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,02	-0,00	-4,80	0,40	382,89	0,00
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,02	-0,00	-10,20	0,30	6.146.052,03	0,81
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,11	0,05	0,00	0,08	0,49	93.098,73	0,01
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,16	0,06	0,00	0,14	0,50	2.112.485,32	0,28
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,18	0,11	-0,00	0,20	0,52	1.832.927,79	0,24
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,18	0,11	-0,00	-0,09	0,46	2.003.772,98	0,26
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTIESTRATÉGIA	Artigo 8º IV, Alínea a	0,40	0,27	0,00	-1,49	-0,11	835.570,20	0,11
NTN-B 150555 (5,400000%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,43	0,19	0,00	2,41	1,53	25.937.857,29	3,41
NTN-B 150555 (4,970000%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,48	0,11	0,00	1,94	1,42	2.439.144,32	0,32
NTN-B 150555 (4,870000%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,48	0,11	0,00	1,92	1,41	26.960.938,32	3,54
NTN-B 150555 (4,470000%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,48	0,11	0,00	1,86	1,38	2.385.986,38	0,31
NTN-B 150555 (4,410000%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,49	0,11	0,00	1,81	1,36	5.201.887,61	0,68
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	1,34	0,98	0,01	-0,34	0,02	8.166.226,20	1,07
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,54	0,56	0,00	-0,66	-0,54	101.709,91	0,01
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,91	0,81	0,00	-0,51	-0,50	849.169,05	0,11
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	1,91	0,81	0,00	-0,51	-0,49	9.759.745,79	1,28
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,19	1,44	0,13	-0,41	-1,24	117.745.806,68	15,46
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,20	1,64	0,11	-0,50	-1,63	81.193.777,71	10,66
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,22	1,44	0,11	-0,42	-1,27	101.270.672,28	13,30
PORTO SEGURO IMA-B5 FIC FI RF LP	Artigo 7º IV, Alínea a	4,23	1,51	0,03	-0,40	-1,23	24.785.651,36	3,25
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,88	1,63	0,01	-0,40	-1,49	6.650.288,00	0,87
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	7,47	3,34	0,07	-0,39	-2,43	24.826.855,44	3,26
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,52	NaN	0,00	-0,40	-2,56	0,00	0,00
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	7,61	2,76	0,08	-0,40	-2,59	35.104.065,74	4,61
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	8,93	3,28	0,03	-0,40	-3,13	9.962.760,37	1,31
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	12,15	6,44	0,04	0,58	7,55	7.803.296,98	1,02
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	Artigo 8º III	12,25	6,49	0,14	0,58	7,63	24.357.700,67	3,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	12,26	6,50	0,25	0,58	7,64	43.664.930,69	5,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150555	Artigo 7º I, Alínea a	14,76	4,83	0,01	-0,36	-4,87	2.695.525,69	0,35
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	14,91	1,21	0,00	-0,31	-4,11	961.442,07	0,13
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	15,69	6,81	0,01	0,64	10,56	10.064.720,09	1,32
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,80	8,72	0,25	-0,45	-6,61	26.318.318,12	3,46
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	16,60	6,69	0,02	0,63	10,93	30.802.851,40	4,04
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	18,51	8,62	-0,03	0,42	8,26	13.335.889,86	1,75
TARPON GT 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	18,68	9,61	0,12	-0,16	-2,56	14.532.236,23	1,91
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,79	9,27	0,09	-0,26	-4,90	9.620.542,99	1,26
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	Artigo 9º A, II	22,18	9,04	-0,02	0,16	4,08	4.646.881,67	0,61
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	Artigo 9º A, II	22,27	8,49	-0,02	0,32	7,56	5.824.112,91	0,76
BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NÍVEL I FI	Artigo 9º A, III	23,22	10,48	0,08	-0,27	-5,84	7.969.367,18	1,05
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	Artigo 9º A, II	24,37	9,29	-0,03	0,26	6,76	10.612.594,90	1,39
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	24,48	9,50	0,08	-0,20	-4,31	8.388.569,16	1,10
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	25,89	11,23	0,10	-0,41	-10,13	8.205.052,14	1,08
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	28,49	11,08	0,15	-0,33	-8,89	13.032.190,43	1,71
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	31,62	12,01	0,05	-0,31	-9,17	5.109.651,30	0,67
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	31,86	12,59	0,22	-0,42	-13,00	17.292.266,84	2,27

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de outubro de 2021, vale observar que:

- Mediante Nota Técnica nº 12/2017/CGACI/SRPPS/SPREV-MF, Perguntas e Respostas - Resolução CMN nº 3.922/2010 (alterações da Resolução CMN nº 4.604/2017 e Resolução CMN nº 4.695/2018), especificamente a questão de nº 61, o enquadramento do fundo PORTO SEGURO IMA-B5 FIC FI RF LP, cnpj: 24.011.864/0001-77 , para fins de verificação dos limites dispostos no art. 14 da Resolução CMN nº 3.922/2010, tem que levar em consideração o patrimônio líquido do fundo "Master", tendo em vista que é neste que ocorre efetivamente a gestão dos recursos, com a transação de ativos finais.
- O Patrimônio Líquido do PORTO SEGURO MASTER INFLAÇÃO IMA-B 5 RF FI cnpj: 21.624.772/0001-74 em 29/10/2021 é de: 444.901.430,10.
- O Instituto está com 8,62% dos recursos garantidores alocados no Artigo 7º I, Alínea a, limite este, superior ao limite máximo estipulado em Política de Investimento;
- O Instituto está com 43,01% dos recursos garantidores alocados no Artigo 7º I, Alínea b, limite este, inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimento;
- O Instituto está com 10,93% dos recursos garantidores alocados no segmento de Investimentos no Exterior, limite este, superior ao permitido pela Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;