



**LDB**  
EMPRESAS

**VITÓRIA - CONSOLIDADO**  
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 65,82%

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	11,65	-0,67	-6,88	71.265.293,41	9,15
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>11,65</b>	<b>-0,67</b>	<b>-7,64</b>	<b>71.265.293,41</b>	<b>9,15</b>

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	9.354.595,28	1,20	199.547.694,03	4,69
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,64	0,85	2,70	103.373,11	0,01	6.465.382.741,43	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,78	0,77	4,31	121.577.459,80	15,61	12.444.051.491,75	0,98
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,80	0,76	4,27	104.999.415,17	13,48	6.458.635.592,00	1,63
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	5,18	0,85	-2,20	6.888.412,00	0,88	460.231.370,14	1,50
BB	BB	BB PREV IPCA I	1,64	0,59	6,64	9.988.179,89	1,28	524.629.076,05	1,90
BB	BB	BB PREV RF VII	1,63	0,58	6,57	868.939,57	0,11	248.037.532,98	0,35
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,84	0,91	-0,40	83.356.718,27	10,70	7.701.081.218,58	1,08
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>3,25</b>	<b>0,78</b>	<b>1,27</b>	<b>337.137.093,09</b>	<b>43,28</b>		

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	2.030.931,10	0,26	289.696.608,52	0,70
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,11	0,53	2,33	4.314.416,43	0,55	983.826.614,17	0,44
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	5,80	0,21	-1,48	36.393.946,03	4,67	1.098.154.442,70	3,31
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	8,19	0,43	-5,86	25.722.199,47	3,30	222.360.588,48	11,57
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,15	0,80	4,62	94.434,23	0,01	7.206.695.128,79	0,00
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,13	0,69	1,64	691,73	0,00	3.073.023.342,66	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,26	0,79	5,50	1.859.822,23	0,24	2.584.228.578,26	0,07
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,48	0,70	0,89	8.305.888,88	1,07	141.132.202,49	5,89
PORTO SEGURO	INTRAG	PORTO SEGURO IMA-B5 FIC FI RF LP	2,96	0,82	2,46	25.615.266,32	3,29	145.203.502,57	17,64
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>4,65</b>	<b>0,51</b>	<b>-1,38</b>	<b>104.337.596,42</b>	<b>13,39</b>		
Renda Fixa			3,83	0,51	0,23	512.739.982,92	65,82		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

23,47%

## 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	19,16	2,31	-12,19	25.855.302,51	3,32	1.378.837.386,58	1,88
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,72	-0,32	-10,50	8.460.125,01	1,09	924.501.793,20	0,92
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	23,77	-0,67	-31,65	16.032.367,05	2,06	162.780.188,13	9,85
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	20,10	3,49	-12,74	9.690.716,40	1,24	1.010.020.909,77	0,96
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	19,96	2,19	-15,47	8.186.036,92	1,05	826.907.180,52	0,99
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	24,86	0,09	11,87	5.625.692,67	0,72	99.070.174,63	5,68
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	17,60	9,08	21,17	14.768.116,34	1,90	346.277.804,83	4,26
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	20,16	5,25	-7,75	13.558.991,11	1,74	163.432.589,71	8,30
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>18,67</b>	<b>2,88</b>	<b>-12,04</b>	<b>102.177.348,01</b>	<b>13,12</b>		

## 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	13,24	5,42	9,13	8.184.634,01	1,05	2.394.295.587,10	0,34
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,38	5,56	32,83	45.867.515,13	5,89	3.768.911.648,33	1,22
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	13,41	5,54	16,35	25.223.814,58	3,24	2.374.573.482,34	1,06
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>11,57</b>	<b>5,54</b>	<b>25,97</b>	<b>79.275.963,72</b>	<b>10,18</b>		

## 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	65,76	-47,94	-48,53	434.574,16	0,06	121.210.426,73	0,36
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b>			<b>65,76</b>	<b>-47,94</b>	<b>-48,53</b>	<b>434.574,16</b>	<b>0,06</b>		

## 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	22,41	-0,67	-22,85	957.344,85	0,12	49.754.627,38	1,92

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
INVESTIMENTO									
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>			<b>22,41</b>	<b>-0,67</b>	<b>-22,85</b>	<b>957.344,85</b>	<b>0,12</b>		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			15,38	3,76	0,30	182.845.230,74	23,47		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

10,71%

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	17,69	4,00	32,35	10.948.686,67	1,41	2.529.172.574,05	0,43
BB	BB	BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	16,64	5,24	25,83	4.740.047,86	0,61	202.584.708,65	2,34
MONGERAL	BEM	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21,13	2,34	8,64	13.036.652,63	1,67	106.549.180,61	12,24
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	17,42	1,64	28,48	5.781.793,48	0,74	360.428.150,55	1,60
<b>Sub-total Artigo 9º A, II</b>			<b>16,54</b>	<b>3,13</b>	<b>26,68</b>	<b>34.507.180,64</b>	<b>4,43</b>		

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	17,57	1,70	30,51	31.047.868,72	3,99	3.890.658.229,39	0,80
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	17,27	2,90	32,16	10.215.205,28	1,31	1.468.389.548,66	0,70
BB	BB	BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NÍVEL I FI	18,59	-0,13	-5,09	7.684.489,80	0,99	795.243.970,77	0,97
<b>Sub-total Artigo 9º A, III</b>			<b>15,49</b>	<b>1,66</b>	<b>22,74</b>	<b>48.947.563,80</b>	<b>6,28</b>		

<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>14,18</b>	<b>2,26</b>	<b>23,41</b>	<b>83.454.744,44</b>	<b>10,71</b>		
<b>Total</b>			<b>4,76</b>	<b>1,44</b>	<b>1,81</b>	<b>779.039.958,10</b>	<b>100,00</b>		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	71.265.293,41	9,15	0,00	0,00	5,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	337.137.093,09	43,28	45,00	66,99	80,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	104.337.596,42	13,39	0,00	0,00	30,00	0,00	50,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>512.739.982,92</b>	<b>65,82</b>					100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	102.177.348,01	13,12	5,00	13,01	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	79.275.963,72	10,18	5,00	10,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	434.574,16	0,06	0,00	0,00	3,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	957.344,85	0,12	0,00	0,00	3,00	0,00	10,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>182.845.230,74</b>	<b>23,47</b>					40,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	34.507.180,64	4,43	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	48.947.563,80	6,28	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>83.454.744,44</b>	<b>10,71</b>					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	-0,67 -88,33	-7,64 -173,77	-0,92 -49,76	-7,57 -245,15	-7,64 -173,77	-508.044,01	-663.389,07
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,78 101,92	1,27 28,91	1,54 83,73	1,57 50,94	1,27 28,91	2.604.592,44	3.454.938,05
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	104.337.596,42	104.337.596,42
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,51 66,16	-1,38 -31,32	1,49 80,68	0,17 5,61	-1,38 -31,32	-103.833.343,28	-106.183.703,30
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	2,88 0,03	-12,04 -0,11	-7,88 -2,33	-19,54 -2,21	-12,04 -0,11	-99.315.992,27	-115.310.104,32
Artigo 8º III % do CDI	5,54 725,82	25,97 590,95	13,03 707,39	14,32 463,78	25,97 590,95	-75.113.155,33	-67.064.880,19
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-47,94 -50,79	-48,53 -36,60	-48,05 -42,50	-50,90 -33,57	-48,53 -36,60	-834.790,23	-844.327,77
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-0,67 -3,52	-22,85 -10,92	-4,52 1,03	-23,34 -6,00	-22,85 -10,92	-963.808,64	-1.240.853,07
Artigo 9º A, II % do CDI	3,13 410,15	26,68 607,08	7,37 400,21	17,87 578,85	26,68 607,08	1.047.862,86	5.105.958,78
Artigo 9º A, III % do CDI	1,66 216,96	22,74 517,34	7,97 432,70	13,30 430,98	22,74 517,34	797.665,96	9.028.773,66
<b>VITÓRIA - CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>-171.781.416,08</b>	<b>-169.379.990,81</b>

**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 150555	64.752.512,83	7.020.824,59	0,00	0,00	71.265.293,41	-508.044,01	-663.389,07
					71.265.293,41	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	9.642.455,67	0,00	-294.914,89	0,00	9.354.595,28	7.054,50	-3.275.710,30
BB PREV IPCA I	9.929.779,67	0,00	0,00	0,00	9.988.179,89	58.400,22	631.385,85
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	82.601.656,20	0,00	0,00	0,00	83.356.718,27	755.062,07	-332.029,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	104.175.232,40	30.009,10	0,00	0,00	104.999.415,17	794.173,67	4.452.864,09
BB PREV RF VII	863.905,76	0,00	0,00	0,00	868.939,57	5.033,81	54.412,36
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.830.336,00	0,00	0,00	0,00	6.888.412,00	58.076,00	-155.164,00
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	120.651.537,42	0,00	0,00	0,00	121.577.459,80	925.922,38	5.033.526,09
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	102.503,32	0,00	0,00	0,00	103.373,11	869,79	7.858,07
					337.137.093,09	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	8.247.750,28	0,00	0,00	0,00	8.305.888,88	58.138,60	73.292,71
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	25.613.321,91	0,00	0,00	0,00	25.722.199,47	108.877,56	-2.251.724,47
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	10.223.026,21	22.706.809,41	-28.637.934,68	0,00	4.314.416,43	22.515,49	110.841,99
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	1.845.219,52	0,00	0,00	0,00	1.859.822,23	14.602,71	426.532,58
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	2.016.167,11	0,00	0,00	0,00	2.030.931,10	14.763,99	141.613,03
BB PREV RF FLUXO FIC	1.730,95	30.671,71	-31.729,15	0,00	691,73	18,22	10.220,42
BB PREV RF IMA-B	36.318.794,01	0,00	0,00	0,00	36.393.946,03	75.152,02	-1.052.746,82
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	93.685,80	0,00	0,00	0,00	94.434,23	748,43	3.773,17
PORTO SEGURO IMA-B5 FIC FI RF LP	25.405.830,20	0,00	0,00	0,00	25.615.266,32	209.436,12	615.266,32
					104.337.596,42	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	25.270.413,41	0,00	0,00	0,00	25.855.302,51	584.889,10	-4.098.130,71
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	16.141.085,07	0,00	0,00	0,00	16.032.367,05	-108.718,02	-7.425.348,92
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	8.487.635,55	0,00	0,00	0,00	8.460.125,01	-27.510,54	-992.495,36

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	8.010.585,44	0,00	0,00	0,00	8.186.036,92	175.451,48	-1.498.176,87
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	5.620.591,04	0,00	0,00	0,00	5.625.692,67	5.101,63	325.692,67
OCCAM FIC FIA	9.363.666,47	0,00	0,00	0,00	9.690.716,40	327.049,93	-1.440.998,62
TARPON GT 30 FIC FIA	13.538.881,66	0,00	0,00	0,00	14.768.116,34	1.229.234,68	577.869,61
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	12.883.133,63	0,00	0,00	0,00	13.558.991,11	675.857,48	-1.227.224,31
					102.177.348,01	0,00	0,00

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	43.450.983,86	0,00	0,00	0,00	45.867.515,13	2.416.531,27	7.820.558,68
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	23.898.652,68	0,00	0,00	0,00	25.223.814,58	1.325.161,90	3.558.870,92
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	7.763.518,79	0,00	0,00	0,00	8.184.634,01	421.115,22	684.634,01
					79.275.963,72	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTIESTRATÉGIA	834.790,23	0,00	0,00	0,00	434.574,16	-400.216,07	-409.753,61
					434.574,16	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	963.808,64	0,00	0,00	0,00	0,00	957.344,85	-6.463,79	-283.508,22
						957.344,85	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\$)
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	10.528.027,90	0,00	0,00	0,00	10.948.686,67	420.658,77	1.991.659,05

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	4.504.136,77	0,00	0,00	0,00	4.740.047,86	235.911,09	973.016,96
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	12.738.684,68	0,00	0,00	0,00	13.036.652,63	297.967,95	1.036.652,63
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	5.688.468,43	0,00	0,00	0,00	5.781.793,48	93.325,05	1.104.630,14
					34.507.180,64	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	9.927.558,32	0,00	0,00	0,00	10.215.205,28	287.646,96	2.032.294,59
BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NÍVEL I FI	7.694.269,21	0,00	0,00	0,00	7.684.489,80	-9.779,41	-246.861,42
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	30.528.070,31	0,00	0,00	0,00	31.047.868,72	519.798,41	7.243.340,49
					48.947.563,80	0,00	0,00

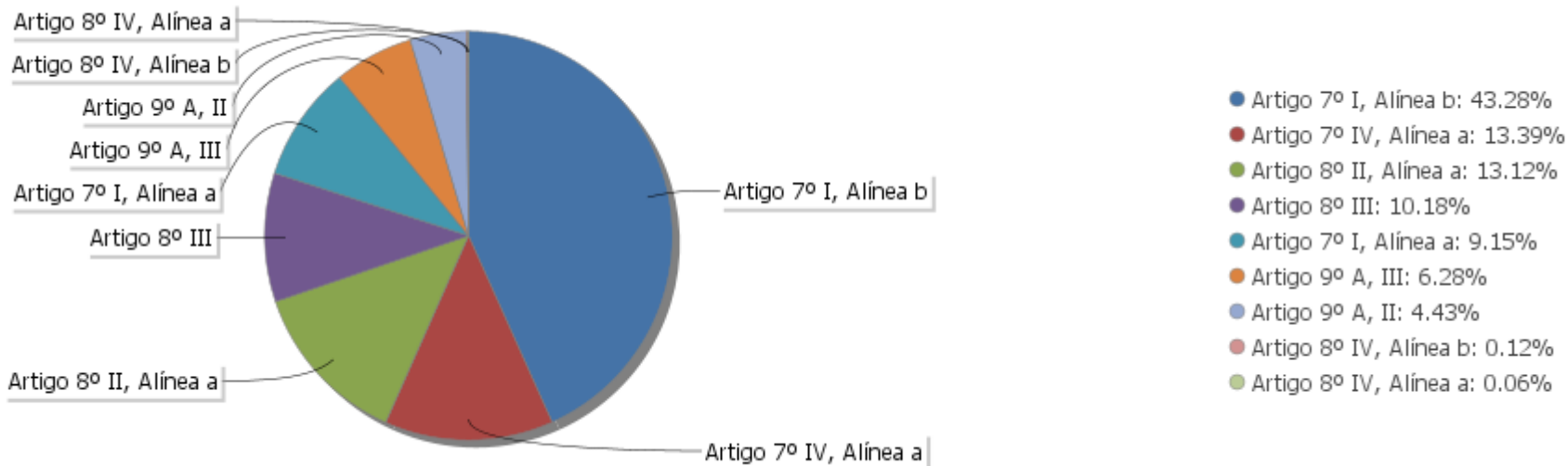
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

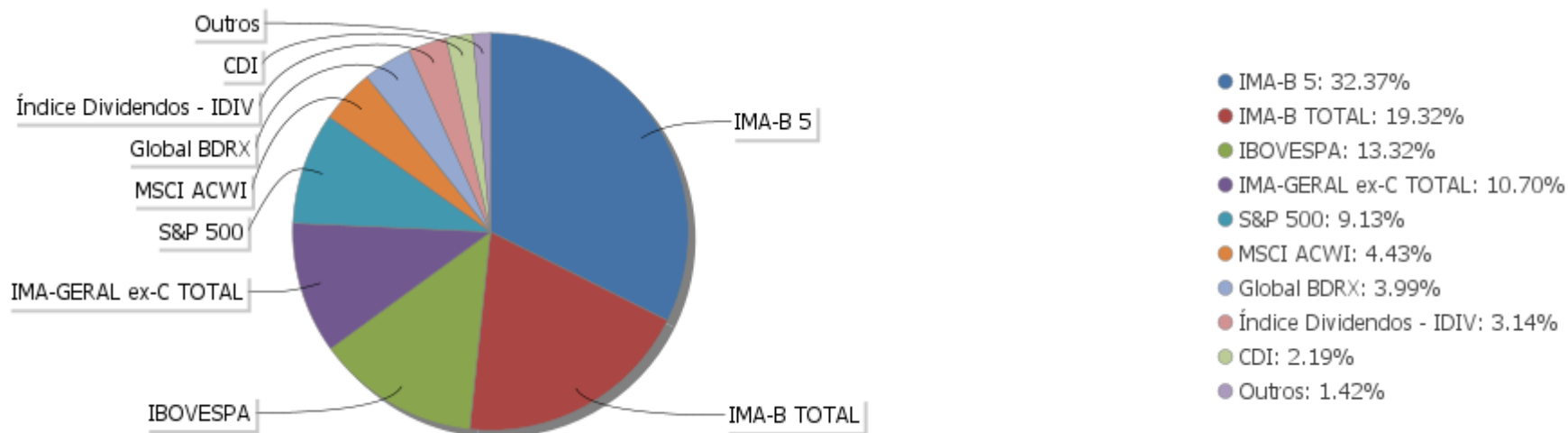
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	656.393.259,40	84,26	656.393.259,40	84,26
de 31 a 365 dias	43.535.648,44	5,59	699.928.907,84	89,85
acima de 365 dias	79.111.050,26	10,15	779.039.958,10	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

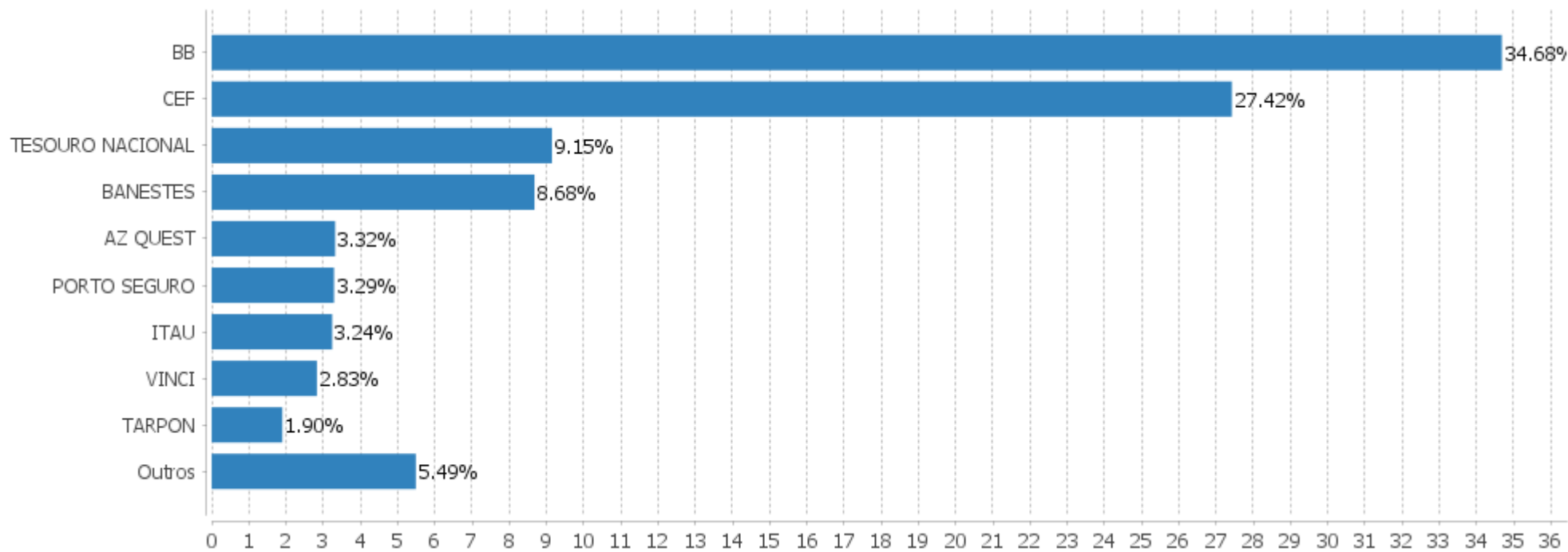


Alocação Por Estratégia



## 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	0,33	0,02	-0,57	-1,03	-0,85	1,08	1,44	1,81
IPCA + 5,50%	0,68	1,25	1,42	0,74	1,28	0,98	1,43	1,34	1,61	1,68	1,38	1,22	16,09
p.p. indexador	-1,28	-2,27	-0,71	0,65	-0,35	-0,64	-1,41	-1,91	-2,64	-2,53	-0,30	0,22	-14,28
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

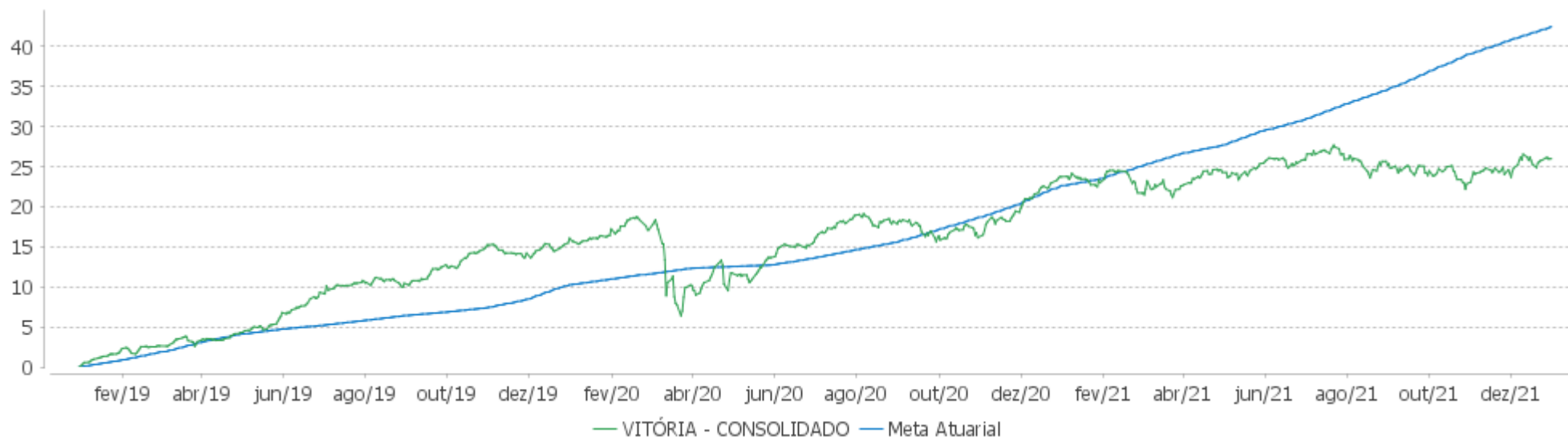
**Performance Sobre a Meta Atuarial**

**Relatório**

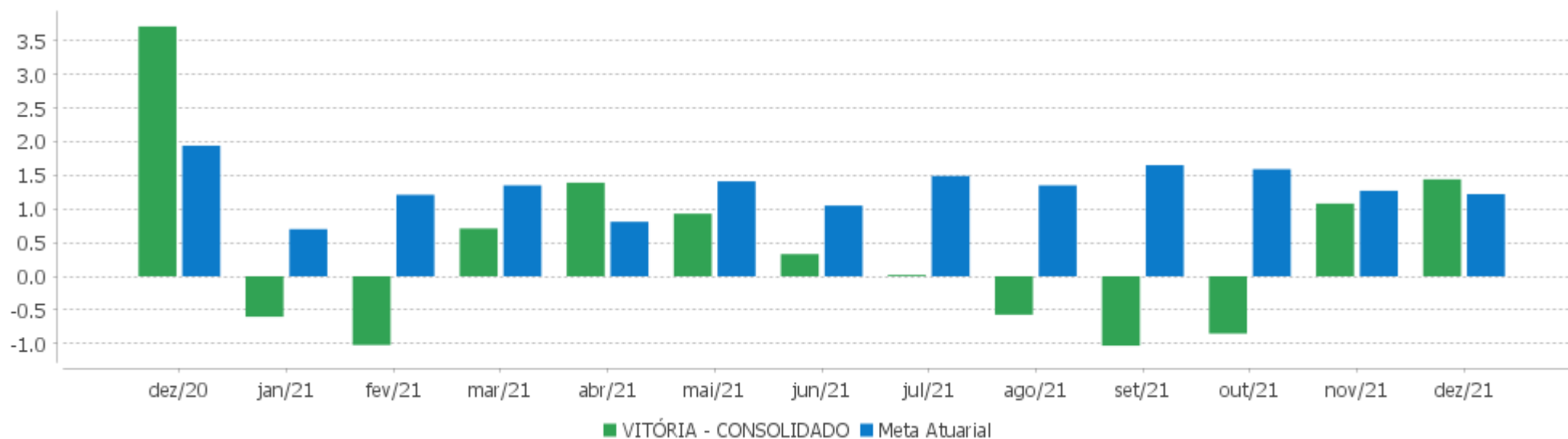
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	16	44,44	03 meses	1,67	4,35	-2,68	5,30
Meses abaixo - Meta Atuarial	20	55,56	06 meses	0,08	8,99	-8,91	5,04
			12 meses	1,81	16,09	-14,28	4,76
			24 meses	8,54	29,12	-20,58	6,44
			36 meses	25,98	43,03	-17,06	5,50
Maior rentabilidade da Carteira	3,71	2020-12	Desde 31/12/2018	25,98	43,03	-17,06	5,50
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
NTN-B 150555 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,67 -0,90	-10,71 -9,45	-0,92 -1,98	-6,81 -6,26	-10,71 -9,45	-8,41 -13,47	21,63 -7,54
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 IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,21 -0,02	-1,48 -0,21	0,99 -0,07	-0,65 -0,10	-1,48 -0,21	4,35 -0,71	27,90 -1,27
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
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO % do CDI	0,53 68,95	2,33 52,94	1,22 66,32	1,88 61,02	2,33 52,94	2,83 38,79	5,77 42,14
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,67 87,65	3,27 74,33	1,58 85,85	2,49 80,68	3,27 74,33	4,96 68,13	10,02 73,22
PORTO SEGURO IMA-B5 FIC FI RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,82 0,04	4,64 0,07	2,08 0,05	3,22 -0,01	4,64 0,07	13,38 0,41	28,02 0,19
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,07 -0,16	-7,16 -5,89	0,08 -0,98	-3,43 -2,89	-7,16 -5,89	-7,19 -12,25	21,62 -7,55
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,77 -0,02	4,31 -0,25	1,97 -0,06	3,12 -0,12	4,31 -0,25	12,39 -0,58	26,84 -0,99
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,59 -0,68	6,64 -10,00	1,84 -2,63	4,32 -4,93	6,64 -10,00	15,55 -13,64	31,90 -10,97
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,58 0,36	6,57 7,83	1,82 0,76	4,29 4,83	6,57 7,83	12,55 7,49	24,32 -4,85
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,85 0,63	-2,20 -0,94	2,03 0,97	0,10 0,64	-2,20 -0,94	6,36 1,30	22,01 -7,17
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,91	-0,40	0,99	0,28	-0,40	4,67	18,35
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,76	4,27	1,94	3,06	4,27	12,38	26,87

## 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 5 p.p.	-0,02	-0,30	-0,09	-0,17	-0,30	-0,59	-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
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	-0,67	-31,65	-19,34	-34,56	-31,65	-26,35	2,48
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-2,28	-25,24	-17,51	-26,26	-25,24	-19,00	-32,01
TARPON GT 30 FIC FIA	9,08	16,51	-0,97	-7,32	16,51		
Var. IBOVESPA p.p.	6,23	28,44	4,57	10,01	28,44		
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	0,09	9,96	0,01	-6,66	9,96		
Var. IBOVESPA p.p.	-2,76	21,88	5,56	10,67	21,88		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	2,31	-9,66	-8,26	-20,26	-9,66	-12,51	30,94
Var. IBOVESPA p.p.	-0,54	2,27	-2,71	-2,92	2,27	-3,16	11,67
OCCAM FIC FIA	3,49	-12,74	-4,20	-16,60	-12,74	-5,88	27,48
Var. IBOVESPA p.p.	0,64	-0,82	1,34	0,74	-0,82	3,48	8,21
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-0,32	-10,50	-3,49	-13,76	-10,50	-7,77	31,03
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,93	-4,09	-1,66	-5,46	-4,09	-0,42	-3,46
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	5,25	-6,31	-5,20	-16,60	-6,31	-7,74	33,14
Var. IBOVESPA p.p.	2,39	5,61	0,35	0,73	5,61	1,62	13,87
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	2,19	-15,47	-10,34	-21,61	-15,47	-14,48	
Var. IBOVESPA p.p.	-0,66	-3,54	-4,79	-4,28	-3,54	-5,12	
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTIESTRATÉGIA	-47,94	-48,53	-48,05	-50,90	-48,53	-67,28	-77,51
% do CDI	-6.278,80	-1.104,18	-2.608,95	-1.648,77	-1.104,18	-923,58	-566,33
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	-0,67	-22,85	-4,52	-23,34	-22,85	-41,25	-45,74
Var. IFIX p.p.	-9,45	-20,57	-7,80	-25,15	-20,57	-28,97	-65,01
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,56	32,83	13,07	14,36	32,83	47,69	94,62
Var. S&P 500 p.p.	1,93	-3,44	-0,45	-9,37	-3,44	-56,56	-79,20
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	5,42	32,11	12,80	14,10	32,11	48,74	96,32
Var. IBOVESPA p.p.	2,57	44,04	18,35	31,43	44,04	58,10	77,05
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	5,54	32,74	13,02	14,30	32,74	49,91	98,49
Var. S&P 500 p.p.	1,92	-3,52	-0,50	-9,42	-3,52	-54,34	-75,33
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1,70	30,51	11,81	20,44	30,51	101,98	171,58
Var. Global BDRX p.p.	-0,01	-3,14	-0,48	-0,99	-3,14	-3,86	-7,67
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	2,90	32,16	12,22	22,40	32,16	94,37	153,08
Var. IBOVESPA p.p.	0,05	44,09	17,76	39,73	44,09	103,73	133,81
BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NÍVEL I FI	-0,13	-5,09	-9,21	-15,33	-5,09	7,63	76,87
Var. IBOVESPA p.p.	-2,98	6,84	-3,66	2,01	6,84	16,98	57,60
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	4,00	32,35	10,14	21,25	32,35	101,00	167,26

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

<b>Fundo</b> <b>Varição da Estratégia</b>	<b>No Mês</b>	<b>No Ano</b>	<b>3 meses</b>	<b>6 meses</b>	<b>12 meses</b>	<b>24 meses</b>	<b>36 meses</b>
Var. MSCI ACWI p.p.	0,83	6,92	1,00	4,28	6,92	16,12	28,68
<b>BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI</b>	<b>5,24</b>	<b>25,83</b>	<b>6,17</b>	<b>14,83</b>	<b>25,83</b>	<b>62,08</b>	<b>104,30</b>
Var. MSCI ACWI p.p.	2,07	0,41	-2,98	-2,14	0,41	-22,81	-34,27
<b>SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE</b>	<b>1,64</b>	<b>28,48</b>	<b>6,78</b>	<b>17,53</b>	<b>28,48</b>		
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,53	3,05	-2,37	0,57	3,05		
<b>MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>	<b>2,34</b>	<b>18,35</b>	<b>5,83</b>	<b>16,42</b>	<b>18,35</b>		
Var. MSCI ACWI p.p.	-0,83	-7,08	-3,32	-0,54	-7,08		
<b>VITÓRIA - CONSOLIDADO</b>	<b>1,44</b>	<b>1,81</b>	<b>1,67</b>	<b>0,08</b>	<b>1,81</b>	<b>8,54</b>	<b>25,98</b>
Var. INPC + 5,50% p.p.	0,22	-14,38	-2,47	-8,82	-14,38	-20,69	-16,51
<b>CDI</b>	<b>0,76</b>	<b>4,40</b>	<b>1,84</b>	<b>3,09</b>	<b>4,40</b>	<b>7,28</b>	<b>13,69</b>
<b>IBOVESPA</b>	<b>2,85</b>	<b>-11,93</b>	<b>-5,55</b>	<b>-17,33</b>	<b>-11,93</b>	<b>-9,36</b>	<b>19,27</b>
<b>INPC + 6,00%</b>	<b>1,27</b>	<b>16,74</b>	<b>4,26</b>	<b>9,16</b>	<b>16,74</b>	<b>30,46</b>	<b>44,52</b>
<b>IPCA + 6,00%</b>	<b>1,27</b>	<b>16,64</b>	<b>4,47</b>	<b>9,25</b>	<b>16,64</b>	<b>29,19</b>	<b>42,87</b>

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 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 INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	1,70
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 VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,80
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	0,00	1,60
BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NÍVEL I FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	2,00
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du	0,00	0,08
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du	0,00	0,08
BB PREV IPCA I	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,15
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du	0,00	0,30
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	1,00
BB PREV RF IMA-B	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,30
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 REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BB PREV RF VII	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	1,20
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	0,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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 FIA CAIXA MULTIGESTOR	D+1 du	D+0	D+23 du	D+25 du	0,00	1,50
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	D+1 du	D+0				
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	1,00
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		
OCCAM FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+15 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+17 (isento de taxa de resgate)	0,00	3,00
PORTO SEGURO IMA-B5 FIC FI RF LP			D+0	D+1 du		0,50
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+2 du	0,00	1,00
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	D+1 du	D+0				
TARPON GT 30 FIC FIA	D+1 du	D+0				
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	D+1 du	D+0	D+5 du	D+7 du	20.000000000000	1,00



**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
652	01/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	390.869,64	47.271,54803363	8,2686024400
653	01/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	672.667,27	81.351,99079878	8,2686024400
676	02/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.157,67	139,98053570	8,2702110200
677	02/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.185.732,41	143.373,89972043	8,2702110200
681	02/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.758.535,47	212.634,89708990	8,2702110200
678	02/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	34.603,37	4.184,09787904	8,2702110200
674	02/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	32.033,77	3.873,39219816	8,2702110200
679	02/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.086.704,18	131.399,81283970	8,2702110200
675	02/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	16.111,68	1.948,15885057	8,2702110200
680	02/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	899.996,16	108.823,84526592	8,2702110200
684	02/12/2021	NTN-B 150555	5.014.874,71	0,00	1.200,00000000	4.179,0622630000
654	02/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.005.949,88	242.551,23287408	8,2702110200
683	02/12/2021	NTN-B 150555	2.005.949,88	0,00	480,00000000	4.179,0622630000
655	03/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	42.449,58	5.131,83607564	8,2718113700
667	06/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	811,30	0,00	98,06126508	8,2733992800
656	06/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	32.639,88	3.945,15952781	8,2733992800
668	07/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	15.229,85	0,00	1.840,46358112	8,2750075300
643	07/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	24.987,96	0,00	3.019,69030204	8,2750075300
644	08/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.741,23	0,00	331,20245731	8,2765992200
645	09/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	3.953,27	0,00	477,54863822	8,2782562500
669	10/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	231,51	0,00	27,95918788	8,2802834300
646	10/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	14.563,70	0,00	1.758,84076064	8,2802834300
647	13/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.521.765,49	0,00	304.474,66643932	8,2823491300
659	14/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.743,80	331,20245731	8,2843625400
660	14/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.956,19	477,54863822	8,2843625400
657	14/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.776.085,90	214.390,17147202	8,2843625400
661	14/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	14.570,87	1.758,84076064	8,2843625400
658	14/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	25.016,21	3.019,69030204	8,2843625400

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
662	14/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	751.459,10	90.708,13798318	8,2843625400
638	14/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	30.000,00	0,00	13.795,40416000	2,1746372670
682	15/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	269,69	32,54675906	8,2862321100
639	15/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	30.009,10	13.795,40416000	2,1752970540
637	15/12/2021	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	30.009,10	0,00	1.400,19798700	21,4320405170
670	17/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	43.542,81	0,00	5.252,22375973	8,2903570000
648	17/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	52.737,65	0,00	6.361,32436934	8,2903570000
640	20/12/2021	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	182.351,23	47.235,01358139	3,8605097400
663	21/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	132,56	15,98183461	8,2944169600
671	22/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.075.330,03	0,00	250.142,29577873	8,2965978400
649	22/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	17.786.275,13	0,00	2.143.803,45779047	8,2965978400
635	22/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.720,05	789,50965600	2,1786307330
672	23/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	53.114,16	0,00	6.400,40053861	8,2985681400
664	23/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.773.823,48	213.750,54662154	8,2985681400
665	23/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	52.789,88	6.361,32436934	8,2985681400
666	23/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	16.077.636,04	1.937.398,80984683	8,2985681400
641	23/12/2021	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	5.105,79	1.321,35035097	3,8640698100
636	23/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	671,71	0,00	308,22311700	2,1792979240
650	29/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.499,20	0,00	180,48447770	8,3065315000
673	30/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	17.960,33	0,00	2.161,65400202	8,3086053500
651	30/12/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	92.065,79	0,00	11.080,77543135	8,3086053500
642	30/12/2021	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	107.457,87	27.932,65994584	3,8470331900
<b>Total</b>						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 19.669.228,61

Value-At-Risk: 2,52%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VITÓRIA - CONSOLIDADO		2,52	2,52			779.039.958,10	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 2,14%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150555		7,46	0,45	5,07			71.265.293,41	9,15
<b>Sub-total</b>	9,95	7,46	0,45		-0,14	-0,67	71.265.293,41	9,15

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B		3,75	0,03	0,93			9.354.595,28	1,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,62	0,00	0,02			103.373,11	0,01
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,20	0,11	0,02			121.577.459,80	15,61
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,20	0,10	0,04			104.999.415,17	13,48
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,68	0,01	2,50			6.888.412,00	0,88
BB PREV IPCA I		0,73	0,00	0,74			9.988.179,89	1,28
BB PREV RF VII		0,73	0,00	2,84			868.939,57	0,11
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,19	0,08	1,85			83.356.718,27	10,70
<b>Sub-total</b>	2,08	1,21	0,34		0,01	0,78	337.137.093,09	43,28

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI		0,08	-0,00	0,08			2.030.931,10	0,26
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO		0,04	0,00	0,01			4.314.416,43	0,55
BB PREV RF IMA-B		3,01	0,10	0,06			36.393.946,03	4,67

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF		3,21	0,07	0,64			25.722.199,47	3,30
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,05	0,00	0,03			94.434,23	0,01
BB PREV RF FLUXO FIC		0,04	0,00	0,01			691,73	0,00
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI		0,08	-0,00	0,08			1.859.822,23	0,24
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF		0,80	0,01	0,80			8.305.888,88	1,07
PORTO SEGURO IMA-B5 FIC FI RF LP		1,16	0,02	0,08			25.615.266,32	3,29
<b>Sub-total</b>	3,16	2,14	0,20		-0,08	0,51	104.337.596,42	13,39

## Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,33%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,30	0,22	5,27			25.855.302,51	3,32
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS		9,84	0,08	2,29			8.460.125,01	1,09
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL		15,80	0,24	9,03			16.032.367,05	2,06
OCCAM FIC FIA		9,64	0,09	2,60			9.690.716,40	1,24
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		11,45	0,09	3,88			8.186.036,92	1,05
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		12,79	0,06	5,94			5.625.692,67	0,72
TARPON GT 30 FIC FIA		9,82	0,12	7,56			14.768.116,34	1,90
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA		12,00	0,16	4,17			13.558.991,11	1,74
<b>Sub-total</b>	17,05	10,17	1,06		0,12	2,88	102.177.348,01	13,12

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		6,41	0,05	9,38			8.184.634,01	1,05
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,48	0,26	5,81			45.867.515,13	5,89
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI		6,47	0,14	5,82			25.223.814,58	3,24
<b>Sub-total</b>	16,67	6,47	0,44		0,29	5,54	79.275.963,72	10,18

Artigo 8º IV, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTIESTRATÉGIA		3,01	-0,00	3,02			434.574,16	0,06
<b>Sub-total</b>	216,09	3,01	-0,00		-0,23	-47,94	434.574,16	0,06

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO		1,24	0,00	3,48			957.344,85	0,12
<b>Sub-total</b>	2,23	1,24	0,00		-0,64	-0,67	957.344,85	0,12

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,44%

Artigo 9º A, II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI		8,91	-0,03	8,28			10.948.686,67	1,41
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI		8,45	-0,02	8,28			4.740.047,86	0,61
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		8,97	-0,05	10,73			13.036.652,63	1,67
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		8,08	-0,02	8,45			5.781.793,48	0,74
<b>Sub-total</b>	10,23	7,58	-0,11		0,23	3,13	34.507.180,64	4,43

Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		8,18	0,04	0,67			31.047.868,72	3,99
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I		8,39	0,01	14,02			10.215.205,28	1,31
BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NÍVEL I FI		11,11	0,09	7,37			7.684.489,80	0,99
<b>Sub-total</b>	17,17	7,39	0,14		0,05	1,66	48.947.563,80	6,28



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

-Referente ao mês de dezembro 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 31/12/2021 é de: 452.378.190,24.
  
- O Instituto está com 9,15% 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 43,28% 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 10,18% dos recursos garantidores alocados no Artigo 8º III, limite este, superior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimento;
- O Instituto está com 10,18% dos recursos garantidores alocados no Artigo 8º III, superior ao permitido pela Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- O Instituto está com 10,71% 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;