



CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO
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

60,85%

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 150535 (5,130000%)	3,83	1,08	1,08	1.512.112,70	2,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,120000%)	3,92	1,15	1,15	1.516.667,78	2,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,170000%)	3,80	1,08	1,08	1.006.757,06	1,76
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,37	1,15	1,15	4.035.537,54	7,06

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
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,64	0,84	2,64	221.130,71	0,39	6.208.104.156,65	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,79	0,20	-1,51	5.831.674,25	10,21	7.081.253.604,41	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,64	0,85	2,70	226.283,99	0,40	6.465.382.741,43	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,73	0,94	0,35	573.472,22	1,00	1.012.379.189,72	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,78	0,77	4,31	2.789.750,43	4,88	12.444.051.491,75	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,76	0,72	4,66	1.616.358,51	2,83	10.998.710.156,34	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,52	1,87	-2,18	4.013.931,14	7,03	1.233.687.856,77	0,33
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	4,01	0,81	0,00	2.053.781,38	3,60	942.926.867,08	0,22
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,84	0,91	-0,40	2.219.709,92	3,89	7.701.081.218,58	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,33	0,83	-0,11	4.071.678,51	7,13	12.561.638.596,69	0,03
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	6,50	-0,10	-1,02	1.868.959,28	3,27	1.091.655.164,39	0,17
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,35	0,78	0,34	25.486.730,34	44,62		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,30	0,08	1,44	2.024.537,54	3,54	625.914.328,31	0,32
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,15	0,80	4,62	721.008,90	1,26	7.206.695.128,79	0,01
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,13	0,67	3,27	728.754,40	1,28	3.073.023.342,66	0,02
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,10	0,86	4,53	7.171,61	0,01	2.626.754.965,66	0,00
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,76	0,46	5,82	1.759.085,88	3,08	1.723.608.994,11	0,10
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,64	0,77	3,84	5.240.558,33	9,17		
Renda Fixa			3,19	0,81	0,80	34.762.826,21	60,85		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

30,52%

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA BRASIL IBX-50	21,02	3,82	-19,30	1.852.412,70	3,24	1.100.433.742,83	0,17
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			21,02	3,82	-18,80	1.852.412,70	3,24		

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
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	23,88	-0,69	-31,79	1.335.629,63	2,34	1.896.702.011,80	0,07
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	21,20	0,02	-20,47	951.660,82	1,67	553.766.496,66	0,17
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	17,92	0,97	-8,51	1.067.509,26	1,87	2.631.453.374,95	0,04
XP	SANTANDER	XP INVESTOR 30 FIC FIA	19,37	2,10	-14,21	278.269,00	0,49	269.073.119,22	0,10
XP	BNY MELLON	XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	18,78	0,04	-14,99	253.025,38	0,44	128.161.621,27	0,20
ARX	BEM	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	19,50	3,40	-12,86	1.348.910,33	2,36	263.492.067,47	0,51
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	27,04	-1,60	-15,03	1.183.944,38	2,07	297.006.334,02	0,40
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	24,29	4,95	-19,69	2.073.339,63	3,63	658.970.786,07	0,31
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	27,20	2,03	-34,38	1.105.779,89	1,94	326.673.019,37	0,34
SCHRODER	BEM	SCHRODER BEST IDEAS FIA	20,81	-0,32	-14,28	1.414.443,79	2,48	51.276.738,60	2,76
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			21,01	1,39	-21,26	11.012.512,11	19,28		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,65	1,43	1,44	477.265,11	0,84	3.414.338.235,91	0,01
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	13,41	5,54	32,74	4.094.354,50	7,17	2.374.573.482,34	0,17
Sub-total Artigo 8º III			11,03	5,06	25,43	4.571.619,61	8,00		
Renda Variável			17,80	2,56	-12,56	17.436.544,42	30,52		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

8,62%

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
XP	BNP PARIBAS	ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	17,53	3,48	-3,13	499.812,54	0,87	155.990.305,09	0,32
XP	BNP PARIBAS	ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,43	1,71	1,45	536.297,67	0,94	56.033.770,47	0,96
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	17,96	1,59	14,71	538.852,23	0,94	596.803.932,92	0,09
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,11	3,53	18,41	497.444,90	0,87	221.430.661,53	0,22
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21,30	-2,60	7,25	1.542.562,14	2,70	1.410.026.256,25	0,11
Sub-total Artigo 9º II			15,56	0,28	7,65	3.614.969,48	6,33		

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	17,53	3,45	33,92	701.949,33	1,23	3.983.843.860,12	0,02
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	18,54	-0,32	21,92	609.604,25	1,07	4.403.177.327,12	0,01
Sub-total Artigo 9º III			17,74	1,66	33,30	1.311.553,58	2,30		

Investimentos no Exterior			15,22	0,65	12,34	4.926.523,06	8,62		
Total			6,03	1,34	-2,71	57.125.893,69	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								Pró-Gestão Nível 1
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	4.035.537,54	7,06	0,00	0,00	20,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	25.486.730,34	44,62	40,00	45,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	5.240.558,33	9,17	0,00	10,00	40,00	0,00	45,00
	Total Renda Fixa	34.762.826,21	60,85					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I, Alinea a	Fundos de Ações Referenciados	1.852.412,70	3,24	0,00	5,00	30,00	0,00	35,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	11.012.512,11	19,28	0,00	24,00	25,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	4.571.619,61	8,00	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável	17.436.544,42	30,52					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	3.614.969,48	6,33	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	1.311.553,58	2,30	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	4.926.523,06	8,62					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	1,15 156,52	1,15 156,52				44.072,34	44.072,34
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,78 101,56	0,34 7,81	1,21 65,68	0,42 13,58	0,34 7,81	196.815,87	43.448,54
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,77 100,92	3,84 87,31	1,63 88,47	2,22 71,78	3,84 87,31	-5.221.655,76	-5.085.903,80
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	3,82 0,97	-18,80 -6,87	-5,58 -0,03	-19,30 -1,97	-18,80 -6,87	-1.784.243,48	-2.244.506,26
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	1,39 -1,47	-21,26 -9,34	-11,45 -5,90	-24,70 -7,37	-21,26 -9,34	-10.864.820,34	-13.646.676,27
Artigo 8º III % do CDI	5,06 662,36	25,43 578,49	11,48 623,38	11,78 381,54	25,43 578,49	-4.370.485,40	-3.976.670,90
Artigo 9º II % do CDI	0,28 36,73	7,65 174,03	3,54 192,26	3,42 110,66	7,65 174,03	10.110,83	315.971,12
Artigo 9º III % do CDI	1,66 218,04	33,30 757,71	11,29 613,24	20,87 676,02	33,30 757,71	21.478,15	287.400,67
CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO (Total)						-21.968.727,79	-24.262.864,56

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 150535 (5,130000%)	0,00	1.496.008,86	0,00	0,00	1.512.112,70	16.103,84	16.103,84
NTN-B 150830 (5,120000%)	0,00	1.499.456,87	0,00	0,00	1.516.667,78	17.210,91	17.210,91
NTN-B 150840 (5,170000%)	0,00	995.999,47	0,00	0,00	1.006.757,06	10.757,59	10.757,59
					4.035.537,54	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2.199.603,34	0,00	0,00	0,00	2.219.709,92	20.106,58	-8.879,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5.819.837,59	0,00	0,00	0,00	5.831.674,25	11.836,66	-110.818,24
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	219.279,12	0,00	0,00	0,00	221.130,71	1.851,59	19.132,33
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.480.138,36	124.936,71	0,00	0,00	1.616.358,51	11.283,44	65.817,66
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	568.138,04	0,00	0,00	0,00	573.472,22	5.334,18	1.989,49
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.958.883,30	0,00	-1.192.008,34	0,00	2.789.750,43	22.875,47	180.300,71
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	224.380,02	0,00	0,00	0,00	226.283,99	1.903,97	8.600,73
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.940.200,88	0,00	0,00	0,00	4.013.931,14	73.730,26	-89.638,18
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	4.038.334,56	0,00	0,00	0,00	4.071.678,51	33.343,95	7.980,03
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	1.870.892,19	0,00	0,00	0,00	1.868.959,28	-1.932,91	-31.040,72
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2.037.298,70	0,00	0,00	0,00	2.053.781,38	16.482,68	4,28
					25.486.730,34	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\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	1.972.326,59	3.644.398,08	-4.898.092,19	0,00	728.754,40	10.121,92	30.205,42
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	19.853,13	700.000,00	0,00	0,00	721.008,90	1.155,77	4.971,65
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	907.035,69	0,00	-900.000,00	0,00	7.171,61	135,92	35.854,04
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	1.053.313,32	700.000,00	0,00	0,00	1.759.085,88	5.772,56	59.085,88
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	2.022.821,14	0,00	0,00	0,00	2.024.537,54	1.716,40	24.537,54
					5.240.558,33	0,00	0,00

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA BRASIL IBX-50	1.784.243,48	0,00	0,00	0,00	1.852.412,70	68.169,22	-384.512,05
					1.852.412,70	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\$)
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	1.304.603,02	0,00	0,00	0,00	1.348.910,33	44.307,31	-151.089,67

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	749.468,57	200.000,00	0,00	0,00	951.660,82	2.192,25	-210.553,40
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.344.847,23	0,00	0,00	0,00	1.335.629,63	-9.217,60	-494.933,46
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	858.850,72	200.000,00	0,00	0,00	1.067.509,26	8.658,54	-80.320,14
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1.203.156,41	0,00	0,00	0,00	1.183.944,38	-19.212,03	-209.370,69
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	1.975.643,64	0,00	0,00	0,00	2.073.339,63	97.695,99	-508.378,17
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	1.083.822,58	0,00	0,00	0,00	1.105.779,89	21.957,31	-463.321,49
SCHRODER BEST IDEAS FIA	1.418.941,95	0,00	0,00	0,00	1.414.443,79	-4.498,16	-235.556,21
XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	252.932,46	0,00	0,00	0,00	253.025,38	92,92	-44.621,32
XP INVESTOR 30 FIC FIA	272.553,76	0,00	0,00	0,00	278.269,00	5.715,24	-46.103,29
					11.012.512,11	0,00	0,00

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	470.517,03	0,00	0,00	0,00	477.265,11	6.748,08	6.787,43
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	3.499.968,37	400.000,00	0,00	0,00	4.094.354,50	194.386,13	588.161,28
					4.571.619,61	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\$)
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	483.007,21	0,00	0,00	0,00	499.812,54	16.805,33	-16.161,91
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	527.257,48	0,00	0,00	0,00	536.297,67	9.040,19	7.674,71
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	530.428,21	0,00	0,00	0,00	538.852,23	8.424,02	69.111,76
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	480.485,71	0,00	0,00	0,00	497.444,90	16.959,19	77.346,91
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.583.680,04	0,00	0,00	0,00	1.542.562,14	-41.117,90	177.999,65
					3.614.969,48	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	678.535,21	0,00	0,00	0,00	701.949,33	23.414,12	177.796,42
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	611.540,22	0,00	0,00	0,00	609.604,25	-1.935,97	109.604,25
					1.311.553,58	0,00	0,00

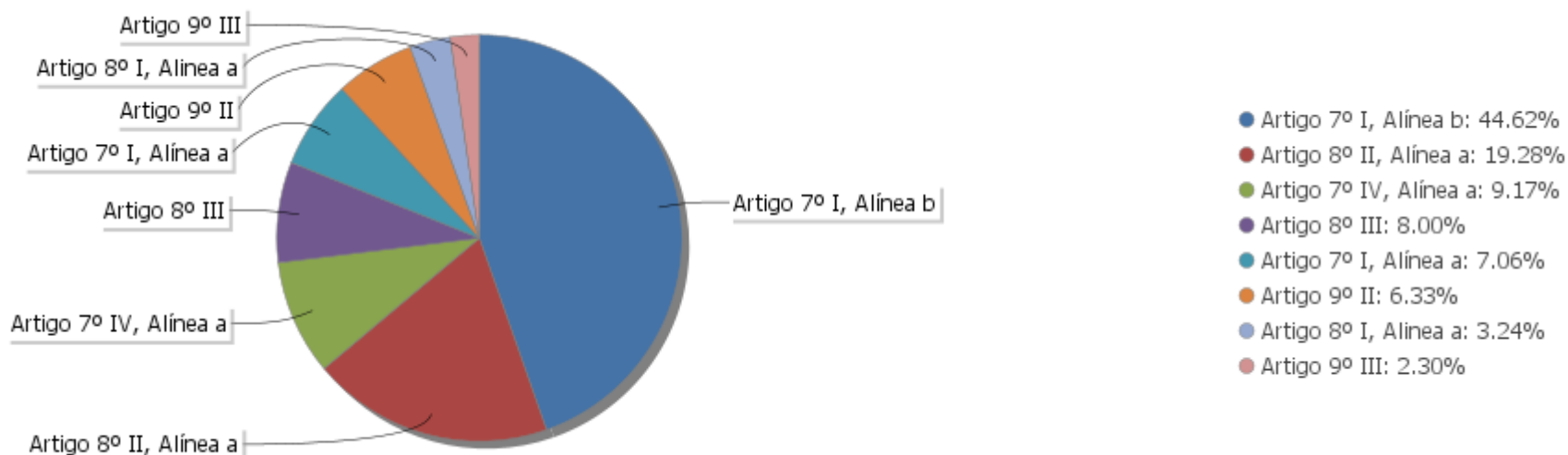
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

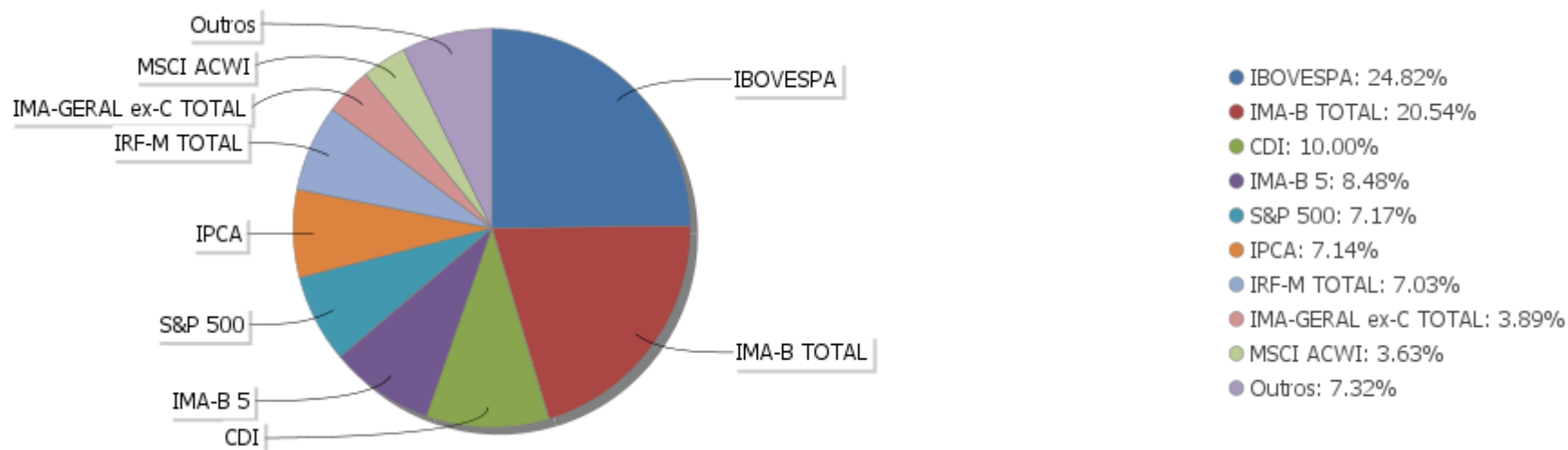
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	49.204.262,06	86,13	49.204.262,06	86,13
de 31 a 365 dias	3.886.094,09	6,80	53.090.356,15	92,94
acima de 365 dias	4.035.537,54	7,06	57.125.893,69	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

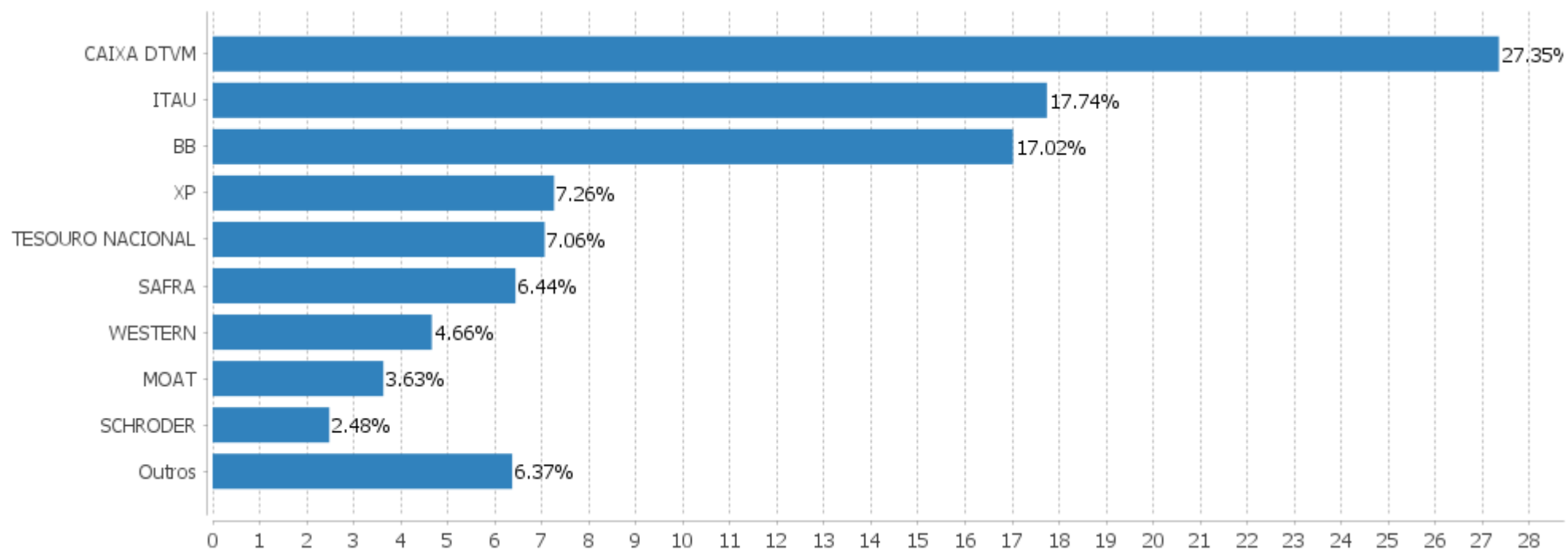


Alocação Por Estratégia



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	-0,40	-0,71	0,31	1,16	1,16	0,42	-1,15	-1,07	-1,90	-2,32	0,49	1,34	-2,71
INPC + 5,42%	0,69	1,20	1,35	0,80	1,41	1,04	1,49	1,35	1,65	1,58	1,26	1,22	16,11
p.p. indexador	-1,09	-1,91	-1,04	0,36	-0,24	-0,63	-2,63	-2,41	-3,54	-3,91	-0,78	0,13	-18,82
2020	0,35	-0,86	-6,80	3,31	2,77	3,07	3,42	-0,76	-1,52	-0,35	3,94	3,56	10,00
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,63
p.p. indexador	-0,36	-1,52	-7,37	3,17	2,70	2,33	2,54	-1,48	-2,64	-1,69	2,59	1,70	-0,62

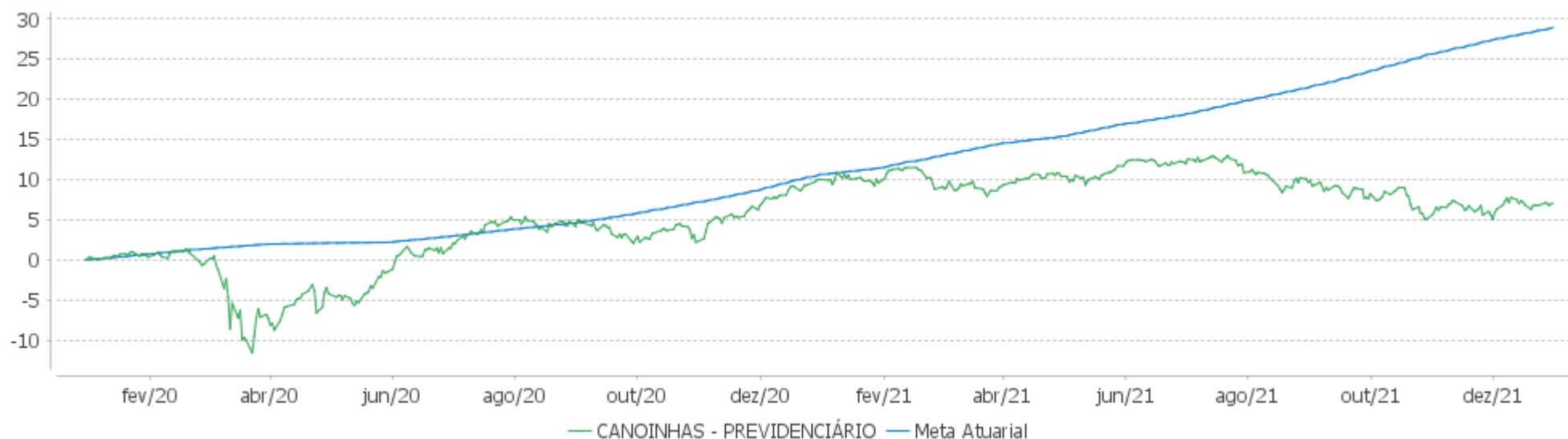
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

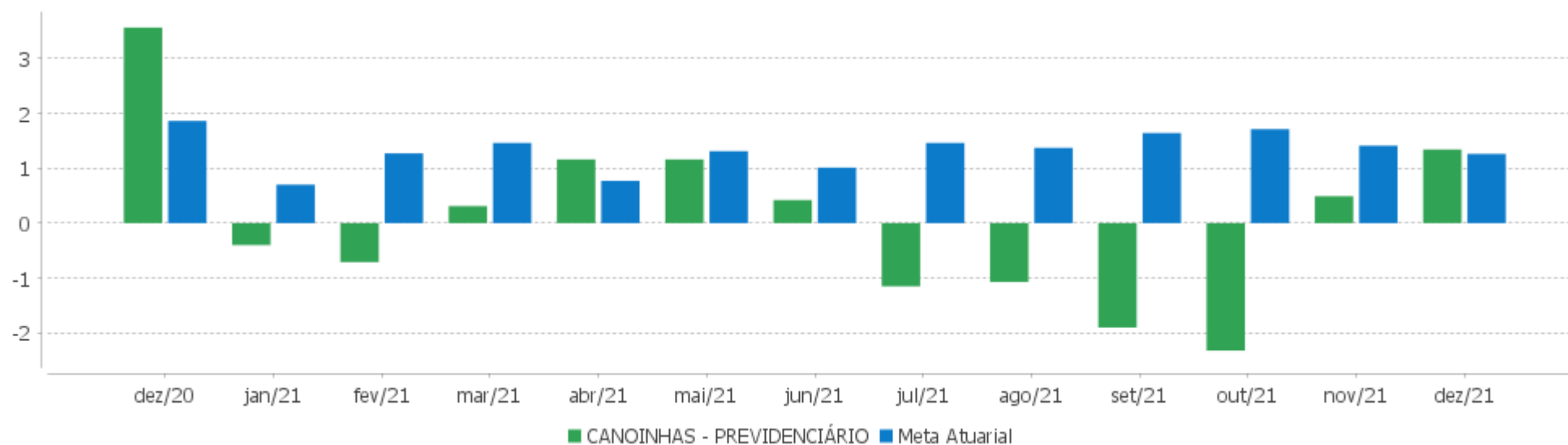
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	8	33,33	03 meses	-0,53	4,12	-4,65	7,20
Meses abaixo - Meta Atuarial	16	66,67	06 meses	-4,56	8,85	-13,41	6,67
			12 meses	-2,71	16,11	-18,82	6,03
			24 meses	7,02	28,45	-21,43	9,38
			Desde 31/12/2019	7,02	28,45	-21,43	9,38
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	3,94	2020-11					
Menor rentabilidade da Carteira	-6,80	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
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	0,08 11,11	-1,47 -33,44	0,37 20,34	-0,61 -19,84	-1,47 -33,44	5,95 81,66	31,88 232,90
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,80 104,63	4,62 105,21	1,93 104,82	3,26 105,62	4,62 105,21	7,13 97,94	13,29 97,07
BB PREV RF 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
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	0,46 60,51	6,00 136,51	2,19 118,80	4,92 159,42	6,00 136,51	10,36 142,18	
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,86 0,13	4,53 -5,53	2,16 -0,80	3,49 -2,58	4,53 -5,53	7,52 -7,51	20,33 0,34
NTN-B 150830 (5,120000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,22 0,99	9,84 11,10	4,36 3,30	5,67 6,22	9,84 11,10	14,15 9,09	17,96 -11,21
NTN-B 150535 (5,130000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,27 1,04	10,01 11,28	1,64 0,58	5,78 6,33	10,01 11,28	14,45 9,39	18,39 -10,78
NTN-B 150840 (5,170000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,22 1,00	10,09 11,35	4,38 3,32	5,79 6,34	10,09 11,35	14,65 9,59	18,72 -10,46
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,10 -0,33	-4,86 -3,60	-0,20 -1,26	-2,91 -2,37	-4,86 -3,60	2,36 -2,70	26,75 -2,42
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	0,81 0,02	0,00 -4,57	1,46 -0,57	1,23 -2,01	0,00 -4,57	10,18 -2,79	27,76 -0,08
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 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
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,83 0,10	-0,11 -10,17	1,07 -1,89	-0,82 -6,89	-0,11 -10,17	6,55 -8,48	24,06 4,07
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,84 -0,03	2,64 -0,29	1,10 -0,03	1,97 -0,12	2,64 -0,29	6,20 -0,68	13,10 -1,01
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,72 -0,11	4,66 -0,31	1,82 -0,02	3,05 0,00	4,66 -0,31	13,07 -0,95	25,72 -1,78
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,20 -0,02	-1,51 -0,25	0,97 -0,09	-0,70 -0,16	-1,51 -0,25	4,53 -0,53	28,20 -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

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.	-0,03	-0,23	-0,04	-0,11	-0,23	-0,45	-0,70
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,94	0,35	1,33	0,80	0,35	5,18	18,15
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,07	-0,61	-0,01	-0,02	-0,61	-1,16	-1,83
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,87	-2,18	0,97	-0,51	-2,18	4,11	16,27
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,01	-0,19	-0,01	-0,08	-0,19	-0,46	-0,88
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP	1,43	1,44	0,85	-1,63	1,44	5,01	24,00
% do CDI	187,83	32,82	45,93	-52,65	32,82	68,77	175,33
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
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-0,69	-31,79	-19,45	-34,71	-31,79	-26,41	2,46
Var. IBOVESPA p.p.	-3,54	-19,86	-13,90	-17,37	-19,86	-17,06	-16,81
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	2,03	-34,38	-24,76	-39,95	-34,38	-28,01	10,08
Var. IBOVESPA p.p.	-0,83	-22,46	-19,21	-22,61	-22,46	-18,65	-9,19
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	4,95	-19,69	-5,32	-20,31	-19,69		
Var. IBOVESPA p.p.	2,09	-7,76	0,23	-2,98	-7,76		
SCHRODER BEST IDEAS FIA	-0,32	-17,62	-6,65	-21,03	-17,62	-9,09	24,16
Var. IBOVESPA p.p.	-3,17	-5,70	-1,10	-3,70	-5,70	0,27	4,90
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	3,40	-6,50	-3,60	-13,99	-6,50		
Var. IBOVESPA p.p.	0,54	5,43	1,94	3,34	5,43		
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	0,02	-20,47	-13,39	-26,26	-20,47	-15,93	11,25
Var. IBOVESPA p.p.	-2,83	-8,54	-7,84	-8,93	-8,54	-6,57	-8,02
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	0,97	-8,51	-7,99	-18,47	-8,51	-12,97	26,43
Var. IBOVESPA p.p.	-1,88	3,42	-2,44	-1,14	3,42	-3,61	7,16
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-1,60	-15,03					
Var. IBOVESPA p.p.	-4,45	-8,47					
XP INVESTOR 30 FIC FIA	2,10	-14,21	-6,16	-21,75	-14,21	-18,69	21,43
Var. IBOVESPA p.p.	-0,76	-2,29	-0,61	-4,42	-2,29	-9,33	2,16
XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	0,04	-14,99	-5,02	-14,67	-14,99	-28,27	9,14
Var. IBOVESPA p.p.	-2,82	-3,06	0,52	2,66	-3,06	-18,91	-10,13
FIA BRASIL IBX-50	3,82	-11,29	-5,58	-19,12	-11,29	-9,95	16,56
Var. IBOVESPA p.p.	0,97	0,64	-0,03	-1,78	0,64	-0,60	-2,71
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	3,45	33,92	12,50	21,19	33,92	93,45	165,70
Var. IBOVESPA p.p.	0,60	45,85	18,05	38,52	45,85	102,81	146,43
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	-0,32	29,00	9,93	20,50	29,00	114,15	190,29
Var. IBOVESPA p.p.	-3,17	40,92	15,48	37,84	40,92	123,51	171,02
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	1,59	14,71	3,09	2,29	14,71	63,78	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,58	-10,71	-6,06	-14,67	-10,71	-21,11	
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	3,48 0,31	-3,13 -28,56	1,96 -7,18	-8,20 -25,16	-3,13 -28,56		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-2,60 -3,86	7,25 -9,39	1,63 -2,84	4,93 -4,32	7,25 -9,39	105,18 75,99	
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	1,71 -1,45	1,45 -23,97	2,72 -6,43	0,37 -16,59	1,45 -23,97		
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	3,53 0,36	18,41 -7,01	11,67 2,52	11,76 -5,20	18,41 -7,01	63,33 -21,55	
CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO Var. IPCA + 5,87% p.p.	1,34 0,09	-2,71 -19,21	-0,53 -4,96	-4,56 -13,75	-2,71 -19,21	7,02 -21,86	
CDI	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69
IBOVESPA	2,85	-11,93	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27
INPC + 6,00%	1,27	16,74	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52
IPCA + 6,00%	1,27	16,64	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	D+0	D+0			-	
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		0,80
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		0,80
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)	-	1,90
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS 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
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)		3,00
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 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 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA BRASIL IBX-50	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du		1,90
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FICFI						
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,00
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI						
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	D+0	D+0		D+15	O GESTOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% (VINTE POR CENTO) DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% (CEM POR CENTO) DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&F BOVESPA.	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	D+0	D+0	D+3 du	D+4 du		0,15
SCHRODER BEST IDEAS FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	-	1,50
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	D+1 du	D+0	D+30	D+32		3,00
XP INVESTOR 30 FIC FIA	D+0	D+0	D+30	D+32	Para informações adicionais, vide o Regulamento	2,00

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
241	01/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.499.460,00	691.200,61235200	2,1693557170
245	01/12/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	900.000,00	48.171,28757000	18,6833287089
248	01/12/2021	NTN-B 150830 (5,120000%)	1.499.456,87	0,00	371,00000000	4.041,6627223700
215	02/12/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.192.008,34	356.141,67929300	3,3470060000
240	02/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	400.006,26	184.342,32246500	2,1699100600
246	02/12/2021	NTN-B 150535 (5,130000%)	1.496.008,86	0,00	367,00000000	4.076,3184196200
247	02/12/2021	NTN-B 150840 (5,170000%)	995.999,47	0,00	238,00000000	4.184,8717226900
239	03/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	51.425,84	23.693,53368800	2,1704588550
216	09/12/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPKA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	77.837,12	0,00	31.184,66862600	2,4960060000
238	10/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.009.421,68	0,00	464.465,85742500	2,1732957630
217	13/12/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPKA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	32.188,54	0,00	12.892,40303000	2,4967060000
237	13/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	28.988,60	0,00	13.334,38456300	2,1739735990
236	14/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.003.807,63	0,00	461.597,73182900	2,1746372670
235	16/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.023,90	0,00	470,55055600	2,1759617220
234	17/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	54.386,50	0,00	24.986,57894500	2,1766285060
218	21/12/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPKA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	14.911,05	0,00	5.971,16502800	2,4971760000
233	21/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.194.172,64	0,00	548.297,18374800	2,1779660290
232	22/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	352.597,13	0,00	161.843,45729500	2,1786307330
227	27/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	700.000,00	0,00	291.087,57050400	2,4047746140
230	27/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.500.006,26	687.876,69030900	2,1806324900
231	27/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	700.000,00	321.007,78247200	2,1806324900
229	28/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	591.726,44	271.272,08971400	2,1813023250
242	28/12/2021	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	400.000,00	0,00	16.273,03021000	24,5805480000
243	28/12/2021	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	700.000,00	0,00	62.635,49400000	11,1757720000
244	28/12/2021	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	200.000,00	0,00	9.692,02712000	20,6355180000
220	29/12/2021	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	200.000,00	0,00	76.557,40343011	2,6124188000
228	30/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	155.467,39	71.229,00313600	2,1826416650

Total

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.889.628,30

Value-At-Risk: 3,31%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO		3,31	3,31			57.125.893,69	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,46%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,130000%)		0,28	0,00	2,95			1.512.112,70	2,65
NTN-B 150830 (5,120000%)		0,22	0,00	2,95			1.516.667,78	2,65
NTN-B 150840 (5,170000%)		0,22	0,00	2,95			1.006.757,06	1,76
Sub-total	0,37	0,17	0,00		1,04	1,15	4.035.537,54	7,06

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,62	0,00	0,03			221.130,71	0,39
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,99	0,17	0,04			5.831.674,25	10,21
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,62	0,00	0,02			226.283,99	0,40
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,29	0,01	0,08			573.472,22	1,00
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,20	0,03	0,02			2.789.750,43	4,88
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,62	0,02	0,26			1.616.358,51	2,83
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,78	0,07	0,02			4.013.931,14	7,03
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF		1,72	0,03	0,60			2.053.781,38	3,60
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,19	0,03	1,85			2.219.709,92	3,89
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,06	0,03	1,07			4.071.678,51	7,13
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF		3,10	0,06	0,38			1.868.959,28	3,27
Sub-total	2,70	1,75	0,45		0,00	0,78	25.486.730,34	44,62

Artigo 7º IV, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO		3,20	0,06	3,19			2.024.537,54	3,54
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,05	0,00	0,03			721.008,90	1,26
BB PREV RF FLUXO FIC		0,04	0,00	0,01			728.754,40	1,28
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI		0,61	0,00	0,63			7.171,61	0,01
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI		0,44	-0,00	0,45			1.759.085,88	3,08
Sub-total	2,44	1,21	0,06		0,00	0,77	5.240.558,33	9,17

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,44%

Artigo 8º I, Alinea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA BRASIL IBX-50		10,90	0,31	1,78			1.852.412,70	3,24
Sub-total	19,27	10,90	0,31		0,16	3,82	1.852.412,70	3,24

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		15,88	0,33	8,98			1.335.629,63	2,34
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA		13,89	0,22	5,20			951.660,82	1,67
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC		9,34	0,16	4,16			1.067.509,26	1,87
XP INVESTOR 30 FIC FIA		10,49	0,05	4,39			278.269,00	0,49
XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES		9,01	0,03	5,32			253.025,38	0,44
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA		10,23	0,22	2,06			1.348.910,33	2,36
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		12,64	0,23	6,49			1.183.944,38	2,07
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA		12,47	0,41	4,99			2.073.339,63	3,63
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA		17,32	0,28	11,27			1.105.779,89	1,94
SCHRODER BEST IDEAS FIA		11,74	0,26	2,79			1.414.443,79	2,48
Sub-total	19,61	12,10	2,19		0,03	1,39	11.012.512,11	19,28

Artigo 8º III

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		1,81	0,01	1,81			477.265,11	0,84
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI		6,47	0,27	5,82			4.094.354,50	7,17
Sub-total	14,97	5,89	0,29		0,29	5,06	4.571.619,61	8,00

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,12%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE		9,13	0,04	10,01			499.812,54	0,87
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		8,13	-0,00	7,45			536.297,67	0,94
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		8,37	0,03	7,80			538.852,23	0,94
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		10,04	0,03	8,75			497.444,90	0,87
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		10,93	-0,08	10,92			1.542.562,14	2,70
Sub-total	14,18	7,31	0,01		-0,03	0,28	3.614.969,48	6,33

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		8,41	0,00	13,95			701.949,33	1,23
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I		8,61	0,01	13,89			609.604,25	1,07
Sub-total	19,54	8,26	0,01		0,05	1,66	1.311.553,58	2,30