



CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO
FEVEREIRO 2022



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 25.02.2022.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA

61,27%

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%)	3,82	1,08	2,18	1.545.014,67	2,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,550000%)	3,96	1,11	1,33	758.251,41	1,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,120000%)	2,77	1,08	2,18	1.507.619,33	2,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,450000%)	2,83	1,10	1,32	735.956,64	1,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,170000%)	2,68	1,08	2,18	1.001.764,70	1,77
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,33	1,08	2,18	5.548.606,75	9,79

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	0,70	0,74	1,36	83.411,51	0,15	5.025.689.167,39	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,63	0,53	-0,24	5.817.770,83	10,26	6.297.272.158,07	0,09
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,70	0,72	1,34	229.312,14	0,40	5.808.584.551,28	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,69	0,67	0,71	0,00	0,00	769.331.691,35	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,75	1,05	1,14	2.821.616,42	4,98	11.612.568.005,11	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,75	1,15	1,17	3.294.305,74	5,81	10.680.932.817,60	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,55	0,59	0,52	4.034.775,15	7,12	962.262.156,33	0,42
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	3,84	0,93	0,77	2.069.504,20	3,65	764.407.302,54	0,27
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,15	0,93	1,46	7.276,01	0,01	2.413.852.979,92	0,00
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,74	0,62	0,65	2.234.232,02	3,94	6.887.287.977,51	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,24	0,81	1,48	1.771.357,99	3,13	10.665.837.627,38	0,02
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	6,25	0,51	-0,50	1.859.606,84	3,28	1.009.798.968,95	0,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,31	0,73	0,59	24.223.168,85	42,74		
Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,16	0,76	-0,34	2.017.595,86	3,56	439.852.043,31	0,46
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	0,68	1,33	1.152.970,48	2,03	3.177.445.522,66	0,04
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,75	0,89	1,34	1.782.704,76	3,15	1.784.832.219,03	0,10
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,98	0,86	0,77	4.953.271,10	8,74		
Renda Fixa			3,13	0,80	0,82	34.725.046,70	61,27		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

23,89%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA BRASIL IBX-50	19,47	1,08	9,06	2.020.218,89	3,56	1.005.312.831,77	0,20
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	24,10	-2,08	2,82	1.373.228,81	2,42	1.853.554.335,79	0,07
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	20,97	-1,47	4,62	995.667,87	1,76	396.598.091,45	0,25
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	17,41	-1,21	0,11	1.068.725,02	1,89	2.516.394.706,99	0,04
XP	SANTANDER	XP INVESTOR 30 FIC FIA	18,48	0,89	6,60	296.636,88	0,52	215.036.143,37	0,14
XP	BNY MELLON	XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	17,90	3,31	10,40	279.351,67	0,49	138.313.687,35	0,20
ARX	BEM	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	18,33	1,00	7,97	1.456.426,94	2,57	299.494.056,41	0,49
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	25,05	1,17	6,89	1.265.534,86	2,23	316.535.744,51	0,40
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	23,59	-6,38	0,49	2.083.409,83	3,68	612.136.935,54	0,34
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	28,49	-5,04	-2,02	1.083.450,94	1,91	273.736.593,80	0,40
SCHRODER	BEM	SCHRODER BEST IDEAS FIA	19,44	1,93	14,51	1.619.657,13	2,86	58.756.755,47	2,76
Sub-total Artigo 8º I			18,94	-1,20	5,27	13.542.308,84	23,89		
Renda Variável			17,71	-1,20	5,27	13.542.308,84	23,89		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,29%

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	17,26	-4,09	-3,64	481.617,09	0,85	123.607.604,22	0,39
XP	BNP PARIBAS	ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,15	-7,32	-11,89	472.526,16	0,83	42.184.622,90	1,12
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	19,69	-5,14	-13,78	464.610,85	0,82	424.907.707,94	0,11
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21,25	-1,53	-14,35	426.067,61	0,75	148.891.425,87	0,29
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	24,84	-9,75	-25,87	1.143.469,38	2,02	923.354.073,39	0,12
Sub-total Artigo 9º II			16,84	-6,66	-17,34	2.988.291,09	5,27		

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	18,39	-7,28	-18,15	574.541,47	1,01	2.643.901.267,54	0,02
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	20,54	-8,91	-21,52	567.053,34	1,00	2.929.429.687,57	0,02
Sub-total Artigo 9º III			18,96	-8,03	-19,72	1.141.594,81	2,01		
Investimentos no Exterior			16,32	-6,98	-17,93	4.129.885,90	7,29		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,55%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,46	0,84	2,12	487.397,26	0,86	3.013.896.599,03	0,02
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	14,37	-2,18	-7,36	3.793.213,66	6,69	2.075.819.919,23	0,18
Sub-total Artigo 10º I			17,73	-1,85	-6,37	4.280.610,92	7,55		
Investimentos Estruturados			17,73	-1,85	-6,37	4.280.610,92	7,55		
Total			6,04	-0,44	-0,33	56.677.852,36	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos							Pró-Gestão Nível	
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	5.548.606,75	9,79	0,00	15,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	24.223.168,85	42,74	0,00	35,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	4.953.271,10	8,74	0,00	5,00	60,00	0,00	65,00
	Total Renda Fixa	34.725.046,70	61,27					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	13.542.308,84	23,89	0,00	22,00	30,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	13.542.308,84	23,89					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	2.988.291,09	5,27	0,00	7,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	1.141.594,81	2,01	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	4.129.885,90	7,29					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	4.280.610,92	7,55	0,00	9,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	4.280.610,92	7,55					15,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,08 144,59	2,18 146,68				59.925,86	107.140,20
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,73 97,24	0,59 39,54	1,37 60,48	2,01 52,73	2,25 39,88	179.446,07	143.186,34
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,86 114,95	0,77 51,91				34.540,71	28.794,69
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-1,20 -2,09	5,27 -2,67				-164.024,26	677.384,03
Artigo 9º II % do CDI	-6,66 -888,30	-17,34 -1.165,55	-17,10 -756,05	-15,72 -412,57	-17,09 -302,66	-213.170,01	-626.678,39
Artigo 9º III % do CDI	-8,03 -1.070,65	-19,72 -1.325,73	-18,38 -812,53	-10,83 -284,24	-1,26 -22,35	-92.672,64	-259.411,18
Artigo 10º I % do CDI	-1,85 -246,65	-6,37 -427,98				-80.632,03	-291.008,69
CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO (Total)						-276.586,30	-220.593,00

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%)	1.528.570,11	0,00	0,00	0,00	1.545.014,67	16.444,56	32.901,97
NTN-B 150535 (5,550000%)	749.952,47	0,00	0,00	0,00	758.251,41	8.298,94	9.936,57
NTN-B 150830 (5,120000%)	1.533.169,88	0,00	0,00	41.797,04	1.507.619,33	16.246,49	32.748,59
NTN-B 150830 (5,450000%)	748.690,77	0,00	0,00	20.842,19	735.956,64	8.108,06	9.732,24
NTN-B 150840 (5,170000%)	1.017.750,08	0,00	0,00	26.813,19	1.001.764,70	10.827,81	21.820,83
					5.548.606,75	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	2.220.553,14	0,00	0,00	0,00	2.234.232,02	13.678,88	14.522,10

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	5.786.893,56	0,00	0,00	0,00	5.817.770,83	30.877,27	-13.903,42
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	182.503,04	0,00	-100.000,00	0,00	83.411,51	908,47	2.280,80
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.655.618,07	1.619.446,99	0,00	0,00	3.294.305,74	19.240,68	19.569,36
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.792.271,73	0,00	0,00	0,00	2.821.616,42	29.344,69	31.865,99
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	573.701,43	0,00	-577.522,74	0,00	0,00	3.821,31	4.050,52
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	227.662,05	0,00	0,00	0,00	229.312,14	1.650,09	3.028,15
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.011.049,25	0,00	0,00	0,00	4.034.775,15	23.725,90	20.844,01
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3.494.898,82	0,00	-1.751.205,53	0,00	1.771.357,99	27.664,70	54.454,05
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	7.209,07	0,00	0,00	0,00	7.276,01	66,94	104,40
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	1.850.254,32	0,00	0,00	0,00	1.859.606,84	9.352,52	-9.352,44
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2.050.389,58	0,00	0,00	0,00	2.069.504,20	19.114,62	15.722,82
					24.223.168,85	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	11.179,11	1.407.970,27	-269.879,57	0,00	1.152.970,48	3.700,67	7.797,89
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	1.767.052,05	0,00	0,00	0,00	1.782.704,76	15.652,71	23.618,88
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	2.002.408,53	0,00	0,00	0,00	2.017.595,86	15.187,33	-6.941,68
					4.953.271,10	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	1.442.047,10	0,00	0,00	0,00	1.456.426,94	14.379,84	107.516,61
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	1.010.531,02	0,00	0,00	0,00	995.667,87	-14.863,15	44.007,05
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.402.458,98	0,00	0,00	0,00	1.373.228,81	-29.230,17	37.599,18
FIA BRASIL IBX-50	1.998.657,63	0,00	0,00	0,00	2.020.218,89	21.561,26	167.806,19
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	1.081.833,61	0,00	0,00	0,00	1.068.725,02	-13.108,59	1.215,76
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1.250.882,45	0,00	0,00	0,00	1.265.534,86	14.652,41	81.590,48
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	2.225.430,22	0,00	0,00	0,00	2.083.409,83	-142.020,39	10.070,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	1.141.014,49	0,00	0,00	0,00	1.083.450,94	-57.563,55	-22.328,95
SCHRODER BEST IDEAS FIA	1.589.037,88	0,00	0,00	0,00	1.619.657,13	30.619,25	205.213,34
XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	270.406,83	0,00	0,00	0,00	279.351,67	8.944,84	26.326,29
XP INVESTOR 30 FIC FIA	294.032,89	0,00	0,00	0,00	296.636,88	2.603,99	18.367,88
					13.542.308,84	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	502.150,05	0,00	0,00	0,00	481.617,09	-20.532,96	-18.195,45
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	509.829,25	0,00	0,00	0,00	472.526,16	-37.303,09	-63.771,51
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	489.767,64	0,00	0,00	0,00	464.610,85	-25.156,79	-74.241,38
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	432.666,92	0,00	0,00	0,00	426.067,61	-6.599,31	-71.377,29
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.267.047,24	0,00	0,00	0,00	1.143.469,38	-123.577,86	-399.092,76
					2.988.291,09	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	619.640,31	0,00	0,00	0,00	574.541,47	-45.098,84	-127.407,86
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	525.174,73	89.452,41	0,00	0,00	567.053,34	-47.573,80	-132.003,32
					1.141.594,81	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP	483.347,68	0,00	0,00	0,00	487.397,26	4.049,58	10.132,15
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	3.877.895,27	0,00	0,00	0,00	3.793.213,66	-84.681,61	-301.140,84
					4.280.610,92	0,00	0,00

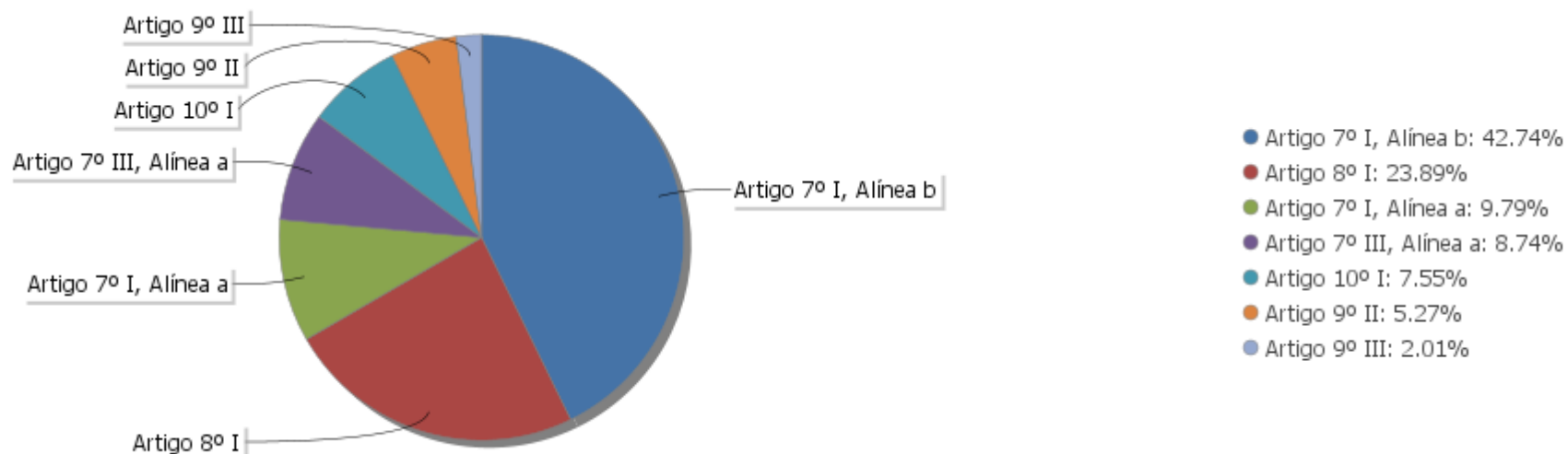
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

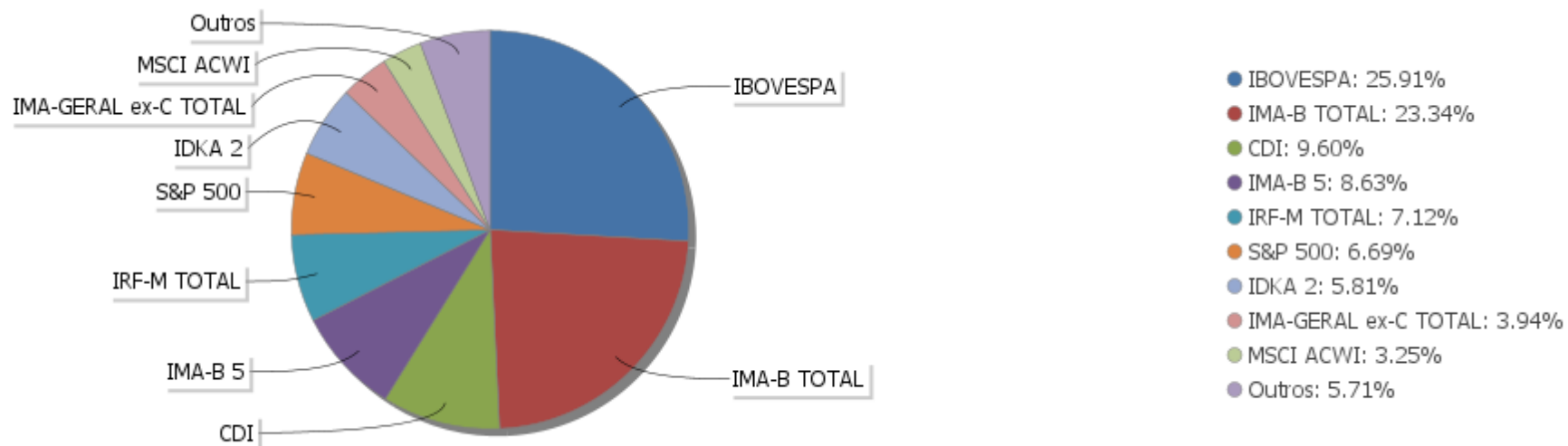
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	47.115.635,36	83,13	47.115.635,36	83,13
de 31 a 365 dias	4.013.610,25	7,08	51.129.245,61	90,21
acima de 365 dias	5.548.606,75	9,79	56.677.852,36	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

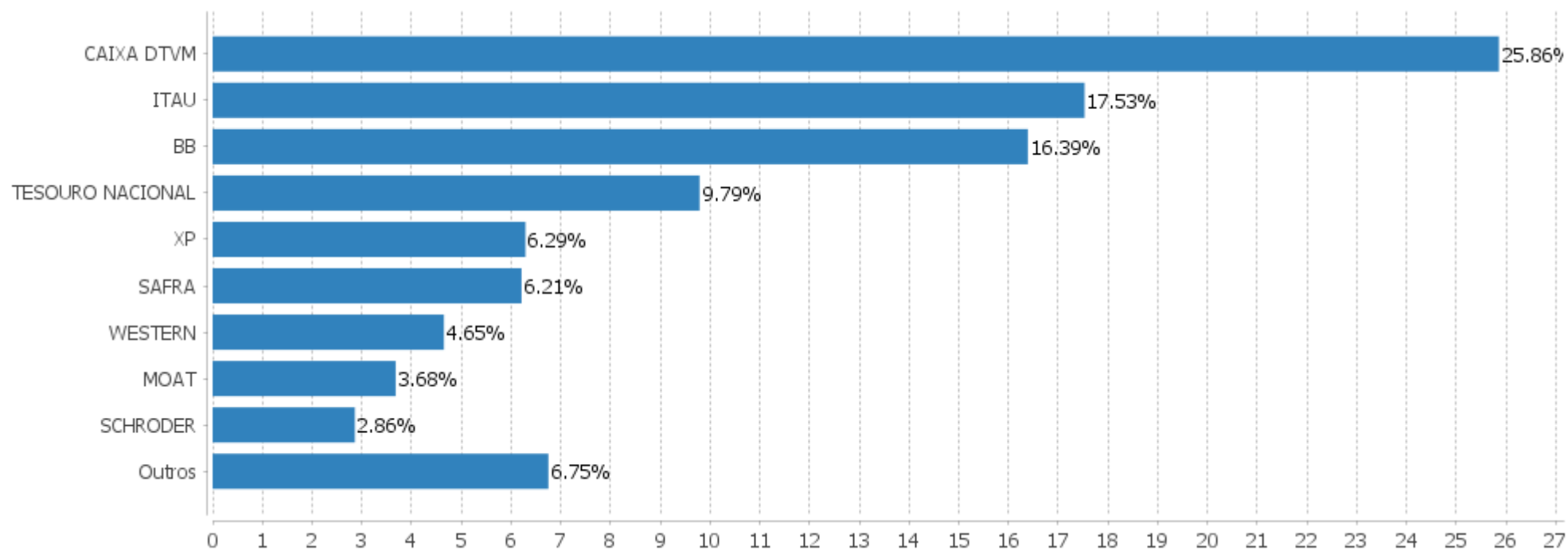


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2022	0,10	-0,44											-0,33
INPC + 4,88%	1,07	1,36											2,45
p.p. indexador	-0,97	-1,80											-2,78
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

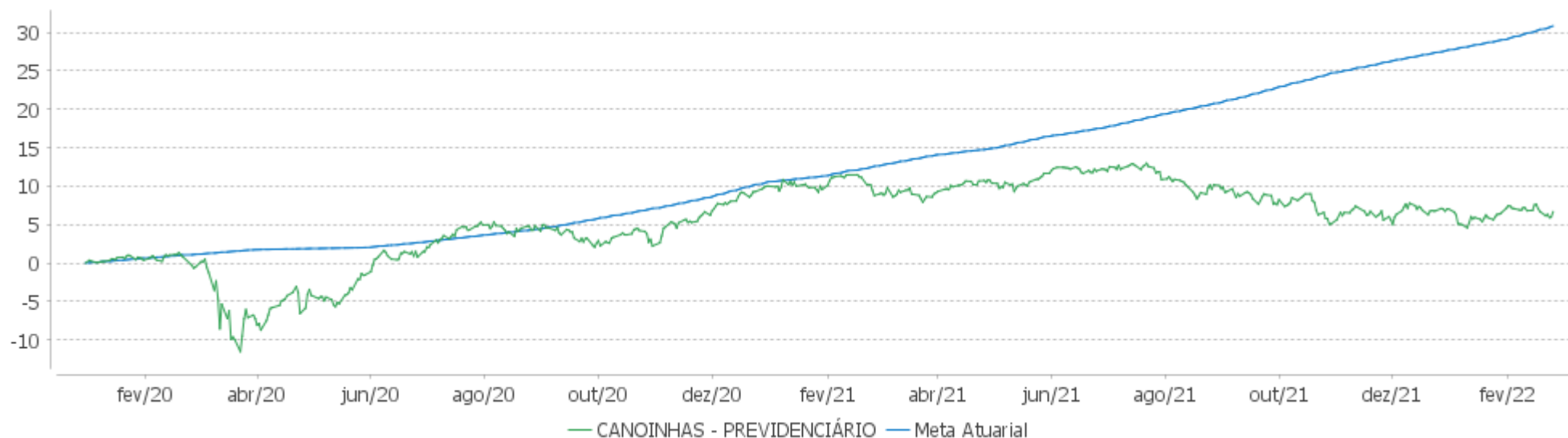
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	8	30,77	03 meses	1,01	3,69	-2,69	6,24
Meses abaixo - Meta Atuarial	18	69,23	06 meses	-2,74	8,42	-11,16	6,89
			12 meses	-1,95	16,73	-18,68	6,04
			24 meses	7,22	29,81	-22,59	9,45
Maior rentabilidade da Carteira	3,94	2020-11	Desde 31/12/2019	6,66	31,59	-24,93	9,18
Menor rentabilidade da Carteira	-6,80	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

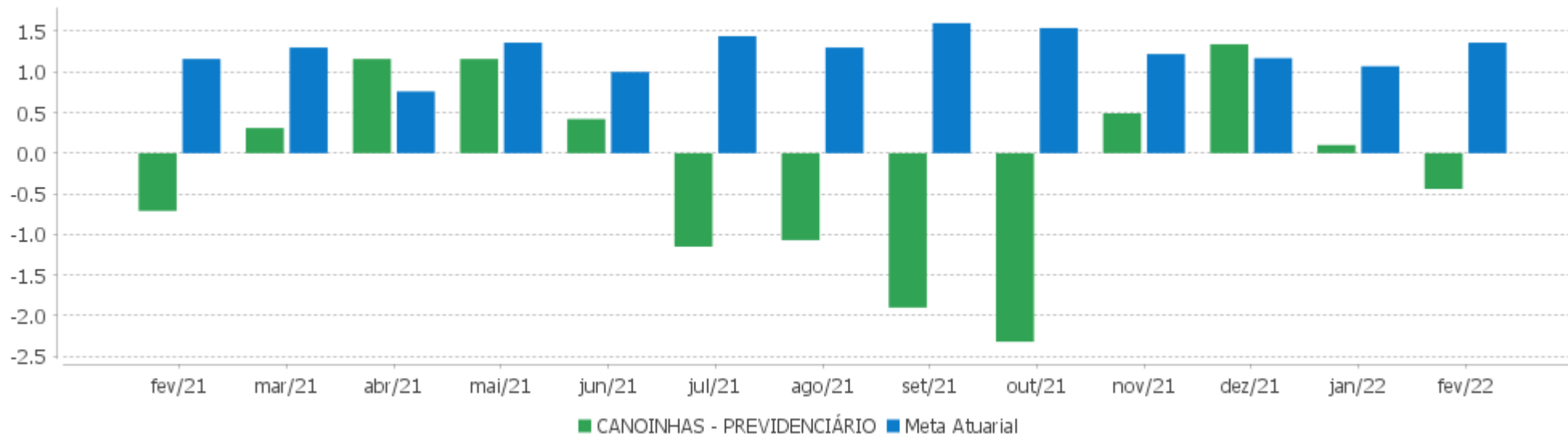


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150535 (5,550000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,11 0,56	2,24 2,43	3,53 3,50	5,56 4,83	10,38 9,45	15,36 11,25	19,84 -3,02
NTN-B 150830 (5,450000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,10 0,55	2,23 2,42	3,50 3,47	8,50 7,77	13,38 12,46	18,37 14,25	22,83 -0,03
NTN-B 150830 (5,120000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,08 0,53	2,18 2,37	3,42 3,39	8,33 7,60	13,09 12,17	17,85 13,74	22,09 -0,77
NTN-B 150535 (5,130000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,08 0,53	2,18 2,37	3,47 3,44	5,51 4,77	10,21 9,29	14,99 10,87	19,25 -3,60
NTN-B 150840 (5,170000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,08 0,53	2,18 2,38	3,43 3,40	8,36 7,62	13,25 12,33	18,28 14,16	22,78 -0,08
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	0,76 101,18	-0,34 -23,05	-0,26 -11,42	0,29 7,67	0,88 15,61	4,64 56,88	25,18 177,42
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,68 90,41	1,33 89,71	2,01 88,96	3,29 86,49	4,51 79,90	5,83 71,53	10,54 74,29
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	0,89 118,17	1,34 90,27	1,81 80,05	4,86 127,62	7,71 136,51	10,92 133,92	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,51 -0,04	-0,50 -0,31	-0,60 -0,63	-1,29 -2,02	-1,91 -2,83	0,84 -3,28	19,54 -3,32
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	0,93 -0,13	0,77 -0,41	1,58 -0,39	2,93 -1,34	2,99 -3,33	8,92 -4,02	25,52 -1,17
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,05 -0,01	1,14 -0,03	1,92 -0,05	4,15 -0,12	6,07 -0,24	12,36 -0,59	25,70 -0,99
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,62	0,65	1,57	1,65	1,74	4,37	16,33
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,81 -0,20	1,48 -0,08	2,32 0,02	2,92 -2,85	1,86 -8,68	6,59 -9,70	21,76 0,81
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,74 -0,01	1,36 -0,02	2,21 -0,05	2,84 -0,09	4,00 -0,26	6,81 -0,65	13,48 -1,00
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,15 -0,11	1,17 -0,14	1,89 -0,26	4,12 -0,19	6,30 -0,40	13,18 -0,93	24,90 -1,99
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,72 -0,02	1,34 -0,04	2,20 -0,07	2,83 -0,10	4,03 -0,23	7,01 -0,46	13,76 -0,71
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,53	-0,24	-0,04	0,58	0,65	3,56	21,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,04	-0,07	-0,15	-0,27	-0,56	-0,91
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,59	0,52	2,40	1,12	0,24	3,13	15,00
Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,01	0,02	0,00	-0,04	-0,24	-0,38	-0,79
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,72	0,76	1,70	2,08	2,42	5,00	16,34
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,03	-0,20	-0,13	-0,22	-0,46	-1,28	-1,94
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,93	1,46	2,33	4,51	5,85	8,44	18,85
Var. IPCA p.p.	-0,08	-0,10	0,03	-1,26	-4,70	-7,85	-2,10
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-2,08	2,82	2,11	-24,50	-27,60	-20,16	-0,27
Var. IBOVESPA p.p.	-2,97	-5,12	-8,91	-19,75	-30,43	-28,77	-18,64
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	-5,04	-2,02	-0,03	-34,39	-34,31	-25,38	4,44
Var. IBOVESPA p.p.	-5,94	-9,96	-11,05	-29,64	-37,13	-34,00	-13,93
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	-6,38	0,49	5,45	-8,66	-8,46		
Var. IBOVESPA p.p.	-7,27	-7,45	-5,56	-3,91	-11,28		
SCHRODER BEST IDEAS FIA	1,93	14,51	14,15	-0,90	1,11	10,34	34,60
Var. IBOVESPA p.p.	1,04	6,57	3,13	3,85	-1,71	1,73	16,23
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	1,00	7,97	11,64	0,33	8,12		
Var. IBOVESPA p.p.	0,11	0,03	0,62	5,08	5,30		
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	-1,47	4,62	4,65	-15,18	-14,36	-4,58	8,58
Var. IBOVESPA p.p.	-2,36	-3,31	-6,37	-10,43	-17,18	-13,19	-9,78
FIA BRASIL IBX-50	1,08	9,06	13,23	-4,49	3,26	9,30	17,31
Var. IBOVESPA p.p.	0,19	1,12	2,21	0,26	0,43	0,69	-1,06
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-1,21	0,11	1,09	-13,89	-7,48	-3,23	16,23
Var. IBOVESPA p.p.	-2,10	-7,82	-9,93	-9,14	-10,30	-11,84	-2,14
XP INVESTOR 30 FIC FIA	0,89	6,60	8,84	-4,70	-3,42	-10,81	19,32
Var. IBOVESPA p.p.	-0,00	-1,34	-2,18	0,05	-6,25	-19,42	0,95
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1,17	6,89	5,18				
Var. IBOVESPA p.p.	0,28	-1,05	-5,83				
XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	3,31	10,40	10,45	1,43	6,40	-16,22	8,69
Var. IBOVESPA p.p.	2,42	2,47	-0,57	6,17	3,58	-24,83	-9,68
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	-7,28	-18,15	-15,33	-8,66	1,13	56,20	102,41
Var. IBOVESPA p.p.	-8,17	-26,09	-26,34	-3,91	-1,69	47,59	84,05
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	-8,91	-21,52	-21,77	-13,30	-3,58	59,64	113,99
Var. IBOVESPA p.p.	-9,80	-29,46	-32,79	-8,55	-6,40	51,03	95,62
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	-5,14	-13,78	-12,41	-15,59	-3,18	45,72	
Var. MSCI ACWI p.p.	1,45	1,00	-0,33	-9,75	-1,97	-9,91	
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	-4,09	-3,64	-0,29	-6,54	-11,08		

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.	2,50	11,13	11,79	-0,70	-9,87		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-9,75 -11,21	-25,87 -28,37	-27,80 -31,59	-24,21 -33,06	-27,00 -44,21	44,06 13,46	
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	-7,32 -0,73	-11,89 2,88	-10,38 1,69	-9,76 -3,92	-20,67 -19,45		
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	-1,53 5,06	-14,35 0,42	-11,33 0,75	-8,67 -2,83	-0,49 0,72	55,22 -0,41	
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	0,84 111,77	2,12 142,74	3,59 158,58	2,22 58,41	4,28 75,86	8,14 99,88	22,14 156,05
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI Var. S&P 500 p.p.	-2,18 4,67	-7,36 7,92	-2,22 9,98	-0,12 3,01	19,95 13,04	49,66 -19,89	65,12 -51,36
CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO Var. INPC + 4,88% p.p.	-0,44 -1,80	-0,33 -2,78	1,01 -2,64	-2,74 -10,98	-1,95 -18,17	7,22 -22,19	
CDI	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19
IBOVESPA	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	18,37
INPC + 6,00%	1,44	2,62	3,92	8,81	17,47	32,17	45,56
IPCA + 6,00%	1,45	2,50	3,80	8,85	17,20	30,60	43,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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
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 B 5 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 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 FICFI	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
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	0,74	1,38	2,27	2,93	4,26	7,47	14,48	22,35	34,40
IRF-M 1+	0,48	-0,02	2,26	0,18	-1,69	1,08	15,45	28,42	46,68
IRF-M TOTAL	0,58	0,50	2,40	1,16	0,48	3,51	15,79	27,30	43,94
IMA-B 5	1,06	1,18	1,97	4,26	6,32	12,94	26,68	39,47	55,81
IMA-B 5+	0,01	-1,60	-1,93	-2,75	-4,23	-3,33	17,98	38,31	53,22
IMA-B TOTAL	0,54	-0,19	0,03	0,73	0,92	4,12	22,86	40,19	55,41
IMA-GERAL TOTAL	0,74	0,95	1,83	2,30	2,88	6,29	18,28	30,05	44,43
IDKA 2	1,26	1,31	2,15	4,31	6,70	14,12	26,89	39,82	57,21
IDKA 20	-0,58	-3,49	-5,69	-9,10	-12,75	-14,41	8,86	34,44	45,63
CDI	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19	21,51	32,41

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	18,37	32,56	69,72
IBRX 100	1,46	8,43	11,83	-4,71	2,87	9,99	22,25	38,00	76,75
IBRX 50	1,74	9,53	13,65	-3,21	4,78	13,29	20,78	33,87	72,89
SMALL CAP	-5,19	-1,95	1,77	-18,60	-13,32	-11,41	20,21	34,33	77,03
IFIX	-1,29	-2,27	6,31	-0,32	-5,04	-7,51	12,59	18,59	35,11
Índice Consumo - ICON	-2,51		-0,33	-21,72	-21,21	-20,40	7,27	6,67	33,15
Índice Dividendos - IDIV	-2,32	4,98	6,66	-1,56	9,19	5,34	28,12	49,91	76,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	1,01	1,56	2,30	5,77	10,54	16,29	20,94	25,65	29,22
INPC	1,00	1,68	2,42	5,73	10,80	17,68	22,30	27,12	29,42
IGPM	1,83	3,68	4,59	4,61	16,12	49,73	59,94	72,10	71,38
SELIC	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19	21,52	32,43

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-6,85	-15,28	-12,20	-3,13	6,92	69,56	116,47	155,90	207,13
MSCI ACWI	-6,59	-14,77	-12,07	-5,84	-1,21	55,63	90,73	113,55	160,11

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,31	2,19	3,30	7,83	14,98	25,74	35,98	46,92	57,07
IPCA + 5,00%	1,38	2,35	3,55	8,34	16,09	28,16	39,93	52,64	64,73
IPCA + 5,50%	1,42	2,42	3,68	8,60	16,65	29,37	41,93	55,56	68,67
IPCA + 5,89%	1,45	2,48	3,77	8,79	17,08	30,33	43,50	57,86	71,80
IPCA + 6,00%	1,45	2,50	3,80	8,85	17,20	30,60	43,95	58,52	72,69
INPC + 4,00%	1,30	2,31	3,43	7,79	15,25	27,25	37,51	48,64	57,31
INPC + 6,00%	1,44	2,62	3,92	8,81	17,47	32,17	45,56	60,37	72,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
282	04/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	100.000,00	35.427,17750400	2,8226917030
283	04/02/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	46.086,75	0,00	20.944,96575700	2,2003736140
284	07/02/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	3.854,02	0,00	1.750,87730600	2,2011936450
267	08/02/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	38.918,56	0,00	15.415,49504701	2,5246390000
285	09/02/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.247,34	4.651,99701000	2,2027830150
286	16/02/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.357.258,24	0,00	615.041,27007200	2,2067758800
287	17/02/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	771,26	0,00	349,36985200	2,2075745620
271	17/02/2022	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	89.452,41	0,00	14,68476661	6.091,5105016000
268	18/02/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.257,97	0,00	6.032,96906644	2,5290980000
272	24/02/2022	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	577.522,74	191.794,67917750	3,0111510000
288	24/02/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	259.632,23	117.392,13211600	2,2116663640
266	24/02/2022	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	1.751.205,53	1.141.109,20912363	1,5346520000
269	25/02/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.565.270,46	0,00	616.694,22334184	2,5381630000
Total			3.116.869,67	2.698.607,84		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.913.201,54

Value-At-Risk: 3,38%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO		3,38	3,38			56.677.852,36	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,22%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,130000%)		0,30	0,00	2,13			1.545.014,67	2,73
NTN-B 150535 (5,550000%)		0,22	0,00	2,13			758.251,41	1,34
NTN-B 150830 (5,120000%)		0,09	-0,00	2,13			1.507.619,33	2,66
NTN-B 150830 (5,450000%)		0,09	-0,00	2,13			735.956,64	1,30
NTN-B 150840 (5,170000%)		0,09	-0,00	2,13			1.001.764,70	1,77
Sub-total	0,25	0,13	0,00		1,31	1,08	5.548.606,75	9,79

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		0,57	0,00	0,02			83.411,51	0,15
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,14	0,10	0,02			5.817.770,83	10,26
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,57	0,00	0,02			229.312,14	0,40
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,17	0,02	0,01			2.821.616,42	4,98
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,60	0,03	0,25			3.294.305,74	5,81
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,77	0,06	0,02			4.034.775,15	7,12
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF		1,79	0,03	0,73			2.069.504,20	3,65
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI		0,59	0,00	0,61			7.276,01	0,01
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,12	0,02	2,02			2.234.232,02	3,94
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,75	0,01	0,78			1.771.357,99	3,13

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF		2,34	0,04	0,34			1.859.606,84	3,28
Sub-total	2,46	1,57	0,31		-0,01	0,73	24.223.168,85	42,74

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO		2,38	0,04	2,37			2.017.595,86	3,56
BB PREV RF FLUXO FIC		0,04	0,00	0,00			1.152.970,48	2,03
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI		0,42	-0,00	0,42			1.782.704,76	3,15
Sub-total	2,02	0,95	0,03		0,06	0,86	4.953.271,10	8,74

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,43%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA BRASIL IBX-50		9,84	0,29	1,61			2.020.218,89	3,56
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		16,86	0,36	10,16			1.373.228,81	2,42
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA		11,02	0,18	3,42			995.667,87	1,76
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		8,62	0,14	5,21			1.068.725,02	1,89
XP INVESTOR 30 FIC FIA		10,65	0,05	4,59			296.636,88	0,52
XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES		9,79	0,04	5,84			279.351,67	0,49
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA		10,19	0,23	2,40			1.456.426,94	2,57
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		13,13	0,26	6,78			1.265.534,86	2,23
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA		12,86	0,41	6,20			2.083.409,83	3,68
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA		19,35	0,31	13,39			1.083.450,94	1,91
SCHRODER BEST IDEAS FIA		10,17	0,24	2,39			1.619.657,13	2,86
Sub-total	12,55	11,43	2,52		-0,16	-1,20	13.542.308,84	23,89

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,76%

Artigo 10º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		1,47	0,01	1,47			487.397,26	0,86
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI		8,67	0,32	6,12			3.793.213,66	6,69
Sub-total	19,73	7,76	0,33		-0,13	-1,85	4.280.610,92	7,55

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,23%

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		9,02	0,04	8,45			481.617,09	0,85
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		8,52	0,01	6,11			472.526,16	0,83
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		11,08	0,04	8,45			464.610,85	0,82
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		12,85	0,03	9,54			426.067,61	0,75
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		14,90	0,03	14,88			1.143.469,38	2,02
Sub-total	27,41	9,55	0,15		-0,27	-6,66	2.988.291,09	5,27

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		10,15	0,02	14,57			574.541,47	1,01
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I		11,41	0,02	15,73			567.053,34	1,00
Sub-total	30,96	10,52	0,03		-0,28	-8,03	1.141.594,81	2,01