



LDB
EMPRESAS

PORTO FERREIRA
NOVEMBRO 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 30.11.2021.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA 79,03%

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-M	3,46	1,80	-4,08	4.589.287,57	2,64	4.900.044.382,84	0,09
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,86	3,44	-1,71	5.049.120,09	2,90	7.086.428.606,24	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,84	3,44	-1,74	8.347.014,98	4,80	4.821.319.332,60	0,17
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,62	0,78	1,84	6.664.692,14	3,83	6.377.941.010,36	0,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,76	2,47	3,52	12.623.734,07	7,25	11.929.906.744,63	0,11
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,57	2,43	3,91	8.275.782,30	4,76	9.400.574.561,59	0,09
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	9,16	4,44	-6,47	4.000.269,72	2,30	994.051.545,66	0,40
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,75	2,48	3,56	1.641.456,99	0,94	1.116.384.945,96	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9,12	4,35	-6,68	7.427.713,26	4,27	1.325.439.328,27	0,56
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,73	2,42	3,91	8.297.146,76	4,77	10.904.431.852,46	0,08
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,88	1,73	-1,30	7.047.773,73	4,05	7.834.893.808,79	0,09
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,36	0,91	-0,93	30.280.977,87	17,40	13.063.702.370,09	0,23
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,46	2,14	-0,49	104.244.969,48	59,90		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,86	3,40	-1,71	14.190.624,54	8,15	2.563.119.438,18	0,55
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			5,86	3,40	-1,71	14.190.624,54	8,15		

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
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,13	0,59	3,53	8.001.075,01	4,60	8.445.398.597,24	0,09
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,13	0,63	3,79	5.398,99	0,00	6.797.782.473,23	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GRAPHEN	RJI	LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	2,31	-0,72	-2,95	4.469.237,91	2,57	68.902.654,54	6,49
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,83	0,12	1,29	12.475.711,91	7,17		

Artigo 7º VII, Alínea a (Cota Sênior de FIDC)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRPP	RJI	INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I - SERIE B	0,00	0,00	0,00	63.038,89	0,04	861.375,60	7,32
BRPP	RJI	INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I	2.950,00	0,00	-17,45	503.025,32	0,29	7.979.603,63	6,30
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	2,95	0,66	-0,94	1.211.115,17	0,70	71.175.905,32	1,70
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			5,54	0,28	-7,08	1.777.179,38	1,02		

Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado")

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRPP	INTRADER	PIATÁ FI RF LONGO PRAZO	0,86	-0,14	-0,77	4.849.827,85	2,79	108.335.987,36	4,48
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			0,86	-0,14	-0,77	4.849.827,85	2,79		
Renda Fixa			3,19	1,98	-0,47	137.538.313,16	79,03		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

19,93%

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
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,36	-1,77	-14,48	4.326.982,53	2,49	962.076.089,31	0,45
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			20,36	-1,77	-14,48	4.326.982,53	2,49		

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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	20,77	-4,14	-22,29	2.325.316,42	1,34	169.703.007,05	1,37
BRAM	BEM	BRADERCO F I A SELECTION	21,05	-1,96	-19,23	3.831.387,89	2,20	530.678.078,14	0,72
BRAM	BRADERCO	BRADERCO FIA DIVIDENDOS	19,48	0,26	-11,36	3.390.561,44	1,95	844.564.387,94	0,40
BRAM	BEM	BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	21,96	-3,17	-13,22	1.288.108,79	0,74	1.389.103.299,23	0,09
XP	XP	XP INVESTOR FI DE ACOES	19,41	0,27	-15,97	6.385.752,21	3,67	219.387.701,48	2,91
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	19,65	-1,67	-15,79	4.307.529,01	2,48	422.311.570,03	1,02
BB	BB	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	19,48	-1,49	-0,92	4.033.121,80	2,32	1.302.608.332,24	0,31
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			19,09	-1,27	-15,38	25.561.777,56	14,69		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GRAPHEN	ORLA	LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	0,18	-0,42	-4,40	18.904,40	0,01	1.559.245,46	1,21
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12,73	-0,49	6,13	2.133.166,84	1,23	3.554.282.113,36	0,06
Sub-total Artigo 8º III			7,69	-0,49	3,36	2.152.071,24	1,24		

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
BRPP	BNY MELLON	GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA	93,17	-0,31	143,56	318.597,06	0,18	19.504.814,12	1,63
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			93,17	-0,31	143,56	318.597,06	0,18		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RJI	RJI	HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	1,63	0,17	1,09	2.319.366,84	1,33	72.674.450,29	3,19
		Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b	1,63	0,17	1,09	2.319.366,84	1,33		
		Renda Variável e Investimentos Estruturados	17,47	-1,18	-12,31	34.678.795,23	19,93		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,04%

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	17,25	-0,89	11,83	1.812.105,93	1,04	3.764.762.598,77	0,05
Sub-total Artigo 9º A, III			17,25	-0,89	11,83	1.812.105,93	1,04		
Investimentos no Exterior			16,17	-0,89	11,83	1.812.105,93	1,04		
Total			5,12	1,30	-2,95	174.029.214,32	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	104.244.969,48	59,90	0,00	42,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	14.190.624,54	8,15	0,00	10,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	12.475.711,91	7,17	0,00	14,00	40,00	0,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	1.777.179,38	1,02	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	4.849.827,85	2,79	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	137.538.313,16	79,03					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	4.326.982,53	2,49	0,00	3,00	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	25.561.777,56	14,69	0,00	18,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	2.152.071,24	1,24	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	318.597,06	0,18	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	2.319.366,84	1,33	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	34.678.795,23	19,93					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	1.812.105,93	1,04	0,00	1,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	1.812.105,93	1,04					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 b % do CDI	2,14 365,03	-0,49 -13,52	0,76 50,40	-0,33 -12,59	2,35 62,36	2.185.935,86	-400.837,31
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	3,40 579,86	-1,71 -47,54	0,62 40,88	-0,47 -17,86	3,06 80,99	466.930,26	-247.401,11
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,12 20,82	1,29 35,77	0,45 30,03	0,70 26,84	1,68 44,48	15.644,73	186.308,46
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	0,28 47,69	-7,08 -196,36	-0,08 -5,29	-4,97 -189,86	-6,63 -175,65	4.958,88	-117.788,43
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,14 -23,38	-0,77 -21,41	-0,42 -27,87	-0,90 -34,48	-0,93 -24,58	-6.663,22	-37.706,54
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,77 -0,24	-14,48 -0,11	-15,61 -1,41	-21,00 -1,75	-6,99 -0,58	-78.053,11	-694.690,49
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,27 0,27	-15,38 -1,01	-14,08 0,12	-19,95 -0,70	-8,56 -2,15	-327.810,69	-4.398.112,42
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,49 1,04	3,36 17,73	2,12 16,31	5,49 24,74	2,96 9,37	-10.583,38	132.296,59
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,31 1,22	143,56 157,93	-0,91 13,28	148,93 168,18	137,69 144,10	-980,07	187.789,83
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,17 1,70	1,09 15,46	0,24 14,44	1,43 20,68	1,23 7,64	4.009,85	25.006,78
Artigo 9º A, III % do CDI	-0,89 -152,03	11,83 548,13	9,66 638,81			-16.310,63	212.105,93
PORTO FERREIRA (Total)						2.237.078,48	-5.153.028,71

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6.927.650,12	0,00	0,00	0,00	7.047.773,73	120.123,61	-92.874,79
BB PREV RF IDKA2	8.079.516,21	0,00	0,00	0,00	8.275.782,30	196.266,09	311.548,97
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.881.190,10	0,00	0,00	0,00	5.049.120,09	167.929,99	-88.080,91
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	3.830.278,66	0,00	0,00	0,00	4.000.269,72	169.991,06	-276.791,35

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IRF-M	4.508.074,84	0,00	0,00	0,00	4.589.287,57	81.212,73	-195.316,76
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8.101.402,65	0,00	0,00	0,00	8.297.146,76	195.744,11	312.540,41
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7.117.839,40	0,00	0,00	0,00	7.427.713,26	309.873,86	-531.956,03
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12.319.708,33	0,00	0,00	0,00	12.623.734,07	304.025,74	429.038,18
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8.069.483,19	0,00	0,00	0,00	8.347.014,98	277.531,79	-166.844,82
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.613.105,44	0,00	0,00	0,00	6.664.692,14	51.586,70	120.199,48
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	30.009.114,31	0,00	0,00	0,00	30.280.977,87	271.863,56	-278.680,23
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	1.601.670,37	0,00	0,00	0,00	1.641.456,99	39.786,62	56.380,54
					104.244.969,48	0,00	0,00

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	13.723.694,28	0,00	0,00	0,00	14.190.624,54	466.930,26	-247.401,11
					14.190.624,54	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.365,16	0,00	0,00	0,00	5.398,99	33,83	197,39
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7.933.309,87	367.151,47	-347.500,00	0,00	8.001.075,01	48.113,67	322.127,59
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	4.501.740,68	0,00	0,00	0,00	4.469.237,91	-32.502,77	-136.016,52
					12.475.711,91	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I	505.993,61	0,00	0,00	0,00	503.025,32	-2.968,29	-106.299,18
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I - SERIE B	63.038,89	0,00	0,00	0,00	63.038,89	0,00	0,00
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1.203.188,00	0,00	0,00	0,00	1.211.115,17	7.927,17	-11.489,25
					1.777.179,38	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º VII, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
PIATÁ FI RF LONGO PRAZO	4.856.491,07	0,00	0,00	0,00	4.849.827,85	-6.663,22	-37.706,54
					4.849.827,85	0,00	0,00

Artigo 8º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	4.405.035,64	0,00	0,00	0,00	4.326.982,53	-78.053,11	-694.690,49
					4.326.982,53	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	4.380.823,33	0,00	0,00	0,00	4.307.529,01	-73.294,32	-807.891,43
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	4.094.145,92	0,00	0,00	0,00	4.033.121,80	-61.024,12	-166.878,20
BRADESCO F I A SELECTION	3.908.049,66	0,00	0,00	0,00	3.831.387,89	-76.661,77	-912.089,98
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	1.330.236,78	0,00	0,00	0,00	1.288.108,79	-42.127,99	-196.168,73
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	3.381.730,54	0,00	0,00	0,00	3.390.561,44	8.830,90	-434.541,46
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	2.425.832,09	0,00	0,00	0,00	2.325.316,42	-100.515,67	-666.871,74
XP INVESTOR FI DE ACOES	6.368.769,93	0,00	0,00	0,00	6.385.752,21	16.982,28	-1.213.670,88
					25.561.777,56	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.143.670,26	0,00	0,00	0,00	2.133.166,84	-10.503,42	133.166,84
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	18.984,36	0,00	0,00	0,00	18.904,40	-79,96	-870,25
					2.152.071,24	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	319.577,13	0,00	0,00	0,00	318.597,06	-980,07	187.789,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					318.597,06	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	2.315.356,99	0,00	0,00	0,00	0,00	2.319.366,84	4.009,85	25.006,78
						2.319.366,84	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1.828.416,56	0,00	0,00	0,00	1.812.105,93	-16.310,63	212.105,93
					1.812.105,93	0,00	0,00

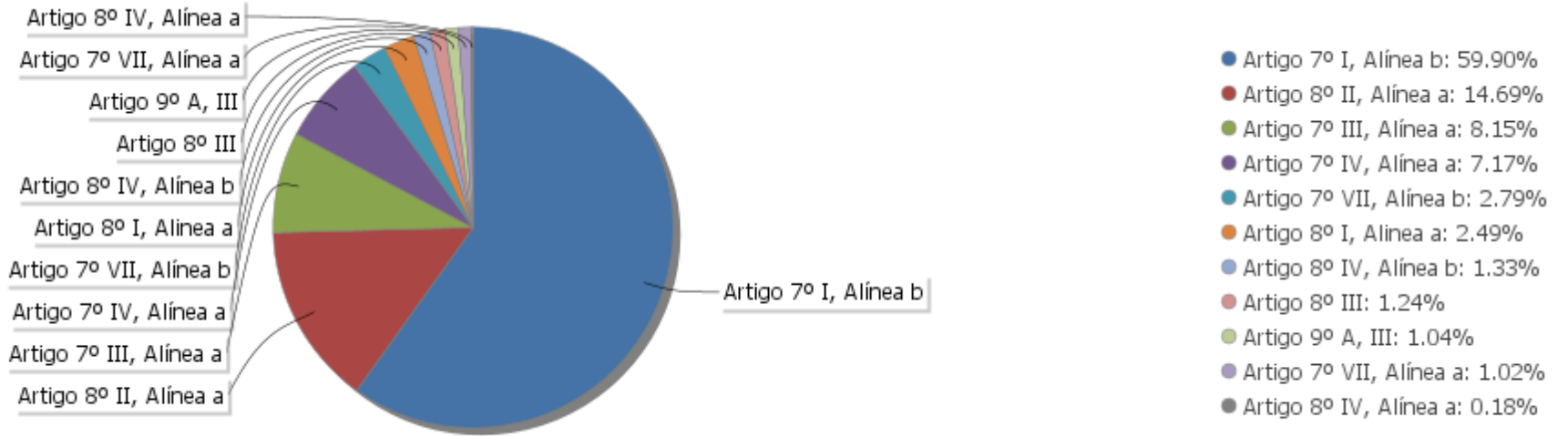
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

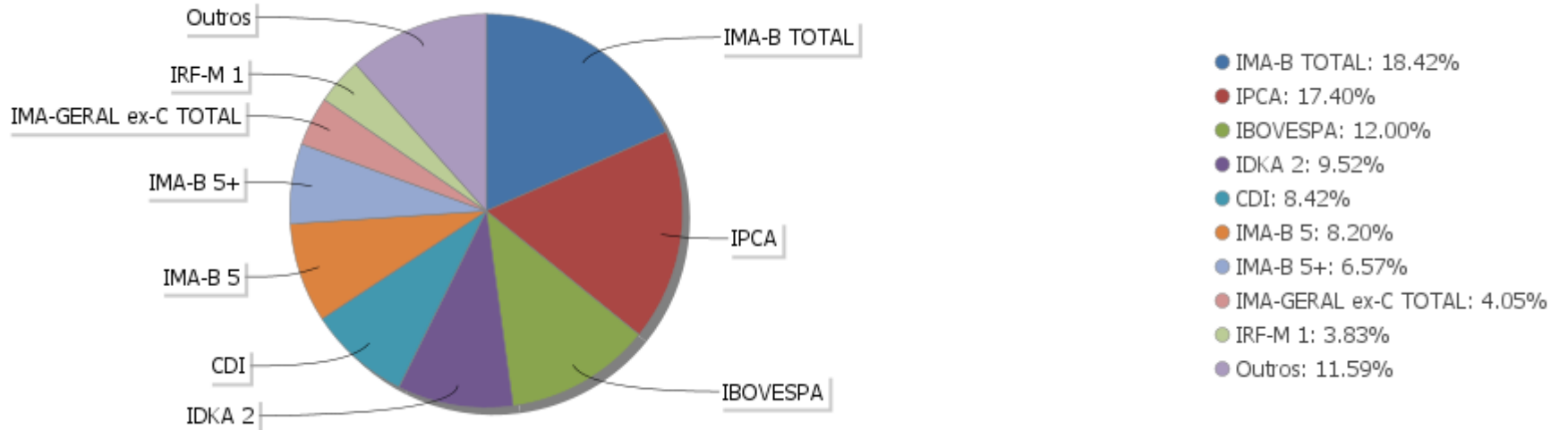
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	164.710.148,56	94,65	164.710.148,56	94,65
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	164.710.148,56	94,65
acima de 365 dias	9.319.065,76	5,35	174.029.214,32	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

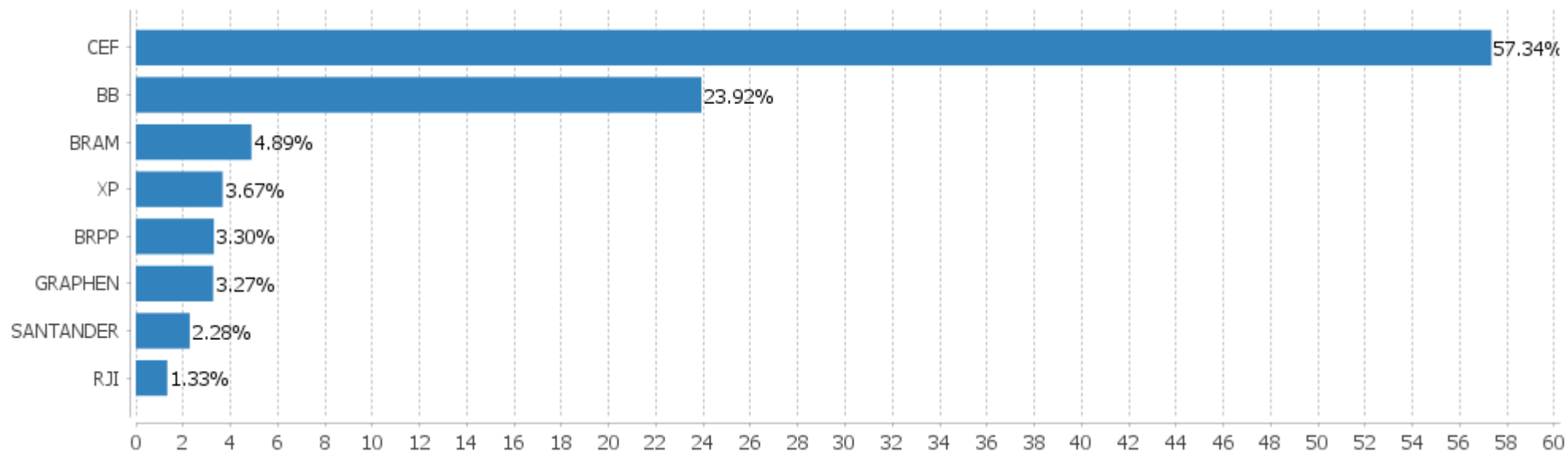


Alocação Por Estratégia



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	-0,87	-1,11	0,42	1,13	1,62	0,49	-1,14	-1,30	-1,12	-2,34	1,30		-2,95
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,67	1,37		14,60
p.p. indexador	-1,54	-2,35	-0,99	0,40	0,35	-0,48	-2,56	-2,64	-2,73	-4,01	-0,07		-17,55
2020	0,22	-1,14	-7,62	-0,32	1,94	1,77	2,89	0,49	-1,40	-0,10	2,74	3,33	2,34
IPCA + 5,86%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,62
p.p. indexador	-0,49	-1,80	-8,19	-0,46	1,87	1,03	2,01	-0,22	-2,52	-1,44	1,40	1,48	-8,28
2019	3,17	0,13	0,33	0,93	1,68	2,27	1,00	0,16	1,69	1,80	0,46	2,27	17,05
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	2,34	-0,76	-0,87	-0,13	1,04	1,82	0,27	-0,46	1,25	1,17	-0,52	0,63	6,46
2018	2,72	-0,87	0,78	0,37	-2,04	-0,27	2,02	-0,90	0,55	4,00	0,72	0,93	8,16
IPCA + 6,00%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	1,92	-1,61	0,20	-0,34	-2,93	-2,02	1,18	-1,34	-0,37	3,04	0,46	0,31	-1,76

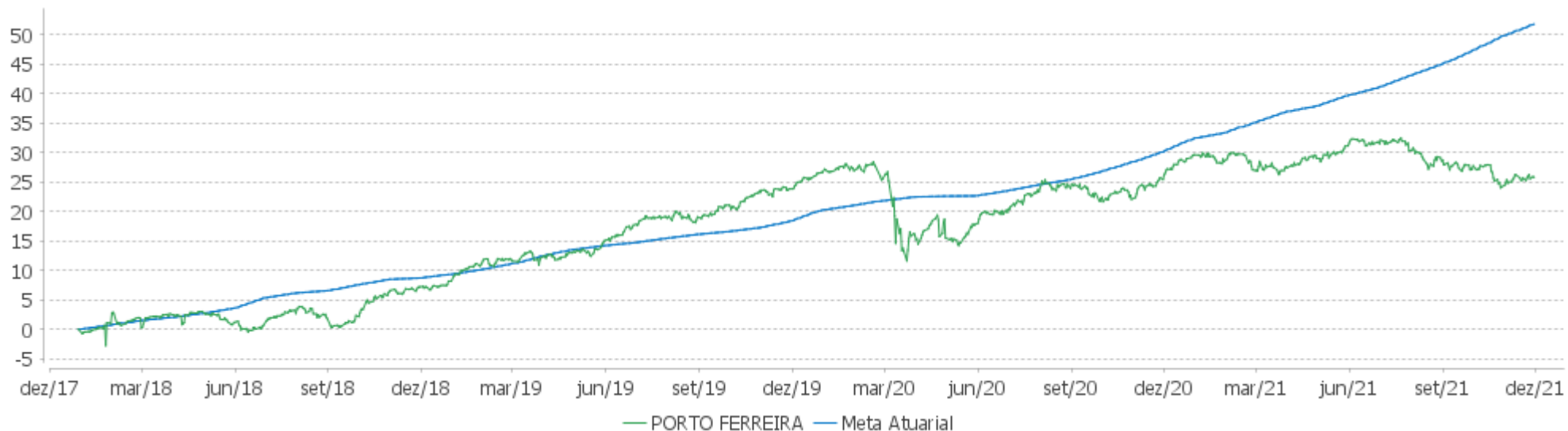
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

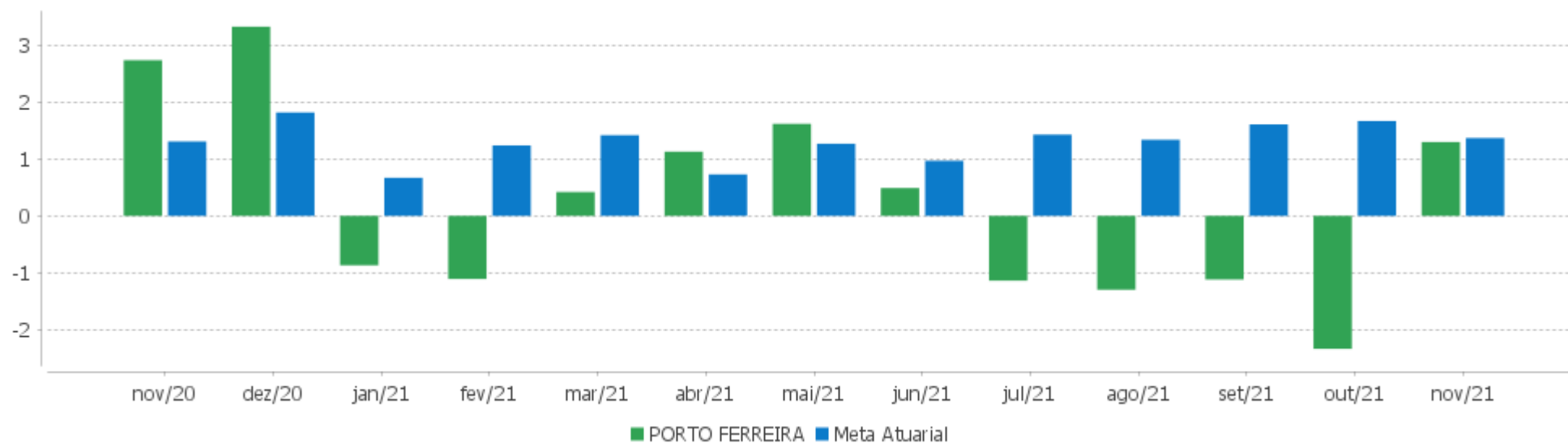
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	20	42,55	03 meses	-2,18	4,72	-6,90	5,78
Meses abaixo - Meta Atuarial	27	57,45	06 meses	-4,08	8,68	-12,76	5,33
			12 meses	0,28	16,72	-16,44	5,12
			24 meses	1,58	28,85	-27,27	8,43
Maior rentabilidade da Carteira	4,00	2018-10	36 meses	17,33	41,05	-23,72	7,28
Menor rentabilidade da Carteira	-7,62	2020-03	Desde 29/12/2017	25,74	54,10	-28,36	7,46

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
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,44 -0,03	-1,74 -0,25	0,63 -0,07	-0,51 -0,16	3,02 -0,28	6,30 -0,63	29,85 -1,16
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	2,48 -0,02	3,56 -0,19	2,20 -0,05	2,18 -0,11	5,43 -0,22	13,03 -0,45	27,77 -0,80
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	2,47 -0,03	3,52 -0,23	2,19 -0,06	2,18 -0,12	5,40 -0,25	12,88 -0,59	27,61 -0,95
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	2,43 -0,08	3,91 -0,20	2,19 0,08	2,36 0,48	5,50 -0,42	13,43 -1,01	26,22 -1,81
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,73	-1,30	0,07	-0,51	1,05	4,72	18,65
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,91 -0,04	-0,93 -10,19	0,59 -2,80	-1,64 -7,49	0,38 -10,36	6,30 -9,21	24,67 5,38
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	2,42 -0,09	3,91 -0,19	2,18 0,07	2,03 0,15	5,63 -0,28	13,49 -0,95	26,27 -1,77
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,80 0,01	-4,08 -0,28	-1,30 -0,09	-2,25 -0,20	-2,20 -0,27	2,67 -0,60	15,81 -0,94
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,44 -0,03	-1,71 -0,23	0,61 -0,09	-0,53 -0,18	3,04 -0,26	6,38 -0,55	30,01 -1,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,78 -0,01	1,84 -0,20	0,62 -0,03	1,32 -0,10	2,13 -0,22	5,96 -0,44	13,06 -0,69
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	4,35 -0,12	-6,68 -0,45	-1,07 -0,23	-3,40 -0,42	0,37 -0,44	0,71 -0,79	29,69 -1,69
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	4,44 -0,04	-6,47 -0,24	-0,97 -0,13	-3,20 -0,22	0,52 -0,29	0,94 -0,56	30,14 -1,24
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,63 107,47	3,79 105,29	1,59 104,89	2,78 106,16	4,06 107,46	6,66 96,93	12,91 96,50
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,59 101,26	3,53 98,06	1,55 102,67	2,67 101,87	3,80 100,61	6,48 94,23	12,89 96,35
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,72 -4,19	-2,95 -1,47	-1,46 -2,16	-2,63 -2,28	-1,95 -5,24	-4,47 -11,39	7,60 -23,41
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,40 -0,06	-1,71 -0,23	0,62 -0,08	-0,47 -0,12	3,06 -0,24	6,31 -0,62	29,73 -1,28
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO	-0,14	-0,77	-0,42	-0,90	-0,93	-3,36	28,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-23,59	-21,44	-27,95	-34,52	-24,61	-48,85	213,19
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I % do CDI	-0,59 -99,98	-17,45 -484,05	-2,95 -195,02	1.879.759.211,54 71.804.494.126,07	1.879.759.211,54 49.802.146.232,62	48.207.041,22 701.448.745,62	509.489,59 3.807.144,93
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I - SERIE B % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	0,66 112,29	-0,94 -26,07	1,16 76,57	1,31 49,90	-0,46 -12,27	-6,02 -87,53	-4,83 -36,08
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	-1,77 -0,04	-14,48 -0,66	-15,61 -0,21	-21,00 -0,33	-6,99 -0,79	-5,92 -1,80	16,11 -3,16
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,31 -1,72	143,56 128,38	-0,91 -5,78	148,93 139,94	137,69 120,36	-92,70 -122,37	-92,63 -134,58
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO Var. IFIX p.p.	0,17 3,81	1,09 11,25	0,24 6,48	1,43 9,88	1,23 9,43	3,58 14,37	4,80 -7,28
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V % do CDI	-0,42 -71,78	-4,40 -122,11	-1,25 -82,61	-2,44 -93,09	-4,78 -126,54	-1,53 -22,30	-0,11 -0,85
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-0,49 0,75	25,83 -5,66	2,15 -8,19	11,27 -5,41	29,78 -3,14	43,53 -49,92	69,64 -71,05
BRADERCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,26 -0,63	-11,36 -3,47	-10,17 -2,46	-15,54 -3,84	-3,00 -3,35	-10,32 -10,61	3,63 -29,59
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,67 -0,14	-15,79 -1,42	-14,74 -0,54	-20,46 -1,20	-8,29 -1,88	-10,53 -4,70	7,07 -6,80
BRADERCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-1,96 -0,43	-19,23 -4,86	-17,83 -3,63	-22,01 -2,76	-12,84 -6,44	-16,60 -10,76	-0,45 -14,32
XP INVESTOR FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	0,27 1,80	-15,97 -1,60	-12,61 1,59	-21,43 -2,18	-10,12 -3,71	-11,70 -5,86	22,55 8,68
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-1,49 0,04	-9,49 4,88	-10,16 4,04	-15,14 4,11	-0,06 6,35	13,16 18,99	
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-4,14 -2,61	-22,29 -7,92	-19,30 -5,10	-23,48 -4,23	-16,37 -9,96	-21,30 -15,47	-2,58 -16,44
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	-3,17 -0,88	-13,22 6,05	-18,61 1,41	-22,89 3,71	-5,75 7,45	-5,98 3,66	28,96 -0,59
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-0,89 -0,22	28,32 -3,08	9,66 -0,55	17,02 -2,04	29,21 -3,41	95,10 -4,19	146,17 -7,16
PORTO FERREIRA Var. IPCA + 5,41% p.p.	1,30 -0,07	-2,95 -17,55	-2,18 -6,90	-4,08 -12,76	0,28 -16,40	1,58 -26,66	17,33 -22,28
CDI	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	-1,53	-14,37	-14,20	-19,25	-6,41	-5,84	13,87
INPC + 6,00%	1,31	15,28	4,70	8,96	17,56	31,03	43,57
IPCA + 6,00%	1,42	15,18	4,87	8,99	17,33	29,67	41,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	1,00
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	1,00
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	2,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du	0,00	0,30
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+2 du	D+2 du	0,00	0,20
BB PREV RF IRF-M	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
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	1,50
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	1,50
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	1,50
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	1,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B 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
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	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
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,40
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	Não se aplica	Não se aplica				
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Não se aplica	Não se aplica				
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I	Não se aplica	Não se aplica				
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I - SERIE B	Não se aplica	Não se aplica				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,00
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	D+0	D+0				
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1008 du	D+1009 du	20.000000000000 PERÍODO SEMESTRAL,C /VENCIMENTO NO ÚLTIMO DIA ÚTIL DE DEZEMBRO E JUNHO.	0,00
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0 ou D+1080 (isento de taxa de resgate)	D+1 du ou D+1081 (isento de taxa de resgate)	0,00	1,40
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	20.000000000000	2,00
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,10
XP INVESTOR FI DE ACOES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	20.000000000000 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	0,79	2,03	0,65	1,42	2,35	6,40	13,74	21,69	36,07
IRF-M 1+	2,19	-7,11	-2,04	-3,73	-4,28	1,46	17,30	31,09	53,93
IRF-M TOTAL	1,79	-3,81	-1,21	-2,06	-1,93	3,27	16,74	28,91	49,37
IMA-B 5	2,50	3,75	2,25	2,30	5,65	13,47	28,56	40,58	59,06
IMA-B 5+	4,47	-6,23	-0,84	-2,98	0,81	1,50	31,39	50,00	74,04
IMA-B TOTAL	3,47	-1,49	0,70	-0,35	3,30	6,93	31,01	46,92	69,13
IMA-GERAL TOTAL	1,80	0,09	0,46	0,31	2,12	6,38	20,34	32,04	50,44
IDKA 2	2,51	4,11	2,12	1,88	5,91	14,44	28,04	40,40	59,70
IDKA 20	6,09	-12,50	-3,62	-8,23	-2,56	-7,04	31,71	56,52	86,71
CDI	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38	20,72	33,50

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-1,53	-14,37	-14,20	-19,25	-6,41	-5,84	13,87	41,61	64,63
IBRX 100	-1,69	-13,88	-14,79	-20,36	-6,00	-4,38	17,37	45,94	70,57
IBRX 50	-1,81	-13,79	-14,84	-20,46	-5,66	-4,80	12,95	40,34	62,89
SMALL CAP	-2,29	-19,26	-20,02	-26,60	-13,19	-9,64	29,55	46,85	103,82
IFIX	-3,64	-10,16	-6,23	-8,45	-8,19	-10,79	12,08	16,51	40,35
Índice Consumo - ICON	-7,50	-26,09	-21,46	-28,01	-22,40	-19,51	15,50	11,72	36,98
Índice Dividendos - IDIV	0,89	-7,89	-7,71	-11,70	0,34	0,29	33,23	61,08	90,61

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	0,95	9,26	3,40	5,86	10,74	15,51	19,30	24,12	27,60
INPC	0,84	9,36	3,23	5,84	10,96	16,73	20,66	24,95	27,38
IGPM	0,02	16,77	0,02	2,08	17,89	46,79	52,62	67,39	65,94
SELIC	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38	20,73	33,53

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	-1,24	31,49	10,34	16,68	32,92	93,45	140,69	197,22	243,65
MSCI ACWI	-2,91	21,57	7,09	9,69	23,86	76,81	115,31	147,67	190,75
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%	1,26	13,21	4,38	7,95	15,13	24,86	34,11	45,07	55,08
IPCA + 5,00%	1,34	14,19	4,63	8,47	16,23	27,25	37,99	50,70	62,64
IPCA + 5,50%	1,38	14,69	4,75	8,73	16,78	28,46	39,96	53,57	66,52
IPCA + 5,89%	1,41	15,07	4,84	8,93	17,21	29,40	41,51	55,84	69,61
IPCA + 6,00%	1,42	15,18	4,87	8,99	17,33	29,67	41,95	56,48	70,48
INPC + 4,00%	1,15	13,31	4,22	7,93	15,36	26,17	35,64	46,04	54,81
INPC + 6,00%	1,31	15,28	4,70	8,96	17,56	31,03	43,57	57,53	70,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
74	08/11/2021	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	179.151,47	0,00	42.916,02087500	4,1744660000
78	08/11/2021	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	14.000,00	0,00	3.353,72236800	4,1744660000
77	22/11/2021	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	107.000,00	0,00	25.564,10054800	4,1855570000
73	29/11/2021	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	67.000,00	0,00	15.983,11419700	4,1919240000
76	29/11/2021	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	347.000,00	82.778,21833400	4,1919240000
75	30/11/2021	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	500,00	119,24263000	4,1931310000
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.569.745,39

Value-At-Risk: 2,63%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PORTO FERREIRA		2,63	2,63			174.029.214,32	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,60%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M		1,84	0,03	0,03			4.589.287,57	2,64
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,74	0,06	0,04			5.049.120,09	2,90
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,71	0,09	0,02			8.347.014,98	4,80
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,59	0,01	0,02			6.664.692,14	3,83
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,51	0,07	0,03			12.623.734,07	7,25
BB PREV RF IDKA2		1,34	0,04	0,61			8.275.782,30	4,76
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		4,03	0,06	0,20			4.000.269,72	2,30
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,54	0,01	0,01			1.641.456,99	0,94
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		4,07	0,12	0,14			7.427.713,26	4,27
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,64	0,05	0,60			8.297.146,76	4,77
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,38	0,04	1,97			7.047.773,73	4,05
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,46	0,16	1,46			30.280.977,87	17,40
Sub-total	3,52	1,71	0,74		0,44	2,14	104.244.969,48	59,90

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		2,72	0,16	0,06			14.190.624,54	8,15
Sub-total	7,67	2,72	0,16		0,37	3,40	14.190.624,54	8,15

Artigo 7º IV, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,04	0,00	0,02			8.001.075,01	4,60
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,05	0,00	0,03			5.398,99	0,00
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA		1,60	0,02	2,29			4.469.237,91	2,57
Sub-total	1,03	0,58	0,02		-0,45	0,12	12.475.711,91	7,17

Artigo 7º VII, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I - SERIE B		0,00	0,00	0,03			63.038,89	0,04
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I		0,88	0,00	0,88			503.025,32	0,29
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC		0,05	-0,00	0,06			1.211.115,17	0,70
Sub-total	0,99	0,24	0,00		-0,31	0,28	1.777.179,38	1,02

Artigo 7º VII, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO		0,03	0,00	0,05			4.849.827,85	2,79
Sub-total	0,49	0,03	0,00		-1,49	-0,14	4.849.827,85	2,79

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 9,66%

Artigo 8º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		12,20	0,27	0,10			4.326.982,53	2,49
Sub-total	23,03	12,20	0,27		-0,10	-1,77	4.326.982,53	2,49

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES		10,60	0,12	2,50			2.325.316,42	1,34
BRADERCO F I A SELECTION		12,35	0,24	2,88			3.831.387,89	2,20
BRADERCO FIA DIVIDENDOS		10,52	0,18	4,13			3.390.561,44	1,95
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		14,43	0,09	4,35			1.288.108,79	0,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
XP INVESTOR FI DE ACOES		10,36	0,34	5,27			6.385.752,21	3,67
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		11,74	0,25	1,56			4.307.529,01	2,48
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI		10,52	0,21	2,59			4.033.121,80	2,32
Sub-total	22,37	10,81	1,43		-0,08	-1,27	25.561.777,56	14,69

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V		0,01	-0,00	0,04			18.904,40	0,01
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		7,20	0,03	7,16			2.133.166,84	1,23
Sub-total	14,87	7,14	0,03		-0,07	-0,49	2.152.071,24	1,24

Artigo 8º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA		0,07	0,00	0,09			318.597,06	0,18
Sub-total	1,09	0,07	0,00		-0,82	-0,31	318.597,06	0,18

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO		0,00	0,00	2,91			2.319.366,84	1,33
Sub-total	0,61	0,00	0,00		-0,67	0,17	2.319.366,84	1,33

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,14%

Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		8,14	-0,02	0,76			1.812.105,93	1,04
Sub-total	19,70	8,14	-0,02		-0,08	-0,89	1.812.105,93	1,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 6,30% do patrimônio líquido do fundo INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I (Art. 7, Inciso VII, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;