



**LDB**  
EMPRESAS

**PORTO FERREIRA**  
JANEIRO 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 31.01.2022.

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

RENDA FIXA 78,06%

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-M	3,54	-0,13	-0,13	4.669.464,53	2,62	4.743.847.539,71	0,10
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,71	-0,77	-0,77	5.020.538,81	2,82	6.778.952.570,88	0,07
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,68	-0,76	-0,76	8.301.158,27	4,66	4.513.989.587,78	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,67	0,61	0,61	6.762.177,65	3,79	6.296.869.255,71	0,11
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,77	0,09	0,09	12.732.109,67	7,14	12.040.160.059,77	0,11
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,62	0,01	0,01	8.335.028,75	4,67	9.258.989.052,65	0,09
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,94	-1,63	-1,63	3.922.299,02	2,20	954.093.578,76	0,41
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,76	0,10	0,10	1.655.643,87	0,93	1.235.193.585,55	0,13
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,88	-1,62	-1,62	7.282.518,54	4,08	1.336.256.948,50	0,54
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,77	0,02	0,02	8.358.434,43	4,69	10.879.369.499,05	0,08
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,77	0,04	0,04	7.114.899,24	3,99	7.461.201.984,89	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,30	0,67	0,67	30.734.830,55	17,24	11.686.800.915,89	0,26
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>3,33</b>	<b>-0,03</b>	<b>-0,03</b>	<b>104.889.103,33</b>	<b>58,83</b>		

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
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,17	0,79	0,79	9.103.348,26	5,11	14.693.290.660,98	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,71	-0,76	-0,76	14.113.439,01	7,92	2.422.224.309,42	0,58
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,78	0,78	5.484,75	0,00	7.223.462.787,00	0,00
GRAPHEN	RJI	LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	2,42	0,89	0,89	4.456.404,58	2,50	68.704.802,46	6,49
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>5,62</b>	<b>-0,03</b>	<b>-0,03</b>	<b>27.678.676,60</b>	<b>15,52</b>		

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRPP	INTRADER	PIATÁ FI RF LONGO PRAZO	0,51	-0,15	-0,15	4.835.497,90	2,71	107.950.648,38	4,48
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea b</b>			<b>0,51</b>	<b>-0,15</b>	<b>-0,15</b>	<b>4.835.497,90</b>	<b>2,71</b>		

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

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	1.694,25	0,00	0,00	497.971,54	0,28	7.899.434,38	6,30
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	2,94	0,50	0,50	1.218.706,06	0,68	72.451.705,68	1,68
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>			<b>0,58</b>	<b>0,17</b>	<b>0,17</b>	<b>1.779.716,49</b>	<b>1,00</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>3,11</b>	<b>-0,03</b>	<b>-0,03</b>	<b>139.182.994,32</b>	<b>78,06</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

18,32%

Artigo 8º I (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	20,70	5,46	5,46	2.505.896,72	1,41	171.372.556,48	1,46
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	21,12	6,78	6,78	4.172.986,12	2,34	571.613.964,36	0,73
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	19,03	6,92	6,92	3.738.061,36	2,10	880.765.225,69	0,42
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	23,10	3,96	3,96	1.391.273,56	0,78	1.385.056.471,22	0,10
XP	XP	XP INVESTOR FI DE ACOES	19,45	5,77	5,77	6.896.764,54	3,87	212.979.215,59	3,24
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,24	6,70	6,70	4.775.488,90	2,68	1.044.534.082,64	0,46
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	19,42	6,74	6,74	4.740.185,46	2,66	467.884.411,12	1,01
BB	BB	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	19,04	6,49	6,49	4.447.715,95	2,49	1.502.868.240,22	0,30
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>18,52</b>	<b>6,30</b>	<b>6,30</b>	<b>32.668.372,61</b>	<b>18,32</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>17,53</b>	<b>6,30</b>	<b>6,30</b>	<b>32.668.372,61</b>	<b>18,32</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,93%

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,35	-9,75	-9,75	1.663.344,87	0,93	3.479.303.240,79	0,05
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>17,35</b>	<b>-9,75</b>	<b>-9,75</b>	<b>1.663.344,87</b>	<b>0,93</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>17,80</b>	<b>-9,75</b>	<b>-9,75</b>	<b>1.663.344,87</b>	<b>0,93</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,38%

Artigo 10º I (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	0,14	-0,43	-0,43	18.741,74	0,01	1.545.829,15	1,21
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,60	-5,30	-5,30	2.132.393,14	1,20	3.506.862.313,47	0,06
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>17,92</b>	<b>-5,26</b>	<b>-5,26</b>	<b>2.151.134,88</b>	<b>1,21</b>		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRPP	BNY MELLON	GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	92,76	-0,32	-0,32	316.615,71	0,18	19.383.513,43	1,63
<b>Sub-total Artigo 10º II</b>			<b>92,76</b>	<b>-0,32</b>	<b>-0,32</b>	<b>316.615,71</b>	<b>0,18</b>		

<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>15,55</b>	<b>-4,66</b>	<b>-4,66</b>	<b>2.467.750,59</b>	<b>1,38</b>		
-----------------------------------	--	--	--------------	--------------	--------------	---------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,30%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RJI	RJI	HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	1,62	0,13	0,13	2.315.265,85	1,30	72.545.951,03	3,19
<b>Sub-total Artigo 11º</b>			<b>1,62</b>	<b>0,13</b>	<b>0,13</b>	<b>2.315.265,85</b>	<b>1,30</b>		
Fundos Imobiliários			1,63	0,13	0,13	2.315.265,85	1,30		
<b>Total</b>			<b>5,10</b>	<b>0,90</b>	<b>0,90</b>	<b>178.297.728,24</b>	<b>100,00</b>		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			ALM	Limite Legal
				Mínimo	Objetivo	Máximo		
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	104.889.103,33	58,83	0,00	55,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	27.678.676,60	15,52	0,00	15,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	4.835.497,90	2,71	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.779.716,49	1,00	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>139.182.994,32</b>	<b>78,06</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	32.668.372,61	18,32	0,00	20,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>32.668.372,61</b>	<b>18,32</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	1.663.344,87	0,93	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>1.663.344,87</b>	<b>0,93</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	2.151.134,88	1,21	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	316.615,71	0,18	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>2.467.750,59</b>	<b>1,38</b>					15,00
<b>Fundos Imobiliários</b>								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.315.265,85	1,30	0,00	1,50	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Fundos Imobiliários</b>	<b>2.315.265,85</b>	<b>1,30</b>					5,00

**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	-0,03 -3,89	-0,03 -3,89	2,77 132,24	0,55 15,82	0,54 10,78	-29.904,82	-29.904,82
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,03 -3,64	-0,03 -3,64	3,60 171,84	-0,32 -9,14	-0,65 -12,92	-6.382,14	-6.382,14
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,17 22,81	0,17 22,81				2.967,37	2.967,37
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	-0,15 -19,96	-0,15 -19,96				-7.076,42	-7.076,42
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	6,30 -0,69	6,30 -0,69				1.935.587,36	1.935.587,36
Artigo 9º III % do CDI	-9,75 -1.330,92	-9,75 -1.330,92	-9,03 -430,53	3,11 89,61		-179.615,60	-179.615,60
Artigo 10º I % do CDI	-5,26 -718,64	-5,26 -718,64				-119.490,15	-119.490,15
Artigo 10º II % do CDI	-0,32 -43,05	-0,32 -43,05				-1.001,28	-1.001,28
Artigo 11º % do CDI	0,13 17,31	0,13 17,31				2.965,67	2.965,67
<b>PORTO FERREIRA (Total)</b>						<b>1.598.049,99</b>	<b>1.598.049,99</b>

**RESULTADO POR ATIVO**

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	7.112.197,46	0,00	0,00	0,00	7.114.899,24	2.701,78	2.701,78
BB PREV RF IDKA2	8.334.226,04	0,00	0,00	0,00	8.335.028,75	802,71	802,71
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5.059.389,23	0,00	0,00	0,00	5.020.538,81	-38.850,42	-38.850,42
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	3.987.209,13	0,00	0,00	0,00	3.922.299,02	-64.910,11	-64.910,11
BB PREV RF IRF-M	4.675.415,25	0,00	0,00	0,00	4.669.464,53	-5.950,72	-5.950,72
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8.356.862,27	0,00	0,00	0,00	8.358.434,43	1.572,16	1.572,16
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7.402.320,96	0,00	0,00	0,00	7.282.518,54	-119.802,42	-119.802,42

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12.720.613,05	0,00	0,00	0,00	12.732.109,67	11.496,62	11.496,62
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8.364.488,92	0,00	0,00	0,00	8.301.158,27	-63.330,65	-63.330,65
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.721.245,41	0,00	0,00	0,00	6.762.177,65	40.932,24	40.932,24
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7.330.354,22	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	30.531.003,54	0,00	0,00	0,00	30.734.830,55	203.827,01	203.827,01
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	1.654.036,89	0,00	0,00	0,00	1.655.643,87	1.606,98	1.606,98
					104.889.103,33	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\$)
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	4.605.523,89	-2.895.542,34	0,00	9.103.348,26	63.012,49	63.012,49
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.442,12	0,00	0,00	0,00	5.484,75	42,63	42,63
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	14.222.012,59	0,00	0,00	0,00	14.113.439,01	-108.573,58	-108.573,58
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	4.417.268,26	0,00	0,00	0,00	4.456.404,58	39.136,32	39.136,32
					27.678.676,60	0,00	0,00

## Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I	501.048,43	0,00	0,00	0,00	497.971,54	-3.076,89	-3.076,89
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	1.212.661,80	0,00	0,00	0,00	1.218.706,06	6.044,26	6.044,26
					1.779.716,49	0,00	0,00

## Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
PIATÁ FI RF LONGO PRAZO	4.842.574,32	0,00	0,00	0,00	4.835.497,90	-7.076,42	-7.076,42
					4.835.497,90	0,00	0,00

## Artigo 8º I (Fundos de Ações)

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	4.440.935,05	0,00	0,00	0,00	4.740.185,46	299.250,41	299.250,41
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	4.475.781,70	0,00	0,00	0,00	4.775.488,90	299.707,20	299.707,20
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	4.176.829,98	0,00	0,00	0,00	4.447.715,95	270.885,97	270.885,97
BRADESCO F I A SELECTION	3.908.180,32	0,00	0,00	0,00	4.172.986,12	264.805,80	264.805,80
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	1.338.250,64	0,00	0,00	0,00	1.391.273,56	53.022,92	53.022,92
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	3.496.149,58	0,00	0,00	0,00	3.738.061,36	241.911,78	241.911,78
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	2.376.118,79	0,00	0,00	0,00	2.505.896,72	129.777,93	129.777,93
XP INVESTOR FI DE ACOES	6.520.539,19	0,00	0,00	0,00	6.896.764,54	376.225,35	376.225,35
					32.668.372,61	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\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1.842.960,47	0,00	0,00	0,00	1.663.344,87	-179.615,60	-179.615,60
					1.663.344,87	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.251.803,14	0,00	0,00	0,00	2.132.393,14	-119.410,00	-119.410,00
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	18.821,89	0,00	0,00	0,00	18.741,74	-80,15	-80,15
					2.151.134,88	0,00	0,00

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	317.616,99	0,00	0,00	0,00	316.615,71	-1.001,28	-1.001,28
					316.615,71	0,00	0,00

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	2.321.199,96	0,00	0,00	0,00	8.899,78	2.315.265,85	2.965,67	2.965,67
						2.315.265,85	0,00	0,00

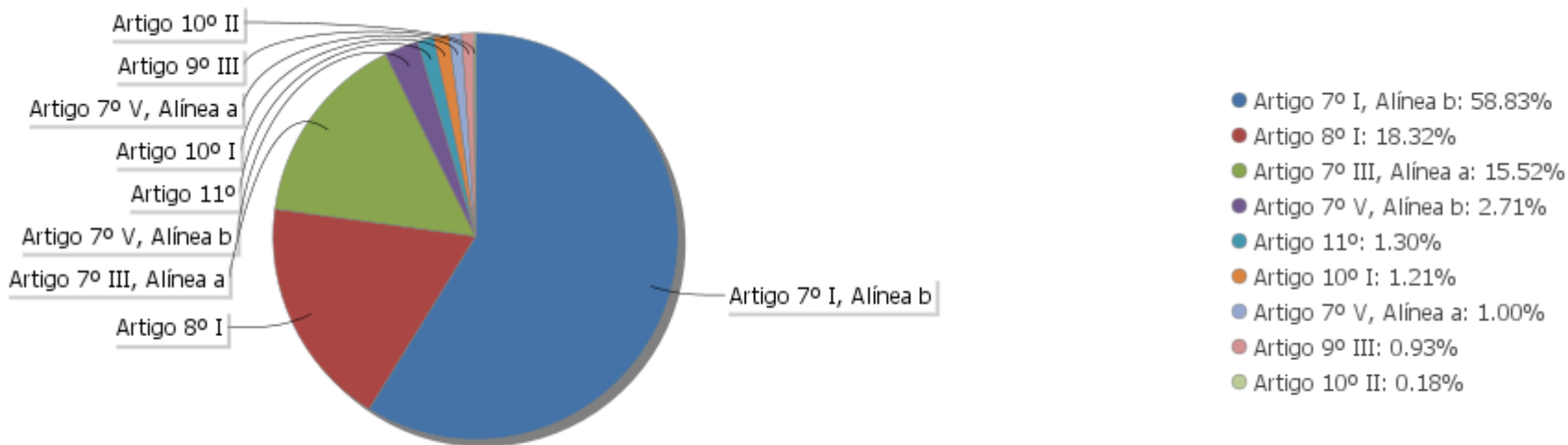
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

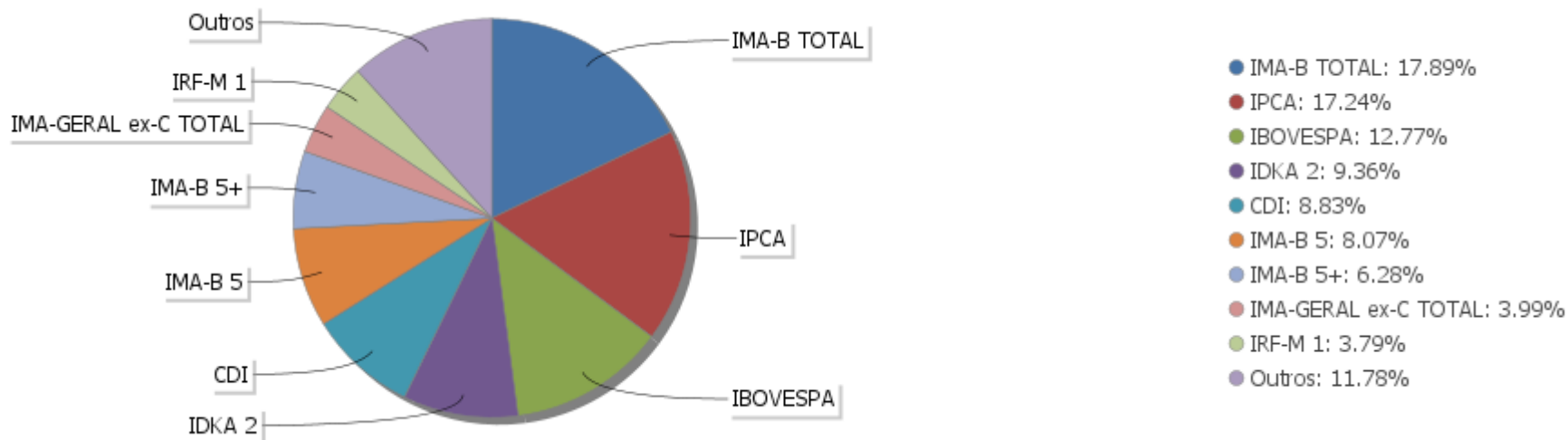
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	169.005.825,76	94,79	169.005.825,76	94,79
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	169.005.825,76	94,79
acima de 365 dias	9.291.902,48	5,21	178.297.728,24	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

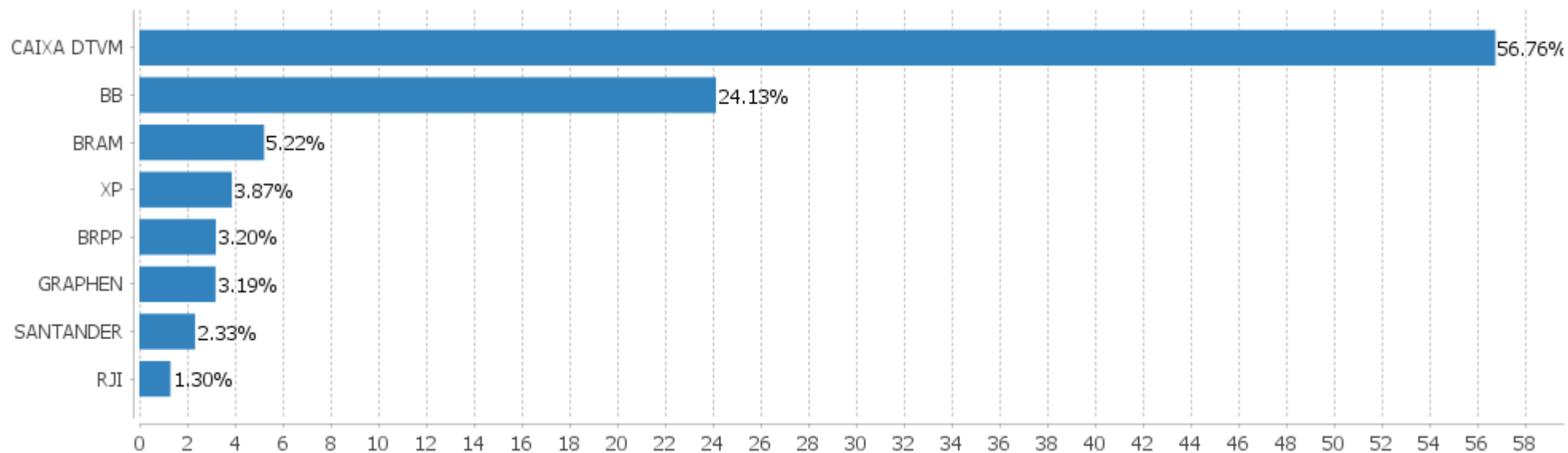


Alocação Por Estratégia



## 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	0,90												0,90
IPCA + 4,84%	0,94												0,94
p.p. indexador	-0,03												-0,03
2021	-0,87	-1,11	0,42	1,13	1,62	0,49	-1,14	-1,30	-1,12	-2,34	1,30	0,98	-2,01
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	1,22	15,99
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	-0,24	-18,00
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**

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	20	40,82
Meses abaixo - Meta Atuarial	29	59,18

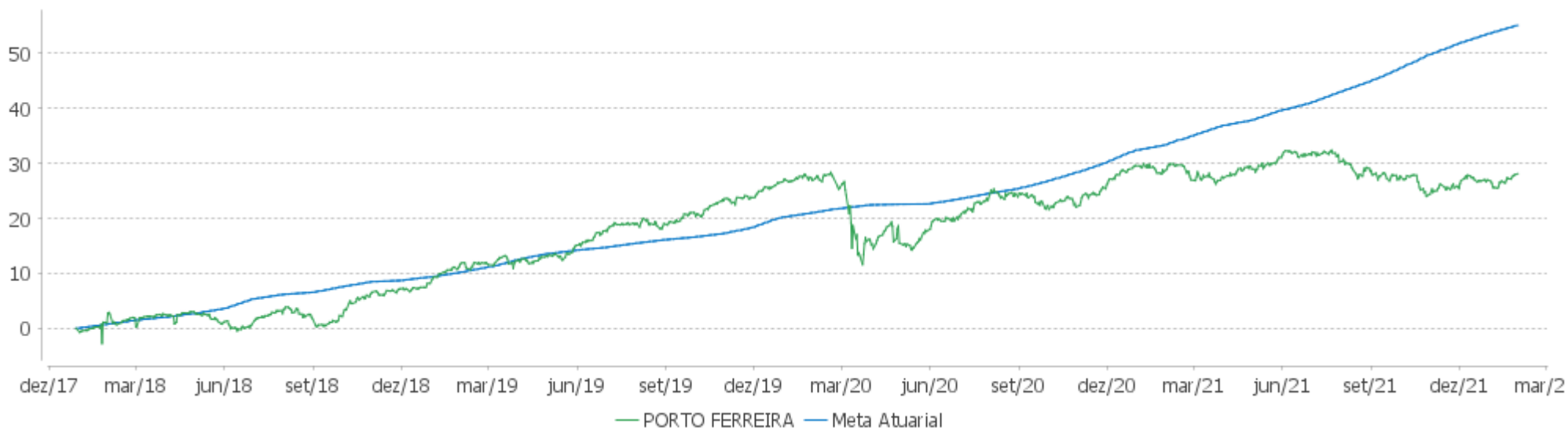
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,00	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-7,62	2020-03

**Relatório**

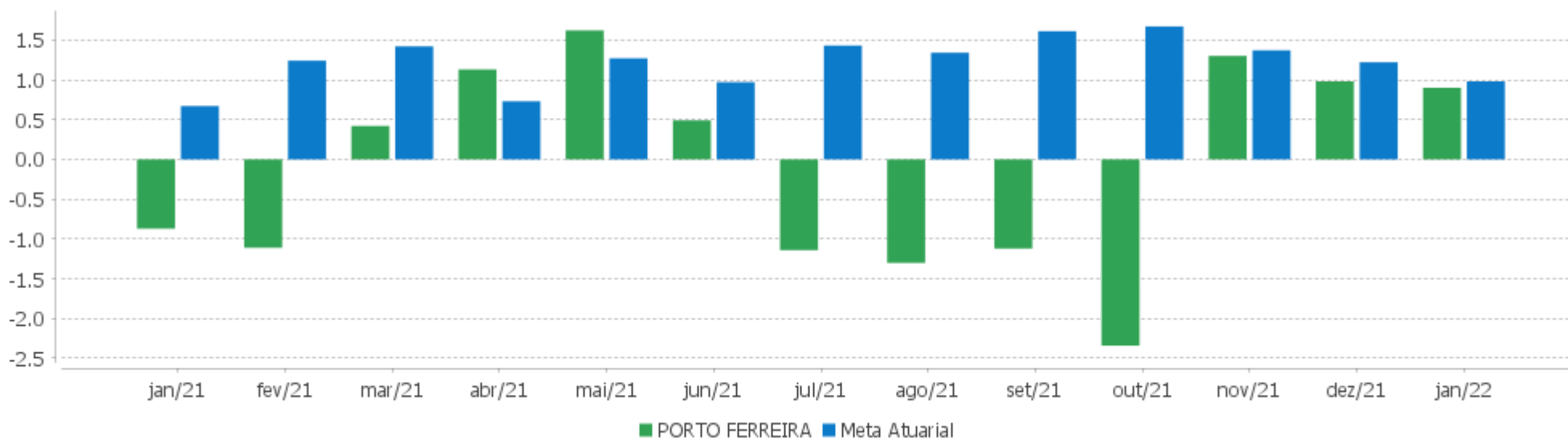
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,21	3,57	-0,35	4,53
06 meses	-1,63	8,42	-10,04	5,29
12 meses	-0,26	16,30	-16,56	5,10
24 meses	0,97	28,60	-27,63	8,45
36 meses	14,81	42,04	-27,23	7,30
48 meses	24,72	56,18	-31,46	6,89
Desde 29/12/2017	28,11	57,43	-29,32	7,35

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
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO % do CDI	-0,15 -19,96	-0,15 -19,96	-0,43 -20,61	-0,86 -24,61	-1,76 -35,10	-2,80 -36,55	28,61 205,80
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,76 -0,03	-0,76 -0,03	2,84 -0,10	-1,05 -0,15	-1,38 -0,23	3,43 -0,59	21,70 -1,16
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,78 106,98	0,78 106,98	2,23 106,30	3,66 105,41	5,27 105,34	7,60 99,12	13,57 97,62
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,79 108,44	0,79 108,44	2,18 103,99	3,57 102,77	4,96 99,07	7,34 95,71	13,52 97,28
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,89 1,62	0,89 1,62	-1,01 -3,94	-3,13 -2,22	-2,96 -1,81	-5,62 -9,64	2,56 -20,30
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I % do CDI	-0,61 -83,86	-0,61 -83,86	-1,59 -75,60	-4,69 -135,09	1.860.873.700,28 37.197.824.385,78	186.840.689.210,89 2.437.702.633.427,88	504.369,86 3.628.286,05
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	0,50 68,07	0,50 68,07	1,29 61,50	1,55 44,53	-0,35 -6,99	-4,92 -64,15	-5,03 -36,22
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,76 -0,02	-0,76 -0,02	2,87 -0,07	-1,06 -0,15	-1,42 -0,27	3,39 -0,62	21,71 -1,15
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,10 -0,02	0,10 -0,02	3,37 -0,05	3,22 -0,11	4,37 -0,21	12,03 -0,45	25,25 -0,78
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,09 -0,02	0,09 -0,02	3,35 -0,08	3,20 -0,12	4,32 -0,25	11,89 -0,59	25,04 -1,00
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,01 -0,04	0,01 -0,04	3,16 -0,25	3,11 -0,18	4,47 -0,40	12,51 -0,97	24,08 -1,89
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,04	0,04	2,70	0,57	0,19	4,20	16,07
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,67 0,13	0,67 0,13	2,42 0,18	0,62 -5,00	0,53 -9,85	6,39 -9,02	21,39 1,14
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,02 -0,03	0,02 -0,03	3,17 -0,24	3,14 -0,15	4,54 -0,33	12,57 -0,90	24,17 -1,81
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,61 -0,02	0,61 -0,02	2,25 -0,06	2,44 -0,10	3,30 -0,23	6,63 -0,45	13,45 -0,71
BB PREV RF IRF-M	-0,13	-0,13	3,58	-0,22	-1,62	2,96	14,51

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 TOTAL p.p.	-0,05	-0,05	-0,05	-0,19	-0,34	-0,62	-0,94
<b>BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI</b>	<b>-0,77</b>	<b>-0,77</b>	<b>2,85</b>	<b>-1,09</b>	<b>-1,42</b>	<b>3,46</b>	<b>21,90</b>
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,03	-0,08	-0,18	-0,27	-0,56	-0,96
<b>FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP</b>	<b>-1,62</b>	<b>-1,62</b>	<b>2,31</b>	<b>-5,29</b>	<b>-6,93</b>	<b>-3,68</b>	<b>17,26</b>
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,01	-0,01	-0,13	-0,37	-0,45	-0,65	-1,36
<b>BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI</b>	<b>-1,63</b>	<b>-1,63</b>	<b>2,40</b>	<b>-5,08</b>	<b>-6,71</b>	<b>-3,70</b>	<b>17,56</b>
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,02	-0,02	-0,04	-0,16	-0,24	-0,67	-1,06
<b>BRADESCO FIA DIVIDENDOS</b>	<b>6,92</b>	<b>6,92</b>	<b>10,54</b>	<b>-2,98</b>	<b>2,10</b>	<b>-5,22</b>	<b>5,19</b>
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,55	-0,55	0,36	-3,25	-3,87	-6,40	-23,31
<b>BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA</b>	<b>6,74</b>	<b>6,74</b>	<b>8,20</b>	<b>-9,31</b>	<b>-3,83</b>	<b>-7,73</b>	<b>10,23</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-0,25	-0,25	-0,15	-1,38	-1,29	-6,31	-4,91
<b>XP INVESTOR FI DE ACOES</b>	<b>5,77</b>	<b>5,77</b>	<b>8,29</b>	<b>-13,39</b>	<b>-4,99</b>	<b>-15,99</b>	<b>18,63</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-1,21	-1,21	-0,06	-5,46	-2,45	-14,57	3,49
<b>BRADESCO F I A SELECTION</b>	<b>6,78</b>	<b>6,78</b>	<b>6,78</b>	<b>-12,54</b>	<b>-9,79</b>	<b>-14,15</b>	<b>2,09</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-0,21	-0,21	-1,57	-4,61	-7,25	-12,73	-13,06
<b>BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI</b>	<b>6,49</b>	<b>6,49</b>	<b>8,64</b>	<b>-2,97</b>	<b>5,03</b>	<b>11,07</b>	<b>17,07</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-0,50	-0,50	0,29	4,96	7,57	12,49	
<b>SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES</b>	<b>5,46</b>	<b>5,46</b>	<b>3,30</b>	<b>-14,86</b>	<b>-13,61</b>	<b>-20,81</b>	<b>-3,91</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-1,52	-1,52	-5,05	-6,93	-11,07	-19,39	-19,05
<b>BB AÇÕES GOVERNANÇA FI</b>	<b>6,70</b>	<b>6,70</b>	<b>8,41</b>	<b>-9,80</b>	<b>-2,87</b>	<b>-2,40</b>	<b>17,07</b>
Var. IGCT p.p.	-0,14	-0,14	-0,22	-0,39	-0,77	-1,77	-3,15
<b>BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS</b>	<b>3,96</b>	<b>3,96</b>	<b>4,59</b>	<b>-14,52</b>	<b>-3,69</b>	<b>-9,51</b>	<b>22,86</b>
Var. SMALL CAP p.p.	0,55	0,55	-0,30	2,91	6,56	4,78	-1,63
<b>FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I</b>	<b>-9,75</b>	<b>-9,75</b>	<b>-9,03</b>	<b>3,11</b>	<b>11,35</b>	<b>71,14</b>	<b>143,50</b>
Var. Global BDRX p.p.	0,09	0,09	-0,12	-0,27	-2,22	-3,19	-6,48
<b>GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA</b>	<b>-0,32</b>	<b>-0,32</b>	<b>-0,93</b>	<b>-1,83</b>	<b>143,17</b>	<b>-92,74</b>	<b>-92,74</b>
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,34	-1,34	-4,69	-10,60	126,17	-122,33	-135,89
<b>LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V</b>	<b>-0,43</b>	<b>-0,43</b>	<b>-1,28</b>	<b>-2,50</b>	<b>-4,86</b>	<b>-8,67</b>	<b>-2,62</b>
% do CDI	-58,16	-58,16	-60,95	-71,92	-97,12	-113,10	-18,88
<b>CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP</b>	<b>-5,30</b>	<b>-5,30</b>	<b>-0,53</b>	<b>5,52</b>	<b>25,85</b>	<b>39,39</b>	<b>71,27</b>
Var. S&P 500 p.p.	3,74	3,74	6,39	-1,95	6,91	-36,27	-73,70
<b>HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO</b>	<b>0,13</b>	<b>0,13</b>	<b>0,38</b>	<b>0,52</b>	<b>1,76</b>	<b>3,78</b>	<b>5,10</b>
Var. IFIX p.p.	1,12	1,12	-3,40	2,20	5,32	13,54	-10,14
<b>PORTO FERREIRA</b>	<b>0,90</b>	<b>0,90</b>	<b>3,21</b>	<b>-1,63</b>	<b>-0,26</b>	<b>0,97</b>	<b>14,81</b>
Var. IPCA + 5,41% p.p.	-0,08	-0,08	-0,40	-10,09	-16,61	-27,19	-25,97
<b>CDI</b>	<b>0,73</b>	<b>0,73</b>	<b>2,10</b>	<b>3,47</b>	<b>5,00</b>	<b>7,66</b>	<b>13,90</b>

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	6,98	6,98	8,35	-7,93	-2,54	-1,42	15,14
INPC + 6,00%	1,16	1,16	3,78	8,75	17,24	31,05	44,93
IPCA + 6,00%	1,03	1,03	3,76	8,77	17,00	29,59	43,15

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		1,00
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+2 du	D+2 du		0,20
BB PREV RF IRF-M	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
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-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B 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 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0		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
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	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)		1,40
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,10
XP INVESTOR FI DE ACOES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	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	0,63	0,63	2,31	2,54	3,53	7,08	14,16	22,11	34,75
IRF-M 1+	-0,50	-0,50	4,01	-1,41	-4,13	1,40	15,16	29,50	49,44
IRF-M TOTAL	-0,08	-0,08	3,63	-0,03	-1,28	3,58	15,45	27,96	45,98
IMA-B 5	0,11	0,11	3,42	3,32	4,57	12,47	26,04	38,75	56,48
IMA-B 5+	-1,61	-1,61	2,45	-4,92	-6,47	-3,03	18,62	39,06	60,95
IMA-B TOTAL	-0,73	-0,73	2,94	-0,91	-1,15	4,02	22,86	40,20	60,52
IMA-GERAL TOTAL	0,21	0,21	2,90	1,13	1,42	5,98	17,98	30,01	46,61
IDKA 2	0,05	0,05	3,41	3,29	4,87	13,47	25,98	38,94	57,36
IDKA 20	-2,92	-2,92	0,64	-12,61	-14,59	-13,99	10,19	35,73	59,77
CDI	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90	21,17	32,56

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,98	6,98	8,35	-7,93	-2,54	-1,42	15,14	32,07	73,41
IBRX 100	6,87	6,87	8,36	-9,14	-2,11	-0,51	18,37	36,58	79,96
IBRX 50	7,65	7,65	9,69	-8,20	-0,93	1,71	16,71	32,14	74,76
SMALL CAP	3,42	3,42	4,89	-17,43	-10,25	-14,29	24,49	41,16	97,42
IFIX	-0,99	-0,99	3,78	-1,67	-3,56	-9,76	15,24	21,52	43,53
Índice Consumo - ICON			-5,43	-22,83	-23,46	-26,51	5,30	5,50	37,84
Índice Dividendos - IDIV	7,47	7,47	10,17	0,27	5,96	1,18	28,50	52,53	93,40



**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	0,54	0,54	2,24	5,63	10,38	15,41	20,25	24,79	28,35
INPC	0,67	0,67	2,26	5,61	10,60	16,72	21,74	26,09	28,45
IGPM	1,82	1,82	2,72	3,40	16,91	46,97	58,45	69,12	68,43
SELIC	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90	21,18	32,59

**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	-9,05	-9,05	-6,91	7,47	18,94	75,67	144,98	170,90	239,48
MSCI ACWI	-8,76	-8,76	-8,61	3,62	9,17	61,14	114,25	124,36	183,76
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%	0,87	0,87	3,26	7,73	14,79	24,77	35,22	45,90	55,99
IPCA + 5,00%	0,95	0,95	3,51	8,26	15,90	27,17	39,15	51,57	63,59
IPCA + 5,50%	0,99	0,99	3,64	8,51	16,45	28,37	41,14	54,46	67,50
IPCA + 5,89%	1,02	1,02	3,73	8,72	16,88	29,32	42,71	56,75	70,61
IPCA + 6,00%	1,03	1,03	3,76	8,77	17,00	29,59	43,15	57,40	71,49
INPC + 4,00%	1,00	1,00	3,28	7,71	15,02	26,18	36,90	47,41	56,11
INPC + 6,00%	1,16	1,16	3,78	8,75	17,24	31,05	44,93	59,03	71,61

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	03/01/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	912.542,34	215.877,26575900	4,2271350000
2	03/01/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	912.542,34	0,00	215.877,26438800	4,2271350000
3	10/01/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	179.151,47	0,00	42.302,43049800	4,2350160000
4	13/01/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8.899,78	0,00	2.099,13739800	4,2397320000
5	19/01/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	88.430,30	0,00	20.825,08798700	4,2463350000
6	25/01/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.249.000,00	0,00	763.922,00236400	4,2530520000
7	26/01/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	120.000,00	0,00	28.203,83191300	4,2547410000
8	27/01/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	40.000,00	9.398,04533600	4,2562050000
9	27/01/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.908.000,00	448.286,67792800	4,2562050000
10	28/01/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	15.000,00	3.522,96203200	4,2577810000
11	31/01/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	20.000,00	4.695,64410600	4,2592660000
12	31/01/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	47.500,00	0,00	11.152,15626300	4,2592660000
<b>Total</b>						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.353.161,80

Value-At-Risk: 2,44%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PORTO FERREIRA		2,44	2,44			178.297.728,24	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,21%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M		1,78	0,03	0,02			4.669.464,53	2,62
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,14	0,04	0,03			5.020.538,81	2,82
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,15	0,06	0,01			8.301.158,27	4,66
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,63	0,01	0,02			6.762.177,65	3,79
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,06	0,04	0,01			12.732.109,67	7,14
BB PREV RF IDKA2		1,36	0,03	0,38			8.335.028,75	4,67
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		3,67	0,05	0,12			3.922.299,02	2,20
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,07	0,01	0,01			1.655.643,87	0,93
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		3,61	0,08	0,08			7.282.518,54	4,08
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,60	0,04	0,26			8.358.434,43	4,69
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,11	0,03	1,75			7.114.899,24	3,99
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,74	0,06	0,76			30.734.830,55	17,24
<b>Sub-total</b>	2,24	1,33	0,48		-0,34	-0,03	104.889.103,33	58,83

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,04	0,00	0,02			9.103.348,26	5,11
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		2,19	0,10	0,07			14.113.439,01	7,92
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,05	0,00	0,03			5.484,75	0,00
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA		1,18	-0,00	2,47			4.456.404,58	2,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
<b>Sub-total</b>	2,36	1,13	0,10		-0,32	-0,03	27.678.676,60	15,52

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO		0,03	0,00	0,05			4.835.497,90	2,71
<b>Sub-total</b>	0,51	0,03	0,00		-1,73	-0,15	4.835.497,90	2,71

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I - SERIE B		0,00	0,00	0,04			63.038,89	0,04
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I		0,18	0,00	0,19			497.971,54	0,28
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC		0,08	-0,00	0,09			1.218.706,06	0,68
<b>Sub-total</b>	0,58	0,04	-0,00		-0,98	0,17	1.779.716,49	1,00

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,81%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES		10,55	0,13	2,08			2.505.896,72	1,41
BRADERCO F I A SELECTION		12,33	0,26	3,53			4.172.986,12	2,34
BRADERCO FIA DIVIDENDOS		9,69	0,18	3,84			3.738.061,36	2,10
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		15,27	0,11	4,09			1.391.273,56	0,78
XP INVESTOR FI DE ACOES		10,68	0,38	4,48			6.896.764,54	3,87
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		11,27	0,27	0,10			4.775.488,90	2,68
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		11,09	0,26	1,35			4.740.185,46	2,66
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI		10,69	0,24	2,50			4.447.715,95	2,49
<b>Sub-total</b>	18,52	10,81	1,84		0,30	6,30	32.668.372,61	18,32

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,20%

Artigo 10º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V		0,01	0,00	0,04			18.741,74	0,01
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		8,33	0,04	5,87			2.132.393,14	1,20
<b>Sub-total</b>	17,92	8,26	0,04		-0,33	-5,26	2.151.134,88	1,21

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA		0,07	0,00	0,11			316.615,71	0,18
<b>Sub-total</b>	1,09	0,07	0,00		-0,96	-0,32	316.615,71	0,18

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,02%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO		0,02	-0,00	3,11			2.315.265,85	1,30
<b>Sub-total</b>	1,63	0,02	-0,00		-0,37	0,13	2.315.265,85	1,30

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,01%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		9,01	-0,01	0,89			1.663.344,87	0,93
<b>Sub-total</b>	22,05	9,01	-0,01		-0,48	-9,75	1.663.344,87	0,93

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

-Referente ao mês de janeiro de 2022, vale observar que:

- O Instituto está com 7,32% do patrimônio líquido do fundo INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I - SERIE B, percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O Instituto está com 6,30% do patrimônio líquido do fundo INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I, percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;