# PAUTA ORDINÁRIA Nº 01

REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

**18/01/2023**

**1. Demonstrativos dos Fundos de Investimentos da CAPSECI – dezembro/2022**

1.1. *Relatório das Aplicações Financeiras com detalhamento por contas bancárias – Dez/2022*

1.2. *Posição de Ativos e Enquadramento da Carteira – Dez/2022*

**CAPSECI - CAIXA DE APOSENTAD E PENSÕES DOS SERV PÚBL DO MUNICÍPIO DE CIANORTE**
**RELATÓRIO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS POR CONTAS BANCÁRIAS DEZEMBRO/2022**

| Conta | Fundo de Investimento | Cód Fundo | Saldo (R$) | Rend Mês (R$) | Rend Ano (R$) |
|---|---|---|---|---|---|
| 384-4 / Fonte 040 (Aporte) | CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO | 15 | 6.854.200,74 | 77.906,37 | 532.281,81 |
| | CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP | 1 | 2.253.016,71 | 27.462,06 | 358.138,24 |
| | CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF | 2 | 340.541,40 | 3.886,93 | 153.745,37 |
| | CAIXA FI BRASIL IMA-B5 TP RF LP | 3 | 0,00 | 0,00 | 13.677,86 |
| | CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF | 5 | 0,03 | 0,30 | 9.813,82 |
| | CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA | 9 | 7.028.013,54 | 79.166,21 | 679.285,69 |
| **Total da conta** | | | **16.475.772,42** | **188.421,87** | **1.746.942,79** |
| 500009-6 / Fonte 100 (Tx adm) | CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO | 15 | 1,50 | 0,01 | 132,77 |
| | CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP | 1 | 111,65 | 1,36 | 16.681,02 |
| | CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF | 2 | 584.471,23 | 6.671,13 | 64.297,12 |
| | CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF | 5 | 489,59 | 4,00 | 169,28 |
| | CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA | 9 | 126.788,98 | 1.428,21 | 12.254,67 |
| **Total da conta** | | | **711.862,95** | **8.104,71** | **93.534,86** |
| 500033-9 / Fonte 040 (Repasses) | CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO | 15 | 12.218.106,65 | 138.874,37 | 927.883,88 |
| | CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP | 1 | 244.112,26 | 2.975,49 | 71.626,14 |
| | CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF | 2 | 652.762,69 | 7.450,61 | 68.576,04 |
| | CAIXA FI BRASIL IMA-B5 TP RF LP | 3 | 0,00 | 0,00 | 452.597,11 |
| | CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B RF LP | 13 | 0,00 | 0,00 | 13.531,96 |
| | CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF | 5 | 633,48 | 29,54 | 58.937,60 |
| | CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA | 9 | 13.578.147,69 | 152.949,38 | 1.332.387,28 |
| | CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIM | 30 | 2.888.186,12 | 31.363,13 | 285.009,10 |
| **Total da conta** | | | **29.581.948,89** | **333.642,52** | **3.210.549,11** |
| 500051-7 / Fonte 551 (Compensação) | CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO | 15 | 5.363.877,58 | 60.965,40 | 135.486,43 |
| | CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP | 1 | 2.331.658,86 | 28.420,67 | 619.729,17 |
| | CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF | 2 | 478.480,11 | 5.461,35 | 50.266,77 |
| | CAIXA FI BRASIL IMA-B5 TP RF LP | 3 | 0,00 | 0,00 | 389.329,24 |
| | CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF | 5 | 0,11 | 1,64 | 2.296,93 |
| | CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA | 9 | 494.434,81 | 5.569,51 | 47.789,12 |
| **Total da conta** | | | **8.668.451,47** | **100.418,57** | **1.244.897,66** |
| **317-8 - F 094** | CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF | 5 | 0,00 | 0,75 | 7.016,99 |
| 40674-0 / Fonte 551 (Compensação) | BB PREVID TP IPCA | 12 | 5.050.316,90 | 47.772,65 | 197.260,46 |
| | BB PREVID RF IDKA 2 | 7 | 0,00 | 0,00 | 147.572,31 |
| | BB PREVID RF FLUXO | 17 | 390.274,29 | 1.594,96 | 26.085,24 |
| | BB PREVID RF PERFIL | 16 | 6.706.325,16 | 74.437,10 | 385.237,30 |
| | BB PREVID IPCA III | 20 | 3.504.184,44 | 35.473,47 | 300.689,49 |
| | BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA VII | 6 | 0,00 | 0,00 | 24.412,57 |
| | BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC | 24 | 2.515.523,44 | -70.195,74 | 88.636,71 |
| | BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID | 25 | 3.348.682,99 | -85.007,53 | -120.386,79 |
| **Total da conta** | | | **21.515.307,22** | **4.074,91** | **1.049.507,29** |
| 59325-7 / Fonte 040 (Repasses) | BB PREVID IMA-B 5 | 4 | 0,00 | 0,00 | 410.114,60 |
| | BB IMA-B TÍT PÚBLICOS FI RF PREVID | 8 | 0,00 | 0,00 | 139.518,29 |
| | BB PREVID TP IPCA | 12 | 2.083.397,32 | 19.707,56 | 203.236,20 |
| | BB PREVID RF IDKA 2 | 7 | 0,00 | 0,00 | -15.245,11 |
| | BB PREVID RF FLUXO | 17 | 0,00 | 14.802,55 | 61.754,64 |
| | BB PREVID RF PERFIL | 16 | 11.378.179,93 | 132.948,78 | 644.255,33 |
| | BB PREVID RF TP XXI FI | 11 | 2.052.754,05 | 26.727,50 | 167.103,86 |
| | BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC | 24 | 1.057.758,43 | -29.516,78 | 37.271,06 |
| **Total da conta** | | | **16.572.089,73** | **164.669,61** | **1.648.008,87** |
| **63296-1 - F 094** | BB PREVID RF FLUXO | 17 | 0,00 | 0,00 | 102,65 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **64921-X / Fonte 100 (Tx adm)** | BB PREVID RF IDKA 2 | **7** | 0,00 | 0,00 | 1.935,46 |
| | BB PREVID RF FLUXO | **17** | 6.892,13 | 445,76 | 5.446,75 |
| | BB PREVID RF PERFIL | **16** | 1.022.759,31 | 11.803,92 | 79.729,28 |
| **Total da conta** | | | **1.029.651,44** | **12.249,68** | **87.111,49** |
| **64998-8 - F 501** | BB PREVID RF PERFIL | **16** | 0,00 | 0,00 | 1.450,74 |
| **67657-8 / Fonte 100 (Tx adm)** | BB PREVID RF FLUXO | **17** | 0,00 | 0,00 | 237,61 |
| | BB PREVID RF PERFIL | **16** | 0,00 | 0,00 | 1.819,47 |
| **Total da conta** | | | **0,00** | **0,00** | **2.057,08** |
| **68200-4 / Fonte 040 (Aporte)** | BB PREVID RF FLUXO | **17** | 0,00 | 778,07 | 1.575,41 |
| | BB PREVID RF PERFIL | **16** | 6.885.522,66 | 63.702,45 | 127.661,69 |
| **Total da conta** | | | **6.885.522,66** | **64.480,52** | **129.237,10** |
| **23192-0 / Fonte 040 (Repasses)** | BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES | **21** | 1.267.999,12 | -40.074,62 | -62.175,64 |
| | LA SHOPPING CENTERS MULTIESTR FIP | **31** | 641.072,54 | -889,51 | 24.697,86 |
| **Total da conta** | | | **1.909.071,66** | **-40.964,13** | **-37.477,78** |
| **28418-1 / Fonte 040 (Aporte)** | ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX | **23** | 996.297,08 | -48.463,14 | -102.885,25 |
| | ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC | **26** | 1.032.519,72 | 18.245,44 | 50.693,53 |
| | ITAÚ MOMENTO 30 II | **28** | 1.499.164,87 | -75.628,63 | -132.075,53 |
| | ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FII | **10** | 11.080.184,29 | -41.124,93 | 804.490,54 |
| **Total da conta** | | | **14.608.165,96** | **-146.971,26** | **620.223,29** |
| **61272-0 / Fonte 040 (Repasses)** | ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI | **19** | 12.442.326,33 | 93.426,01 | 107.326,33 |
| | ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA | **18** | 1.637.012,91 | -4.043,50 | 77.025,07 |
| | ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FII | **10** | 703.200,97 | -2.609,99 | 51.056,78 |
| **Total da conta** | | | **14.782.540,21** | **86.772,52** | **235.408,18** |
| **61535-1 / Fonte 040 (Repasses)** | SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M1 LP | **14** | 1.956.897,65 | 23.101,56 | 212.409,69 |
| | SCHRODERS IBOVESPA FIA | **29** | 1.130.936,99 | -24.866,49 | 109.008,77 |
| **Total da conta** | | | **3.087.834,64** | **-1.764,93** | **321.418,46** |
| **471492-0 F 040** | BRADESCO FIA SELECTION | **27** | 855.462,51 | -22.651,92 | 57.191,55 |
| **BEM - F 040** | SOMA BRASIL FIA | **22** | 2.501.127,40 | -53.055,97 | 2.588,62 |
| **40810-7 - F 551** | GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII | **32** | 573.946,14 | -81.410,80 | 10.177,26 |
| | **Total em aplicações financeiras** | | **139.758.755,30** | **616.016,65** | **10.429.946,21** |
| | Renda Fixa | | 119.450.077,95 | 1.098.169,21 | 10.182.194,96 |
| | Renda Variável | | 20.308.677,35 | -482.152,56 | 247.751,25 |

| Seguimento | Classificação | Tipo de Ativo / Fundo de Investimento | CNPJ DO FUNDO | VALOR R$ | % Aplicado | Limites da Política de Investimentos | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | | Limite Res CMN | Limite Inferior | Estratégia Alvo | Limite Superior |
| RENDA FIXA - Art. 7º | Art. 7º, I, "a" | **Títulos Públicos** | | | | 100,00% | 0,00% | 15,00% | 100,00% |
| | **Art. 7º, I, "b"** | **Fundos 100% Títulos Públicos** | | **49.083.516,67** | **35,12%** | **100,00%** | **0,00%** | **40,00%** | **100,00%** |
| | | **1** CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP | 14.386.926/0001-71 | 4.828.899,48 | 3,46% | | | | |
| | | **2** CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF | 10.740.670/0001-06 | 2.056.255,43 | 1,47% | | | | |
| | | **3** CAIXA FI BRASIL IMA-B5 TP RF LP | 11.060.913/0001-10 | 0,00 | 0,00% | | | | |
| | | **4** BB PREVID IMA-B 5 | 03.543.447/0001-03 | 0,00 | 0,00% | | | | |
| | | **5** CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF | 14.508.643/0001-55 | 1.123,21 | 0,00% | | | | |
| | | **6** BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA VII | 19.523.305/0001-06 | 0,00 | 0,00% | | | | |
| | | **7** BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI | 13.322.205/0001-35 | 0,00 | 0,00% | | | | |
| | | **8** BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RF PREVID | 07.442.078/0001-05 | 0,00 | 0,00% | | | | |
| | | **9** CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 23.215.097/0001-55 | 21.227.385,02 | 15,19% | | | | |
| | | **10** ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FI I | 21.838.150/0001-49 | 11.783.385,26 | 8,43% | | | | |
| | | **11** BB PREVID RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI | 44.345.590/0001-60 | 2.052.754,05 | 1,47% | | | | |
| | | **12** BB PREVID RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI | 15.486.093/0001-83 | 7.133.714,22 | 5,10% | | | | |
| | Art. 7º, I, "c" | **Fundos de Índice 100% Títulos Públicos** | | | | 100,00% | 0,00% | 0,00% | 100,00% |
| | Art. 7º, II | **Operações Compromissadas** | | | | 5,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| | **Art. 7º, III, "a"** | **Fundos Renda Fixa** | | **66.862.376,84** | **47,84%** | **60,00%** | **0,00%** | **16,00%** | **60,00%** |
| | | **13** CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B RF LP | 10.646.895/0001-90 | 0,00 | 0,00% | | | | |
| | | **14** SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M 1 LP | 19.196.599/0001-09 | 1.956.897,65 | 1,40% | | | | |
| | | **15** CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO | 03.737.206/0001-97 | 24.436.186,47 | 17,48% | | | | |
| | | **16** BB PREVID RF PERFIL | 13.077.418/0001-49 | 25.992.787,06 | 18,60% | | | | |
| | | **17** BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI | 13.077.415/0001-05 | 397.166,42 | 0,28% | | | | |
| | | **18** ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA | 05.073.656/0001-58 | 1.637.012,91 | 1,17% | | | | |
| | | **19** ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI | 00.832.435/0001-00 | 12.442.326,33 | 8,90% | | | | |
| | Art. 7º, III, "b" | **Fundos de Índice Renda Fixa** | | | | 60,00% | 0,00% | 0,00% | 60,00% |
| | Art. 7º, IV | **Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)** | | | | 20,00% | 0,00% | 0,00% | 20,00% |
| | Art. 7º, V, "a" | **Cota Sênior de FIDC** | | | | 5,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| | **Art. 7º, V, "b"** | **Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"** | | **3.504.184,44** | **2,51%** | **5,00%** | **0,00%** | **3,00%** | **5,00%** |
| | | **20** BB PREVID RF CP IPCA III FI | 14.091.645/0001-91 | 3.504.184,44 | 2,51% | | | | |
| | Art. 7º, V, "c" | **Fundo de Debêntures Incentivadas** | | | | 5,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| **SUBTOTAL RENDA FIXA** | | | | **119.450.077,95** | **85,47%** | **460,00%** | **0,00%** | **74,00%** | **460,00%** |
| FUNDOS DE AÇÕES - Art. 8º | **Art. 8º, I** | **Fundos de Ações** | | **16.205.472,55** | **11,60%** | **30,00%** | **0,00%** | **15,00%** | **30,00%** |
| | | **21** BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES | 11.977.794/0001-64 | 1.267.999,12 | 0,91% | | | | |
| | | **22** SOMMA BRASIL FIA | 14.550.994/0001-24 | 2.501.127,40 | 1,79% | | | | |
| | | **23** ITAÚ INST AÇÕES PHOENIX FIC DE FI | 23.731.629/0001-07 | 996.297,08 | 0,71% | | | | |
| | | **24** BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FIC DE FI | 18.270.783/0001-99 | 3.573.281,87 | 2,56% | | | | |
| | | **25** BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID | 29.258.294/0001-38 | 3.348.682,99 | 2,40% | | | | |
| | | **26** ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI | 24.571.992/0001-75 | 1.032.519,72 | 0,74% | | | | |
| | | **27** BRADESCO SELECTION FI AÇÕES | 03.660.879/0001-96 | 855.462,51 | 0,61% | | | | |
| | | **28** ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES | 42.318.981/0001-60 | 1.499.164,87 | 1,07% | | | | |
| | | **29** SCHRODERS IBOVESPA FIA | 06.051.151/0001-55 | 1.130.936,99 | 0,81% | | | | |
| | Art. 8º, II | **FI em Índices de Ações** | | | | 30,00% | 0,00% | 0,00% | 30,00% |
| EXTERIOR - Art. 9º | Art. 9º, I | **Renda Fixa - Dívida Externa** | | | | 10,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% |
| | Art. 9º, II | **Fundos de Investimento no Exterior** | | | | 10,00% | 0,00% | 2,00% | 10,00% |
| | Art. 9º, III | **Ações - BDR Nível I** | | | | 10,00% | 0,00% | 2,00% | 10,00% |
| ESTRUTURADOS - Art. 10º | **Art. 10º, I** | **Fundos Multimercados** | | **2.888.186,12** | **2,07%** | **10,00%** | **0,00%** | **5,00%** | **10,00%** |
| | | **30** CAIXA ALOC MACRO FIC MULTIMERCADO LP | 08.070.841/0001-87 | 2.888.186,12 | 2,07% | | | | |
| | **Art. 10º, II** | **Fundo de Participação** | | **641.072,54** | **0,46%** | **5,00%** | **0,00%** | **1,00%** | **5,00%** |
| | | **31** LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRAT FIP | 16.685.929/0001-31 | 641.072,54 | 0,46% | | | | |
| | Art. 10º, III | **Fundos de Ações - Mercado de Acesso** | | | | 5,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| IMOBILIÁRIOS - Art. 11º | **Art. 11º** | **Fundo de Investimento Imobiliário** | | **573.946,14** | **0,41%** | **5,00%** | **0,00%** | **1,00%** | **5,00%** |
| | | **32** GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII | 13.584.584/0001-31 | 573.946,14 | 0,41% | | | | |
| CONS - Art. 12º | Art. 12º | **Empréstimo Consign - Sem Pró Gestão** | | | | 5,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| **SUBTOTAL RENDA VARIÁVEL** | | | | **20.308.677,35** | **14,53%** | **120,00%** | **0,00%** | **26,00%** | **120,00%** |
| **TOTAL EM INVESTIMENTOS FINANCEIROS** | | | | **139.758.755,30** | **100,00%** | **580,00%** | **0,00%** | **100,00%** | **580,00%** |
| DISP FINANC | | **Disponibilidades Financeiras** | | 21.988,22 | | | | | |
| IMÓVEIS VINCULADOS AO RPPS | | **Terreno** | | 11.351.500,00 | | | | | |
| | | **Prédio Comercial** | | 1.070.000,00 | | | | | |
| | | **Apartamento** | | 360.000,00 | | | | | |
| **SUBTOTAL** | | | | **12.803.488,22** | | | | | |
| **TOTAL GERAL** | | | | **152.562.243,52** | | | | | |

LDB
EMPRESAS

# CIANORTE

DEZEMBRO 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 30.12.2022.

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** **85,47%**

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,48 | 0,05 | 1,15 | 11,74 | 2.056.255,43 | 1,47 | 6.557.713.378,25 | 0,03 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,92 | 0,04 | 1,23 | 9,04 | 4.828.899,48 | 3,46 | 6.893.208.496,34 | 0,07 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | 0,08 | 0,04 | 0,96 | 10,58 | 1.123,21 | 0,00 | 918.894.770,10 | 0,00 |
| BB | BB | BB PREV RF IPCA | 1,93 | 0,04 | 0,95 | 10,31 | 7.133.714,22 | 5,10 | 3.745.902.538,43 | 0,19 |
| ITAU | ITAU | ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 3,08 | 0,05 | -0,37 | 7,83 | 11.783.385,26 | 8,43 | 2.189.575.950,42 | 0,54 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 1,78 | 0,05 | 1,14 | 10,70 | 21.227.385,02 | 15,19 | 5.292.657.963,96 | 0,40 |
| BB | BB | BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI | 2,92 | 0,04 | 1,32 | 8,66 | 2.052.754,05 | 1,47 | 2.756.777.028,75 | 0,07 |
| | | **Sub-total Artigo 7º I, Alínea b** | **2,12** | **0,05** | **0,76** | **9,29** | **49.083.516,67** | **35,12** | | |

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| ITAU | ITAU | ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO | 5,91 | 0,04 | -0,25 | 4,94 | 1.637.012,91 | 1,17 | 397.808.834,02 | 0,41 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,10 | 0,05 | 1,15 | 12,67 | 24.436.186,47 | 17,48 | 13.943.633.561,86 | 0,18 |
| ITAU | ITAU | ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | 0,13 | 0,05 | 1,13 | 1,39 | 12.442.326,33 | 8,90 | 3.683.074.422,00 | 0,34 |
| BB | BB | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,09 | 0,05 | 1,12 | 12,59 | 25.992.787,06 | 18,60 | 12.858.761.791,29 | 0,20 |
| BB | BB | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,08 | 0,05 | 1,03 | 11,26 | 397.166,42 | 0,28 | 3.841.990.026,28 | 0,01 |
| SICREDI | SICREDI | SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO | 0,41 | 0,05 | 1,19 | 12,18 | 1.956.897,65 | 1,40 | 427.440.479,04 | 0,46 |
| | | **Sub-total Artigo 7º III, Alínea a** | **0,51** | **0,05** | **1,09** | **11,94** | **66.862.376,84** | **47,84** | | |

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

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| BB | BB | BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI | 2,82 | 0,04 | 1,02 | 9,39 | 3.504.184,44 | 2,51 | 458.250.946,61 | 0,76 |
| | | **Sub-total Artigo 7º V, Alínea b** | **2,82** | **0,04** | **1,02** | **9,39** | **3.504.184,44** | **2,51** | | |
| | | **Renda Fixa** | **1,62** | **0,05** | **0,95** | **10,22** | **119.450.077,95** | **85,47** | | |

# EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL 11,60%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| BTG PACTUAL | BTG PACTUAL | BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | 23,56 | -0,00 | -3,06 | -4,67 | 1.267.999,12 | 0,91 | 1.373.628.350,10 | 0,09 |
| SOMMA | BEM | SOMMA BRASIL FIA | 20,86 | -0,01 | -2,08 | 0,10 | 2.501.127,40 | 1,79 | 343.144.362,04 | 0,73 |
| BB | BB | BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA | 20,34 | -0,00 | -2,71 | 3,65 | 3.573.281,87 | 2,56 | 384.478.473,26 | 0,93 |
| ITAU | ITAU | ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 20,59 | -0,01 | 1,80 | 5,16 | 1.032.519,72 | 0,74 | 1.879.797.625,43 | 0,05 |
| ITAU | ITAU | ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI | 23,34 | -0,00 | -4,64 | -9,36 | 996.297,08 | 0,71 | 389.197.038,05 | 0,26 |
| BB | BB | BB AÇÕES VALOR FIC FIA | 20,42 | 0,01 | -2,48 | -3,47 | 3.348.682,99 | 2,40 | 987.099.652,68 | 0,34 |
| BRAM | BEM | BRADESCO F I A SELECTION | 21,43 | -0,00 | -2,58 | 7,16 | 855.462,51 | 0,61 | 465.783.812,97 | 0,18 |
| ITAU | ITAU | ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI | 23,35 | -0,00 | -4,80 | -8,10 | 1.499.164,87 | 1,07 | 227.381.609,67 | 0,66 |
| SCHRODER | SICREDI | SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA | 20,57 | -0,00 | -2,15 | 10,67 | 1.130.936,99 | 0,81 | 253.971.092,12 | 0,45 |
| | | **Sub-total Artigo 8º I** | **20,29** | **-0,00** | **-2,59** | **-0,44** | **16.205.472,55** | **11,60** | | |
| | | **Renda Variável** | **20,29** | **-0,00** | **-2,59** | **-0,44** | **16.205.472,55** | **11,60** | | |

# EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 2,53%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP | 4,00 | 0,04 | 1,10 | 10,95 | 2.888.186,12 | 2,07 | 1.966.376.241,03 | 0,15 |
| | | **Sub-total Artigo 10º I** | **4,00** | **0,04** | **1,10** | **10,95** | **2.888.186,12** | **2,07** | | |

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| LEGATUS | BTG PACTUAL | FIP LA SHOPPING CENTERS | 3,69 | -0,14 | -0,14 | 4,01 | 641.072,54 | 0,46 | 155.004.456,26 | 0,41 |
| | | **Sub-total Artigo 10º II** | **3,69** | **-0,14** | **-0,14** | **4,01** | **641.072,54** | **0,46** | | |
| | | **Investimentos Estruturados** | **3,39** | **0,01** | **0,87** | **9,62** | **3.529.258,66** | **2,53** | | |

# EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## FUNDOS IMOBILIÁRIOS 0,41%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| PLANNER | PLANNER | CARE11 | 54,63 | 0,00 | -12,42 | 1,81 | 573.946,14 | 0,41 | 0,00 | |
| | | **Sub-total Artigo 11º** | **54,63** | **0,00** | **-12,42** | **1,81** | **573.946,14** | **0,41** | | |
| | | **Fundos Imobiliários** | **54,63** | **0,00** | **-12,42** | **1,81** | **573.946,14** | **0,41** | | |
| | | **Total** | **3,60** | **0,04** | **0,43** | **8,71** | **139.758.755,30** | **100,00** | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Enquadramento da Carteira

| | | | | Política de Investimentos | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **Artigo** | **Tipo de Ativo** | **Valor(R$)** | **% Carteira** | **Mínimo** | **Objetivo** | **Máximo** | **ALM** | **Limite Legal** |
| **Renda Fixa** | | | | | | | | |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 49.083.516,67 | 35,12 | 0,00 | 55,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º III, Alínea a | Fundos Renda Fixa | 66.862.376,84 | 47,84 | 0,00 | 16,00 | 60,00 | 0,00 | 60,00 |
| Artigo 7º V, Alínea b | FI RF - Crédito Privado | 3.504.184,44 | 2,51 | 0,00 | 3,00 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | **Total Renda Fixa** | **119.450.077,95** | **85,47** | | | | | 100,00 |
| **Renda Variável** | | | | | | | | |
| Artigo 8º I | Fundos de Ações | 16.205.472,55 | 11,60 | 0,00 | 15,00 | 30,00 | 0,00 | 30,00 |
| | **Total Renda Variável** | **16.205.472,55** | **11,60** | | | | | 30,00 |
| **Investimentos Estruturados** | | | | | | | | |
| Artigo 10º I | Fundos Multimercados | 2.888.186,12 | 2,07 | 0,00 | 5,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 10º II | Fundo de Participação | 641.072,54 | 0,46 | 0,00 | 1,00 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | **Total Investimentos Estruturados** | **3.529.258,66** | **2,53** | | | | | 15,00 |
| **Fundos Imobiliários** | | | | | | | | |
| Artigo 11º | Fundo de Investimento Imobiliário | 573.946,14 | 0,41 | 0,00 | 1,00 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | **Total Fundos Imobiliários** | **573.946,14** | **0,41** | | | | | 5,00 |
| **Total** | | **139.758.755,30** | **100,00** | | | | | |

## Rentabilidades por Artigo

| Estratégia<br>Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R$) | No Ano(R$) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Artigo 7º I, Alínea b<br>% do CDI | 0,76<br>67,97 | 9,29<br>75,05 | 1,81<br>56,53 | 3,48<br>52,60 | 9,29<br>75,05 | 371.951,93 | 6.540.071,42 |
| Artigo 7º III, Alínea a<br>% do CDI | 1,09<br>97,43 | 11,94<br>96,51 | 3,08<br>96,20 | 6,27<br>94,81 | 11,94<br>96,51 | 690.743,81 | 3.341.434,05 |
| Artigo 7º V, Alínea b<br>% do CDI | 1,02<br>91,04 | 9,39<br>75,86 | 2,50<br>78,24 | 2,84<br>42,96 | 9,39<br>75,86 | 35.473,47 | 300.689,49 |
| Artigo 8º I<br>Var. IBOVESPA p.p. | -2,59<br>-0,15 | -0,44<br>-5,13 | -3,02<br>-2,74 | 7,84<br>-3,52 | -0,44<br>-5,13 | -431.215,39 | -72.132,97 |
| Artigo 10º I<br>% do CDI | 1,10<br>97,73 | 10,95<br>88,49 | 1,68<br>52,63 | 6,67<br>100,78 | 10,95<br>88,49 | 31.363,13 | 285.009,10 |
| Artigo 10º II<br>% do CDI | -0,14<br>-12,34 | 4,01<br>32,38 | -0,27<br>-8,47 | 2,08<br>31,42 | 4,01<br>32,38 | -889,51 | 24.697,86 |
| Artigo 11º<br>% do CDI | -12,42<br>-1.105,87 | 1,81<br>14,59 | -29,32<br>-916,89 | -32,21<br>-487,00 | 1,81<br>14,59 | -81.410,80 | 10.176,35 |
| **CIANORTE (Total)** | | | | | | **616.016,64** | **10.429.945,30** |

**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 IPCA | 7.066.234,01 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 7.133.714,22 | 67.480,21 | 400.496,66 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI | 2.026.026,55 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.052.754,05 | 26.727,50 | 167.103,86 |
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | 1.458,64 | 54.659,12 | -55.030,78 | 0,00 | 1.123,21 | 36,23 | 78.234,62 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 4.770.039,90 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.828.899,48 | 58.859,58 | 1.066.174,57 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 2.032.785,41 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.056.255,43 | 23.470,02 | 336.885,30 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 20.988.271,71 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 21.227.385,02 | 239.113,31 | 2.071.716,76 |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 11.827.120,18 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 11.783.385,26 | -43.734,92 | 855.547,32 |
| | | | | | 49.083.516,67 | 0,00 | 0,00 |

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

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R$) | Resultado Financ. Ano (R$) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BB PREV RF FLUXO FIC | 53.389,57 | 9.640.619,48 | -9.314.463,97 | 0,00 | 397.166,42 | 17.621,34 | 95.202,30 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 26.005.429,32 | 4.244.465,49 | -4.540.000,00 | 0,00 | 25.992.787,06 | 282.892,25 | 1.240.153,81 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 24.158.159,71 | 280,61 | 0,00 | 0,00 | 24.436.186,47 | 277.746,15 | 1.595.784,89 |
| ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | 6.348.900,32 | 6.000.000,00 | 0,00 | 0,00 | 12.442.326,33 | 93.426,01 | 107.326,33 |
| ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO | 1.641.056,41 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.637.012,91 | -4.043,50 | 77.025,07 |
| SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO | 1.933.796,09 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.956.897,65 | 23.101,56 | 212.409,69 |
| | | | | | 66.862.376,84 | 0,00 | 0,00 |

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R$) | Resultado Financ. Ano (R$) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI | 3.468.710,97 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.504.184,44 | 35.473,47 | 300.689,49 |
| | | | | | 3.504.184,44 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R$) | Resultado Financ. Ano (R$) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA | 3.672.994,39 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.573.281,87 | -99.712,52 | 125.907,77 |
| BB AÇÕES VALOR FIC FIA | 3.433.690,52 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.348.682,99 | -85.007,53 | -120.386,79 |
| BRADESCO F I A SELECTION | 878.114,43 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 855.462,51 | -22.651,92 | 57.191,55 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | 1.308.073,74 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.267.999,12 | -40.074,62 | -62.175,64 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 1.014.274,28 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.032.519,72 | 18.245,44 | 50.693,53 |
| ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI | 1.044.760,23 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 996.297,08 | -48.463,15 | -102.885,25 |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI | 1.574.793,50 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.499.164,87 | -75.628,63 | -132.075,53 |
| SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA | 1.155.803,48 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.130.936,99 | -24.866,49 | 109.008,77 |
| SOMMA BRASIL FIA | 2.554.183,37 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.501.127,40 | -53.055,97 | 2.588,62 |
| | | | | | 16.205.472,55 | 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 ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP | 2.856.822,99 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.888.186,12 | 31.363,13 | 285.009,10 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R$) | Resultado Financ. Ano (R$) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 2.888.186,12 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R$) | Resultado Financ. Ano (R$) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FIP LA SHOPPING CENTERS | 641.962,05 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 641.072,54 | -889,51 | 24.697,86 |
| | | | | | 641.072,54 | 0,00 | 0,00 |

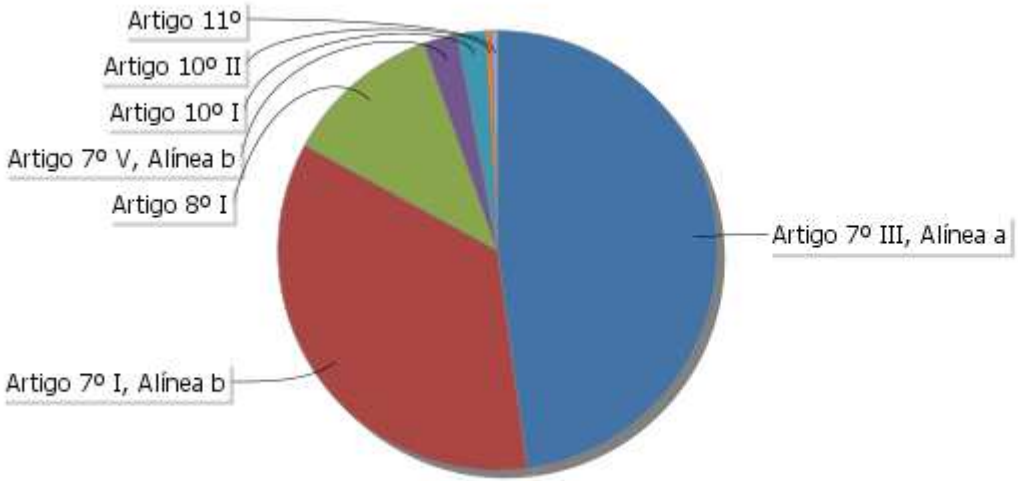
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Proventos | Saldo | Resultado Financ. Mês (R$) | Resultado Financ. Ano (R$) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CARE11 | 655.356,94 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 573.946,14 | -81.410,80 | 10.176,35 |
| | | | | | | 573.946,14 | 0,00 | 0,00 |

## Análise de Liquidez

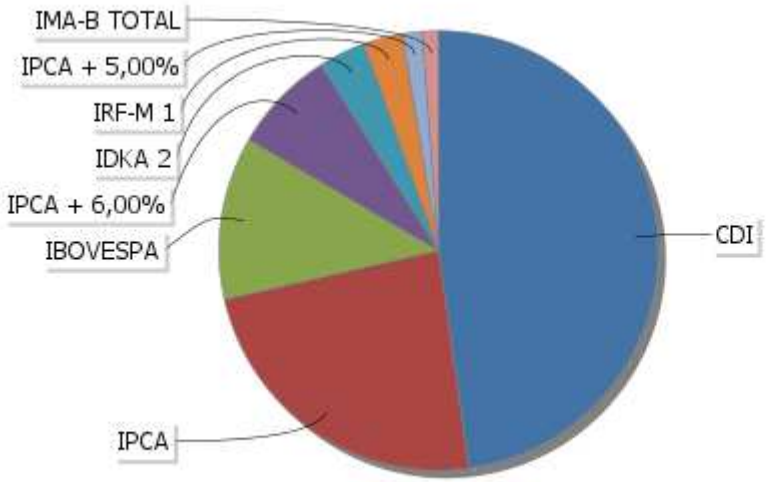
| Período | Valor (R$) | (%) | Valor Acumulado (R$) | (%) Acum. |
|---|---|---|---|---|
| de 0 a 30 dias | 118.282.366,27 | 84,63 | 118.282.366,27 | 84,63 |
| de 31 a 365 dias | 15.278.378,00 | 10,93 | 133.560.744,27 | 95,57 |
| acima de 365 dias | 6.198.011,03 | 4,43 | 139.758.755,30 | 100,00 |

## Alocação por Artigo




- Artigo 7º III, Alínea a: 47.84%
- Artigo 7º I, Alínea b: 35.12%
- Artigo 8º I: 11.60%
- Artigo 7º V, Alínea b: 2.51%
- Artigo 10º I: 2.07%
- Artigo 10º II: 0.46%
- Artigo 11º: 0.41%

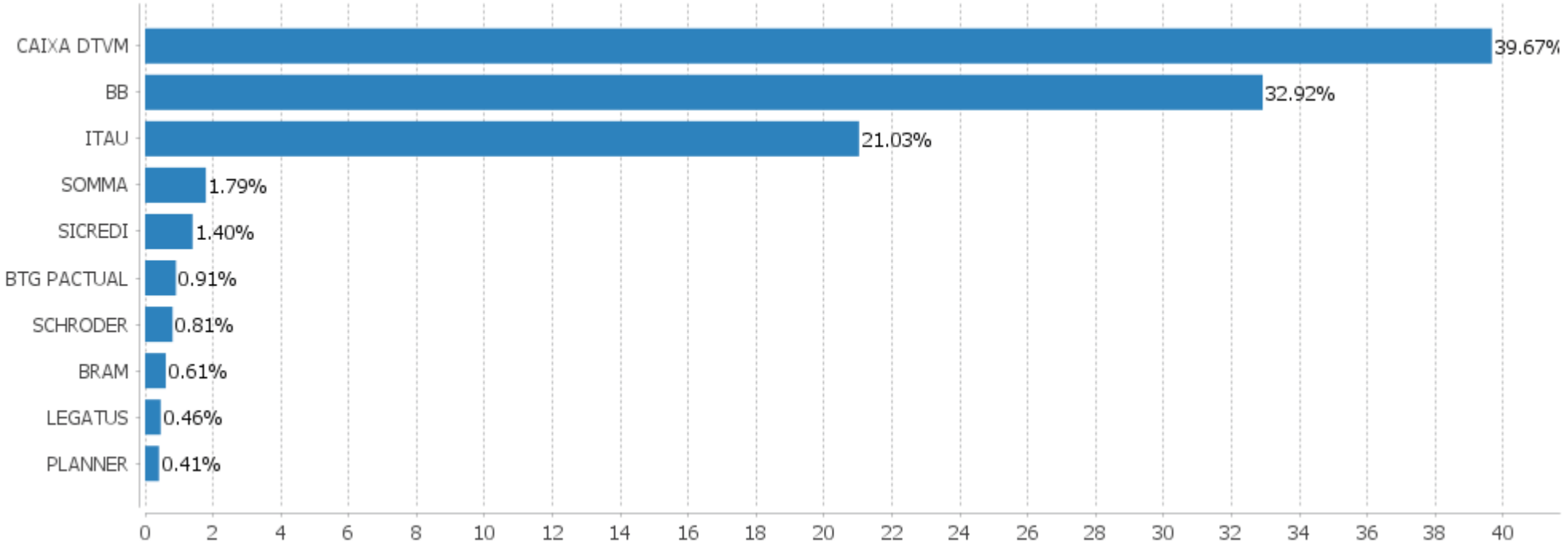
## Alocação Por Estratégia




- CDI: 47.80%
- IPCA: 23.62%
- IBOVESPA: 12.01%
- IPCA + 6,00%: 7.61%
- IDKA 2: 3.46%
- IRF-M 1: 2.87%
- IPCA + 5,00%: 1.47%
- IMA-B TOTAL: 1.17%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Alocação por Gestor**



## Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

| Ano | Jan | Fev | Mar | Abr | Mai | Jun | Jul | Ago | Set | Out | Nov | Dez | Rent. Ano |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 2022 | 0,97 | 0,86 | 2,43 | -0,37 | 1,27 | -1,31 | 1,01 | 1,35 | 0,67 | 1,73 | -0,59 | 0,43 | 8,71 |
| IPCA + 5,04% | 0,95 | 1,39 | 2,06 | 1,44 | 0,90 | 1,08 | -0,27 | 0,09 | 0,12 | 0,98 | 0,80 | 1,05 | 11,10 |
| p.p. indexador | 0,02 | -0,53 | 0,38 | -1,81 | 0,37 | -2,40 | 1,28 | 1,26 | 0,55 | 0,74 | -1,39 | -0,62 | -2,38 |
| 2021 | -0,54 | -0,98 | 0,78 | 1,26 | 1,38 | 0,14 | -0,81 | -0,76 | -0,58 | -2,10 | -0,35 | 1,10 | -1,51 |
| IPCA + 5,40% | 0,67 | 1,24 | 1,42 | 0,73 | 1,27 | 0,97 | 1,42 | 1,33 | 1,60 | 1,67 | 1,37 | 1,21 | 15,98 |
| p.p. indexador | -1,21 | -2,22 | -0,63 | 0,53 | 0,11 | -0,84 | -2,23 | -2,09 | -2,19 | -3,77 | -1,72 | -0,11 | -17,49 |

Performance Sobre a Meta Atuarial

| | Quantidade | Perc. (%) |
|---|---|---|
| Meses acima - Meta Atuarial | 9 | 37,50 |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 15 | 62,50 |

| | Rentabilidade | Mês |
|---|---|---|
| Maior rentabilidade da Carteira | 2,43 | 2022-03 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -2,10 | 2021-10 |

Relatório

| Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---|---|---|---|---|
| 03 meses | 1,56 | 2,87 | -1,30 | 4,22 |
| 06 meses | 4,66 | 2,80 | 1,86 | 3,92 |
| 12 meses | 8,71 | 11,10 | -2,38 | 3,60 |
| 24 meses | 7,07 | 28,85 | -21,78 | 4,09 |
| Desde 31/12/2020 | 7,07 | 28,85 | -21,78 | 4,09 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução

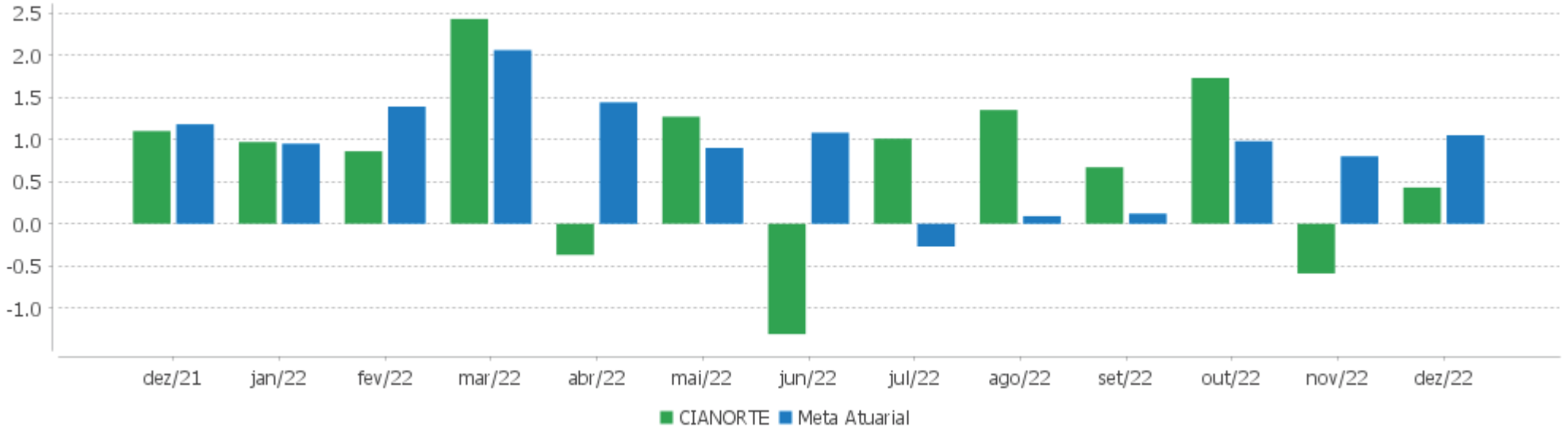



### Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses**



## Performance dos Fundos

| Fundo<br>Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI<br>Var. IPCA + 6,00% p.p. | 1,02<br>-0,11 | 9,39<br>-2,72 | 2,50<br>-0,59 | 2,84<br>-0,43 | 9,39<br>-2,72 | 13,84<br>-16,91 | 22,91<br>-21,93 |
| BB PREV RF IPCA<br>Var. IPCA + 6,00% p.p. | 0,95<br>-0,18 | 11,41<br>-0,70 | 3,98<br>0,88 | 4,00<br>0,73 | 11,41<br>-0,70 | 16,36<br>-14,40 | 26,43<br>-18,41 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF<br>Var. IPCA p.p. | 1,14<br>0,52 | 10,70<br>4,91 | 2,23<br>0,60 | 5,84<br>5,56 | 10,70<br>4,91 | 10,58<br>-5,85 | 17,95<br>-3,74 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IDKA 2 p.p. | 1,23<br>-0,01 | 9,04<br>-0,30 | 2,36<br>0,11 | 2,47<br>0,13 | 9,04<br>-0,30 | 14,12<br>-0,66 | 23,29<br>-1,38 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IRF-M 1 p.p. | 1,15<br>-0,02 | 11,74<br>-0,28 | 3,09<br>-0,06 | 6,56<br>-0,13 | 11,74<br>-0,28 | 14,76<br>-0,54 | 18,92<br>-0,80 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI<br>Var. IPCA + 5,00% p.p. | 1,32<br>0,27 | 8,60<br>-1,66 | 2,71<br>-0,15 | 2,69<br>-0,09 | | | |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI<br>Var. IPCA p.p. | -0,37<br>-0,99 | 7,83<br>2,04 | -0,53<br>-2,16 | 2,43<br>2,14 | 7,83<br>2,04 | 12,71<br>-3,72 | 15,94<br>-5,75 |
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF<br>% do CDI | 0,96<br>85,76 | 10,58<br>85,49 | 2,76<br>86,23 | 5,72<br>86,52 | 10,58<br>85,49 | 14,21<br>82,10 | 16,39<br>79,70 |
| ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI<br>% do CDI | 1,13<br>100,42 | 13,13<br>106,12 | 3,32<br>103,91 | 6,83<br>103,32 | 13,13<br>106,12 | 18,83<br>108,78 | 21,84<br>106,21 |
| SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO<br>Var. IRF-M 1 p.p. | 1,19<br>0,02 | 12,18<br>0,16 | 3,14<br>-0,01 | 6,73<br>0,03 | 12,18<br>0,16 | 15,51<br>0,21 | 20,04<br>0,31 |
| ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO<br>Var. IMA-B TOTAL p.p. | -0,25<br>-0,05 | 4,94<br>-1,43 | -0,49<br>-0,72 | 0,73<br>-1,21 | 4,94<br>-1,43 | 3,40<br>-1,63 | 11,18<br>-0,57 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI<br>% do CDI | 1,12<br>99,92 | 12,59<br>101,73 | 3,22<br>100,61 | 6,67<br>100,91 | 12,59<br>101,73 | 17,79<br>102,78 | 20,62<br>100,29 |
| BB PREV RF FLUXO FIC<br>% do CDI | 1,03<br>92,01 | 11,26<br>91,00 | 2,95<br>92,16 | 6,09<br>92,12 | 11,26<br>91,00 | 14,89<br>86,04 | 16,78<br>81,63 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP<br>% do CDI | 1,15<br>102,35 | 12,67<br>102,40 | 3,25<br>101,77 | 6,70<br>101,28 | 12,67<br>102,40 | 17,85<br>103,09 | 20,69<br>100,66 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA<br>Var. IBOVESPA p.p. | -3,06<br>-0,62 | -4,67<br>-9,36 | -3,97<br>-3,69 | 9,84<br>-1,52 | -4,67<br>-9,36 | -34,98<br>-27,18 | -29,85<br>-24,74 |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA<br>Var. IBOVESPA p.p. | -2,71<br>-0,27 | 3,65<br>-1,03 | -1,81<br>-1,53 | 9,14<br>-2,22 | 3,65<br>-1,03 | -10,01<br>-2,22 | -11,64<br>-6,53 |
| BRADESCO F I A SELECTION | -2,58 | 7,16 | -0,93 | 12,81 | 7,16 | -11,71 | -14,95 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Var. IBOVESPA p.p. | -0,13 | 2,48 | -0,65 | 1,46 | 2,48 | -3,91 | -9,84 |
| ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI | -4,64 | -9,36 | -9,69 | 1,51 | -9,36 | -24,85 | -40,81 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -2,19 | -14,05 | -9,41 | -9,85 | -14,05 | -17,05 | -35,70 |
| SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA | -2,15 | 10,67 | -1,84 | 10,74 | 10,67 | -7,65 | -4,14 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 0,29 | 5,98 | -1,57 | -0,62 | 5,98 | 0,15 | 0,97 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 1,80 | 5,16 | 3,00 | 15,16 | 5,16 | -3,78 | -8,47 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 4,24 | 0,48 | 3,27 | 3,80 | 0,48 | 4,02 | -3,36 |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI | -4,80 | -8,10 | -10,28 | 0,31 | -8,10 | | |
| Var. IBOVESPA p.p. | -2,36 | -12,78 | -10,01 | -11,05 | -12,78 | | |
| SOMMA BRASIL FIA | -2,08 | 0,10 | -1,60 | 10,01 | 0,10 | -10,58 | -16,84 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 0,37 | -4,58 | -1,32 | -1,35 | -4,58 | -2,78 | -11,73 |
| BB AÇÕES VALOR FIC FIA | -2,48 | -3,47 | -1,99 | 5,53 | -3,47 | -8,07 | -2,57 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -0,03 | -8,16 | -1,71 | -5,83 | -8,16 | -0,27 | 2,54 |
| FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP | 1,10 | 10,95 | 1,68 | 6,67 | 10,95 | 12,55 | 16,51 |
| % do CDI | 97,73 | 88,49 | 52,63 | 100,78 | 88,49 | 72,49 | 80,29 |
| FIP LA SHOPPING CENTERS | -0,14 | 4,01 | -0,27 | 2,08 | 4,01 | -70,84 | -68,56 |
| % do CDI | -12,34 | 32,38 | -8,47 | 31,42 | 32,38 | -409,19 | -333,50 |
| CARE11 | -12,42 | 1,81 | -29,32 | -32,21 | 1,81 | -18,34 | -55,69 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -9,98 | -2,88 | -29,05 | -43,57 | -2,88 | -10,54 | -50,57 |
| CIANORTE | 0,43 | 8,71 | 1,56 | 4,66 | 8,71 | 7,07 | |
| Var. IPCA + 5,04% p.p. | -0,62 | -2,38 | -1,30 | 1,86 | -2,38 | -21,34 | |
| CDI | 1,12 | 12,37 | 3,20 | 6,61 | 12,37 | 17,31 | 20,56 |
| IBOVESPA | -2,45 | 4,69 | -0,27 | 11,36 | 4,69 | -7,80 | -5,11 |
| INPC + 6,00% | 1,20 | 12,26 | 3,01 | 3,29 | 12,26 | 31,06 | 46,46 |
| IPCA + 6,00% | 1,13 | 12,11 | 3,10 | 3,27 | 12,11 | 30,76 | 44,83 |

## Cotização e Taxas

| | Aplicação | | Resgate | | Taxas | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Fundo | 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 VALOR FIC FIA | D+1 du | D+0 | D+30 | D+32 | | 2,00 |
| BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI | D+0 | D+0 | D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação) | D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação) | | 0,20 |
| BB PREV RF FLUXO FIC | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 1,00 |
| BB PREV RF IPCA | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,15 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI | | | D+0 | D+0 | | |
| BRADESCO F I A SELECTION | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+3 du | | 1,50 |
| 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 |
| CARE11 | Não se aplica | Não se aplica | | | | |
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,80 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A 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 RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FIC CAIXA ALOCACAO 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 |
| FIP LA SHOPPING CENTERS | Não se aplica | Não se aplica | | | | |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | D+0 | D+0 | D+21 du | D+23 du | O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE | 1,90 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| | Aplicação | | Resgate | | Taxas | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Fundo | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance | Administração |
| | | | | | DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA | |
| ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI | D+0 | D+0 | D+21 du | D+23 du | O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA | 2,50 |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | D+0 | D+0 | D+0 | D+1 du | | 0,40 |
| ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | | | D+0 | D+0 | | 0,18 |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI | D+0 | D+0 | D+21 du | D+24 du | | |
| ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO | D+0 | D+0 | D+0 | D+1 du | | 0,50 |
| SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO | D+0 | D+0 | D+0 | D+1 du | | 0,20 |
| SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+3 du | | 1,50 |
| SOMMA BRASIL FIA | D+0 | D+0 | D+1 du | D+3 du | - | 2,00 |

## 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 | 1,18 | 12,02 | 3,16 | 6,70 | 12,02 | 15,30 | 19,73 | 27,82 | 36,73 |
| IRF-M 1+ | 1,62 | 7,41 | 1,10 | 6,63 | 7,41 | 2,06 | 10,68 | 26,44 | 41,95 |
| IRF-M TOTAL | 1,48 | 8,82 | 1,74 | 6,49 | 8,82 | 6,66 | 13,80 | 27,49 | 41,17 |
| IMA-B 5 | 0,94 | 9,78 | 2,53 | 2,98 | 9,78 | 14,79 | 24,02 | 40,34 | 54,18 |
| IMA-B 5+ | -1,19 | 3,30 | -1,72 | 1,24 | 3,30 | -3,47 | 1,84 | 32,76 | 53,22 |
| IMA-B TOTAL | -0,19 | 6,37 | 0,23 | 1,94 | 6,37 | 5,02 | 11,75 | 37,40 | 55,34 |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,77 | 9,66 | 1,73 | 4,95 | 9,66 | 10,71 | 16,62 | 31,57 | 44,78 |
| IDKA 2 | 1,24 | 9,34 | 2,25 | 2,34 | 9,34 | 14,78 | 24,67 | 39,41 | 53,01 |
| IDKA 20 | -3,32 | -1,92 | -5,66 | 0,71 | -1,92 | -16,13 | -14,29 | 23,65 | 48,88 |
| CDI | 1,12 | 12,37 | 3,20 | 6,61 | 12,37 | 17,31 | 20,56 | 27,75 | 35,96 |

### Renda Variável

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| IBOVESPA | -2,45 | 4,69 | -0,27 | 11,36 | 4,69 | -7,80 | -5,11 | 24,86 | 43,63 |
| IBRX 100 | -2,63 | 4,02 | -0,39 | 10,33 | 4,02 | -7,61 | -4,37 | 27,56 | 47,23 |
| IBRX 50 | -2,55 | 5,72 | 0,38 | 12,12 | 5,72 | -5,43 | -2,00 | 26,57 | 44,96 |
| SMALL CAP | -3,01 | -15,06 | -7,61 | 5,76 | -15,06 | -28,82 | -29,28 | 11,87 | 20,97 |
| Índice Consumo - ICON | | | | | | | | | |
| Índice Dividendos - IDIV | -1,61 | 12,65 | 3,15 | 7,71 | 12,65 | 5,43 | 4,37 | 51,51 | 75,68 |

# EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Investimentos Estruturados

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| S&P 500 | -7,26 | -24,68 | 3,34 | 1,04 | -24,68 | 2,63 | 53,84 | 106,24 | 126,51 |

## Investimentos Imobiliários

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| IFIX | -0,00 | 2,22 | -4,14 | 2,56 | 2,22 | -0,11 | -10,33 | 21,92 | 28,78 |

## Investimentos no Exterior

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MSCI ACWI | -5,43 | -25,01 | 5,58 | 1,05 | -25,01 | -5,95 | 38,64 | 78,90 | 86,12 |

## Indicadores Econômicos

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| IPCA | 0,62 | 5,79 | 1,63 | 0,28 | 5,79 | 16,43 | 21,69 | 26,93 | 31,68 |
| INPC | 0,69 | 5,93 | 1,55 | 0,30 | 5,93 | 16,70 | 23,05 | 28,57 | 32,98 |
| IGPM | 0,45 | 5,45 | -1,09 | -2,51 | 5,45 | 24,20 | 52,94 | 64,11 | 76,48 |
| SELIC | 1,12 | 12,37 | 3,20 | 6,61 | 12,37 | 17,31 | 20,56 | 27,75 | 35,97 |

## Meta Atuarial

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| IPCA + 4,00% | 0,97 | 10,00 | 2,61 | 2,28 | 10,00 | 25,89 | 36,82 | 48,44 | 60,11 |
| IPCA + 5,00% | 1,05 | 11,05 | 2,86 | 2,78 | 11,05 | 28,31 | 40,79 | 54,22 | 67,93 |
| IPCA + 5,50% | 1,09 | 11,58 | 2,98 | 3,03 | 11,58 | 29,53 | 42,80 | 57,17 | 71,96 |
| IPCA + 5,89% | 1,12 | 11,99 | 3,07 | 3,22 | 11,99 | 30,49 | 44,38 | 59,51 | 75,15 |
| IPCA + 6,00% | 1,13 | 12,11 | 3,10 | 3,27 | 12,11 | 30,76 | 44,83 | 60,17 | 76,06 |
| INPC + 4,00% | 1,04 | 10,15 | 2,53 | 2,31 | 10,15 | 26,18 | 38,35 | 50,36 | 61,69 |
| INPC + 6,00% | 1,20 | 12,26 | 3,01 | 3,29 | 12,26 | 31,06 | 46,46 | 62,24 | 77,79 |

## Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1266 | 01/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 38.431,95 | 0,00 | 15.977,03392173 | 2,4054496090 |
| 1233 | 02/12/2022 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | 0,00 | 91,03 | 42,72880423 | 2,1304130000 |
| 1244 | 02/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 8.183,50 | 0,00 | 3.400,47475830 | 2,4065757230 |
| 1267 | 02/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 13.754,32 | 5.715,30738408 | 2,4065757230 |
| 1245 | 05/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 80.856,75 | 0,00 | 33.582,45822361 | 2,4077079010 |
| 1268 | 05/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 41.030,16 | 0,00 | 17.041,17014483 | 2,4077079010 |
| 1246 | 06/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 1.225.438,72 | 0,00 | 508.728,47272062 | 2,4088266840 |
| 1247 | 07/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 414.195,25 | 0,00 | 171.868,85735288 | 2,4099494020 |
| 1269 | 07/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 58,32 | 0,00 | 24,19967820 | 2,4099494020 |
| 1248 | 08/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 1.528,50 | 0,00 | 633,95031355 | 2,4110722360 |
| 1280 | 09/12/2022 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | 219,61 | 0,00 | 102,85850200 | 2,1350690000 |
| 1234 | 09/12/2022 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | 0,00 | 219,61 | 102,85850247 | 2,1350690000 |
| 1249 | 09/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 766.009,37 | 0,00 | 317.557,40462244 | 2,4121918080 |
| 1270 | 09/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 2.145,60 | 889,48150511 | 2,4121918080 |
| 1250 | 12/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 25.507,98 | 0,00 | 10.569,70572912 | 2,4133103280 |
| 1251 | 13/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 12.317,14 | 0,00 | 5.101,48596177 | 2,4144220120 |
| 1271 | 13/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 25.682,52 | 0,00 | 10.637,12966182 | 2,4144220120 |
| 1252 | 14/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 774.775,46 | 320.743,16946607 | 2,4155633970 |
| 1272 | 14/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 16.806,85 | 6.957,73500330 | 2,4155633970 |
| 1253 | 15/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 18.197,31 | 0,00 | 7.529,88448703 | 2,4166785070 |
| 1273 | 15/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 5.945,07 | 2.460,01691279 | 2,4166785070 |
| 1254 | 16/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 390.412,86 | 0,00 | 161.474,25846945 | 2,4178024640 |
| 1242 | 19/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 373.873,92 | 0,00 | 154.562,03028378 | 2,4189247470 |
| 1255 | 19/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 1.265.315,08 | 0,00 | 523.089,89007172 | 2,4189247470 |
| 1256 | 20/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 732.692,44 | 0,00 | 302.761,39880846 | 2,4200325500 |
| 1277 | 20/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 1.689.071,42 | 0,00 | 697.954,00892438 | 2,4200325500 |
| 1240 | 21/12/2022 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | 54.439,51 | 0,00 | 25.408,97191219 | 2,1425310000 |
| 1257 | 21/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 4.194.803,85 | 1.732.568,60129603 | 2,4211473340 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1263 | 21/12/2022 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 4.480.000,00 | 1.658.297,45165078 | 2,7015659920 |
| 1265 | 21/12/2022 | ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | 6.000.000,00 | 0,00 | 1.588,12458077 | 3.778,0411390000 |
| 1274 | 21/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 59.949,51 | 24.760,78558216 | 2,4211473340 |
| 1276 | 21/12/2022 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 60.000,00 | 22.209,34087032 | 2,7015659920 |
| 1278 | 21/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 1.689.849,49 | 697.954,00976618 | 2,4211473340 |
| 1279 | 21/12/2022 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 1.689.849,49 | 0,00 | 625.507,38904919 | 2,7015659920 |
| 1235 | 22/12/2022 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | 0,00 | 0,75 | 0,34990123 | 2,1434620000 |
| 1236 | 22/12/2022 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 43,54 | 0,00 | 9,91298024 | 4,3922210000 |
| 1237 | 22/12/2022 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 237,07 | 0,00 | 53,97497075 | 4,3922210000 |
| 1238 | 22/12/2022 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | 0,00 | 236,92 | 110,53146732 | 2,1434620000 |
| 1239 | 22/12/2022 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | 0,00 | 42,96 | 20,04234271 | 2,1434620000 |
| 1241 | 22/12/2022 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | 0,00 | 54.439,51 | 25.397,93567602 | 2,1434620000 |
| 1258 | 22/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 999,40 | 0,00 | 412,58484696 | 2,4222896390 |
| 1275 | 22/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 1.817,82 | 750,45525966 | 2,4222896390 |
| 1259 | 23/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 9.182,90 | 0,00 | 3.789,24912936 | 2,4234088830 |
| 1260 | 26/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 24.104,53 | 0,00 | 9.941,76410587 | 2,4245727160 |
| 1261 | 27/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 2.482.724,05 | 0,00 | 1.023.502,58457747 | 2,4257135130 |
| 1243 | 28/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 14.805,41 | 0,00 | 6.100,61514337 | 2,4268716600 |
| 1262 | 29/12/2022 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 2.554.616,00 | 1.052.146,98749791 | 2,4280029600 |
| 1264 | 29/12/2022 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 2.554.616,00 | 0,00 | 942.681,27466375 | 2,7099466900 |
| | **Total** | | **19.940.024,70** | **13.909.494,75** | | |

## Análise de Risco

**Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%** **Value-At-Risk (R$): 2.235.792,61** **Value-At-Risk: 1,60%**

| | Volatilidade(1) | VaR(2) | CVaR(3) | Sharpe | Rent. | Valor(R$) | % Carteira |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CIANORTE | | 1,60 | 1,60 | | | 139.758.755,30 | 100,00 |

**Renda Fixa** **Value-At-Risk: 0,46%**

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo | Volatilidade(1) | VaR(2) | CVaR(3) | BVaR(4) | Sharpe | Rent. | Valor(R$) | % Carteira |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | | 0,11 | 0,00 | 0,01 | | | 2.056.255,43 | 1,47 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | | 1,52 | 0,04 | 0,40 | | | 4.828.899,48 | 3,46 |
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | | 0,00 | -0,00 | 0,00 | | | 1.123,21 | 0,00 |
| BB PREV RF IPCA | | 0,89 | 0,01 | 0,86 | | | 7.133.714,22 | 5,10 |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | | 1,94 | 0,13 | 1,96 | | | 11.783.385,26 | 8,43 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | | 0,62 | 0,07 | 0,64 | | | 21.227.385,02 | 15,19 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI | | 1,31 | 0,01 | 1,29 | | | 2.052.754,05 | 1,47 |
| **Sub-total** | 1,42 | 0,92 | 0,25 | | -0,25 | 0,76 | 49.083.516,67 | 35,12 |

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 | | 3,21 | 0,03 | 0,40 | | | 1.637.012,91 | 1,17 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | | 0,01 | 0,00 | 0,01 | | | 24.436.186,47 | 17,48 |
| ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | | 0,01 | 0,00 | 0,01 | | | 12.442.326,33 | 8,90 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | | 0,01 | 0,00 | 0,01 | | | 25.992.787,06 | 18,60 |
| BB PREV RF FLUXO FIC | | 0,01 | 0,00 | 0,01 | | | 397.166,42 | 0,28 |
| SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO | | 0,13 | 0,00 | 0,03 | | | 1.956.897,65 | 1,40 |
| **Sub-total** | 0,16 | 0,08 | 0,03 | | -0,18 | 1,09 | 66.862.376,84 | 47,84 |

Artigo 7º V, Alínea b

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade(1) | VaR(2) | CVaR(3) | BVaR(4) | Sharpe | Rent. | Valor(R$) | % Carteira |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI | | 1,32 | 0,02 | 1,30 | | | 3.504.184,44 | 2,51 |
| **Sub-total** | 2,10 | 1,32 | 0,02 | | -0,05 | 1,02 | 3.504.184,44 | 2,51 |

**Renda Variável** **Value-At-Risk: 10,94%**

Artigo 8º I

| Ativo | Volatilidade(1) | VaR(2) | CVaR(3) | BVaR(4) | Sharpe | Rent. | Valor(R$) | % Carteira |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | | 10,76 | 0,09 | 5,25 | | | 1.267.999,12 | 0,91 |
| SOMMA BRASIL FIA | | 11,13 | 0,19 | 1,55 | | | 2.501.127,40 | 1,79 |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA | | 10,82 | 0,25 | 2,83 | | | 3.573.281,87 | 2,56 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | | 11,11 | 0,07 | 5,23 | | | 1.032.519,72 | 0,74 |
| ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI | | 13,52 | 0,09 | 5,82 | | | 996.297,08 | 0,71 |
| BB AÇÕES VALOR FIC FIA | | 10,88 | 0,25 | 1,51 | | | 3.348.682,99 | 2,40 |
| BRADESCO F I A SELECTION | | 11,23 | 0,07 | 2,33 | | | 855.462,51 | 0,61 |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI | | 13,55 | 0,14 | 5,88 | | | 1.499.164,87 | 1,07 |
| SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA | | 11,21 | 0,09 | 1,74 | | | 1.130.936,99 | 0,81 |
| **Sub-total** | 20,21 | 10,94 | 1,24 | | -0,18 | -2,59 | 16.205.472,55 | 11,60 |

**Investimentos Estruturados** **Value-At-Risk: 1,87%**

Artigo 10º I

| Ativo | Volatilidade(1) | VaR(2) | CVaR(3) | BVaR(4) | Sharpe | Rent. | Valor(R$) | % Carteira |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP | | 2,29 | 0,04 | 2,29 | | | 2.888.186,12 | 2,07 |
| **Sub-total** | 4,71 | 2,29 | 0,04 | | -0,01 | 1,10 | 2.888.186,12 | 2,07 |

Artigo 10º II

| Ativo | Volatilidade(1) | VaR(2) | CVaR(3) | BVaR(4) | Sharpe | Rent. | Valor(R$) | % Carteira |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FIP LA SHOPPING CENTERS | | 0,02 | -0,00 | 0,02 | | | 641.072,54 | 0,46 |
| **Sub-total** | 0,47 | 0,02 | -0,00 | | -2,69 | -0,14 | 641.072,54 | 0,46 |

# EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Fundos Imobiliários** **Value-At-Risk: 13,12%**

Artigo 11º

| Ativo | Volatilidade[1] | VaR[2] | CVaR[3] | BVaR[4] | Sharpe | Rent. | Valor(R$) | % Carteira |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CARE11 | | 13,12 | 0,00 | 16,71 | | | 573.946,14 | 0,41 |
| **Sub-total** | 31,81 | 13,12 | 0,00 | | -0,43 | -12,42 | 573.946,14 | 0,41 |