



**LDB**  
EMPRESAS

**MOGI DAS CRUZES**  
OUTUBRO 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 29.10.2021.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

63,65%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,58	-0,52	1,00	62.321,40	0,01	6.857.913.148,95	0,00
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,59	-2,58	-5,08	14.052.114,16	1,90	609.574.848,27	2,31
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,59	-2,56	-5,00	109.303.642,93	14,80	4.811.776.336,97	2,27
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,58	-0,47	1,17	15.593,63	0,00	105.867.861,90	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,58	-0,54	1,05	80.042,91	0,01	6.589.712.896,46	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,69	-1,24	1,03	67.078.618,16	9,08	10.998.044.937,35	0,61
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	5,59	-2,56	-5,00	20.086.283,05	2,72	1.083.533.278,18	1,85
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,35	-2,64	-5,68	5.191.868,60	0,70	1.295.006.190,43	0,40
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	4,10	-1,82	-3,23	66.574.512,10	9,02	1.079.535.760,60	6,17
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,70	-1,27	0,98	16.174.654,75	2,19	6.081.334.244,20	0,27
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	1,59	-0,50	4,16	14.102.609,38	1,91	464.701.176,96	3,03
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,84	-1,63	-2,98	55.554.564,37	7,52	7.937.028.591,03	0,70
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,40	-0,66	-1,82	66.219.537,92	8,97	13.374.488.418,39	0,50
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	2,12	-0,80	2,69	2.852.315,19	0,39	573.078.307,62	0,50
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>3,57</b>	<b>-1,72</b>	<b>-2,49</b>	<b>437.348.678,55</b>	<b>59,23</b>		

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
XP	INTRAG	XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP	3,73	-1,43	-0,74	2.169.086,13	0,29	818.308.242,76	0,27
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>3,73</b>	<b>-1,43</b>	<b>-0,74</b>	<b>2.169.086,13</b>	<b>0,29</b>		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,14	0,60	3,51	12.117.080,65	1,64	1.527.024.616,05	0,79
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	5,97	-2,72	-6,30	5.766.904,61	0,78	143.845.887,84	4,01
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	5,61	-2,59	-4,97	2.936.539,10	0,40	1.089.006.458,36	0,27
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	7,03	-3,20	-5,27	9.349.838,67	1,27	405.559.851,21	2,31
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,95	-0,36	1,96	264.058,48	0,04	2.956.661.982,44	0,01
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>3,41</b>	<b>-1,51</b>	<b>-1,67</b>	<b>30.434.421,51</b>	<b>4,12</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>3,56</b>	<b>-1,71</b>	<b>-2,44</b>	<b>469.952.186,19</b>	<b>63,65</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

25,78%

Artigo 8º I, Alínea b (Fundos de Índices Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	22,91	-6,73	-13,01	20.319.527,31	2,75	7.576.579.931,80	0,27
ITAU	ITAU	IT NOW S&P 500 TRN FUNDO DE ÍNDICE	17,95	10,46	33,86	29.727.568,83	4,03	3.159.793.084,55	0,94
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea b</b>			<b>17,65</b>	<b>2,77</b>	<b>3,21</b>	<b>50.047.096,14</b>	<b>6,78</b>		

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	20,63	-8,53	-18,93	329.672,07	0,04	219.426.925,85	0,15
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	18,56	-6,96	-17,20	882.310,52	0,12	1.037.994.854,41	0,09
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	18,23	-6,92	-8,05	6.397.134,87	0,87	1.046.179.744,82	0,61
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	23,08	-13,79	-16,76	16.494.221,74	2,23	459.836.564,88	3,59
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	19,98	-8,24	-16,79	8.039.253,65	1,09	230.759.980,78	3,48
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	20,26	-6,80	-15,80	9.135.445,47	1,24	665.873.580,06	1,37
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	18,39	-8,12	-13,22	1.327.697,25	0,18	544.097.312,19	0,24
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	20,08	-4,90	-13,38	1.403.315,19	0,19	1.013.856.434,24	0,14
XP	SANTANDER	XP INVESTOR 30 FIC FIA	18,88	-8,25	-16,13	16.108.292,23	2,18	295.927.192,42	5,44
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	20,43	-5,54	-7,69	2.187.200,73	0,30	1.091.836.208,84	0,20
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,84	-4,31	-11,26	10.666.279,51	1,44	970.137.115,48	1,10
BB	BB	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	20,07	-5,02	-12,52	4.796.664,59	0,65	1.271.071.598,64	0,38
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	19,20	-10,13	-15,27	9.432.696,71	1,28	862.345.754,21	1,09
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	23,52	-14,37	-21,56	11.964.096,16	1,62	1.063.418.749,17	1,13
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	20,76	-16,09	-23,59	845.789,95	0,11	465.036.411,36	0,18
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	23,29	-17,38	-28,40	666.575,69	0,09	398.304.374,86	0,17
SAFRA	SAFRA	SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES	20,90	-13,95	-21,12	876.704,91	0,12	295.454.411,40	0,30
TPE	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	19,24	-2,56	-3,30	966.960,51	0,13	327.977.554,65	0,29
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	19,70	-8,89	-9,95	13.231.462,92	1,79	166.020.130,72	7,97
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>19,50</b>	<b>-9,35</b>	<b>-15,52</b>	<b>115.751.774,67</b>	<b>15,68</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	13,18	7,66	26,19	10.530.337,65	1,43	2.441.878.674,75	0,43
BRAM	BRADERCO	BRADERCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	2,20	-1,16	-1,18	516.885,44	0,07	257.678.202,41	0,20
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	13,23	7,70	3,91	10.390.008,29	1,41	256.107.064,98	4,06
SICREDI	SICREDI	SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP	13,19	7,67	4,85	3.145.359,03	0,43	323.981.197,29	0,97
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>11,13</b>	<b>7,48</b>	<b>21,77</b>	<b>24.582.590,41</b>	<b>3,33</b>		
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>			<b>14,06</b>	<b>-4,46</b>	<b>-7,31</b>	<b>190.381.461,22</b>	<b>25,78</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

10,57%

Artigo 9º A, II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,06	10,90	34,59	17.282.907,60	2,34	577.219.493,02	2,99
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	17,53	5,53	17,43	6.065.565,92	0,82	645.954.817,70	0,94
BRPP	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	31,99	10,90	8,61	9.602.210,17	1,30	532.047.009,68	1,80
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21,03	7,38	13,32	30.995.630,37	4,20	1.633.422.031,43	1,90
<b>Sub-total Artigo 9º A, II</b>			<b>18,79</b>	<b>8,65</b>	<b>19,85</b>	<b>63.946.314,06</b>	<b>8,66</b>		

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	17,17	10,93	29,48	5.090.087,12	0,69	3.720.209.176,93	0,14
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	17,65	8,52	29,18	4.807.148,72	0,65	3.790.339.456,50	0,13
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	17,92	10,62	29,81	4.184.156,44	0,57	4.336.590.897,15	0,10
<b>Sub-total Artigo 9º A, III</b>			<b>17,23</b>	<b>10,01</b>	<b>28,93</b>	<b>14.081.392,28</b>	<b>1,91</b>		

<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>17,80</b>	<b>8,89</b>	<b>21,52</b>	<b>78.027.706,34</b>	<b>10,57</b>		
<b>Total</b>			<b>5,25</b>	<b>-1,43</b>	<b>-1,75</b>	<b>738.361.353,75</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	437.348.678,55	59,23	0,00	5,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	2.169.086,13	0,29	0,00	0,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	30.434.421,51	4,12	0,00	1,14	40,00	0,00	40,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>469.952.186,19</b>	<b>63,65</b>					100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 8º I, Alínea b	Fundos de Índices Referenciados	50.047.096,14	6,78	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	115.751.774,67	15,68	0,00	18,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	24.582.590,41	3,33	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>190.381.461,22</b>	<b>25,78</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	63.946.314,06	8,66	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	14.081.392,28	1,91	0,00	1,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>78.027.706,34</b>	<b>10,57</b>					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	-1,72 -358,13	-2,49 -83,05	-2,08 -154,41	-1,63 -71,32	1,58 47,59	-7.664.009,01	-11.086.543,74
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-1,43 -298,42	-0,74 -80,87				-31.548,51	-17.913,87
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-1,51 -313,87	-1,67 -55,64	-2,15 -159,25	-1,29 -56,34	2,23 67,09	-478.446,56	-651.826,21
Artigo 8º I, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	2,77 9,51	3,21 16,25	-0,06 14,97	2,13 15,07	26,77 16,61	1.348.666,49	1.479.499,55
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-9,35 -2,62	-15,52 -2,48	-18,28 -3,25	-15,92 -2,98	3,22 -6,95	-11.974.765,55	-20.185.334,67
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	7,48 14,21	21,77 34,81	5,88 20,91	10,89 23,83	35,75 25,58	1.709.860,21	3.889.466,51
Artigo 9º A, II % do CDI	8,65 1.799,94	19,85 661,78	10,79 799,99	10,02 437,01	25,32 761,96	5.089.245,12	9.213.050,19
Artigo 9º A, III % do CDI	10,01 2.082,70	28,93 964,34	12,41 919,92	13,78 601,22	30,70 923,81	1.280.727,56	3.834.237,91
<b>MOGI DAS CRUZES (Total)</b>						<b>-10.720.270,25</b>	<b>-13.525.364,33</b>

**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	56.473.003,09	0,00	0,00	0,00	55.554.564,37	-918.438,72	-1.708.087,56
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	13.920.419,88	2.473.000,00	0,00	0,00	16.174.654,75	-218.765,13	92.387,87
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	62.646,37	0,00	0,00	0,00	62.321,40	-324,97	556,78
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	2.875.200,58	0,00	0,00	0,00	2.852.315,19	-22.885,39	76.444,66
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	14.172.931,64	0,00	0,00	0,00	14.102.609,38	-70.322,26	576.877,58
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	14.424.411,83	0,00	0,00	0,00	14.052.114,16	-372.297,67	-752.443,61
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	67.923.616,10	0,00	0,00	0,00	67.078.618,16	-844.997,94	859.243,75
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	112.177.217,71	0,00	0,00	0,00	109.303.642,93	-2.873.574,78	-5.756.711,84
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	80.473,98	0,00	0,00	0,00	80.042,91	-431,07	830,47

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.332.691,51	0,00	0,00	0,00	5.191.868,60	-140.822,91	-367.431,99
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	66.660.315,95	0,00	0,00	0,00	66.219.537,92	-440.778,03	-1.225.110,83
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.666,93	0,00	0,00	0,00	15.593,63	-73,30	180,37
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	20.615.003,31	0,00	0,00	0,00	20.086.283,05	-528.720,26	-1.057.996,18
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	67.806.088,68	0,00	0,00	0,00	66.574.512,10	-1.231.576,58	-1.825.283,21
					437.348.678,55	0,00	0,00

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP	2.200.634,64	0,00	0,00	0,00	2.169.086,13	-31.548,51	-17.913,87
					2.169.086,13	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 IMA-B	3.014.625,94	0,00	0,00	0,00	2.936.539,10	-78.086,84	-153.508,69
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	5.928.085,65	0,00	0,00	0,00	5.766.904,61	-161.181,04	-387.787,16
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	265.000,03	0,00	0,00	0,00	264.058,48	-941,55	4.672,06
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	12.062.989,87	6.308.000,00	-6.325.000,00	0,00	12.117.080,65	71.090,78	412.958,91
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	9.659.166,58	0,00	0,00	0,00	9.349.838,67	-309.327,91	-528.161,33
					30.434.421,51	0,00	0,00

Artigo 8º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	21.786.416,45	0,00	0,00	0,00	20.319.527,31	-1.466.889,14	-3.276.826,76
IT NOW S&P 500 TRN FUNDO DE ÍNDICE	26.912.013,20	0,00	0,00	0,00	29.727.568,83	2.815.555,63	4.756.326,31
					50.047.096,14	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	5.050.312,37	0,00	0,00	0,00	4.796.664,59	-253.647,78	-658.443,97
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	2.315.514,38	0,00	0,00	0,00	2.187.200,73	-128.313,65	-182.242,14
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	8.761.297,13	0,00	0,00	0,00	8.039.253,65	-722.043,48	-1.656.711,64
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	19.133.487,13	0,00	0,00	0,00	16.494.221,74	-2.639.265,39	-3.321.364,90
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	5.266.110,71	1.649.000,00	0,00	0,00	6.397.134,87	-517.975,84	-1.007.237,77
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	11.146.190,92	0,00	0,00	0,00	10.666.279,51	-479.911,41	-1.352.968,23
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	9.802.299,34	0,00	0,00	0,00	9.135.445,47	-666.853,87	-1.713.674,68
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	10.495.971,97	0,00	0,00	0,00	9.432.696,71	-1.063.275,26	-1.700.474,64
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	948.348,75	0,00	0,00	0,00	882.310,52	-66.038,23	-180.331,42
INDIE FIC FIA	13.972.375,38	0,00	0,00	0,00	11.964.096,16	-2.008.279,22	-2.926.675,36
OCCAM FIC FIA	1.475.590,98	0,00	0,00	0,00	1.403.315,19	-72.275,79	246.620,41
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	1.008.006,03	0,00	0,00	0,00	845.789,95	-162.216,08	-248.210,05
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	806.777,53	0,00	0,00	0,00	666.575,69	-140.201,84	-264.424,31
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES	1.018.783,25	0,00	0,00	0,00	876.704,91	-142.078,34	-216.295,09
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	360.403,12	0,00	0,00	0,00	329.672,07	-30.731,05	120.681,95
TARPON GT 30 FIC FIA	992.315,71	0,00	0,00	0,00	966.960,51	-25.355,20	-33.039,49
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	14.521.827,16	0,00	0,00	0,00	13.231.462,92	-1.290.364,24	-1.462.676,94
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	1.445.071,19	0,00	0,00	0,00	1.327.697,25	-117.373,94	-202.301,73
XP INVESTOR 30 FIC FIA	17.556.857,17	0,00	0,00	0,00	16.108.292,23	-1.448.564,94	-3.097.536,00
					115.751.774,67	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	522.958,30	0,00	0,00	0,00	516.885,44	-6.072,86	-17.418,34
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	9.647.319,64	0,00	0,00	0,00	10.390.008,29	742.688,65	390.008,29
SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP	2.921.212,41	0,00	0,00	0,00	3.145.359,03	224.146,62	145.359,03
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	9.781.239,85	0,00	0,00	0,00	10.530.337,65	749.097,80	3.371.517,53
					24.582.590,41	0,00	0,00

Artigo 9º A, II

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	15.584.893,15	0,00	0,00	0,00	17.282.907,60	1.698.014,45	4.220.441,20
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	5.747.802,45	0,00	0,00	0,00	6.065.565,92	317.763,47	876.320,23
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	8.658.651,82	0,00	0,00	0,00	9.602.210,17	943.558,35	724.210,17
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	28.865.721,52	0,00	0,00	0,00	30.995.630,37	2.129.908,85	3.392.078,59
					63.946.314,06	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	4.588.605,62	0,00	0,00	0,00	5.090.087,12	501.481,50	1.577.728,22
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	4.429.740,31	0,00	0,00	0,00	4.807.148,72	377.408,41	925.662,81
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	3.782.318,79	0,00	0,00	0,00	4.184.156,44	401.837,65	1.330.846,88
					14.081.392,28	0,00	0,00

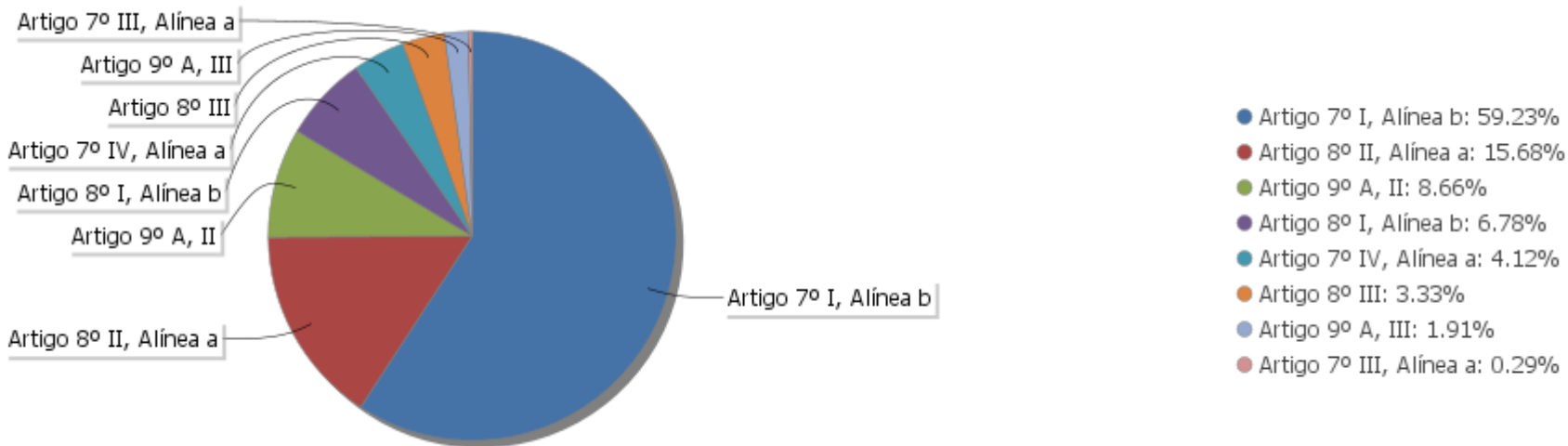
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

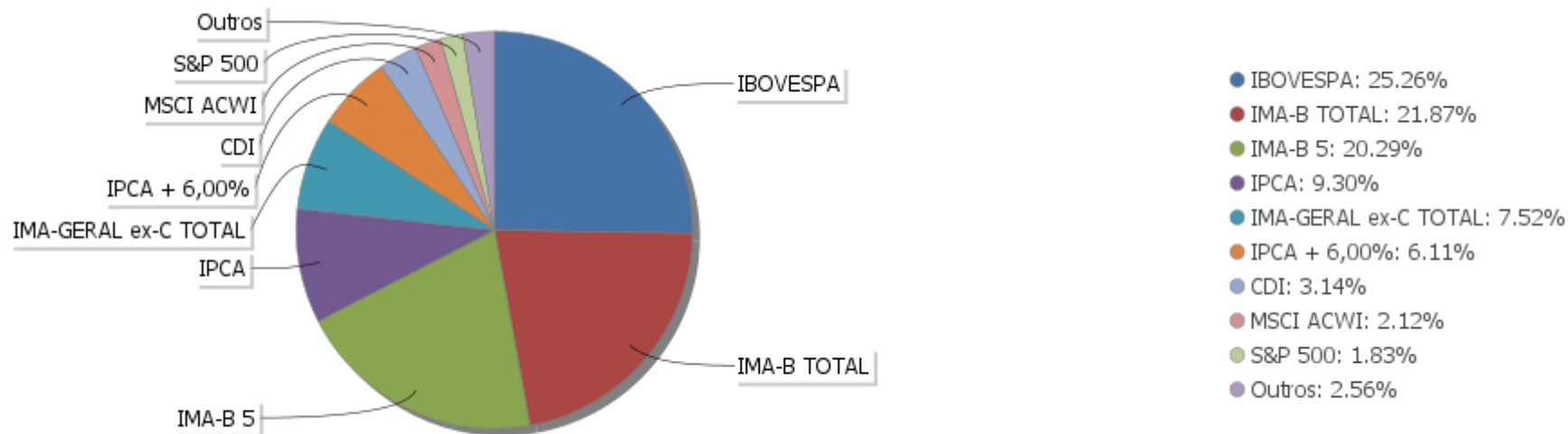
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	659.738.931,17	89,35	659.738.931,17	89,35
de 31 a 365 dias	75.770.107,39	10,26	735.509.038,56	99,61
acima de 365 dias	2.852.315,19	0,39	738.361.353,75	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

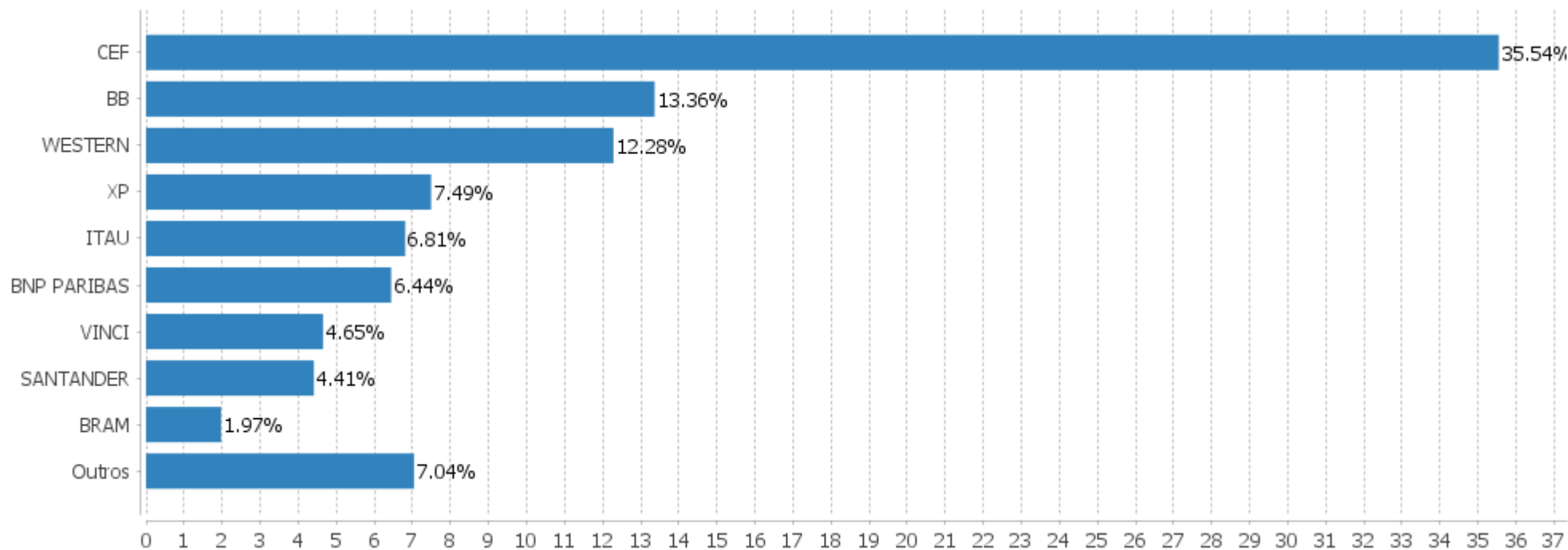


Alocação Por Estratégia



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	-0,75	-1,12	1,02	1,46	1,26	0,41	-0,47	-0,93	-1,17	-1,43			-1,75
IPCA + 5,39%	0,67	1,24	1,41	0,73	1,27	0,97	1,42	1,33	1,60	1,67			13,03
p.p. indexador	-1,42	-2,36	-0,39	0,73	-0,02	-0,56	-1,89	-2,26	-2,77	-3,10			-14,78
2020	0,64	-0,53	-5,69	3,28	2,94	2,96	3,43	-0,44	-1,65	-0,40	4,30	4,01	13,08
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	-0,07	-1,19	-6,26	3,14	2,87	2,22	2,55	-1,16	-2,77	-1,74	2,96	2,16	2,46
2019	2,62	0,40	0,42	1,14	1,92	2,62	1,15	-0,04	2,03	2,09	-0,62	1,88	16,71
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	1,79	-0,50	-0,77	0,09	1,28	2,17	0,42	-0,66	1,58	1,46	-1,59	0,24	6,12
2018	1,78	0,59	0,91	0,37	-1,50	0,13	1,83	-0,52	0,58	3,66	0,79	1,09	10,06
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	0,98	-0,15	0,34	-0,34	-2,38	-1,62	0,99	-0,96	-0,34	2,70	0,53	0,48	0,14

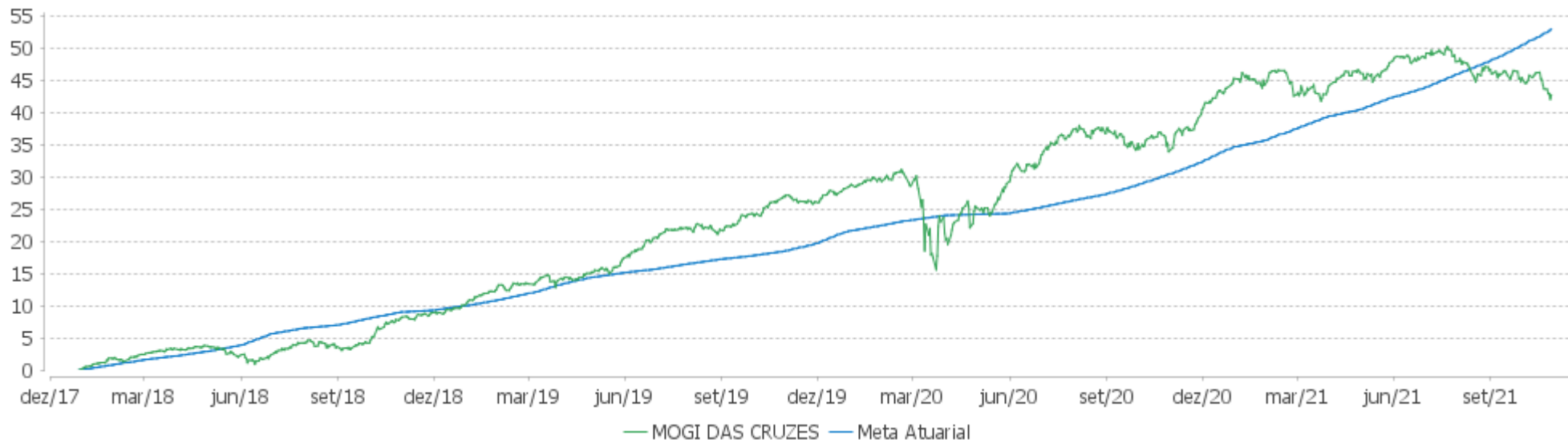
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

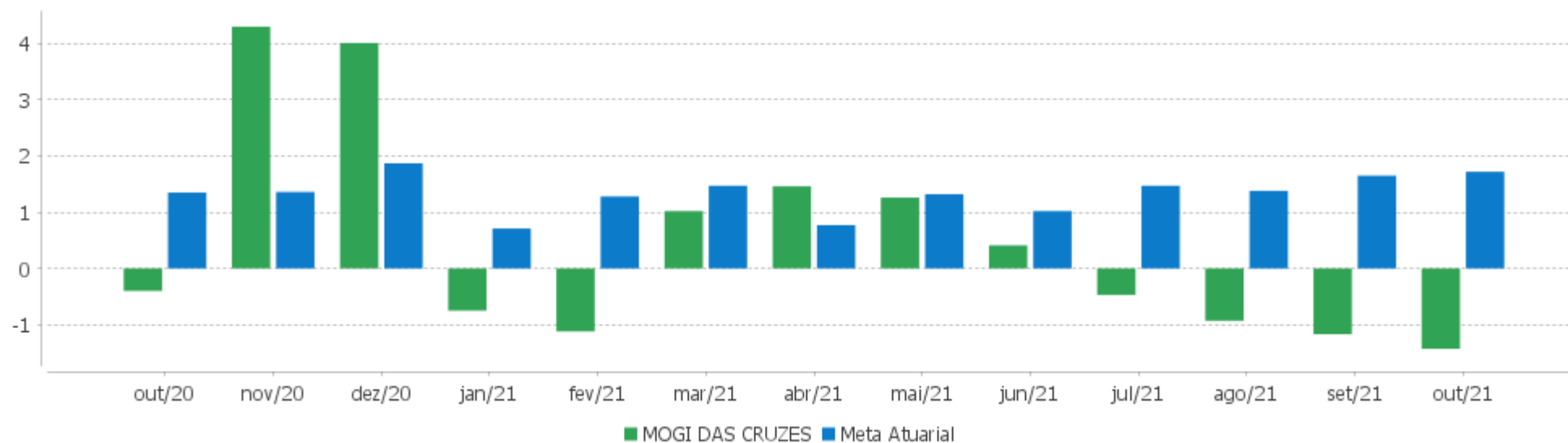
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	21	45,65	03 meses	-3,48	4,68	-8,16	5,37
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	54,35	06 meses	-2,32	8,57	-10,89	4,97
			12 meses	6,59	16,68	-10,09	5,25
			24 meses	12,49	28,32	-15,83	8,68
			36 meses	32,11	39,47	-7,36	7,32
Maior rentabilidade da Carteira	4,30	2020-11	Desde 29/12/2017	42,70	51,98	-9,28	6,65
Menor rentabilidade da Carteira	-5,69	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	-1,82 -0,58	-3,23 -4,45	-1,62 -1,53	-1,79 -2,28	1,35 -3,08	7,03 -3,36	26,86 1,25
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,56 -0,02	-5,00 -0,22	-3,82 -0,09	-2,82 -0,14	1,58 -0,26	0,15 -0,66	26,66 -1,11
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-1,24 -0,01	1,03 -0,19	-0,14 -0,05	0,39 -0,10	4,19 -0,24	9,79 -0,60	24,71 -0,90
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	-0,52 0,02	1,00 -0,23	0,18 -0,05	0,70 -0,12	1,52 -0,26	5,24 -0,67	12,47 -1,00
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-1,27 -0,04	0,98 -0,24	-0,21 -0,11	0,31 -0,18	4,16 -0,27	9,80 -0,59	24,69 -0,92
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6,00% p.p.	-0,80 -2,42	2,69 -11,11	0,70 -4,09	1,95 -7,17	5,69 -12,00	10,94 -19,70	25,68 -16,34
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-2,64 -0,01	-5,68 -0,19	-3,61 -0,09	-3,73 -0,14	-3,52 -0,21	0,50 -0,49	14,90 -0,93
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,58 -0,04	-5,08 -0,30	-3,82 -0,09	-2,84 -0,17	1,46 -0,37	0,11 -0,70	26,44 -1,32
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,50 -2,22	4,16 -9,41	1,25 -3,58	3,05 -5,84	6,66 -10,60	13,25 -15,85	29,50 -10,82
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-1,63 -0,27	-2,98 -0,88	-2,07 -0,40	-1,74 -0,78	0,17 -0,50	1,97 -0,88	17,51 -0,37
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	-0,47 0,07	1,17 -0,06	0,26 0,03	0,83 0,01	1,79 0,02	5,41 -0,50	12,75 -0,72
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,66 -1,91	-1,82 -10,05	-1,75 -5,07	-2,29 -8,02	0,30 -10,38	4,82 -10,19	24,02 6,09
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	-0,54 0,00	1,05 -0,18	0,18 -0,04	0,71 -0,12	1,55 -0,22	5,47 -0,44	12,78 -0,69
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,56 -0,02	-5,00 -0,22	-3,80 -0,06	-2,80 -0,13	1,55 -0,28	0,01 -0,80	26,44 -1,33
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,59 -0,05	-4,97 -0,18	-3,80 -0,07	-2,78 -0,10	1,54 -0,29	0,12 -0,69	26,49 -1,27
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-3,20 -0,66	-9,21 -4,42	-5,33 -1,60	-5,00 -2,33	-1,24 -3,07	-2,43 -3,24	28,56 0,80
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	-2,72	-6,30	-4,39	-3,48	0,34	-1,51	25,96

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,17	-1,51	-0,66	-0,81	-1,49	-2,32	-1,80
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,60 124,18	3,51 116,92	1,58 117,48	2,68 116,72	3,96 119,13	6,40 96,19	12,94 97,45
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	-0,36 -1,61	1,96 -6,28	0,79 -2,53	1,51 -4,22	2,27 -8,40	5,61 -9,40	20,03 2,10
XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP Var. IPCA p.p.	-1,43 -2,68	0,23 -8,01	-0,80 -4,11	0,15 -5,58	4,45 -6,22	9,38 -5,63	
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	7,66 1.594,22	26,19 873,06	6,14 455,33	12,26 534,89	44,14 1.328,31	50,83 763,97	75,40 567,86
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	7,70 -3,22	27,34 -5,80	6,26 -9,19	12,78 -2,25	45,56 7,87		
SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP Var. S&P 500 p.p.	7,67 -3,24	26,84 -6,31	6,17 -9,28	12,37 -2,65	44,35 6,65		
BRDESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL % do CDI	-1,16 -241,73	-1,18 -39,42	-1,05 -77,90	-1,35 -59,12	1,09 32,67	6,18 92,87	14,58 109,81
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	-6,80 -0,06	-15,80 -2,76	-16,70 -1,68	-15,60 -2,65	3,76 -6,41	-1,13 2,34	44,50 26,11
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-4,31 -0,07	-11,26 -2,55	-11,69 -2,71	-11,00 -3,45	10,90 -2,87	-0,23 -1,98	41,49 -0,17
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-8,53 -1,79	-18,93 -5,89	-17,58 -2,55	-15,33 -2,38	-1,71 -11,88	-16,77 -13,30	3,85 -14,54
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-5,02 1,72	-8,12 4,92	-10,68 4,34	-8,86 4,09	18,52 8,36	15,82 19,28	
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-13,95 -7,21	-15,77 -2,73	-24,90 -9,87	-19,02 -6,08	0,92 -9,25		
XP INVESTOR 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-8,25 -1,51	-16,13 -3,09	-19,69 -4,67	-16,14 -3,19	-1,62 -11,78	-9,35 -5,88	22,67 4,28
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-8,89 -2,15	-9,95 3,08	-17,65 -2,63	-13,40 -0,46	6,69 -3,47	-0,87 2,60	34,79 16,40
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,96 -0,22	-17,20 -4,16	-15,67 -0,65	-16,13 -3,18	1,54 -8,63	-19,02 -15,55	15,18 -3,21
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,54 1,20	-7,69 5,35	-9,59 5,43	-7,38 5,56	19,55 9,39	9,52 12,98	44,24 25,85
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-17,38 -10,64	-27,94 -14,91	-31,22 -16,19	-27,53 -14,58	-19,08 -29,25	-12,95 -9,48	33,42 15,03
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-8,24	-16,79	-17,25	-15,37	3,37	-8,42	28,75

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-1,50	-3,75	-2,22	-2,42	-6,79	-4,95	10,36
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-6,92 -0,18	-8,05 4,99	-14,17 0,86	-14,35 -1,40	10,91 0,74	0,45 3,92	37,92 19,53
TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,56 4,18	14,65 27,69	-7,77 7,26	-0,80 12,15	43,94 33,78		
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-16,09 -9,35	-19,54 -6,50	-26,86 -11,83	-22,66 -9,72	-4,60 -14,77	0,36 3,83	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA Var. IBOVESPA p.p.	-8,12 -1,38	-13,22 -0,19	-15,41 -0,38	-13,02 -0,08	3,87 -6,29	3,53 7,00	30,83 12,44
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-14,37 -7,63	-21,56 -8,52	-25,50 -10,47	-21,52 -8,58	-6,80 -16,96	-2,96 0,51	
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-13,79 -7,06	-16,76 -3,72	-21,40 -6,37	-20,24 -7,30	4,22 -5,94	-3,90 -0,43	37,08 18,69
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,90 1,84	-13,38 -0,34	-13,65 1,38	-13,99 -1,05	6,72 -3,45	-0,81 2,65	27,85 9,46
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	-10,13 -3,39	-15,27 -2,24	-17,46 -2,43	-16,11 -3,16	2,63 -7,53	-4,49 -1,02	
IT NOW S&P 500 TRN FUNDO DE ÍNDICE Var. IBOVESPA p.p.	10,46 17,20	33,86 46,90	13,60 28,62	14,65 27,60	38,71 28,55		
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE Var. IBOVESPA p.p.	-6,73 0,01	-13,01 0,03	-15,01 0,02	-12,91 0,04	10,22 0,05	-3,36 0,11	35,67 17,28
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IBOVESPA p.p.	10,90 17,63	34,59 47,63	15,37 30,39	20,65 33,59	40,46 30,30	154,77 158,24	208,00 189,61
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	5,53 -3,44	17,43 -7,79	3,05 -10,33	9,05 -1,84	34,24 2,01		
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	10,90 1,93	20,78 -4,44	12,06 -1,32	15,10 4,21	43,51 11,28		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	7,38 5,66	13,32 -0,25	9,59 4,76	3,68 -5,20	17,60 0,34		
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	10,93 17,67	29,48 42,52	13,35 28,37	13,59 26,54	33,54 23,38	114,42 117,89	160,27 141,88
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	8,52 15,26	29,18 42,22	10,06 25,08	12,67 25,62	32,79 22,63	96,39 99,86	150,12 131,73
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	10,62 17,36	29,81 42,84	14,06 29,08	15,82 28,77	33,34 23,18	130,49 133,96	188,46 170,07
MOGI DAS CRUZES	-1,43	-1,75	-3,48	-2,32	6,59	12,49	32,11

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-3,15	-15,32	-8,31	-11,20	-10,67	-16,61	-8,21
CDI	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28
IBOVESPA	-6,74	-13,04	-15,02	-12,95	10,16	-3,47	18,39
INPC + 6,00%	1,63	13,79	4,79	9,12	17,69	30,64	42,02
IPCA + 6,00%	1,72	13,57	4,83	8,88	17,26	29,10	40,32

**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	-0,54	1,23	0,23	0,83	1,78	5,91	13,47	21,48	36,42
IRF-M 1+	-3,44	-9,10	-5,21	-5,61	-5,90	-1,54	16,13	28,17	50,67
IRF-M TOTAL	-2,63	-5,50	-3,53	-3,59	-3,30	0,99	15,83	26,75	47,22
IMA-B 5	-1,24	1,22	-0,10	0,49	4,43	10,39	25,61	37,29	55,80
IMA-B 5+	-3,87	-10,25	-7,19	-5,85	-1,01	-6,80	27,68	41,57	63,18
IMA-B TOTAL	-2,54	-4,79	-3,73	-2,67	1,83	0,81	27,76	40,92	61,47
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-1,35	-2,10	-1,67	-0,96	0,67	2,85	17,88	28,05	46,14
IMA-GERAL TOTAL	-1,31	-1,68	-1,71	-0,86	1,05	3,75	19,11	29,71	47,78
IDKA 2	-1,47	1,56	-0,12	0,25	4,62	11,66	25,12	37,32	56,68
IDKA 20	-6,31	-17,52	-13,17	-11,45	-5,06	-17,66	27,75	43,34	67,23
CDI	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28	20,70	34,10

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-6,74	-13,04	-15,02	-12,95	10,16	-3,47	18,39	39,29	59,42
IBRX 100	-6,81	-12,40	-16,15	-14,19	10,40	-1,79	22,56	43,44	64,83
IBRX 50	-6,27	-12,20	-16,31	-13,99	11,64	-2,23	17,51	38,33	58,04
SMALL CAP	-12,53	-17,37	-21,28	-20,14	3,62	-2,77	38,93	46,64	90,99
IFIX	-1,47	-6,78	-5,26	-6,48	-3,29	-4,17	19,32	20,19	41,88
Índice Consumo - ICON	-9,73	-20,10	-18,41	-17,11	-8,62	-10,39	29,95	16,52	35,92
Índice Dividendos - IDIV	-4,23	-8,71	-8,99	-7,55	13,78	1,74	41,65	49,00	84,75



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	1,25	8,24	3,32	5,73	10,67	15,01	17,92	23,30	26,63
INPC	1,16	8,45	3,27	5,96	11,08	16,38	19,35	24,13	26,41
IGPM	0,64	16,74	0,66	6,24	21,73	47,21	51,84	68,23	65,87
SELIC	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28	20,71	34,13

**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	10,92	33,14	15,45	15,03	37,70	113,67	157,78	207,96	284,24
MSCI ACWI	8,97	25,22	13,38	10,89	32,23	96,53	133,44	158,41	221,64
MSCI World	9,54	28,15	13,97	12,82	35,37	100,32	138,32	168,41	233,05

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,57	11,80	4,33	7,84	15,06	24,32	32,57	44,11	53,90
IPCA + 5,00%	1,64	12,68	4,58	8,36	16,16	26,70	36,41	49,70	61,40
IPCA + 5,50%	1,68	13,13	4,71	8,62	16,71	27,90	38,35	52,55	65,25
IPCA + 5,89%	1,71	13,47	4,80	8,82	17,14	28,84	39,89	54,81	68,31
IPCA + 6,00%	1,72	13,57	4,83	8,88	17,26	29,10	40,32	55,45	69,18
INPC + 4,00%	1,48	12,02	4,29	8,08	15,49	25,80	34,17	45,08	53,62
INPC + 6,00%	1,63	13,79	4,79	9,12	17,69	30,64	42,02	56,50	68,89

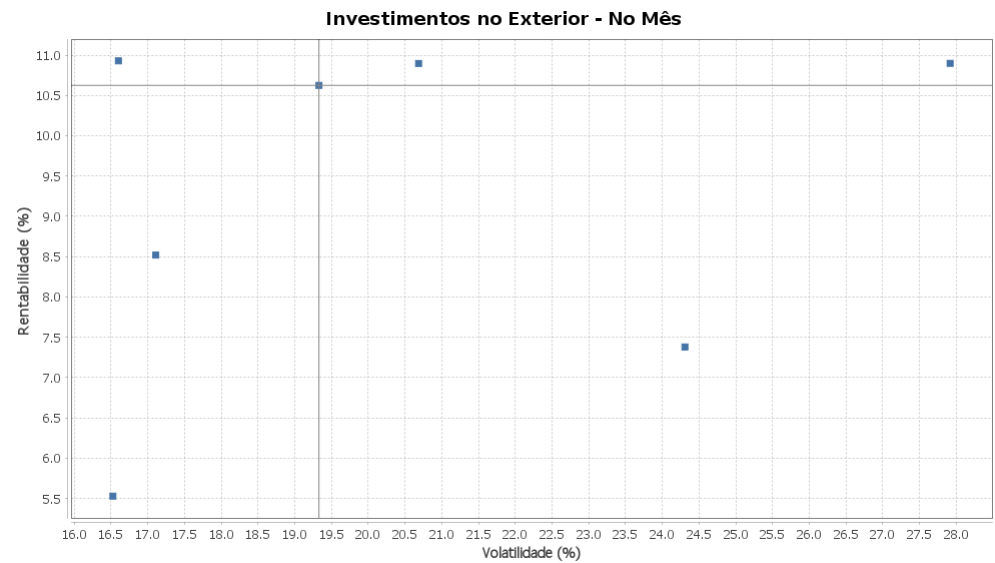
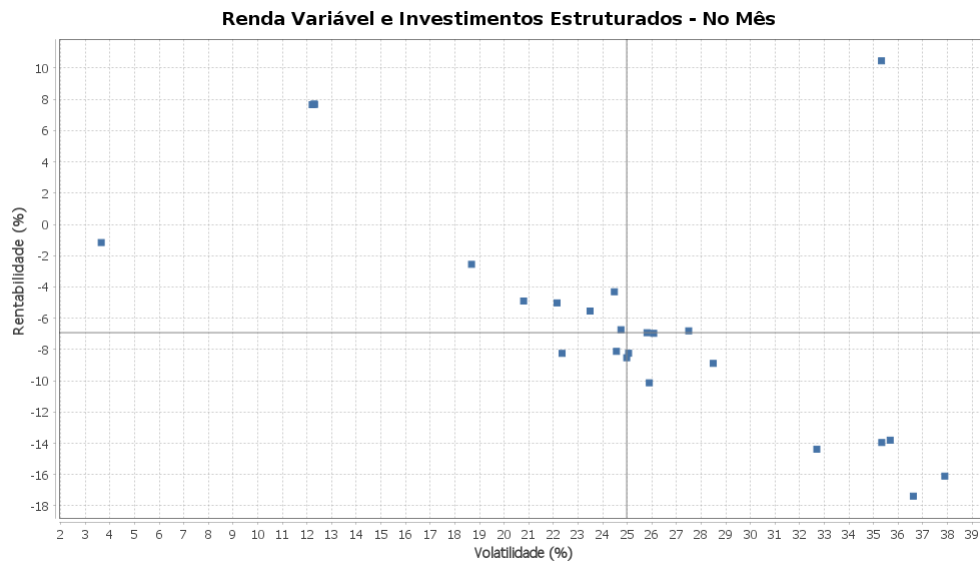
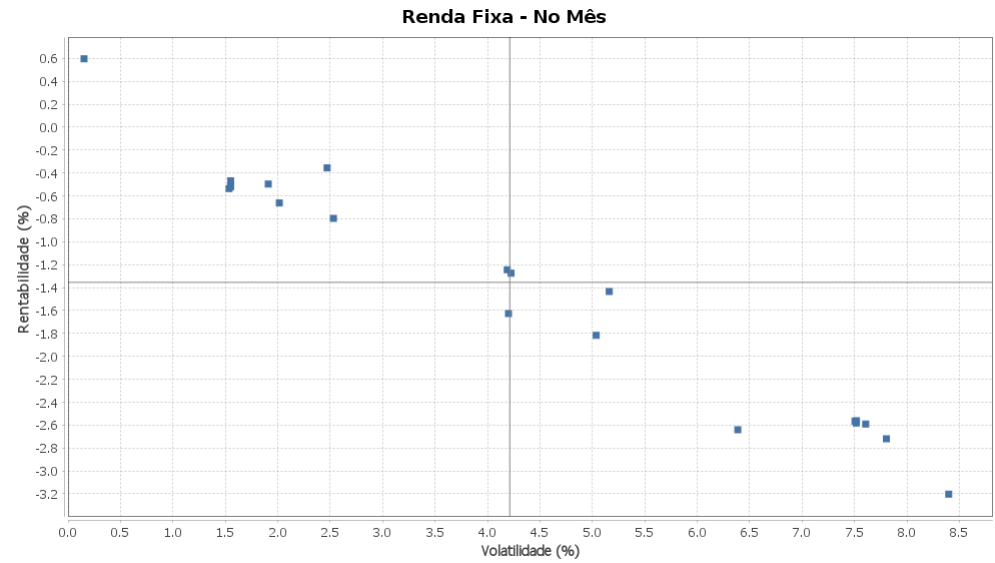
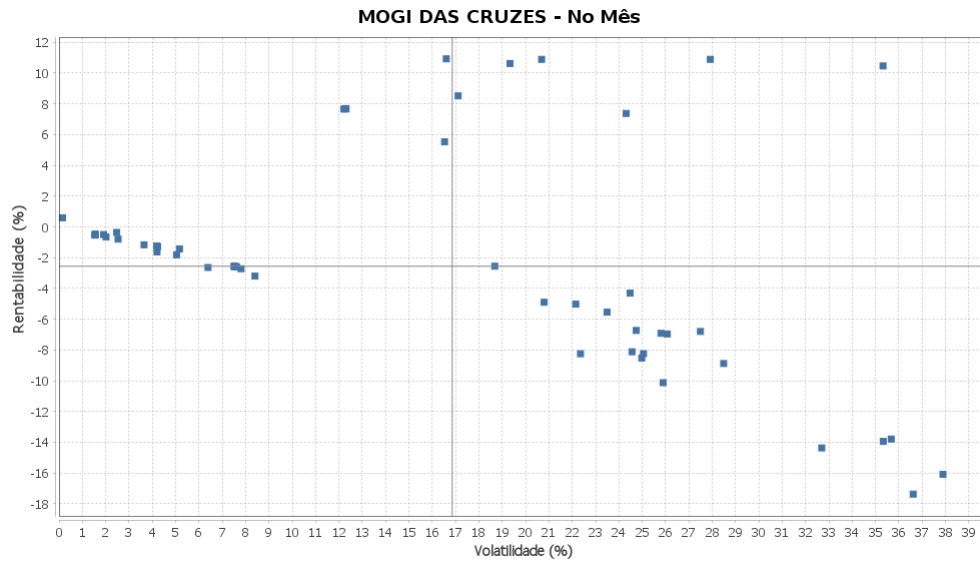
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
197	01/10/2021	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	519.000,00	0,00	24.539,02828000	21,1499817380
199	01/10/2021	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	347.000,00	0,00	91.165,54385920	3,8062626000
186	04/10/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	18.000,00	93,54713400	192,4163725000
189	04/10/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	931.230,69	4.839,66451500	192,4163725000
190	04/10/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	216.130,06	1.123,24155000	192,4163725000
191	04/10/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	2.116.639,25	11.000,30746200	192,4163725000
196	04/10/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	749.000,00	0,00	3.892,60014800	192,4163725000
193	08/10/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	749.000,00	3.887,67435200	192,6601696000
194	08/10/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	427.000,00	0,00	2.216,33771500	192,6601696000
195	08/10/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	5.132.000,00	0,00	26.637,57646800	192,6601696000
198	11/10/2021	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1.954.000,00	0,00	92.098,85794300	21,2163325760
187	15/10/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	52.000,00	269,62596700	192,8597633000
192	15/10/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	2.223.000,00	11.526,51005100	192,8597633000
200	15/10/2021	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	1.302.000,00	0,00	335.417,07541860	3,8817344000
188	25/10/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	19.000,00	98,32389600	193,2388849000
<b>Total</b>						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 18.074.003,11

Value-At-Risk: 2,45%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,15	0,04	-0,00	0,76	0,60	12.117.080,65	1,64
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,54	0,56	0,00	-0,66	-0,54	80.042,91	0,01
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,55	0,56	0,00	-0,61	-0,47	15.593,63	0,00
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,55	0,56	0,00	-0,64	-0,52	62.321,40	0,01
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,91	0,81	0,01	-0,51	-0,50	14.102.609,38	1,91
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,42	0,08	-0,57	-0,66	66.219.537,92	8,97
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	2,47	0,61	0,00	-0,34	-0,36	264.058,48	0,04
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,53	1,11	0,00	-0,50	-0,80	2.852.315,19	0,39
BRABESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	Artigo 8º III	3,64	1,32	0,00	-0,45	-1,16	516.885,44	0,07
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,19	1,44	0,09	-0,41	-1,24	67.078.618,16	9,08
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,20	1,64	0,09	-0,50	-1,63	55.554.564,37	7,52
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,22	1,44	0,02	-0,42	-1,27	16.174.654,75	2,19
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,04	2,19	0,14	-0,46	-1,82	66.574.512,10	9,02
XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP	Artigo 7º III, Alínea a	5,16	2,25	0,00	-0,37	-1,43	2.169.086,13	0,29
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,39	1,74	0,01	-0,49	-2,64	5.191.868,60	0,70
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	Artigo 7º I, Alínea b	7,50	2,75	0,05	-0,41	-2,56	20.086.283,05	2,72
BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	7,52	2,75	0,04	-0,41	-2,58	14.052.114,16	1,90
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,52	2,75	0,30	-0,40	-2,56	109.303.642,93	14,80
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	7,61	2,76	0,01	-0,40	-2,59	2.936.539,10	0,40
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	7,80	2,92	0,02	-0,41	-2,72	5.766.904,61	0,78
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	8,40	3,28	0,03	-0,44	-3,20	9.349.838,67	1,27
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	12,21	6,56	0,05	0,59	7,66	10.530.337,65	1,43
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	12,28	6,54	0,05	0,59	7,70	10.390.008,29	1,41
SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP	Artigo 8º III	12,30	6,52	0,01	0,58	7,67	3.145.359,03	0,43
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	16,53	6,07	0,02	0,31	5,53	6.065.565,92	0,82
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	16,60	6,69	-0,00	0,63	10,93	5.090.087,12	0,69
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	17,11	6,47	-0,00	0,47	8,52	4.807.148,72	0,65
TARPON GT 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	18,68	9,61	0,01	-0,16	-2,56	966.960,51	0,13

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	19,33	7,51	0,00	0,52	10,62	4.184.156,44	0,57
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	20,68	7,75	-0,01	0,50	10,90	17.282.907,60	2,34
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,79	9,27	0,01	-0,26	-4,90	1.403.315,19	0,19
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	22,15	9,80	0,05	-0,25	-5,02	4.796.664,59	0,65
XP INVESTOR 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,35	9,97	0,18	-0,39	-8,25	16.108.292,23	2,18
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,49	9,56	0,02	-0,26	-5,54	2.187.200,73	0,30
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	24,31	8,43	-0,04	0,28	7,38	30.995.630,37	4,20
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	24,48	9,50	0,11	-0,20	-4,31	10.666.279,51	1,44
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,56	9,05	0,01	-0,35	-8,12	1.327.697,25	0,18
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	Artigo 8º I, Alínea b	24,74	0,91	0,00	-0,29	-6,73	20.319.527,31	2,75
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	24,98	9,41	0,00	-0,36	-8,53	329.672,07	0,04
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	25,05	10,17	0,09	-0,35	-8,24	8.039.253,65	1,09
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	25,80	9,38	0,07	-0,29	-6,92	6.397.134,87	0,87
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	25,89	11,23	0,12	-0,41	-10,13	9.432.696,71	1,28
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	26,07	10,26	0,01	-0,29	-6,96	882.310,52	0,12
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	27,49	9,95	0,10	-0,26	-6,80	9.135.445,47	1,24
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	27,92	11,66	0,05	0,37	10,90	9.602.210,17	1,30
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	28,49	11,08	0,16	-0,33	-8,89	13.231.462,92	1,79
INDIE FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	32,69	12,89	0,18	-0,45	-14,37	11.964.096,16	1,62
IT NOW S&P 500 TRN FUNDO DE ÍNDICE	Artigo 8º I, Alínea b	35,32	0,76	-0,00	0,28	10,46	29.727.568,83	4,03
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	35,33	13,70	0,01	-0,41	-13,95	876.704,91	0,12
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	35,67	14,74	0,28	-0,40	-13,79	16.494.221,74	2,23
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	36,61	14,84	0,01	-0,49	-17,38	666.575,69	0,09
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	37,89	13,82	0,01	-0,44	-16,09	845.789,95	0,11

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

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

- O percentual alocado no segmento de Investimentos no Exterior, (10,57% dos recursos) está superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;