

Comitê de Investimentos

Ata nº 07/2022 – aos dezanove dias do mês de janeiro do ano de dois mil e vinte e dois, às 9 horas, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos, **Roberto Cassiano Guedes – Presidente do Comitê**, **Evanilson Fischer Matos Siqueira – Secretário do Comitê**, **Clayton Faria Schmidt**, **Patrícia Ramos Quaresma**, **Victor Mendes Neto** e o **Sr. Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade – Presidente do Instituto**. Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM mercedores de destaque, conforme Relatório Focus de 17/01/2022:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/12/2021 a 02/02/2022	2022	Elevação	7,75%	9,25%
Fonte: Banco Central do Brasil					

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2022	Estável	11,75	11,75
PIB	Mediana agregada	2022	Elevação	0,28	0,29
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2022	Estável	5,60	5,60
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2022	Elevação	5,03	5,09
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2022	Elevação	62,48	62,50
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2022	Elevação	-1,00	-0,96

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8190 d.u. - 2054)	Anbima – 18/01/2022	2022	Redução	5,8535	5,8434
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2052)	Anbima – 18/01/2022	2022	Redução	5,8463	5,8364
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2042)	Anbima – 18/01/2022	2022	Redução	5,7991	5,7913
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2032)	Anbima – 18/01/2022	2022	Redução	5,6658	5,6605
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2027)	Anbima – 18/01/2022	2022	Redução	5,5335	5,5146
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2024)	Anbima – 18/01/2022	2022	Elevação	5,7209	5,7612

Ibovespa	18/01/2022	2022	Elevação	103.779	106.668
Risco Brasil (JP Morgan)	17/01/2022	2022	Elevação	335	336
Fonte: Banco Central do Brasil; Anbima; BM&F; J P Morgan.					

Posição dos Investimentos	Novembro/21-Dezembro/21	2021	em Mil	Fechamento Novembro	Fechamento Dezembro
				624.839	634.860

A meta SELIC aponta para 11,75% ao final de 2022 conforme último Boletim FOCUS, com projeção de inflação medida pelo IPCA chegando a 5,09% no exercício. Mantem-se expectativa de que uma elevação mais significativa nas curvas de juros poderá ocorrer em função de reavaliação da trajetória da dívida pública atualmente suavizada em razão do incremento das receitas causado pelo ciclo inflacionário, e eventualmente por conta de expectativas relacionadas a possíveis elevações nas taxas de juros praticadas pelos bancos

centrais das principais economias mundiais para fazer frente a uma inflação elevada mundialmente, se os efeitos permanecerem duradouros. Registra-se a operação bem sucedida para a aquisição de Títulos Públicos realizada no dia 13 de janeiro do corrente ano e com dados constantes em ata 06/2022. Considerando previsão de meta atuarial informada pela Consultoria Atuarial contratada em IPCA + 4,99% para vigor em 2022, o Comitê registra que em razão da reunião mensal do Conselho Administrativo a realizar-se no dia de amanhã, não haverá operação para aquisição de Títulos Públicos Federais. Será mantido monitoramento das condições de mercado objetivando adquirir NTNBS, com preferência pelos vencimentos 2040, 2045, 2050 e 2055 com a escolha adotando como uma das referências o último estudo de ALM disponível e condições de mercado em montante total a ser definido futuramente. Esta última semana a ETTJ apresentou redução em todos os vértices monitorados, exceto no vértice 504 d.u., com impacto patrimonial positivo na carteira de renda fixa em razão da marcação a mercado desconsideradas as movimentações decorrentes da execução orçamentária em posição financeira e patrimonial fechado em 14/01/2022. O risco Brasil teve elevação; no IBOVESPA houve elevação para 106.668 pontos; o segmento de renda variável apresentou variação patrimonial positiva. Foi apresentado o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 14/01/2022 com o patrimônio de R\$ 634.723M e relatório mensal referente a dezembro/2021 com o patrimônio de 634.860M. Foram emitidas as seguintes APRs.

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
008/2022	14/01/2022	100.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
009/2022	18/01/2022	77.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:00 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

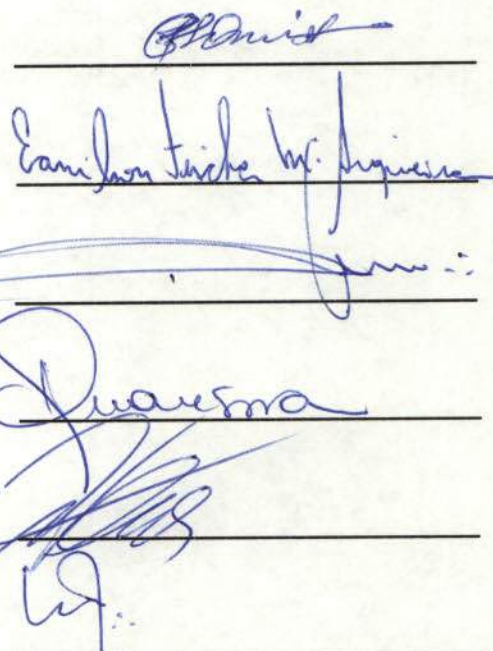
Evanilson Fischer Matos Siqueira

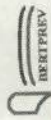
Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade





Relatório de Investimentos

DEZEMBRO 2021

CNPJ	Fundo	Patrimônio	% PL	CMV Limite % Res. 3922/10	Limite % Pré-Gestão	Saldo Dez/20 Evolução PL	R\$ 632.604.044,97 R\$ 2.256.334,83	9,90% 0,36%
				Res. 4604/17 Res. 4695/18	Nível II	Evolução PL Acumulada Saldo Anterior		1,49%
						Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)	Enquadramento
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	634.860.379,80	100,0%					
	(*) CONTA TRANSITÓRIA		0,000%					
	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	161.621.639,70	25,46%					Artigo 7, inciso I, Alínea A
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	161.621.639,70	25,46%					Artigo 7, inciso I, Alínea B
	Fundos de Investimentos 100% Títulos Públicos	65.487.728,67	10,32%					
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.744.483,38	2,638%					
19.523.305/0001-06	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.900.499,01	0,929%					
19.769.046/0001-06	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	16.507.523,20	2,600%					
22.791.074/0001-26	FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.121.244,00	3,169%					
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	6.213.979,08	0,979%					
	Fundos Renda Fixa em geral	213.605.559,65	33,65%					Artigo 7, inciso IV, Alínea A
09.577.447/0001-00	SANTANDER RF REF DI TP PREMIUM FIC FI	107.349.801,92	16,909%					
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	106.255.757,73	16,737%					
	FI Renda Fixa "Crédito Privado"	4.322.698,03	0,68%					Artigo 7, inciso VII, Alínea B
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.322.698,03	0,68%					
	RENDA FIXA - SUB TOTAL	445.037.626,05	70,10%					
	Fundos de Investimentos de Ações em geral	126.312.438,26	19,90%					Artigo 8, inciso II, Alínea A
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	18.347.233,70	2,890%					
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	18.431.541,49	2,903%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	6.397.520,58	1,008%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	35.487.353,26	5,590%					
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	37.216.953,22	5,862%					
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	6.847.677,73	1,079%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FIC EM AÇÕES	3.584.158,28	0,565%					Artigo 8, inciso IV, Alínea A
	FI em Participações - Fechado - (Investimentos Estruturado	24.113.053,25	3,80%					
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	4.983.680,52	0,785%					
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRAT	19.129.372,73	3,013%					
	Fundos de Investimentos no Exterior	27.234.535,63	4,29%					Artigo 9 A, inciso II
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIOR	10.520.477,06	1,657%					
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	11.030.985,96	1,738%					
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	5.683.072,61	0,895%					
	Fundos de Investimentos no Exterior	12.162.726,61	1,92%					Artigo 9 A, inciso III
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	6.047.137,79	0,953%					
17.502.937/0001-68	FI CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	6.115.588,82	0,963%					
	RENDA VARIÁVEL - SUB TOTAL	189.822.753,75	29,90%					

José Ferreira Melo Filho
Reg. 087 - BERTPREV

Coordenador Administrativo Financeiro



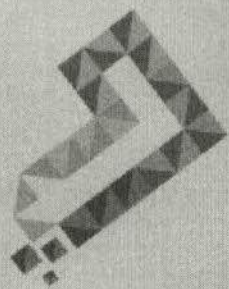
Relatório de Investimentos - Semanal

19/01/2022

CNPJ	Fundo	Posição 06/01/2022	Posição 14/01/2022	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 4922/10 Res. 4604/17 Res. 4695/18	Limite % Pro-Gestão Nível II	Saldo Dez/20 Evolução PL	Res. 632.604.044,97 Res. 2.119.120,36	Unidade Superior (N)	Unidade Superior (N)	Emparelhamento
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	627.425.232,12	634.723.165,33	1,16%	100,0%							
	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%							
	Títulos Públicos Federais	228.903.603,61	303.893.414,14	32,76%	47,88%							
CP 0184	Fundos 100% Títulos Públicos	65.202.219,34	65.326.820,29	0,19%	10,29%							
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.753.969,88	16.783.335,21	0,18%	2,644%							
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.917.721,33	5.931.189,37	0,23%	0,934%							
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.277.992,40	16.282.325,60	0,03%	2,565%							
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.033.975,00	20.095.738,00	0,31%	3,166%							
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.218.560,73	6.234.232,11	0,25%	0,982%							
	Fundos Referenciados Renda Fixa	146.515.572,51	74.683.329,80	-49,03%	11,77%							
09.577.447/0001-00	SANTANDER DI TÍTULOS PUBL PREMIUM*	40.248.062,83	43.207.378,09	7,35%	6,807%							
21.838.150/0001-49	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	106.267.509,68	31.475.951,71	-70,38%	4,959%							
	FI Renda Fixa Crédito Privado	4.303.747,46	4.318.121,72	0,33%	0,68%							
14.091.645/0001-91	(I)BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.303.747,46	4.318.121,72	0,33%	0,680%							
	RENDIA FIXA - SUB TOTAL	444.925.142,92	448.221.685,95	0,74%	70,62%							
	Fundos de Investimentos em Ações	119.468.408,22	125.035.800,30	4,66%	19,70%							
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	17.795.759,02	18.669.854,58	4,91%	2,941%							
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	17.367.311,92	17.917.016,35	3,17%	2,823%							
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	6.029.896,01	6.380.910,64	5,82%	1,005%							
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	32.751.461,32	34.174.723,44	4,35%	5,384%							
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	35.554.490,96	37.440.618,38	5,30%	5,899%							
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	6.503.199,92	6.848.117,03	5,30%	1,079%							
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FIC EM AÇÕES	3.466.289,07	3.604.559,88	3,99%	0,568%							
	Fundos de Investimento em Participações	24.113.053,25	24.113.053,25	0,00%	3,80%							
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	4.983.680,52	4.983.680,52	0,00%	0,785%							
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP M	19.129.372,73	19.129.372,73	0,00%	3,014%							
	Fundos de Investimentos no Exterior	26.812.314,43	25.694.198,43	-4,17%	4,05%							
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIO	10.097.429,72	9.563.342,09	-5,29%	1,507%							
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	10.996.028,40	10.618.538,61	-3,43%	1,673%							
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR F	5.718.856,31	5.512.317,73	-3,61%	0,868%							
	Fundos de Investimentos no Exterior	12.106.313,30	11.658.427,40	-3,70%	1,84%							
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	5.967.148,88	5.693.370,49	-4,59%	0,897%							
17.502.937/0001-68	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	6.139.164,42	5.965.056,91	-2,84%	0,940%							
	RENDIA VARIÁVEL - SUB TOTAL	182.500.089,20	186.501.479,38	2,19%	29,38%							

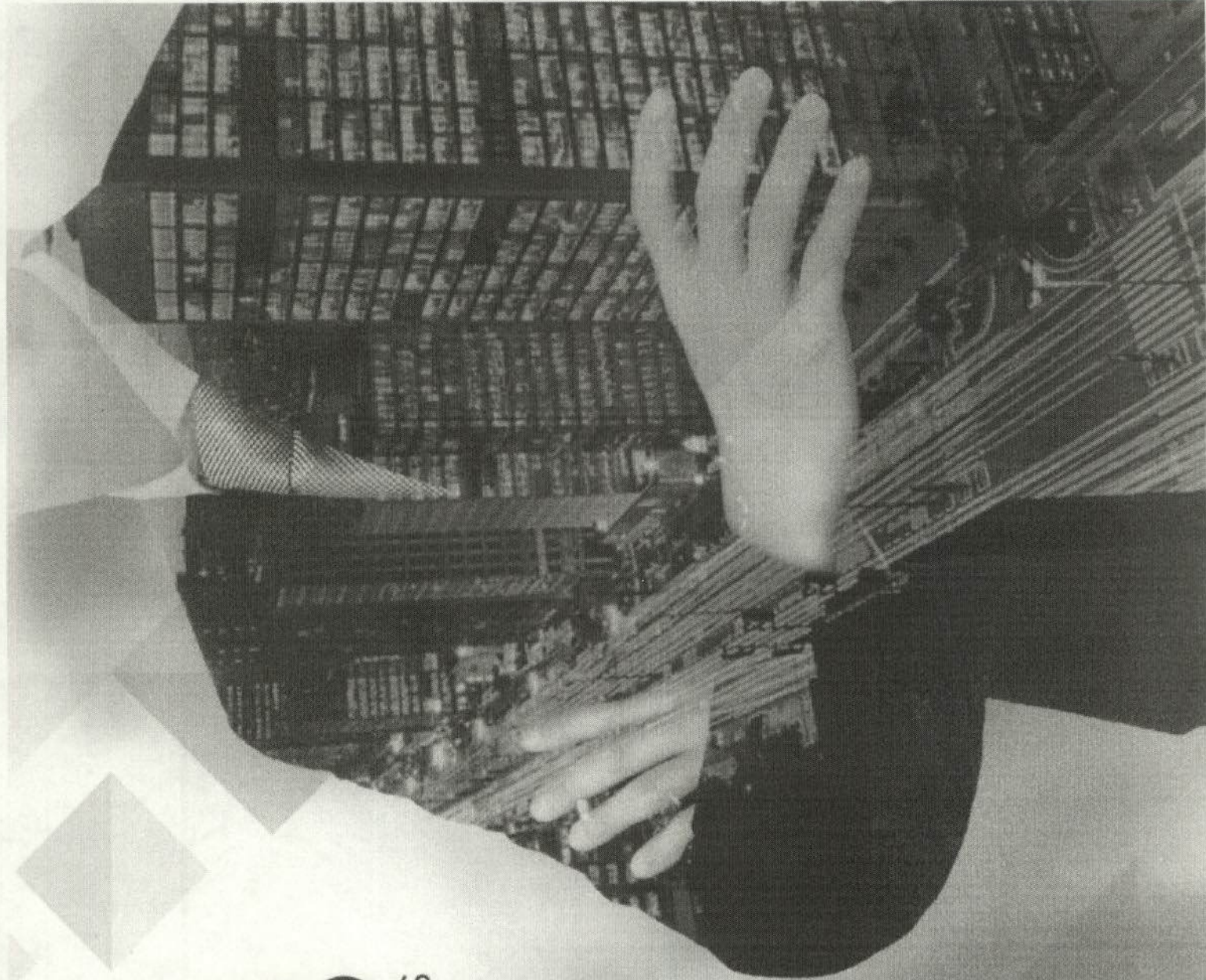
(*) ANTIGO SANTANDER FIC FI SOBRANO RF REF DI

José Ferreira Melo Filho
Rep. 007 - BERTPREV
Coordenador Administrativo Financeiro



LDB
EMPRESAS

BERTIOGA
DEZEMBRO 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 31.12.2021.

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	70,10%
------------	--------

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535	8,84	0,16	-5,19	108.415.122,03	17,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	3,84	0,87	3,19	10.529.426,46	1,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	10,82	-0,85	-9,41	11.547.391,43	1,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	9,80	-1,41	-7,59	8.716.925,59	1,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	2,63	0,57	4,64	22.412.774,21	3,53
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		7,62	0,10	-3,88	161.621.639,72	25,46

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 IPCA	2,63	0,55	4,44	16.744.483,38	2,64	347.953.592,87	4,81
BB	BB	BB PREV RF VII	1,63	0,58	6,57	5.900.499,01	0,93	248.037.532,98	2,38
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	6,96	0,68	-2,85	16.507.523,20	2,60	66.053.892,41	24,99
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	3,83	0,85	2,94	20.121.244,00	3,17	218.489.919,55	9,21
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	2,11	0,66	5,47	6.213.979,08	0,98	588.575.447,75	1,06
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,49	0,69	2,19	65.487.728,67	10,32		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	1,10	0,86	4,53	106.255.757,73	16,74	2.626.754.965,66	4,05
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,14	0,75	4,33	107.349.801,92	16,91	4.572.328.960,89	2,35
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,00	0,80	3,35	213.605.559,65	33,65		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3,28	0,85	4,08	4.322.698,03	0,68	619.522.449,09	0,70
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			3,28	0,85	4,08	4.322.698,03	0,68		
Renda Fixa			3,89	0,54	0,31	445.037.626,07	70,10		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

23,69%

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
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	18,83	2,20	-16,49	18.347.233,70	2,89	402.367.291,52	4,56
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	19,14	0,73	-19,00	6.397.520,58	1,01	87.352.824,95	7,32
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVSPA ATIVO FICFI	20,34	1,88	-16,64	37.216.953,22	5,86	723.867.535,77	5,14
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	19,16	2,31	-9,66	18.431.541,49	2,90	1.378.837.386,58	1,34
WESTERN	BNP PARIBAS	WA ASSET VALUATION FIA	21,28	0,74	-26,33	6.847.677,73	1,08	83.153.601,75	8,23
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	23,88	-0,69	-31,79	35.487.353,26	5,59	1.896.702.011,80	1,87
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,72	-0,32	-10,50	3.584.158,28	0,56	924.501.793,20	0,39
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			20,05	1,07	-21,17	126.312.438,26	19,90		

Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
KINEA	KINEA	FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	1,13	-0,07	-1,12	4.983.680,52	0,79	35.384.131,82	14,08
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	71,84	-1,14	22,75	19.129.372,73	3,01	305.113.505,96	6,27
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			54,67	-0,62	17,01	24.113.053,25	3,80		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			18,94	0,93	-16,88	150.425.491,51	23,69		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,21%

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
BB	BB	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	17,06	2,80	20,86	5.683.072,61	0,90	870.371.049,74	0,65
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21,30	-2,60	5,20	10.520.477,06	1,66	1.410.026.256,25	0,75
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16,28	0,89	10,31	11.030.985,96	1,74	2.180.881.081,62	0,51
Sub-total Artigo 9º A, II			15,63	-0,11	8,92	27.234.535,63	4,29		

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	17,57	1,70	22,31	6.115.588,82	0,96	3.890.658.229,39	0,16
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	17,53	3,45	20,94	6.047.137,79	0,95	3.983.843.860,12	0,15
Sub-total Artigo 9º A, III			15,33	2,56	20,23	12.162.726,61	1,92		
Investimentos no Exterior			14,86	0,70	11,97	39.397.262,24	6,21		
Total			6,42	0,65	-3,75	634.860.379,82	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos									Pró-Gestão Nível 2
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal	
Renda Fixa									
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	161.621.639,72	25,46	10,00	25,80	100,00	0,00	100,00	
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	65.487.728,67	10,32	10,00	10,50	100,00	0,00	100,00	
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	213.605.559,65	33,65	0,00	32,90	50,00	0,00	50,00	
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	4.322.698,03	0,68	0,00	0,70	15,00	0,00	15,00	
Total Renda Fixa		445.037.626,07	70,10						100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados									
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	126.312.438,26	19,90	0,00	20,00	30,00	0,00	30,00	
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	24.113.053,25	3,80	0,00	3,80	5,00	0,00	5,00	
Total Renda Variável e Investimentos Estruturados		150.425.491,51	23,69						40,00
Investimentos no Exterior									
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	27.234.535,63	4,29	0,00	4,30	10,00	0,00	10,00	
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	12.162.726,61	1,92	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00	
Total Investimentos no Exterior		39.397.262,24	6,21						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, Alinea a % do CDI	0,10 13,47	-3,88 -88,35	1,09 59,01	-2,05 -66,43	-3,88 -88,35	166.112,94	-6.903.582,55
Artigo 7º I, Alinea b % do CDI	0,69 90,22	2,19 -49,78	1,90 103,17	2,39 77,52	2,19 49,78	448.063,99	1.001.025,55
Artigo 7º IV, Alinea a % do CDI	0,80 105,39	3,35 76,27	1,87 101,72	2,72 88,06	3,35 76,27	1.691.923,39	6.632.125,75
Artigo 7º VII, Alinea b % do CDI	0,85 111,75	4,08 92,72	2,32 126,00	3,40 110,08	4,08 92,72	36.573,55	169.267,71
Artigo 8º II, Alinea a Var. IBOVESPA p.p.	1,07 -1,78	-21,17 -9,25	-12,45 -6,90	-25,84 -8,50	-21,17 -9,25	1.337.675,72	-33.927.935,34
Artigo 8º IV, Alinea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,62 -3,47	17,01 28,93	-1,56 3,99	-3,96 13,37	17,01 28,93	59.932,74	3.556.461,72
Artigo 9º A, II % do CDI	-0,11 -13,89	8,92 244,79	5,27 286,25	11,97 387,59	-28,916,96	2.469.655,30	
Artigo 9º A, III % do CDI	2,56 335,84	20,23 592,25	12,15 659,95	20,81 674,13	304.093,60	2.162.726,61	
BERTIOGA (Total)						4.015.458,97	-24.840.255,25

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alinea a	Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	NTN-B 150523	22.285.391,98	0,00	0,00	0,00	22.412.774,21	127.382,23	1.022.314,17
	NTN-B 150535	108.243.265,91	0,00	0,00	0,00	108.415.122,03	171.856,12	-6.276.360,37
	NTN-B 150545	8.841.548,71	0,00	0,00	0,00	8.716.925,59	-124.623,12	-742.149,80
	NTN-B 150824	10.438.455,13	0,00	0,00	0,00	10.529.426,46	90.971,33	323.900,19
	NTN-B 150850	11.646.865,05	0,00	0,00	0,00	11.547.391,43	-99.473,62	-1.231.286,74
Artigo 7º I, Alinea b						161.621.639,72	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IPCA	16.652.237,03	0,00	0,00	0,00	16.744.483,38	92.246,35	731.148,78
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	6.173.012,14	0,00	0,00	0,00	6.213.979,08	40.966,94	325.768,89
BB PREV RF VII	5.866.317,11	0,00	0,00	0,00	5.900.499,01	34.181,90	369.484,93
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	19.951.932,00	0,00	0,00	0,00	20.121.244,00	169.312,00	570.496,84
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	16.396.166,40	0,00	0,00	0,00	16.507.523,20	111.356,80	-516.461,23
					65.487.728,67	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	105.348.935,22	0,00	0,00	0,00	106.255.757,73	906.822,51	4.604.302,79
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	101.560.285,04	8.075.000,00	-3.070.584,00	0,00	107.349.801,92	785.100,88	2.645.254,66
					213.605.559,65	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.286.124,48	0,00	0,00	0,00	4.322.698,03	36.573,55	169.267,71
					4.322.698,03	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST ACOES FIC FIA	17.953.075,68	0,00	0,00	0,00	18.347.233,70	394.158,02	-3.623.081,77
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	18.014.589,97	0,00	0,00	0,00	18.431.541,49	416.951,52	-1.971.048,75
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	35.732.262,62	0,00	0,00	0,00	35.487.353,26	-244.909,36	-16.536.889,50
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	6.351.285,80	0,00	0,00	0,00	6.397.520,58	46.234,78	-1.500.530,43
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	3.595.813,21	0,00	0,00	0,00	3.584.158,28	-11.654,93	-420.473,75
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	36.530.368,24	0,00	0,00	0,00	37.216.953,22	686.584,98	-7.428.007,16
WA ASSET VALUATION FIA	6.797.367,02	0,00	0,00	0,00	6.847.677,73	50.310,71	-2.447.903,98
					126.312.438,26	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	4.987.118,04	0,00	0,00	0,00	4.983.680,52	-3.437,52	-56.595,90
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	18.065.418,47	1.000.584,00	0,00	0,00	19.129.372,73	63.370,26	3.613.057,62
					24.113.053,25	0,00	0,00

Artigo 9º A, II

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	5.528.523,42	0,00	0,00	0,00	5.683.072,61	154.549,19	918.192,28
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	10.800.906,55	0,00	0,00	0,00	10.520.477,06	-280.429,49	520.477,06
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	10.934.022,62	0,00	0,00	0,00	11.030.985,96	96.963,34	1.030.985,96
					27.234.535,63	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	6.013.202,62	0,00	0,00	0,00	6.115.588,82	102.386,20	1.115.588,82
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	5.845.430,39	0,00	0,00	0,00	6.047.137,79	201.707,40	1.047.137,79
					12.162.726,61	0,00	0,00

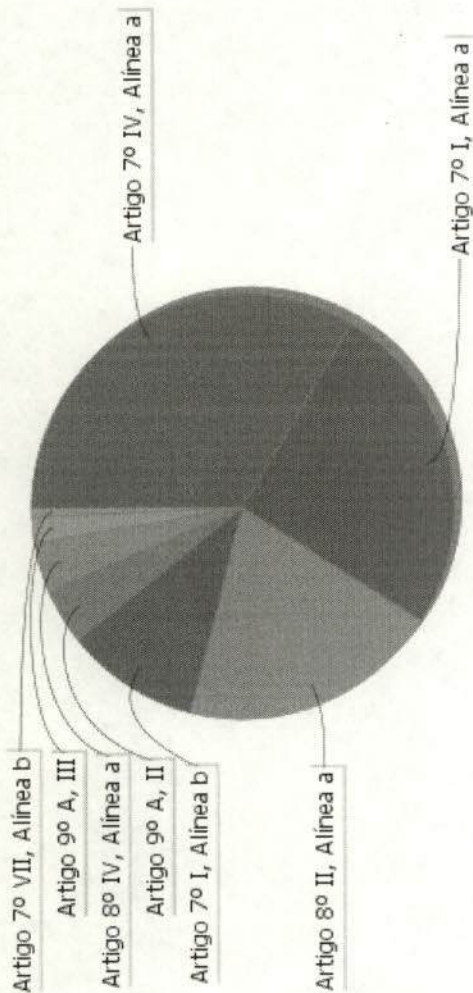
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	361.734.952,33	56,98	361.734.952,33	56,98
de 31 a 365 dias	44.972.010,55	7,08	406.706.962,88	64,06
acima de 365 dias	228.153.416,94	35,94	634.860.379,82	100,00

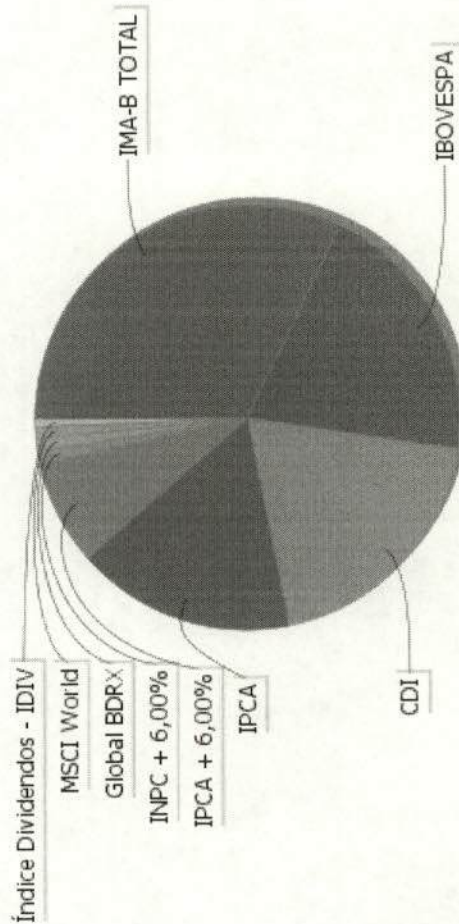
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



- Artigo 7º IV, Alínea a: 33,64%
- Artigo 7º I, Alínea a: 25,45%
- Artigo 8º II, Alínea a: 19,90%
- Artigo 7º I, Alínea b: 10,32%
- Artigo 9º A, II: 4,29%
- Artigo 8º IV, Alínea a: 3,80%
- Artigo 9º A, III: 1,92%
- Artigo 7º VII, Alínea b: 0,68%

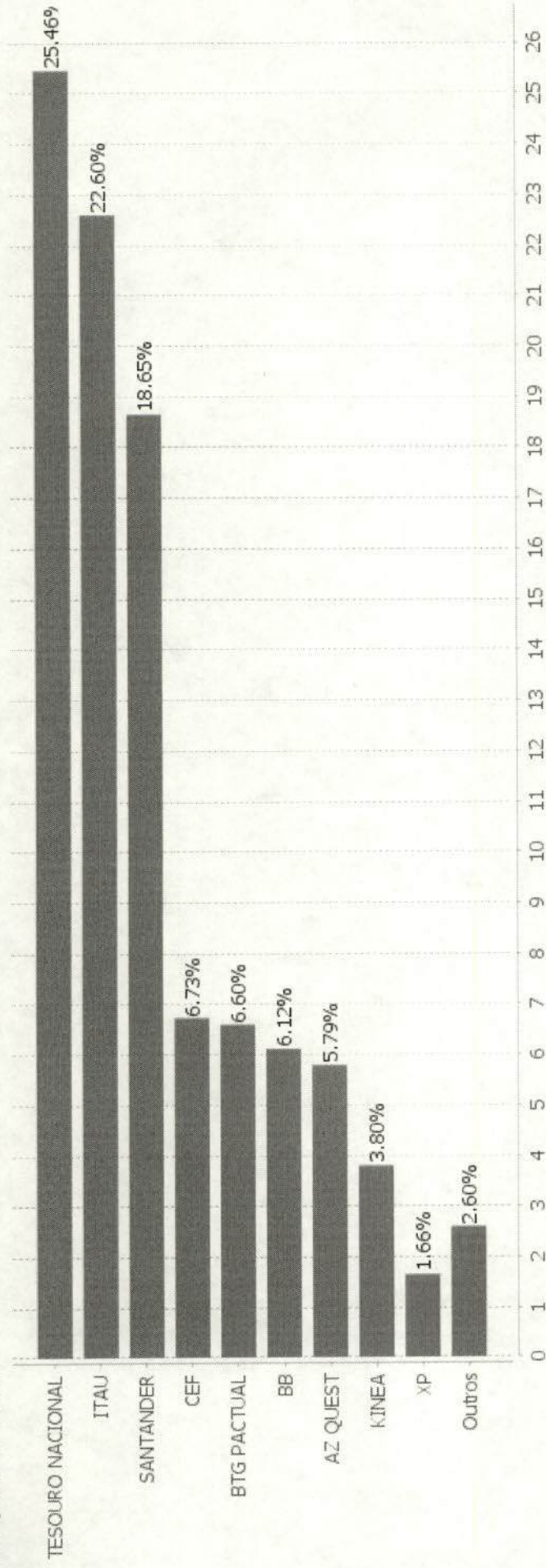
Alocação Por Estratégia



- IMA-B TOTAL: 32,16%
- IBOVESPA: 20,28%
- CDI: 19,43%
- IPCA: 16,74%
- IPCA + 6,00%: 7,99%
- INPC + 6,00%: 0,98%
- Global BDRX: 0,96%
- MSCI World: 0,90%
- Índice Dividendos - IDIV: 0,56%

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													
IPCA + 5,46%	-0,82	-0,86	0,46	1,08	1,44	0,49	-1,18	-1,50	-1,56	-2,74	0,82	0,65	-3,75
p.p. indexador	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,98	1,43	1,34	1,61	1,68	1,38	1,22	16,05
	-1,49	-2,11	-0,96	0,35	0,17	-0,48	-2,61	-2,84	-3,17	-4,41	-0,56	-0,57	-19,79
2020													
IPCA + 5,89%	0,98	-1,02	-11,57	3,30	2,82	3,36	4,26	-1,37	-1,94	-0,52	3,57	4,22	5,06
p.p. indexador	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,65
	0,27	-1,68	-12,15	3,15	2,75	2,62	3,37	-2,09	-3,06	-1,87	2,22	2,36	-5,59
2019													
IPCA + 6,00%	4,65	-0,50	0,16	1,38	2,73	3,38	1,58	0,31	1,87	2,49	-0,78	2,81	21,87
p.p. indexador	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
	3,82	-1,39	-1,04	0,32	2,09	2,93	0,86	-0,31	1,42	1,86	-1,76	1,17	11,28
2018													
IPCA + 6,00%	4,47	0,74	0,98	-0,04	-4,30	-1,08	2,86	-1,15	0,17	6,78	0,37	1,36	11,27
p.p. indexador	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
	3,67	-0,00	0,40	-0,75	-5,19	-2,83	2,02	-1,60	-0,75	5,82	0,11	0,75	1,35
2017													
IPCA + 6,00%	2,46	3,79	0,60	-0,18	-1,48	0,41	6,44	2,39	2,45	-0,71	-1,44	1,85	17,56
p.p. indexador	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
	1,57	3,04	-0,19	-0,74	-2,30	0,16	5,71	1,67	1,83	-1,62	-2,18	0,95	8,52

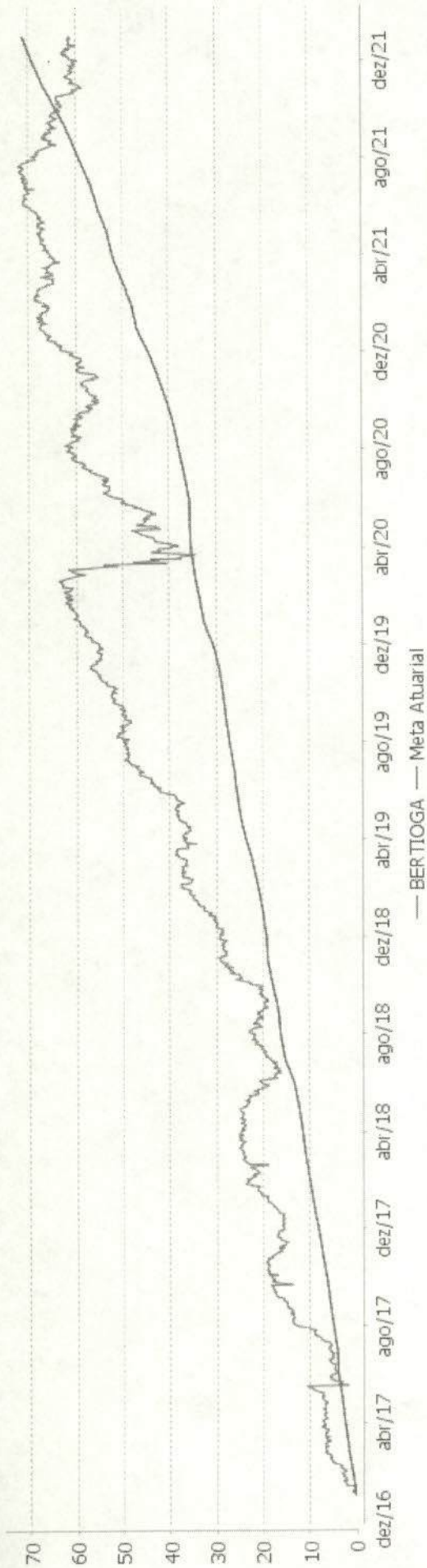
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

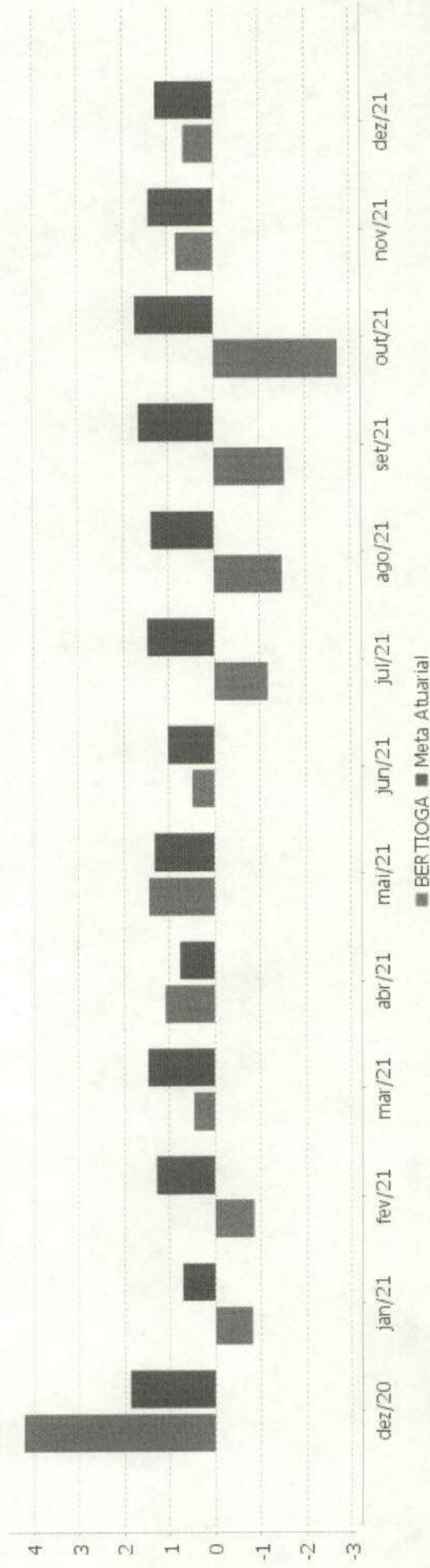
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	30	50,00	03 meses	-1,30	4,34	-5,64	6,68
Meses abaixo - Meta Atuarial	30	50,00	06 meses	-5,43	8,97	-14,40	6,46
			12 meses	-3,75	16,05	-19,79	6,42
		Mês	24 meses	1,12	28,40	-27,28	11,58
			36 meses	23,23	42,00	-18,77	10,03
			48 meses	37,12	56,09	-18,97	9,69
			60 meses	61,20	70,21	-9,01	10,11
			Desde 30/12/2016	61,20	70,21	-9,01	10,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Variação da Estratégia							
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	0,85	4,08	2,32	3,40	4,08	12,36	26,07
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,41	-12,56	-2,15	-5,86	-12,56	-16,83	-16,80
NTN-B 150545	-1,41	-7,59	-1,44	-6,06	-7,59	-4,01	28,20
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,63	-6,33	-2,50	-5,52	-6,33	-9,07	-0,98
NTN-B 150824	0,87	3,19	2,09	2,93	3,19	12,50	32,50
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,65	4,46	1,03	3,48	4,46	7,44	3,33
NTN-B 150850	-0,85	-9,41	-1,38	-6,75	-9,41	-7,01	26,93
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,08	-8,15	-2,44	-6,20	-8,15	-12,07	-2,25
NTN-B 150535	0,16	-5,19	1,36	-2,66	-5,19	2,93	32,17
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,07	-3,93	0,30	-2,11	-3,93	-2,13	3,00
NTN-B 150523	-0,57	4,64	1,58	3,07	4,64	13,92	32,09
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,35	5,91	0,52	3,62	5,91	8,86	2,92
BB PREV RF VII	0,58	6,57	1,82	4,29	6,57	12,55	24,32
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,36	7,83	0,76	4,83	7,83	7,49	-4,85
BB PREV RF IPCA	0,55	4,44	1,53	2,97	4,44	13,48	31,32
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,71	-12,20	-2,94	-6,28	-12,20	-15,71	-11,56
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	0,68	-2,85	2,15	0,16	-2,85	6,20	30,84
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,45	-1,59	1,09	0,71	-1,59	1,14	1,66
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,66	5,47	1,89	3,84	5,47	12,76	27,06
Var. INPC + 6,00% p.p.	-0,60	-11,28	-2,38	-5,31	-11,28	-17,70	-17,46
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	0,85	2,94	2,03	2,80	2,94	11,93	31,52
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,62	4,20	0,97	3,34	4,20	6,87	2,35
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	0,86	4,53	2,16	3,49	4,53	7,52	20,33
Var. IPCA p.p.	0,13	-5,53	-0,80	-2,58	-5,53	-7,51	0,34
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,75	4,33	1,84	3,12	4,33	6,76	
% do CDI	97,98	98,62	100,03	100,97	98,62	92,86	
WA ASSET VALUATION FIA	0,74	-26,33	-13,82	-28,30	-26,33	-25,12	-0,38
Var. IBOVESPA p.p.	-2,11	-14,41	-8,27	-10,97	-14,41	-15,76	-19,64
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-0,69	-31,79	-19,45	-34,71	-31,79	-26,41	2,46
Var. IBOVESPA p.p.	-3,54	-19,86	-13,90	-17,37	-19,86	-17,06	-16,81
AZ QUEST ACOES FIC FIA	2,20	-16,49	-9,71	-22,47	-16,49	-19,72	3,24
Var. IBOVESPA p.p.	-0,66	-4,56	-4,16	-5,14	-4,56	-10,36	-16,03
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-0,32	-10,50	-3,49	-13,76	-10,50	-7,77	31,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Variação da Estratégia							
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,93	-4,09	-1,66	-5,46	-4,09	-0,42	-3,46
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA							
Var. IBOVESPA p.p.	2,31	-9,66	-8,26	-20,26	-9,66	-12,51	30,94
	-0,54	2,27	-2,71	-2,92	2,27	-3,16	11,67
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI							
Var. IBOVESPA p.p.	1,88	-16,64	-8,98	-21,40	-16,64	-14,85	14,99
	-0,97	-4,71	-3,44	-4,07	-4,71	-5,49	-4,28
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES							
Var. IBOVESPA p.p.	0,73	-19,00	-11,81	-21,31	-19,00	-20,41	8,71
	-2,12	-7,07	-6,26	-3,98	-7,07	-11,05	-10,56
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME							
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,14	22,75	-2,08	-5,07	22,75	38,74	85,59
	-2,41	6,11	-6,55	-14,32	6,11	9,55	42,72
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..							
% do CDI	-0,07	-1,12	-1,01	-1,14	-1,12	-11,96	-35,08
	-9,03	-25,55	-54,57	-36,78	-25,55	-164,23	-256,27
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I							
Var. Global BDRX p.p.	1,70	30,51	11,81	20,44	30,51	101,98	171,58
	-0,01	-3,14	-0,48	-0,99	-3,14	-3,86	-7,67
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB							
Var. IBOVESPA p.p.	3,45	33,92	12,50	21,19	33,92	93,45	165,70
	0,60	45,85	18,05	38,52	45,85	102,81	146,43
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI							
Var. MSCI World p.p.	2,80	31,21	9,85	20,58	31,21		
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR							
% do CDI	0,89	23,65	6,63	15,15	23,65	99,50	
	116,14	538,19	359,92	490,83	538,19	1.365,97	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR							
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-2,60	7,25	1,63	4,93	7,25	105,18	
	-3,86	-9,39	-2,84	-4,32	-9,39	75,99	
BERTIOGA							
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,65	-3,75	-1,30	-5,43	-3,75	1,12	23,23
	-0,62	-20,39	-5,77	-14,68	-20,39	-28,07	-19,64
CDI							
	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69
IBOVESPA							
	2,85	-11,93	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27
INPC + 6,00%							
	1,27	16,74	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52
IPCA + 6,00%							
	1,27	16,64	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AZ QUEST ACOES FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	20.0000000000000000 Para informações adicionais, vide o Regulamento	2,00
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	20.0000000000000000	2,00
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du	0,00	0,07
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)	0,00	0,20
BB PREV RF IPCA	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,15
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BB PREV RF VII	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
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)	0,00	3,00
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	2,50
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	0,70
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du	0,00	1,72
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	Não se aplica	Não se aplica				
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	D+1 du	D+0	D+2 du	D+4 du	0,00	1,50
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,40
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	Não se aplica	Não se aplica				
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du	0,00	0,80
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	0,00	1,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+8 du	0,00	1,00
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
WA ASSET VALUATION FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	2,50

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	0,88	2,93	1,13	2,10	2,93	6,88	14,10	22,06	35,63
IRF-M 1+	2,29	-4,99	0,93	-1,74	-4,99	3,04	17,72	32,16	54,19
IRF-M TOTAL	1,89	-1,99	0,98	-0,42	-1,99	4,57	17,15	29,72	49,44
IMA-B 5	0,79	4,57	2,03	3,24	4,57	12,97	27,83	40,44	58,11
IMA-B 5+	-0,34	-6,55	0,09	-4,11	-6,55	-1,41	28,53	48,33	67,24
IMA-B TOTAL	0,22	-1,26	1,06	-0,55	-1,26	5,06	29,17	46,04	64,72
IMA-GERAL TOTAL	0,87	0,96	1,34	0,82	0,96	6,35	19,98	32,02	48,95
IDKA 2	0,83	4,97	1,84	3,05	4,97	14,02	27,50	39,94	58,99
IDKA 20	-2,28	-14,50	-2,87	-11,27	-14,50	-12,61	26,07	51,79	70,27
CDI	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	20,99	33,03

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	2,85	-11,93	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27	37,20	74,05
IBRX 100	3,14	-11,17	-5,51	-18,37	-11,17	-8,07	22,63	41,54	80,53
IBRX 50	3,76	-10,54	-4,49	-18,01	-10,54	-7,30	19,73	37,12	73,89
SMALL CAP	3,80	-16,20	-11,28	-24,79	-16,20	-16,75	31,71	42,41	112,70
IFIX	8,78	-2,28	3,28	1,81	-2,28	-12,28	19,27	25,98	50,42
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	1,60	-6,41	-1,83	-8,30	-6,41	-7,35	34,49	55,95	95,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,73	10,06	2,96	6,07	10,06	15,03	19,99	24,48	28,15
INPC	0,73	10,16	2,75	5,97	10,16	16,16	21,37	25,53	28,13
IGPM	0,87	17,78	1,54	2,35	17,78	45,04	55,63	67,36	66,49
SELIC	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	21,00	33,06

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	3,63	36,26	13,52	23,73	36,26	104,25	173,82	200,73	264,52
MSCI ACWI	3,17	25,42	9,15	16,96	25,42	84,89	138,58	148,21	206,39
MSCI World									

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,09	14,45	3,97	8,20	14,45	24,38	34,95	45,56	55,77
IPCA + 5,00%	1,18	15,54	4,22	8,73	15,54	26,77	38,87	51,22	63,36
IPCA + 5,50%	1,22	16,09	4,35	8,99	16,09	27,98	40,86	54,11	67,27
IPCA + 5,89%	1,26	16,52	4,44	9,20	16,52	28,92	42,43	56,40	70,37
IPCA + 6,00%	1,27	16,64	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87	57,04	71,26
INPC + 4,00%	1,09	14,55	3,77	8,10	14,55	25,60	36,50	46,79	55,74
INPC + 6,00%	1,27	16,74	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52	58,37	71,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
80	10/12/2021	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	5.650.000,00	0,00	191.343,45610300	29,5280545000
83	17/12/2021	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.000.584,00	33.828,62509700	29,5780274000
87	20/12/2021	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	1.000.584,00	0,00	1.000.584,00000000	1,0000000000
84	22/12/2021	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	2.070.000,00	69.910,36366800	29,6093439000
85	23/12/2021	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	2.205.000,00	0,00	74.444,31396400	29,6194549000
86	28/12/2021	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	220.000,00	0,00	7.419,97282000	29,6497043000

Total

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 17.529.841,20

Value-At-Risk: 2,76%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BERTIOGA		2,76	2,76			634.860.379,82	100,00
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea a							Value-At-Risk: 1,73%

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535	4,44	0,53	1,72				108.415.122,03	17,08
NTN-B 150824	1,72	0,02	1,65				10.529.426,46	1,66
NTN-B 150850	5,08	0,06	2,25				11.547.391,43	1,82
NTN-B 150545	4,59	0,04	1,76				8.716.925,59	1,37
NTN-B 150523	1,34	0,02	2,40				22.412.774,21	3,53
Sub-total	5,93	3,76	0,67		-0,11	0,10	161.621.639,72	25,46

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IPCA	1,34	0,01	1,35				16.744.483,38	2,64
BB PREV RF VII	0,73	0,00	2,84				5.900.499,01	0,93
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	3,24	0,06	0,75				16.507.523,20	2,60
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	1,72	0,04	1,65				20.121.244,00	3,17
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,92	0,00	0,93				6.213.979,08	0,98
Sub-total	2,46	1,64	0,11		-0,03	0,69	65.487.728,67	10,32

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	0,61	0,06	0,63				106.255.757,73	16,74
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,04	0,00	0,01				107.349.801,92	16,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,25	0,31	0,06		0,16	0,80	213.605.559,65	33,65
Artigo 7º VII, Alinea b								
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI		1,22	0,01	1,23			4.322.698,03	0,68
Sub-total	2,41	1,22	0,01		0,04	0,85	4.322.698,03	0,68

Value-At-Risk: 9,43%

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Artigo 8º II, Alinea a								
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST ACOES FIC FIA		8,21	0,20	2,97			18.347.233,70	2,89
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES		10,79	0,09	3,90			6.397.520,58	1,01
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		10,84	0,57	2,07			37.216.953,22	5,86
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,30	0,22	5,27			18.431.541,49	2,90
WA ASSET VALUATION FIA		12,43	0,12	4,39			6.847.677,73	1,08
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		15,88	0,80	8,98			35.487.353,26	5,59
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS		9,84	0,05	2,29			3.584.158,28	0,56
Sub-total	18,15	11,19	2,05		0,02	1,07	126.312.438,26	19,90

Artigo 8º IV, Alinea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..		0,05	-0,00	0,06			4.983.680,52	0,79
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME		3,78	0,01	3,79			19.129.372,73	3,01
Sub-total	129,23	3,00	0,01		-0,01	-0,62	24.113.053,25	3,80

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,99%

Artigo 9º A, II								
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI		8,59	-0,03	11,42			5.683.072,61	0,90
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		10,93	-0,06	10,92			10.520.477,06	1,66
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		7,93	-0,04	7,93			11.030.985,96	1,74
Sub-total	14,83	8,56	-0,12		-0,06	-0,11	27.234.535,63	4,29
Artigo 9º A, III								
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		8,18	-0,01	0,67			6.115.588,82	0,96
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		8,41	-0,01	13,95			6.047.137,79	0,95
Sub-total	18,09	8,13	-0,02		0,10	2,56	12.162.726,61	1,92