

Comitê de Investimentos

Ata nº 21/2022 – aos treze dias do mês de abril 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 e Victor Mendes Neto**. Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM merecedores de destaque, cabendo mencionar que o Relatório *Focus* de 08/04/2022 não está disponível no site do Banco Central, por motivo de greve de servidores do BACEN:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	15/03/2022 a 04/05/2022	2022	Elevação	10,75%	11,75%
Fonte: Banco Central do Brasil					

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2022	-	13,00	-
PIB	Mediana agregada	2022	-	0,50	-
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2022	-	5,30	-
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2022	-	6,59	-
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2022	-	60,30	-
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2022	-	-0,50	-

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8190 d.u. - 2054)	Anbima – 12/04/2022	2022	Elevação	5,7057	5,8298
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2052)	Anbima – 12/04/2022	2022	Elevação	5,6937	5,8207
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2042)	Anbima – 12/04/2022	2022	Elevação	5,6158	5,7618
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2032)	Anbima – 12/04/2022	2022	Elevação	5,4004	5,6048
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2027)	Anbima – 12/04/2022	2022	Elevação	5,1971	5,4862
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2024)	Anbima – 12/04/2022	2022	Elevação	5,3950	5,7007

Ibovespa	12/04/2022	2022	Redução	118.885	116.147
Risco Brasil (JP Morgan)	11/04/2022	2022	Elevação	290	300
Fonte: Banco Central do Brasil; Anbima; BM&F; J P Morgan.					

Posição dos Investimentos	Fevereiro/22- Março/22	2022	em Mil	Fechamento Fevereiro	Fechamento Março
				643.633	667.608

As comparações de cenário ficam prejudicadas pela segunda semana consecutiva em razão da indisponibilidade do Boletim FOCUS. Uma retomada de elevação mais significativa nas curvas juros ainda é esperada em função de possível reavaliação da trajetória da dívida pública interna que pelo segundo ano seguido é suavizada em razão do incremento das receitas causado pelo ciclo inflacionário, e eventualmente por conta de expectativas relacionadas a incrementos na elevação das taxas de juros praticadas pelos bancos centrais das principais economias mundiais

para fazer frente a uma inflação elevada mundialmente, se os efeitos permanecerem duradouros acrescentando ao cenário a crise geopolítica ocasionada pelo conflito entre Ucrânia e Rússia. Foi apresentado o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 07/04/2022 com o patrimônio de R\$ 670.621M e relatório mensal referente mês de março com patrimônio de R\$ 667.608M. Esta última semana todos os vértices da ETTJ monitorados apresentaram elevação. Houve variação patrimonial positiva em razão da marcação a mercado de Títulos Públicos mantidos em carteira, desconsideradas movimentações decorrentes da execução orçamentária, no relatório de investimentos em análise. O risco Brasil está em 300 pontos apresentando elevação; no IBOVESPA houve redução para 116.147 pontos, apresentando variação patrimonial negativa, também considerando os dados do relatório financeiro em análise. Foram emitidas as seguintes APRs.

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
039/2022	06/04/2022	3.185.519,45	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
040/2022	06/04/2022	3.185.519,45	Resgate	KINEA PRIVATE EQUITY II FEEDER INSTITUCIONAL I FIP
041/2022	01/04/2022	125.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
042/2022	08/04/2022	3.270.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI

Foi atendida a solicitação da Sra. Rejane - Coordenadora Jurídico Previdenciária para trazer o assunto da LC 167/21, artigo 116, aliado ao momento de produção de minuta de PL a ser enviado à PMB. Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:00 horas, e lavrada em ata.

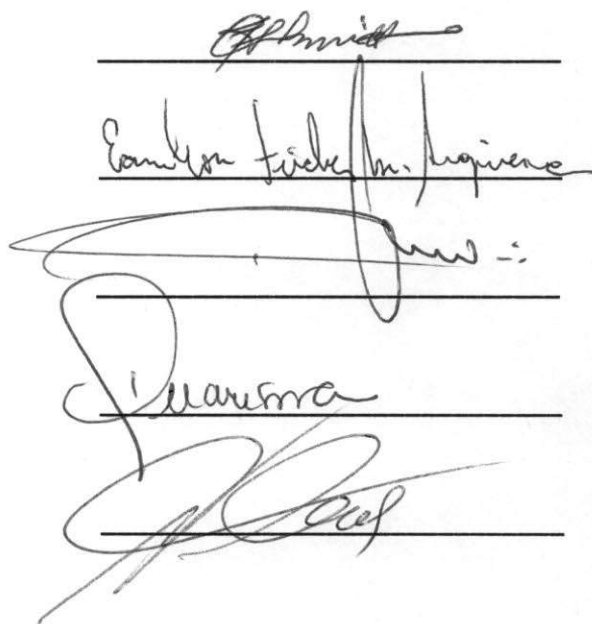
Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto





Relatório de Investimentos - Semanal

12/04/2022

CNPJ	Fundo	Posição 30/03/2022	Posição 07/04/2022	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 4.963/21	Limite % Pró-Gestão	Saldo Dez/21 Evolução PL	RS 634.860.379,80 RS 35.761.470,29	9,90% 5,63%
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	667.969.460,05	670.621.850,09	0,40%	100,0%	Nível II				
	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%					
	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	374.005.244,17	376.757.076,90	0,74%	56,18%					
CP 0184	C/P (NTN-B) Marcação a Mercado	164.479.796,70	166.260.463,95	1,08%	24,79%					
CP	C/P (NTN-B) Marcação na Curva	209.525.447,47	210.496.612,95	0,46%	31,39%					
	Fundos de Investimentos 100% Títulos Públicos	66.555.818,10	66.930.159,48	0,56%	9,98%					
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	17.471.017,48	17.471.066,82	0,31%	2,605%					
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.967.523,21	5.991.791,49	0,41%	0,893%					
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.579.780,00	16.780.910,40	1,21%	2,502%					
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.307.391,00	20.377.838,00	0,35%	3,039%					
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.284.106,41	6.308.552,77	0,39%	0,941%					
	FI Renda Fixa conforme CVM	30.374.235,93	34.171.287,21	12,50%	5,10%					
09.577.447/0001-00	SANTANDER DI TÍTULOS PUBL PREMIUM*	30.374.235,93	34.171.287,21	12,50%	5,095%					
	RENDA FIXA - SUB TOTAL	470.935.298,20	477.858.523,59	1,47%	71,26%					
	Fundos de Investimentos em Ações	141.181.184,30	137.756.667,98	-2,43%	20,54%					
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	20.583.012,92	20.256.521,60	-1,59%	3,021%					
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	19.677.209,04	19.252.333,78	-2,16%	2,871%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.237.072,38	7.095.972,52	-1,95%	1,058%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	39.431.944,46	37.914.941,45	-3,85%	5,654%					
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	42.073.511,65	41.330.062,63	-1,77%	6,163%					
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	8.035.828,59	7.805.645,53	-2,86%	1,164%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	4.142.605,26	4.101.190,47	-1,00%	0,612%					
	RENDA VARIÁVEL - SUB TOTAL	141.181.184,30	137.756.667,98	-2,43%	20,54%					
	FIC Aberto "Investimentos no Exterior"	20.735.669,57	19.777.109,74	-4,62%	2,95%					
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIOR	7.347.327,73	6.913.644,86	-5,90%	1,031%					
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	8.676.524,93	8.334.372,88	-3,94%	1,243%					
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR F	4.711.816,91	4.529.092,00	-3,88%	0,675%					
	FIA - BDR Nível I - Investimentos no Exterior	9.825.827,75	9.518.434,66	-3,13%	1,42%					
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	4.820.933,72	4.657.434,10	-3,39%	0,694%					
17.502.937/0001-68	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5.004.894,03	4.861.000,56	-2,88%	0,725%					
	INVESTIMENTOS NO EXTERIOR - SUB TOTAL	30.561.497,32	29.295.544,40	-4,14%	4,37%					
	FI em Participações - FIP - (Invest. Estruturados)	25.291.480,23	25.711.114,12	1,66%	3,83%					
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	4.904.475,81	5.208.285,54	6,19%	0,777%					
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP M	20.387.004,42	20.502.828,58	0,57%	3,057%					
	INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS - SUB TOTAL	25.291.480,23	25.711.114,12	1,66%	3,83%					

Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021.
Ficam revogadas: Resolução 3.922 de 25/11/2010; Resolução 4.392 de 19/12/2014; Resolução 4.604 de 19/10/2017 e Arts. 1º, 2º, 3º, 4º e 5º da Resolução 4.695 de 27/11/2018.
Esta Resolução entra em vigor em 3 de janeiro de 2022.



Relatório de Investimentos

Março

2022

CNPJ	Fundo	Patrimônio	% PL	CMN Limite % Res. 4.963	Limite % Pró-Gestão	Saldo Dez/21 Evolução PL	R\$ 634.860.379,80 R\$ 32.748.390,39	9,90% 5,16%
XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	667.608.770,19	100,0%					5,16%
	(*) CONTA TRANSITÓRIA	-	0,000%					
	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	374.310.105,69	56,07%					
CP 0184	C P (NTN-B) Marcação a Mercado	164.623.250,46	24,559%					
CP	C P (NTN-B) Marcação na Curva	209.686.855,23	31,409%					
	Fundos de Investimentos 100% Títulos Públicos	66.544.062,67	9,97%					
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	17.400.822,17	2,606%					
19.523.305/0001-06	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.963.999,01	0,893%					
19.769.046/0001-06	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	16.600.314,40	2,487%					
22.791.074/0001-26	FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.298.265,00	3,040%					
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	6.280.662,09	0,941%					
	FI Renda Fixa conforme CVM	30.797.166,57	4,61%					
09.577.447/0001-00	SANTANDER RF REF DI TP PREMIUM FIC FI	30.797.166,57	4,613%					
	RENDA FIXA - SUB TOTAL	471.651.334,93	70,65%					
	Fundos de Ações CVM	140.274.134,22	21,01%					
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	20.471.930,13	3,066%					
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	19.587.871,41	2,934%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.182.594,86	1,076%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	38.995.253,49	5,841%					
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	41.902.658,55	6,277%					
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	7.987.545,50	1,196%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FIC EM AÇÕES	4.146.280,28	0,621%					
	RENDA VARIÁVEL - SUB TOTAL	140.274.134,22	21,01%					
	FIC Aberto "Investimentos no Exterior"	20.330.735,22	3,05%					
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	7.161.625,13	1,073%					
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INV NO EXTERIOR	8.504.848,31	1,274%					
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVEST NO EXTERIOR FI	4.664.261,78	0,699%					
	F I A - BDR Nível I - Investimentos no Exterior	9.641.451,70	1,44%					
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR - NÍVEL I PB	4.725.508,96	0,708%					
17.502.937/0001-68	F I A EM AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR - NÍVEL I	4.915.942,74	0,736%					
	INVESTIMENTOS NO EXTERIOR - SUB TOTAL	29.972.186,92	4,49%					
	FI em Participações - FIP - (Invest. Estruturados)	25.711.114,12	3,85%					
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.208.285,54	0,780%					
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MUL	20.502.828,58	3,071%					
	INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS - SUB TOTAL	25.711.114,12	3,85%					

Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021.

Ficam revogadas: Resolução 3.922 de 25/11/2010; Resolução 4.392 de 19/12/2014; Resolução 4.604 de 19/10/2017 e Arts. 1º, 2º, 3º, 4º e 5º da Resolução 4.695 de 27/11/2018. Esta Resolução entra em vigor em 3 de janeiro de 2022.



Relatório de Investimentos - Semanal

12/04/2022

CNPJ	Fundo	Posição 30/03/2022	Posição 07/04/2022	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 4.963/21	Limite % Pré-Estação	Saldo Dez/21 Evolução PL	Estratégia Alvo	Limite Superior (%)	Enquadramento
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO (*) CONTA TRANSITÓRIA	667.969.460,05	670.621.850,09	0,40%	100,0%						
	TTulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	374.005.244,17	376.757.076,90	0,74%	56,18%						
CP 0184	CP (NTN-B) Marcação a Mercado	164.479.796,70	166.260.463,95	1,08%	24,79%				52,00%	100,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea A
CP	CP (NTN-B) Marcação na Curva	209.525.447,47	210.496.612,95	0,46%	31,39%						
15.486.093/0001-83	Fundos de Investimentos - 100% Títulos Públicos	66.555.818,10	66.930.159,48	0,56%	9,98%						
19.523.305/0001-06	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	17.417.017,48	17.471.066,82	0,31%	2,605%						
19.769.046/0001-06	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.967.523,21	5.991.791,49	0,41%	0,893%						
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.579.780,00	16.780.910,40	1,21%	2,502%						
19.303.795/0001-35	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.307.391,00	20.377.838,00	0,35%	3,039%						
	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.284.106,41	6.308.552,77	0,39%	0,941%						
09.577.447/0001-00	FI Renda Fixa conforme CVM	30.374.235,93	34.171.287,21	12,50%	5,10%						
	SANTANDER DI TÍTULOS PUBL PREMIUM*	30.374.235,93	34.171.287,21	12,50%	5,095%						
	RENDA FIXA - SUB TOTAL	470.935.298,20	477.858.523,59	1,47%	71,26%						
	Fundos de Investimentos em Ações	141.181.184,30	137.756.667,98	-2,43%	20,54%						
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	20.583.012,92	20.256.521,60	-1,59%	3,021%						
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	19.677.209,04	19.252.333,78	-2,16%	2,871%						
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.237.072,38	7.095.972,52	-1,95%	1,058%						
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	39.431.944,46	37.914.941,45	-3,85%	5,654%						
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	42.073.511,65	41.330.062,63	-1,77%	6,163%						
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	8.035.828,59	7.805.645,53	-2,86%	1,164%						
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FIC AÇÕES	4.142.605,26	4.101.190,47	-1,00%	0,612%						
	RENDA VARIÁVEL - SUB TOTAL	141.181.184,30	137.756.667,98	-2,43%	20,54%						
	FIC Aberto "Investimentos no Exterior"	20.735.669,57	19.777.109,74	-4,62%	2,95%						
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIOR	7.347.327,73	6.913.644,86	-5,90%	1,031%						
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	8.676.524,93	8.334.372,88	-3,94%	1,243%						
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR F	4.711.816,91	4.529.092,00	-3,88%	0,675%						
	FIA - BDR Nível I - Investimentos no Exterior	9.825.827,75	9.518.434,66	-3,13%	1,42%						
19.436.819/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	4.820.933,72	4.657.434,10	-3,39%	0,694%						
17.502.937/0001-68	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5.004.894,03	4.861.000,56	-2,88%	0,725%						
	INVESTIMENTOS NO EXTERIOR - SUB TOTAL	30.561.497,32	29.295.544,40	-4,14%	4,37%						
	FI em Participações - FIP - (Invest. Estruturados)	25.291.480,23	25.711.114,12	1,66%	3,83%						
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	4.904.475,81	5.208.285,54	6,19%	0,777%						
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP IV	20.387.004,42	20.502.828,58	0,57%	3,057%						
	INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS - SUB TOTAL	25.291.480,23	25.711.114,12	1,66%	3,83%						

Resolução CVM nº 4.963 de 25 de novembro de 2021.

Ficam revogadas: Resolução 3.922 de 25/11/2010; Resolução 4.392 de 19/10/2017 e Arts. 1º, 2º, 3º, 4º e 5º da Resolução 4.695 de 27/11/2018. Esta Resolução entra em vigor em 3 de janeiro de 2022.



Relatório de Investimentos

Comparativo

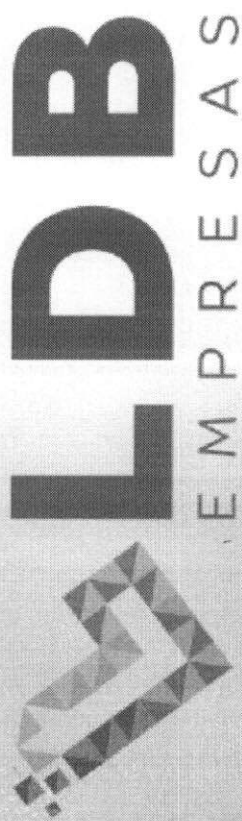
Fevereiro/Março

2022

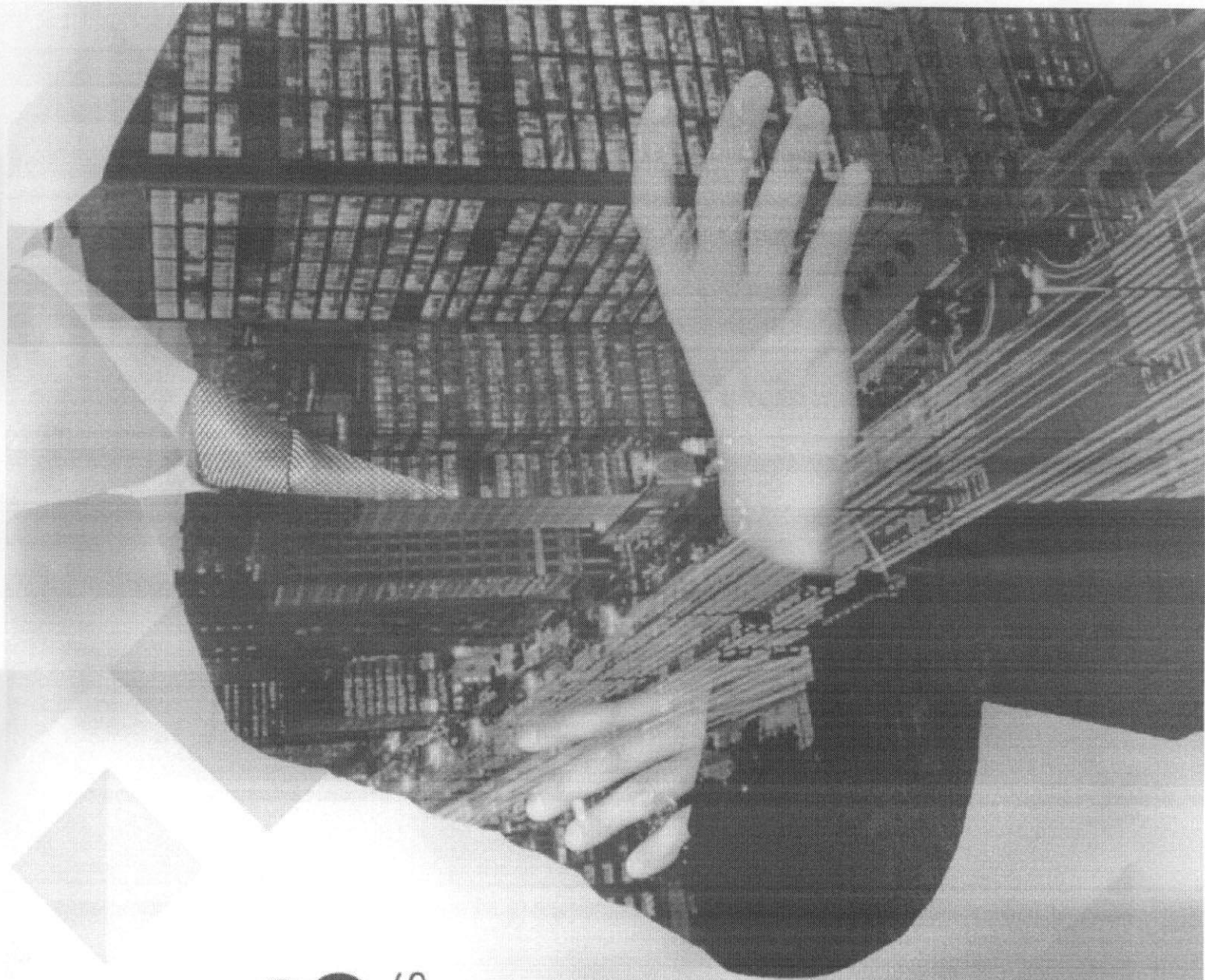
CNPJ	Fundo	Patrimônio		Variação Mensal	% PL Atual	CMN Limite % Res. 4.963	Limite % Pro-Gestão	Saldo Dez/21	Evolução PL	R\$ 634.860.379,80	R\$ 32.748.390,39	9,90%	5,16%
		Fevereiro/22	Março/22										
Nível II													
Evolução PL Acumulada Saldo Anterior													
Limite Inferior (%)													
Limite Superior (%)													
Enquadramento													
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	643.633.819,47	667.608.770,19	3,72%	100,0%								
	(*) CONTA TRANSITÓRIA	-	-	#DIV/0!	0,000%								
	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	364.891.669,66	374.310.105,69	2,58%	56,07%								
CP 0184	C P (NTN-B) Marcação a Mercado	158.804.810,70	164.623.250,46	3,66%	24,659%								
CP	C P (NTN-B) Marcação na Curva	206.086.858,96	209.686.855,23	1,75%	31,409%								
	Fundos de Investimentos 100% Títulos Públicos	64.748.333,15	66.544.062,67	2,77%	9,97%								
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.991.010,12	17.400.822,17	2,41%	2,606%								
19.523.305/0001-06	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.830.337,26	5.963.999,01	2,29%	0,893%								
19.769.046/0001-06	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	16.020.650,00	16.600.314,40	3,62%	2,487%								
22.791.074/0001-26	FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.773.052,00	20.298.265,00	2,66%	3,040%								
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	6.133.283,77	6.280.662,09	2,40%	0,941%								
	FI Renda Fixa conforme CVM	24.075.800,65	30.797.166,57	27,92%	4,61%								
09.577.447/0001-00	SANTANDER RF REF DI TP PREMIUM FIC FI	24.075.800,65	30.797.166,57	27,92%	4,613%								
	FI Renda Fixa "Crédito Privado"	-	-	#DIV/0!	0,00%								
	RENDA FIXA - SUB TOTAL	453.715.803,46	471.651.334,93	3,95%	70,65%								
	Fundos de Ações CVM	132.753.242,01	140.274.134,22	5,67%	21,01%								
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	19.573.592,11	20.471.930,13	4,59%	3,066%								
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	18.639.258,90	19.587.871,41	5,09%	2,934%								
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	6.674.044,50	7.182.594,86	7,62%	1,076%								
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	36.486.354,64	38.995.253,49	6,88%	5,841%								
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	40.045.553,75	41.902.658,55	4,64%	6,277%								
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	7.461.957,32	7.987.545,50	7,04%	1,196%								
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FIC EM AÇÕES	3.872.480,79	4.146.280,28	7,07%	0,621%								
	RENDA VARIÁVEL - SUB TOTAL	132.753.242,01	140.274.134,22	5,67%	21,01%								
	FIC Aberto "Investimentos no Exterior"	21.797.002,58	20.330.735,22	-6,73%	3,05%								
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	7.798.611,85	7.161.625,13	-8,17%	1,073%								
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INV NO EXTERIOR	9.135.644,92	8.504.848,31	-6,90%	1,274%								
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVEST NO EXTERIOR FI	4.862.745,81	4.664.261,78	-4,08%	0,699%								
	FIA - BDR Nível I - Investimentos no Exterior	10.076.291,19	9.641.451,70	-4,32%	1,44%								
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR - NÍVEL I PB	4.949.547,35	4.725.508,96	-4,53%	0,708%								
17.502.937/0001-68	FIA EM AÇÕES CAIXA INSTITUCIONALBDR NÍVEL I	5.126.743,84	4.915.942,74	-4,11%	0,736%								
	INVESTIMENTOS NO EXTERIOR - SUB TOTAL	31.873.293,77	29.972.186,92	-5,96%	4,49%								
	FI em Participações - FIP - (Invest. Estruturados)	25.291.480,23	25.711.114,12	1,66%	3,85%								
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	4.904.475,81	5.208.285,54	6,19%	0,780%								
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTI	20.387.004,42	20.502.828,58	0,57%	3,071%								
	INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS - SUB TOTAL	25.291.480,23	25.711.114,12	1,66%	3,85%								
										</			

Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021.

Ficam revogadas: Resolução 3.922 de 25/11/2010; Resolução 4.392 de 19/12/2014; Resolução 4.604 de 19/10/2017 e Arts. 1º, 2º, 3º, 4º e 5º da Resolução 4.695 de 27/11/2018. Esta Resolução entra em vigor em 3 de janeiro de 2022.



BERTIOGA
MARÇO 2022



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.03.2022.

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

RENTA FIXA 70,65%

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

Emissor	Título Público	Volatild. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535	8,53	4,09	1,86	110.432.399,55	16,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	3,44	2,68	3,77	10.615.861,01	1,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	10,74	3,31	1,33	11.378.739,86	1,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	9,53	3,34	2,01	8.892.294,02	1,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	2,37	2,43	3,98	23.303.956,02	3,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5.540000%)	3,91	1,74	3,77	15.563.952,72	2,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5.670000%)	3,97	1,75	2,93	10.293.149,08	1,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5.730000%)	4,00	1,75	3,45	10.341.784,28	1,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5.540000%)	3,87	1,74	3,77	36.314.568,92	5,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5.670000%)	3,94	1,75	2,93	20.584.062,14	3,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5.720000%)	3,97	1,75	3,44	36.204.743,74	5,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5.621000%)	2,82	1,75	2,93	10.005.675,71	1,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5.690000%)	2,84	1,75	3,44	15.082.440,47	2,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5.540000%)	2,76	1,74	3,77	20.192.370,07	3,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5.670000%)	2,81	1,75	2,93	20.019.570,16	3,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730000%)	2,84	1,75	3,45	15.084.537,94	2,26			
	Sub-total Artigo 7º I, Alinea a	6,87	2,58	1,84	374.310.105,69	56,07			
Artigo 7º I, Alinea 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	2,36	2,41	3,92	17.400.822,18	2,61	1.781.925.104,48	0,98
BB	BB	BB PREV RF VII	1,59	2,29	4,03	5.963.999,01	0,89	250.707.080,03	2,38
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	6,64	3,62	2,50	16.600.314,40	2,49	258.148.586,85	6,43
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	3,43	2,66	3,71	20.298.265,00	3,04	220.412.181,75	9,21
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,90	2,40	3,93	6.280.662,09	0,94	594.892.242,95	1,06
Sub-total Artigo 7º I, Alinea b			3,25	2,77	3,51	66.544.062,68	9,97		
Artigo 7º III, Alinea a (Fundos Renda Fixa)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,17	0,90	2,47	30.797.166,58	4,61	4.414.643.514,53	0,70
Sub-total Artigo 7º III, Alinea a			0,17	0,90	2,41	30.797.166,58	4,61		
Renda Fixa									
			3,59	2,49	3,04	471.651.334,95	70,65		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

21,01%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
AZ QUEST BTG PACTUAL	BEM BTG PACTUAL	AZ QUEST ACOES FIC FIA BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	16,73 18,13	4,59 7,62	11,58 12,27	20.471.930,14 7.182.594,86	3,07 1,08	401.255.617,44 61.735.503,30	5,10 11,63
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	19,04	4,64	12,59	41.902.658,55	6,28	616.631.969,58	6,80
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	16,53	5,09	6,27	19.587.871,44	2,93	1.463.287.787,94	1,34
WESTERN	BNP PARIBAS	WA ASSET VALUATION FIA	20,35	7,04	16,65	7.987.545,48	1,20	98.047.399,31	8,15
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	24,14	6,88	9,88	38.995.253,48	5,84	1.932.751.487,29	2,02
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,45	7,07	15,68	4.146.280,28	0,62	1.055.290.766,99	0,39
Sub-total Artigo 8º I			19,60	5,67	11,05	140.274.134,23	21,01		
Renda Variável			18,76	5,67	11,05	140.274.134,23	21,01		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,49%

Artigo 9º 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	17,24	-4,08	-17,93	4.664.261,78	0,70	800.283.478,90	0,58
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	26,54	-8,17	-31,93	7.161.625,13	1,07	813.691.529,92	0,88
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16,16	-6,90	-22,90	8.504.848,32	1,27	1.416.865.842,79	0,60
Sub-total Artigo 9º II			18,93	-6,73	-25,35	20.330.735,23	3,05		

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,89	-4,11	-19,62	4.915.942,74	0,74	2.671.897.209,12	0,18
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	18,50	-4,53	-21,86	4.725.508,96	0,71	2.224.682.241,76	0,21
Sub-total Artigo 9º III			18,60	-4,32	-20,73	9.641.451,70	1,44		
Investimentos no Exterior			17,81	-5,96	-23,92	29.972.186,93	4,49		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,85%

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
KINEA	LIONS TRUST	FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	6,31	6,19	4,51	5.208.285,48	0,78	36.978.827,46	14,08
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	69,17	0,57	29,97	20.502.828,62	3,07	327.020.127,53	6,27
Sub-total Artigo 10º II			32,41	1,66	24,77	25.711.114,10	3,85		
Investimentos Estruturados			32,41	1,66	24,77	25.711.114,10	3,85		
Total			6,02	2,69	3,79	667.608.770,21	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	374.310.105,69	56,07	20,00	52,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	66.544.062,68	9,97	5,00	7,90	50,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	30.797.166,58	4,61	32,00	5,50	50,00	0,00	70,00
	Total Renda Fixa	471.651.334,95	70,65					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	140.274.134,23	21,01	0,00	22,00	30,00	0,00	40,00
	Total Renda Variável	140.274.134,23	21,01					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	20.330.735,23	3,05	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	9.641.451,70	1,44	0,00	2,50	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	29.972.186,93	4,49					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º II	Fundo de Participação	25.711.114,10	3,85	0,00	4,50	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	25.711.114,10	3,85					15,00

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	2,58 279,51	1,84 75,70	1,84 75,70	2,94 68,25	1,76 27,43	9.418.436,03	10.542.121,51
Artigo 7º I, Alinea b % do CDI	2,77 300,33	3,51 144,72	3,51 144,72	5,48 127,02	7,71 120,17	1.795.729,53	2.262.192,86
Artigo 7º III, Alinea a % do CDI	0,90 97,60	2,41 99,30	2,41 99,30			273.365,93	1.148.788,20
Artigo 7º V, Alinea b % do CDI	0,00 0,00	0,40 16,38	0,40 16,38			0,00	17.164,80
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,67 -0,40	11,05 -3,43	11,05 -3,43			7.520.892,22	13.961.695,97
Artigo 9º II % do CDI	-6,73 -728,46	-25,35 -1.045,54	-25,35 -1.045,54	-21,41 -496,74		-1.466.267,35	-6.903.800,40
Artigo 9º III % do CDI	-4,32 -467,32	-20,73 -854,99	-20,73 -854,99	-11,09 -257,37		-434.839,49	-2.521.274,91
Artigo 10º II % do CDI	1,66 179,67	24,77 1.021,45	24,77 1.021,45			419.633,87	5.833.674,09
BERTIOGA (Total)						17.526.950,74	24.340.562,12

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150523	22.750.793,63	0,00	0,00	0,00	23.303.956,02	553.162,39	891.181,81
NTN-B 150535	106.096.718,41	0,00	0,00	0,00	110.432.399,55	4.335.681,14	2.017.277,52
NTN-B 150545	8.604.691,50	0,00	0,00	0,00	8.892.294,02	287.602,52	175.368,43
NTN-B 150545 (5,5400000%)	15.298.017,23	0,00	0,00	0,00	15.563.952,72	265.935,49	564.925,97
NTN-B 150545 (5,6700000%)	10.116.179,83	0,00	0,00	0,00	10.293.149,08	176.969,25	293.341,99
NTN-B 150545 (5,7300000%)	10.163.477,00	0,00	0,00	0,00	10.341.784,28	178.307,28	344.560,47
NTN-B 150555 (5,5400000%)	35.694.077,17	0,00	0,00	0,00	36.314.568,92	620.491,75	1.318.110,83
NTN-B 150555 (5,6700000%)	20.230.173,60	0,00	0,00	0,00	20.584.062,14	353.888,54	586.621,70
NTN-B 150555 (5,7200000%)	35.580.815,90	0,00	0,00	0,00	36.204.743,74	623.927,84	1.205.571,69

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150824	10.338.492,73	0,00	0,00	0,00	10.615.861,01	277.368,28	388.251,97
NTN-B 150840 (5,621000%)	9.834.043,31	0,00	0,00	0,00	10.005.675,71	171.632,40	285.954,57
NTN-B 150840 (5,6900000%)	14.822.890,22	0,00	0,00	0,00	15.082.440,47	259.550,25	505.777,54
NTN-B 150850	11.014.114,43	0,00	0,00	0,00	11.378.739,86	364.625,43	144.093,92
NTN-B 150850 (5,5400000%)	19.847.351,71	0,00	0,00	0,00	20.192.370,07	345.018,36	740.451,56
NTN-B 150850 (5,6700000%)	19.675.385,53	0,00	0,00	0,00	20.019.570,16	344.184,63	573.637,39
NTN-B 150850 (5,7300000%)	14.824.447,46	0,00	0,00	0,00	15.084.537,94	260.090,48	506.994,09
					374.310.105,69	0,00	0,00

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	16.991.010,12	0,00	0,00	0,00	17.400.822,18	409.812,06	656.338,80
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	6.133.283,77	0,00	0,00	0,00	6.280.662,09	147.378,32	239.478,00
BB PREV RF VII	5.830.337,26	0,00	0,00	0,00	5.963.999,01	133.661,75	232.821,85
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	19.773.052,00	0,00	0,00	0,00	20.298.265,00	525.213,00	729.574,84
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	16.020.650,00	0,00	0,00	0,00	16.600.314,40	579.664,40	403.979,37
					66.544.062,68	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	24.075.800,65	9.343.000,00	-2.895.000,00	0,00	30.797.166,58	273.365,93	834.423,81
					30.797.166,58	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\$)
AZ QUEST ACOES FIC FIA	19.573.592,11	0,00	0,00	0,00	20.471.930,14	898.338,03	2.124.696,44
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	18.639.258,90	0,00	0,00	0,00	19.587.871,44	948.612,54	1.156.329,95
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	36.486.354,64	0,00	0,00	0,00	38.995.253,48	2.508.898,84	3.507.900,22
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	6.674.044,50	0,00	0,00	0,00	7.182.594,86	508.550,36	785.074,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	3.872.480,79	0,00	0,00	0,00	4.146.280,28	273.799,49	562.122,00
ITAU FOF RPI ACOES IBOVSPA ATIVO FICFI	40.045.553,75	0,00	0,00	0,00	41.902.658,55	1.857.104,80	4.685.705,33
WA ASSET VALUATION FIA	7.461.957,32	0,00	0,00	0,00	7.987.545,48	525.588,16	1.139.867,75
					140.274.134,23	0,00	0,00

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	4.862.745,81	0,00	0,00	0,00	4.664.261,78	-198.484,03	-1.018.810,83
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	7.798.611,85	0,00	0,00	0,00	7.161.625,13	-636.986,72	-3.358.851,93
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	9.135.644,92	0,00	0,00	0,00	8.504.848,32	-630.796,60	-2.526.137,64
					20.330.735,23	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5.126.743,84	0,00	0,00	0,00	4.915.942,74	-210.801,10	-1.199.646,08
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	4.949.547,35	0,00	0,00	0,00	4.725.508,96	-224.038,39	-1.321.628,83
					9.641.451,70	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\$)
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	4.904.475,81	0,00	0,00	0,00	5.208.285,48	303.809,67	224.604,96
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	20.387.004,42	0,00	0,00	0,00	20.502.828,62	115.824,20	5.609.069,13
					25.711.114,10	0,00	0,00

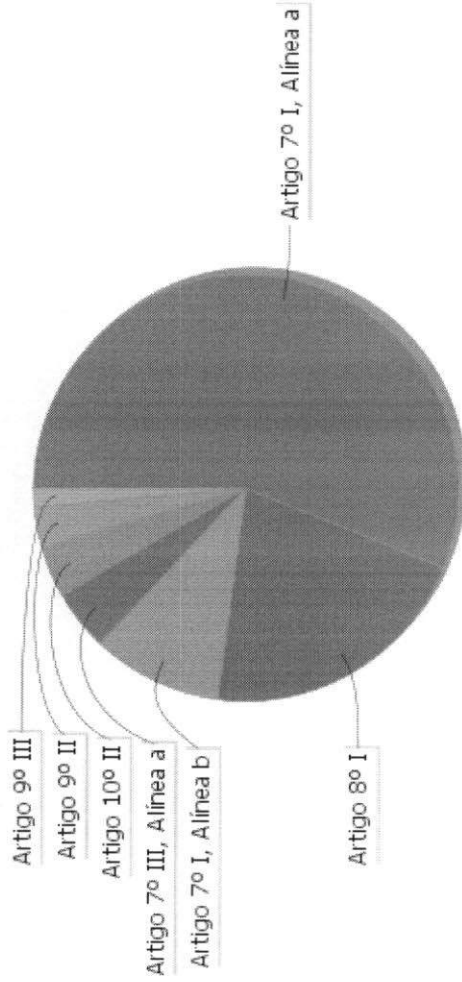
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	179.710.553,86	26,92	179.710.553,86	26,92
de 31 a 365 dias	49.105.532,77	7,36	228.816.086,63	34,27
acima de 365 dias	438.792.683,58	65,73	667.608.770,21	100,00

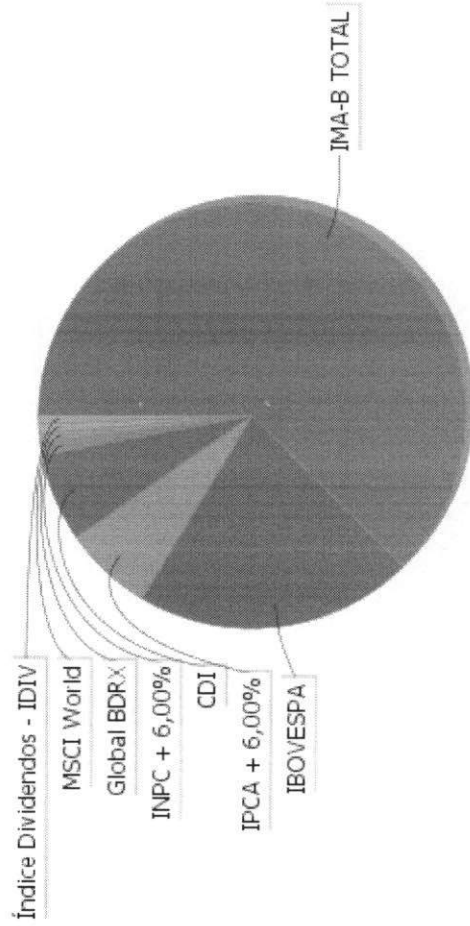
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



- Artigo 7º I, Alínea a: 56,07%
- Artigo 8º I: 21,01%
- Artigo 7º I, Alínea b: 9,97%
- Artigo 7º III, Alínea a: 4,61%
- Artigo 10º II: 3,85%
- Artigo 9º II: 3,05%
- Artigo 9º III: 1,44%

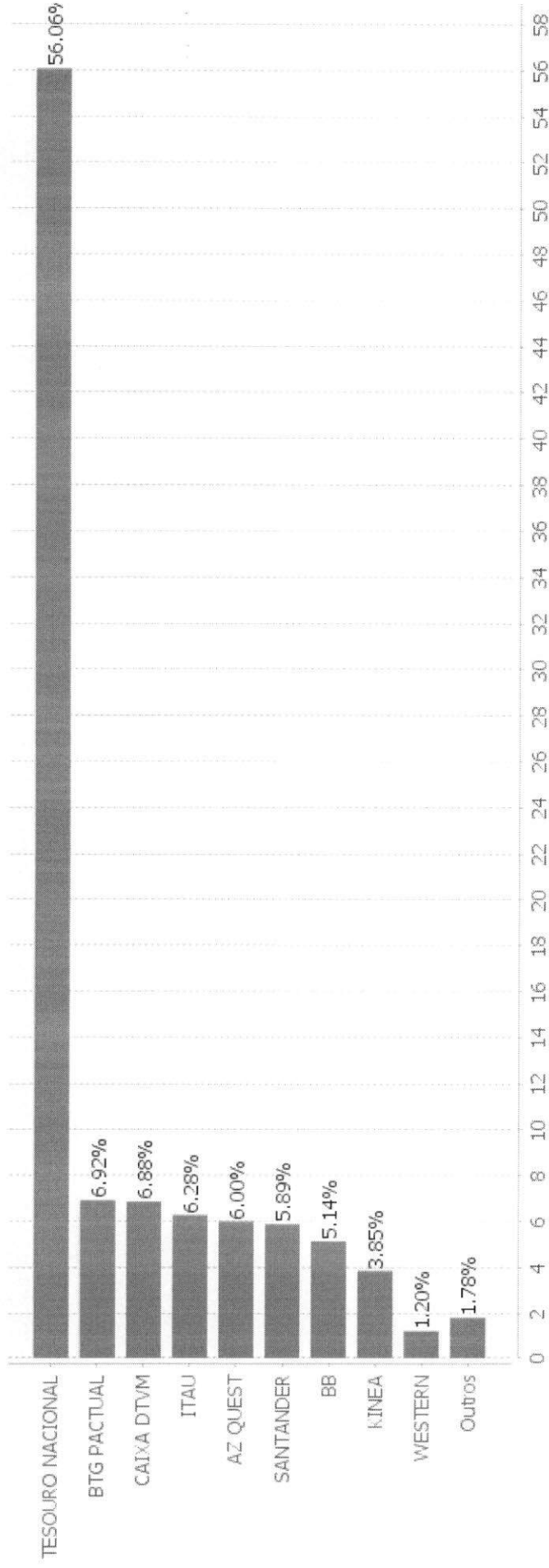
Alocação Por Estratégia



- IMA-B TOTAL: 62,48%
- IBOVESPA: 21,10%
- IPCA + 6,00%: 6,75%
- CDI: 6,67%
- INPC + 6,00%: 0,94%
- Global BDRX: 0,74%
- MSCI World: 0,70%
- Índice Dividendos - IDIV: 0,62%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2022	0,33	0,74	2,69										3,79
IPCA + 4,99%	0,95	1,38	2,05										4,44
p.p. indexador	-0,62	-0,64	0,64										-0,66
2021	-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
IPCA + 5,46%	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
p.p. indexador	-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	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
IPCA + 5,89%	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
p.p. indexador	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	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
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	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	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
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	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	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
IPCA + 6,00%	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
p.p. indexador	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

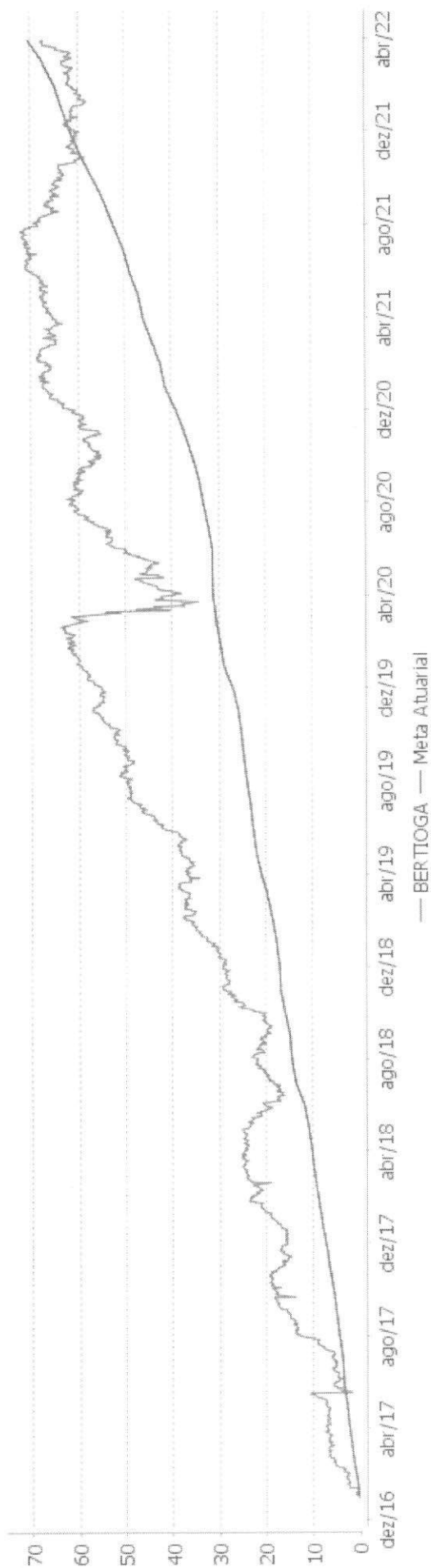
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	31	49,21	03 meses	3,79	4,44	-0,66	5,62
Meses abaixo - Meta Atuarial	32	50,79	06 meses	2,43	8,97	-6,54	6,19
			12 meses	1,14	17,25	-16,10	6,02
		Mês	24 meses	18,74	31,54	-12,79	7,57
Maior rentabilidade da Carteira	6,78	2018-10	36 meses	22,64	44,06	-21,43	9,93
Menor rentabilidade da Carteira	-11,57	2020-03	48 meses	33,91	59,62	-25,71	9,39
			60 meses	56,39	73,53	-17,14	10,09
			Desde 30/12/2016	67,31	77,77	-10,47	9,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

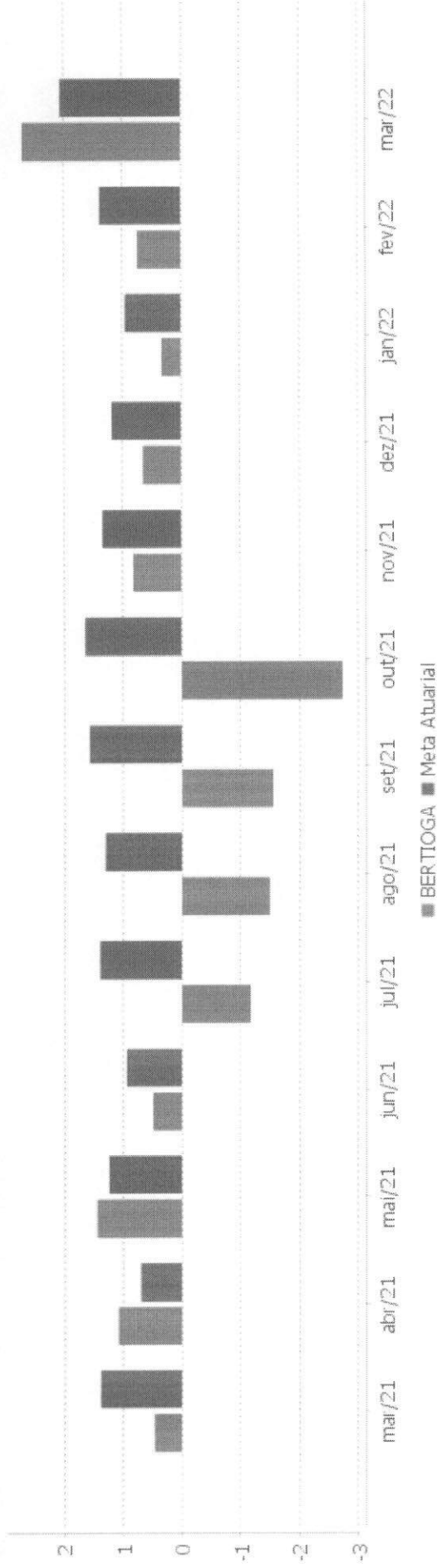


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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 VII	2,29	4,03	4,03	5,92	10,12	17,95	26,13
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,78	1,16	1,16	1,96	5,62	2,60	0,23
BB PREV RF IPCA	2,41	3,92	3,92	5,51	8,74	18,49	31,85
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,27	-0,77	-0,77	-3,86	-9,24	-14,13	-13,44
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	3,62	2,50	2,50	4,71	4,75	14,77	26,16
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,55	-0,37	-0,37	0,74	0,24	-0,59	0,26
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	2,40	3,93	3,93	5,90	9,62	18,08	28,30
Var. INPC + 6,00% p.p.	0,17	-0,97	-0,97	-3,48	-8,81	-16,11	-18,72
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	2,66	3,71	3,71	5,81	8,41	17,52	31,50
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,41	0,84	0,84	1,85	3,90	2,17	5,60
NTN-B 150545	3,34	2,01	2,01	0,54	-1,33	11,58	20,55
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,27	-0,86	-0,86	-3,42	-5,83	-3,77	-5,35
NTN-B 150824	2,68	3,77	3,77	5,95	8,69	18,14	32,50
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,39	0,90	0,90	1,98	4,18	2,78	6,60
NTN-B 150840 (5,6900000%)	1,75	4,05	4,05	8,74	13,71	20,07	24,57
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,32	1,18	1,18	4,78	9,20	4,71	-1,33
NTN-B 150850	3,31	1,33	1,33	-0,06	-2,16	9,83	18,01
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,24	-1,54	-1,54	-4,03	-6,66	-5,52	-7,89
NTN-B 150535	4,09	1,86	1,86	3,25	1,01	14,58	25,02
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,02	-1,01	-1,01	-0,71	-3,49	-0,78	-0,88
NTN-B 150555 (5,7200000%)	1,75	4,06	4,06	5,76	10,63	16,89	21,34
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,32	1,19	1,19	1,80	6,12	1,53	-4,56
NTN-B 150850 (5,6700000%)	1,75	4,05	4,05	8,73	13,72	20,13	24,68
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,32	1,18	1,18	4,77	9,22	4,78	-1,22
NTN-B 150523	2,43	3,98	3,98	5,62	8,96	18,96	32,63
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,64	1,10	1,10	1,66	4,45	3,61	6,73
NTN-B 150545 (5,6700000%)	1,75	4,05	4,05	5,74	10,58	16,79	21,18
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,32	1,18	1,18	1,77	6,07	1,43	-4,72
NTN-B 150545 (5,5400000%)	1,74	4,02	4,02	5,72	10,54	16,71	21,07
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,33	1,15	1,15	1,76	6,04	1,36	-4,83
NTN-B 150850 (5,7300000%)	1,75	4,06	4,06	8,76	13,76	20,19	24,75
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,32	1,19	1,19	4,80	9,26	4,83	-1,15
NTN-B 150850 (5,5400000%)	1,74	4,02	4,02	8,66	13,64	20,01	24,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Variação da Estratégia							
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,33	1,15	1,15	4,70	9,13	4,66	-1,38
NTN-B 150555 (5,670000%)	1,75	4,05	4,05	5,76	10,62	16,87	21,31
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,32	1,18	1,18	1,79	6,12	1,52	-4,59
NTN-B 150545 (5,730000%)	1,75	4,06	4,06	5,74	10,59	16,82	21,24
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,32	1,19	1,19	1,78	6,09	1,47	-4,66
NTN-B 150555 (5,540000%)	1,74	4,02	4,02	5,75	10,60	16,83	21,24
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,33	1,15	1,15	1,78	6,09	1,47	-4,66
NTN-B 150840 (5,621000%)	1,75	4,04	4,04	8,71	13,66	19,99	24,46
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,33	1,17	1,17	4,74	9,15	4,64	-1,44
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,90	2,47	2,47	4,36	6,43	8,37	14,01
% do CDI	97,60	101,83	101,83	101,06	100,32	95,34	95,29
WA ASSET VALUATION FIA	7,04	16,65	16,65	0,53	-9,27	43,20	7,03
Var. IBOVESPA p.p.	0,98	2,17	2,17	-7,60	-12,16	-21,14	-18,74
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	6,88	9,88	9,88	-11,48	-23,94	24,96	8,13
Var. IBOVESPA p.p.	0,82	-4,59	-4,59	-19,61	-26,82	-39,38	-17,64
AZ QUEST ACOES FIC FIA	4,59	11,58	11,58	0,75	-3,79	45,72	10,72
Var. IBOVESPA p.p.	-1,47	-2,90	-2,90	-7,38	-6,68	-18,62	-15,04
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	7,07	15,68	15,68	11,65	6,45	54,59	35,48
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-2,93	0,21	0,21	-1,72	-5,20	-1,00	-8,02
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	5,09	6,27	6,27	-2,50	-3,61	49,24	36,90
Var. IBOVESPA p.p.	-0,97	-8,20	-8,20	-10,63	-6,50	-15,09	11,14
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	4,64	12,59	12,59	2,47	-3,79	50,39	20,69
Var. IBOVESPA p.p.	-1,42	-1,89	-1,89	-5,65	-6,68	-13,95	-5,07
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	7,62	12,27	12,27	-0,99	-9,03	30,57	15,81
Var. IBOVESPA p.p.	1,56	-2,21	-2,21	-9,12	-11,91	-33,76	-9,96
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-4,11	-19,62	-19,62	-10,12	-7,40	52,03	93,17
Var. Global BDRX p.p.	-0,13	-0,29	-0,29	-0,72	-2,26	-4,80	-5,60
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	-4,53	-21,86	-21,86	-12,08	-6,29	49,12	81,53
Var. IBOVESPA p.p.	-10,59	-36,33	-36,33	-20,21	-9,17	-15,22	55,76
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	-4,08	-17,93	-17,93	-9,84	-6,16		
Var. MSCI World p.p.							
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-6,90	-22,90	-22,90	-17,79	-15,88	44,92	74,35
% do CDI	-747,72	-944,53	-944,53	-412,67	-247,72	511,58	505,54
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-8,17	-31,93	-31,93	-30,82	-31,50	23,14	
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-10,31	-36,62	-36,62	-40,19	-49,47	-9,49	
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	0,57	29,97	29,97	27,27	21,54	53,00	163,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Variação da Estratégia							
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,57	25,28	25,28	17,90	3,56	20,38	117,99
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..							
% do CDI	6,19	4,51	4,51	3,46	2,90	-10,06	-15,66
	670,81	185,88	185,88	80,18	45,30	-114,52	-106,46
BERTIOGA							
Var. IPCA + 4,99% p.p.	2,69	3,79	3,79	2,43	1,14	18,74	22,64
	0,64	-0,66	-0,66	-6,42	-15,71	-11,37	-18,54
CDI							
	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71
IBOVESPA							
	6,06	14,48	14,48	8,13	2,89	64,34	25,77
INPC + 6,00%							
	2,23	4,91	4,91	9,38	18,43	34,19	47,02
IPCA + 6,00%							
	2,14	4,69	4,69	9,37	17,98	32,62	45,29

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	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	-	2,00
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,07
BB PREV RF IPCA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREV RF VII	D+0	D+0	D+0	D+0		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)		3,00
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,50
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		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		1,50
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		0,80
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+8 du		1,00
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
WA ASSET VALUATION FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		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	0,89	2,28	2,28	3,43	5,14	7,77	14,95	22,64	34,09
IRF-M 1+	0,81	0,79	0,79	1,73	0,56	2,39	15,66	27,47	45,50
IRF-M TOTAL	0,84	1,35	1,35	2,35	2,19	4,49	16,08	26,70	43,00
IMA-B 5	2,61	3,81	3,81	5,92	8,72	17,96	28,97	40,83	57,68
IMA-B 5+	3,56	1,91	1,91	1,99	0,35	12,40	21,66	42,68	57,29
IMA-B TOTAL	3,07	2,87	2,87	3,96	4,50	15,36	25,90	43,16	58,53
IMA-GERAL TOTAL	1,57	2,54	2,54	3,91	4,91	10,14	19,47	30,83	44,94
IDKA 2	2,54	3,88	3,88	5,80	9,10	18,45	29,25	41,12	58,63
IDKA 20	4,00	0,37	0,37	-2,51	-7,51	6,54	12,87	41,87	51,51
CDI	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71	21,98	32,24

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,06	14,48	14,48	8,13	2,89	64,34	25,77	40,57	84,66
IBRX 100	5,96	14,89	14,89	8,55	2,79	66,70	29,68	46,11	91,79
IBRX 50	5,43	15,47	15,47	10,28	4,13	71,54	27,56	41,05	86,31
SMALL CAP	8,81	6,69	6,69	-5,35	-9,80	48,46	30,68	46,05	95,46
IFIX	1,42	-0,88	-0,88	2,37	-2,35	11,46	11,96	17,92	36,76
Índice Consumo - ICON	5,74	-0,88	-0,88	-11,99	-18,58	22,89	14,32	13,52	40,45
Índice Dividendos - IDIV	10,00	15,48	15,48	13,37	11,66	55,59	43,49	63,17	97,87

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	1,62	3,20	3,20	6,25	11,30	18,09	21,99	27,57	30,99
INPC	1,71	3,42	3,42	6,26	11,73	19,48	23,44	29,20	31,22
IGPM	1,74	5,49	5,49	7,11	14,77	50,46	60,70	73,99	74,34
SELIC	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71	21,99	32,26

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	-4,75	-19,30	-19,30	-8,39	-5,17	59,75	94,34	144,53	186,72
MSCI ACWI	-6,10	-19,97	-19,97	-12,65	-12,11	46,60	70,12	100,67	137,04

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,97	4,20	4,20	8,34	15,75	27,68	37,22	49,19	59,20
IPCA + 5,00%	2,05	4,45	4,45	8,86	16,86	30,14	41,22	55,00	66,95
IPCA + 5,50%	2,10	4,57	4,57	9,11	17,42	31,38	43,24	57,97	70,94
IPCA + 5,89%	2,13	4,66	4,66	9,31	17,85	32,35	44,84	60,31	74,11
IPCA + 6,00%	2,14	4,69	4,69	9,37	17,98	32,62	45,29	60,98	75,01
INPC + 4,00%	2,06	4,42	4,42	8,35	16,20	29,19	38,85	51,10	59,47
INPC + 6,00%	2,23	4,91	4,91	9,38	18,43	34,19	47,02	63,04	75,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
191	03/03/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	4.400.000,00	0,00	145.866,14016200	30,1646427000
192	10/03/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	3.200.000,00	0,00	105.876,96777400	30,2237594000
193	22/03/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	45.000,00	1.484,11165500	30,3211688000
194	24/03/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	1.333.000,00	0,00	43.924,65667300	30,3474199000
195	29/03/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.515.282,99	49.866,96382700	30,3865099000
196	29/03/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.334.717,01	43.924,65667300	30,3865099000
197	31/03/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	410.000,00	0,00	13.481,41135900	30,4122461000
Total			9.343.000,00	2.895.000,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 17.433.026,87

Value-At-Risk: 2,61%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BERTIOGA		2,61	2,61			667.608.770,21	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,09%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535		3,09	0,31	1,31			110.432.399,55	16,54
NTN-B 150824		1,40	0,01	1,07			10.615.861,01	1,59
NTN-B 150850		4,15	0,04	2,67			11.378.739,86	1,70
NTN-B 150545		3,72	0,03	1,88			8.892.294,02	1,33
NTN-B 150523		0,89	0,01	1,64			23.303.956,02	3,49
NTN-B 150545 (5,5400000%)		0,24	0,00	1,95			15.563.952,72	2,33
NTN-B 150545 (5,6700000%)		0,25	0,00	1,95			10.293.149,08	1,54
NTN-B 150545 (5,7300000%)		0,25	0,00	1,95			10.341.784,28	1,55
NTN-B 150555 (5,5400000%)		0,24	0,00	1,95			36.314.568,92	5,44
NTN-B 150555 (5,6700000%)		0,24	0,00	1,95			20.584.062,14	3,08
NTN-B 150555 (5,7200000%)		0,25	0,00	1,95			36.204.743,74	5,42
NTN-B 150840 (5,6210000%)		0,12	-0,00	1,97			10.005.675,71	1,50
NTN-B 150840 (5,6900000%)		0,12	-0,00	1,97			15.082.440,47	2,26
NTN-B 150850 (5,5400000%)		0,12	-0,00	1,97			20.192.370,07	3,02
NTN-B 150850 (5,6700000%)		0,12	-0,00	1,97			20.019.570,16	3,00
NTN-B 150850 (5,7300000%)		0,12	-0,00	1,97			15.084.537,94	2,26
Sub-total	2,99	1,17	0,40		0,55	2,58	374.310.105,69	56,07

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

Carteira: BERTIOGA

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IPCA		0,89	0,01	0,87			17.400.822,18	2,61
BB PREV RF VII		0,73	0,00	1,95			5.963.999,01	0,89
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF		2,61	0,04	0,89			16.600.314,40	2,49
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..		1,40	0,02	1,07			20.298.265,00	3,04
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI		0,80	0,00	0,77			6.280.662,09	0,94
Sub-total	3,23	1,26	0,07		0,57	2,77	66.544.062,68	9,97

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI		0,04	0,00	0,01			30.797.166,58	4,61
Sub-total	0,03	0,04	0,00		-0,67	0,90	30.797.166,58	4,61

Renda Variável

Artigo 8º I	Value-At-Risk: 10,11%							
-------------	-----------------------	--	--	--	--	--	--	--

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST ACOES FIC FIA		7,21	0,19	2,43			20.471.930,14	3,07
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES		11,42	0,11	5,63			7.182.594,86	1,08
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		10,12	0,59	2,49			41.902.658,55	6,28
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		9,20	0,25	4,95			19.587.871,44	2,93
WA ASSET VALUATION FIA		9,95	0,11	3,40			7.987.545,48	1,20
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		13,42	0,73	7,89			38.995.253,48	5,84
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		7,57	0,04	2,40			4.146.280,28	0,62
Sub-total	22,04	10,11	2,02		0,22	5,67	140.274.134,23	21,01

Investimentos no Exterior

Artigo 9º II	Value-At-Risk: 9,89%							
--------------	----------------------	--	--	--	--	--	--	--

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI		9,13	0,01	10,94			4.664.261,78	0,70

Carteira: BERTIOGA

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		16,50	0,06	16,50			7.161.625,13	1,07
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,00	0,02	9,01			8.504.848,32	1,27
Sub-total	27,25	10,58	0,08		-0,28	-6,73	20.330.735,23	3,05
Artigo 9º III								
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		10,42	0,02	0,97			4.915.942,74	0,74
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		10,77	0,02	12,50			4.725.508,96	0,71
Sub-total	25,70	10,38	0,04		-0,20	-4,32	9.641.451,70	1,44

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 1,48%

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..		0,20	-0,00	0,20			5.208.285,48	0,78
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME		1,86	0,00	1,86			20.502.828,62	3,07
Sub-total	5,57	1,48	0,00		0,13	1,66	25.711.114,10	3,85