



**LDB**  
EMPRESAS

**TIBAGI**  
JANEIRO 2022



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.01.2022.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 91,36%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF M	3,54	-0,02	-0,02	0,00	0,00	4.743.847.539,71	0,00
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,68	0,61	0,61	4.823.260,40	4,29	5.049.727.685,75	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,67	0,61	0,61	1.889.855,48	1,68	6.296.869.255,71	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,77	0,09	0,09	9.098.697,85	8,09	12.040.160.059,77	0,08
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,62	0,01	0,01	20.963.021,19	18,65	9.258.989.052,65	0,23
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,77	0,02	0,02	1.778.358,58	1,58	10.879.369.499,05	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,54	-0,14	-0,14	0,00	0,00	1.205.162.298,95	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,79	0,08	0,08	20.860.339,57	18,56	6.406.714.372,41	0,33
BB	BB	BB PREV RF VII	1,68	0,56	0,56	45.640,61	0,04	249.437.254,95	0,02
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,77	0,04	0,04	9.948.462,34	8,85	7.461.201.984,89	0,13
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,30	0,67	0,67	15.582.660,26	13,86	11.686.800.915,89	0,13
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,24	-0,37	-0,37	9.963.372,46	8,86	911.505.616,42	1,09
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,76</b>	<b>0,17</b>	<b>0,17</b>	<b>94.953.668,74</b>	<b>84,47</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,15	0,65	0,65	1.792.089,32	1,59	3.101.943.229,29	0,06
BB	BB	BB INSTITUCIONAL FI RF	0,21	0,76	0,76	901.310,92	0,80	1.069.706.638,31	0,08
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,67	0,19	0,19	5.048.307,17	4,49	4.210.770.280,16	0,12
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>1,23</b>	<b>0,32</b>	<b>0,32</b>	<b>7.741.707,41</b>	<b>6,89</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,71</b>	<b>0,18</b>	<b>0,18</b>	<b>102.695.376,15</b>	<b>91,36</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

5,23%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,24	6,70	6,70	210.110,66	0,19	1.044.534.082,64	0,02
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	13,57	-5,41	-5,41	1.622.058,21	1,44	2.567.862.425,36	0,06
BB	BB	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	19,04	6,49	6,49	4.050.746,17	3,60	1.502.868.240,22	0,27
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>14,91</b>	<b>2,92</b>	<b>2,92</b>	<b>5.882.915,04</b>	<b>5,23</b>		
Renda Variável			14,91	2,92	2,92	5.882.915,04	5,23		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,41%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI	2,12	1,32	1,32	3.832.998,01	3,41	2.298.597.190,94	0,17
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>2,12</b>	<b>1,32</b>	<b>1,32</b>	<b>3.832.998,01</b>	<b>3,41</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>1,31</b>	<b>1,32</b>	<b>1,32</b>	<b>3.832.998,01</b>	<b>3,41</b>		
<b>Total</b>			<b>1,93</b>	<b>0,36</b>	<b>0,36</b>	<b>112.411.289,20</b>	<b>100,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	94.953.668,74	84,47	60,00	60,00	90,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	7.741.707,41	6,89	5,00	10,00	30,00	0,00	60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>102.695.376,15</b>	<b>91,36</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	5.882.915,04	5,23	3,00	10,00	28,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>5.882.915,04</b>	<b>5,23</b>					30,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	3.832.998,01	3,41	2,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>3.832.998,01</b>	<b>3,41</b>					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, Alínea b % do CDI	0,17 23,12	0,17 23,12				159.189,16	159.189,16
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,32 43,78	0,32 43,78				21.749,43	21.749,43
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	2,92 -4,06	2,92 -4,06				167.158,89	167.158,89
Artigo 10º I % do CDI	1,32 180,08	1,32 180,08				49.886,01	49.886,01
<b>TIBAGI (Total)</b>						<b>397.983,49</b>	<b>397.983,49</b>

## RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	9.944.684,55	0,00	0,00	0,00	9.948.462,34	3.777,79	3.777,79
BB PREV RF IDKA2	20.961.002,32	0,00	0,00	0,00	20.963.021,19	2.018,87	2.018,87
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	20.844.328,46	0,00	0,00	0,00	20.860.339,57	16.011,11	16.011,11
BB PREV RF IRF M	3.603.912,92	0,00	-3.603.185,89	0,00	0,00	-727,03	-727,03
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	5.154.486,11	395.052,67	-758.889,22	0,00	4.823.260,40	32.610,84	32.610,84
BB PREV RF VII	45.384,50	0,00	0,00	0,00	45.640,61	256,11	256,11
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,00	10.000.000,00	0,00	0,00	9.963.372,46	-36.627,54	-36.627,54
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.778.024,08	0,00	0,00	0,00	1.778.358,58	334,50	334,50
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.090.482,08	0,00	0,00	0,00	9.098.697,85	8.215,77	8.215,77
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.845.043,19	33.540,22	0,00	0,00	1.889.855,48	11.272,07	11.272,07
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.703.772,08	0,00	-3.698.506,74	0,00	0,00	-5.265,34	-5.265,34
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	19.455.348,25	0,00	-4.000.000,00	0,00	15.582.660,26	127.312,01	127.312,01
					94.953.668,74	0,00	0,00

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

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB INSTITUCIONAL FI RF	894.541,25	0,00	0,00	0,00	901.310,92	6.769,67	6.769,67
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	5.038.693,82	0,00	0,00	0,00	5.048.307,17	9.613,35	9.613,35
BB PREV RF FLUXO FIC	513.655,94	1.324.073,41	-51.006,44	0,00	1.792.089,32	5.366,41	5.366,41
					7.741.707,41	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	1.714.794,47	0,00	0,00	0,00	1.622.058,21	-92.736,26	-92.736,26
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	196.924,23	0,00	0,00	0,00	210.110,66	13.186,43	13.186,43
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	3.804.037,45	0,00	0,00	0,00	4.050.746,17	246.708,72	246.708,72
					5.882.915,04	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI	3.783.112,00	0,00	0,00	0,00	3.832.998,01	49.886,01	49.886,01
					3.832.998,01	0,00	0,00



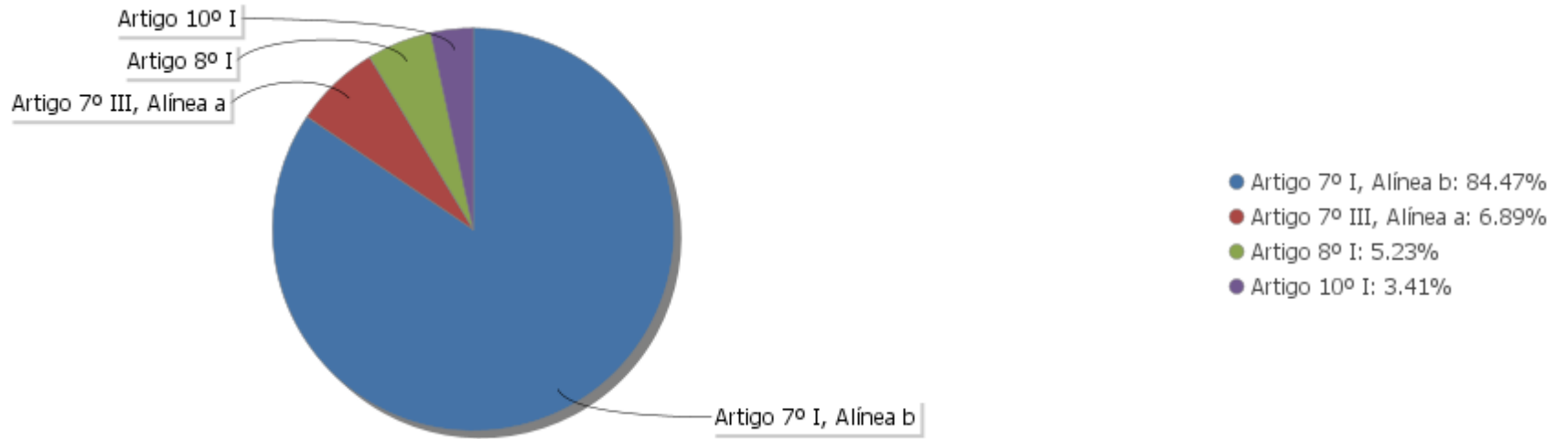
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

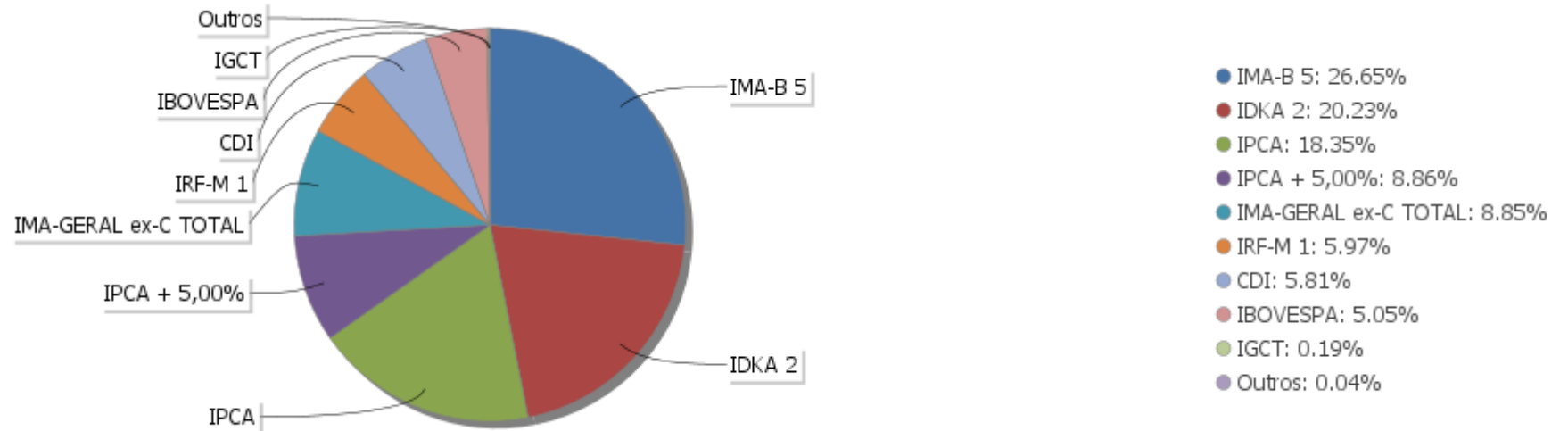
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	102.402.276,13	91,10	102.402.276,13	91,10
de 31 a 365 dias	45.640,61	0,04	102.447.916,74	91,14
acima de 365 dias	9.963.372,46	8,86	112.411.289,20	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

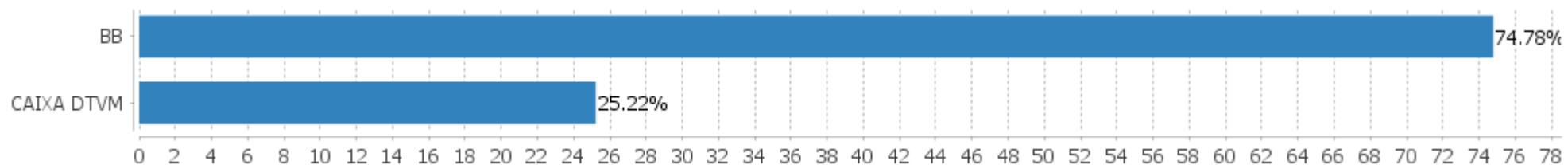


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial**

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2022	0,36												0,36
IPCA + 5,04%	0,95												0,95
p.p. indexador	-0,59												-0,59

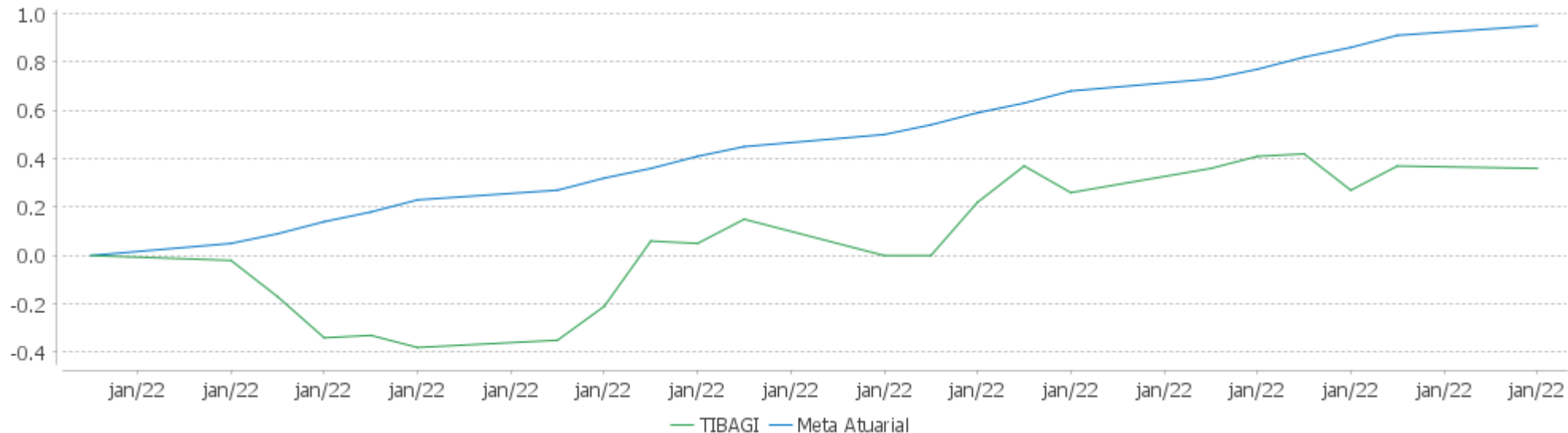
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

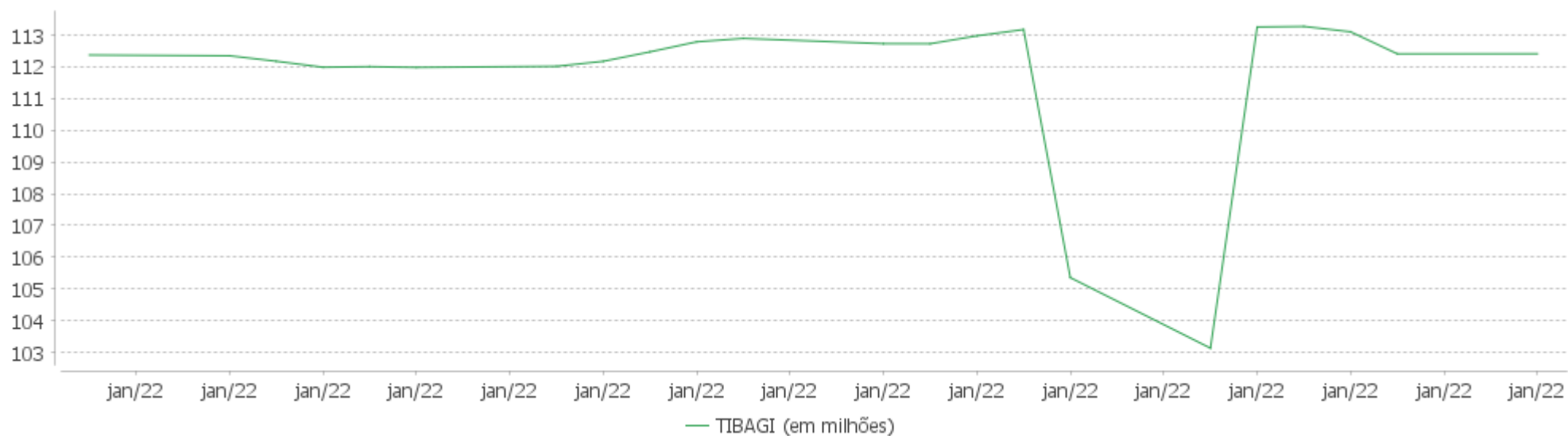
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	0	0,00	03 meses				
Meses abaixo - Meta Atuarial	1	100,00	06 meses				
			12 meses				
			24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	0,36	2022-01	Desde 31/12/2021	0,36	0,95	-0,59	1,93
Menor rentabilidade da Carteira	0,36	2022-01					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

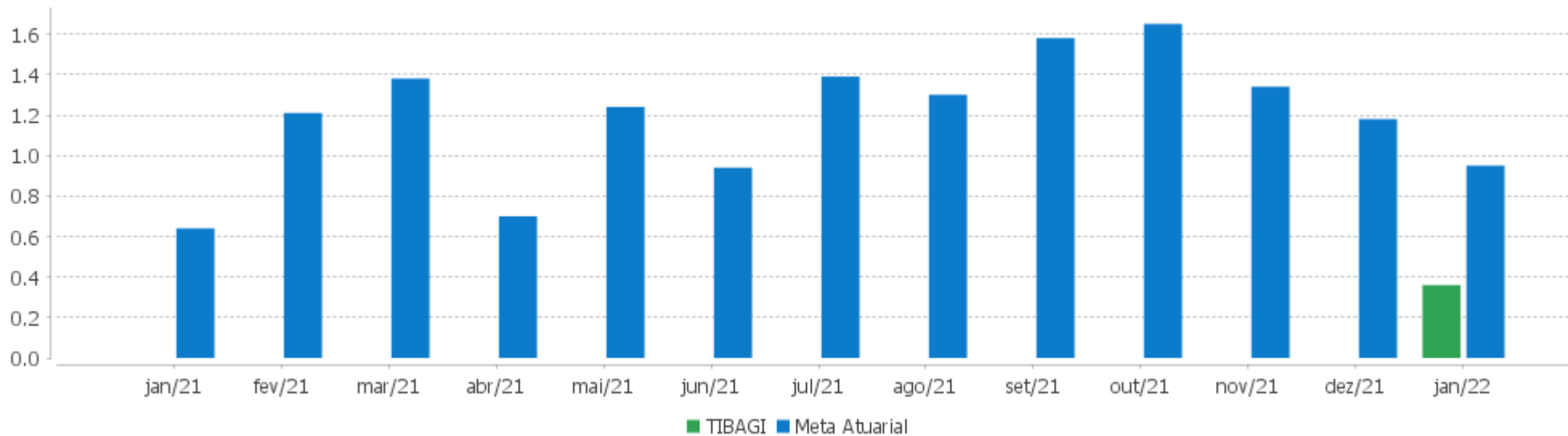


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB INSTITUCIONAL FI RF % do CDI	0,76 103,35	0,76 103,35	2,23 106,22	3,73 107,38	5,47 109,24	7,84 102,34	13,92 100,17
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,65 89,07	0,65 89,07	1,84 87,65	2,91 83,63	3,86 77,14	5,35 69,76	10,25 73,70
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,19 -0,35	0,19 -0,35	2,51 0,27	1,24 -4,39	1,20 -9,18		
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,09 -0,02	0,09 -0,02	3,35 -0,08	3,20 -0,12	4,32 -0,25	11,89 -0,59	25,04 -1,00
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,56 1,30	0,56 1,30	2,91 -0,03	4,19 5,10	6,86 8,01	12,96 8,94	23,37 0,51
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,01 -0,04	0,01 -0,04	3,16 -0,25	3,11 -0,18	4,47 -0,40	12,51 -0,97	24,08 -1,89
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,04	0,04	2,70	0,57	0,19	4,20	16,07
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,67 0,13	0,67 0,13	2,42 0,18	0,62 -5,00	0,53 -9,85	6,39 -9,02	21,39 1,14
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,61 -0,01	0,61 -0,01	2,25 -0,06	2,43 -0,11	3,24 -0,29	6,41 -0,67	13,14 -1,02
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,02 -0,03	0,02 -0,03	3,17 -0,24	3,14 -0,15	4,54 -0,33	12,57 -0,90	24,17 -1,81
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,08 -0,04	0,08 -0,04	3,33 -0,09	3,12 -0,20	4,25 -0,32	11,85 -0,63	25,06 -0,97
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,42 -0,65	-0,42 -0,65					
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,61 -0,02	0,61 -0,02	2,25 -0,06	2,44 -0,10	3,30 -0,23	6,63 -0,45	13,45 -0,71
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,13 -0,05	-0,13 -0,05	3,58 -0,05	-0,22 -0,19	-1,62 -0,34	2,96 -0,62	14,51 -0,94
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,07 0,01	-0,07 0,01	3,64 0,01	-0,11 -0,08	-1,50 -0,22	3,17 -0,41	14,64 -0,82
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	6,49 -0,50	6,49 -0,50	8,64 0,29	-2,97 4,96	5,03 7,57	11,07 12,49	
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	-5,41	-5,41	-0,96	4,38	23,74		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

<b>Fundo</b> <b>Varição da Estratégia</b>	<b>No Mês</b>	<b>No Ano</b>	<b>3 meses</b>	<b>6 meses</b>	<b>12 meses</b>	<b>24 meses</b>	<b>36 meses</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-12,39	-12,39	-9,31	12,31	26,28		
<b>BB AÇÕES GOVERNANÇA FI</b>	<b>6,70</b>	<b>6,70</b>	<b>8,41</b>	<b>-9,80</b>	<b>-2,87</b>	<b>-2,40</b>	<b>17,07</b>
Var. IGCT p.p.	-0,14	-0,14	-0,22	-0,39	-0,77	-1,77	-3,15
<b>BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI</b>	<b>1,32</b>	<b>1,32</b>	<b>2,02</b>	<b>2,41</b>	<b>3,59</b>	<b>7,61</b>	<b>15,78</b>
% do CDI	180,08	180,08	96,47	69,28	71,73	99,23	113,52
<b>TIBAGI</b>	<b>0,36</b>	<b>0,36</b>					
Var. IPCA + 5,04% p.p.	-0,59	-0,59					
<b>CDI</b>	<b>0,73</b>	<b>0,73</b>	<b>2,10</b>	<b>3,47</b>	<b>5,00</b>	<b>7,66</b>	<b>13,90</b>
<b>IBOVESPA</b>	<b>6,98</b>	<b>6,98</b>	<b>8,35</b>	<b>-7,93</b>	<b>-2,54</b>	<b>-1,42</b>	<b>15,14</b>
<b>INPC + 6,00%</b>	<b>1,16</b>	<b>1,16</b>	<b>3,78</b>	<b>8,75</b>	<b>17,24</b>	<b>31,05</b>	<b>44,93</b>
<b>IPCA + 6,00%</b>	<b>1,03</b>	<b>1,03</b>	<b>3,76</b>	<b>8,77</b>	<b>17,00</b>	<b>29,59</b>	<b>43,15</b>



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB INSTITUCIONAL FI RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+1 du		1,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0		D+3 du		
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IRF M	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREV RF VII	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Indexadores**

**Renda Fixa**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,63	0,63	2,31	2,54	3,53	7,08	14,16	22,11	34,75
IRF-M 1+	-0,50	-0,50	4,01	-1,41	-4,13	1,40	15,16	29,50	49,44
IRF-M TOTAL	-0,08	-0,08	3,63	-0,03	-1,28	3,58	15,45	27,96	45,98
IMA-B 5	0,11	0,11	3,42	3,32	4,57	12,47	26,04	38,75	56,48
IMA-B 5+	-1,61	-1,61	2,45	-4,92	-6,47	-3,03	18,62	39,06	60,95
IMA-B TOTAL	-0,73	-0,73	2,94	-0,91	-1,15	4,02	22,86	40,20	60,52
IMA-GERAL TOTAL	0,21	0,21	2,90	1,13	1,42	5,98	17,98	30,01	46,61
IDKA 2	0,05	0,05	3,41	3,29	4,87	13,47	25,98	38,94	57,36
IDKA 20	-2,92	-2,92	0,64	-12,61	-14,59	-13,99	10,19	35,73	59,77
CDI	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90	21,17	32,56

**Renda Variável**

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

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,54	0,54	2,24	5,63	10,38	15,41	20,25	24,79	28,35
INPC	0,67	0,67	2,26	5,61	10,60	16,72	21,74	26,09	28,45
IGPM	1,82	1,82	2,72	3,40	16,91	46,97	58,45	69,12	68,43
SELIC	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90	21,18	32,59

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-9,05	-9,05	-6,91	7,47	18,94	75,67	144,98	170,90	239,48
MSCI ACWI	-8,76	-8,76	-8,61	3,62	9,17	61,14	114,25	124,36	183,76

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	0,87	3,26	7,73	14,79	24,77	35,22	45,90	55,99
IPCA + 5,00%	0,95	0,95	3,51	8,26	15,90	27,17	39,15	51,57	63,59
IPCA + 5,50%	0,99	0,99	3,64	8,51	16,45	28,37	41,14	54,46	67,50
IPCA + 5,89%	1,02	1,02	3,73	8,72	16,88	29,32	42,71	56,75	70,61
IPCA + 6,00%	1,03	1,03	3,76	8,77	17,00	29,59	43,15	57,40	71,49
INPC + 4,00%	1,00	1,00	3,28	7,71	15,02	26,18	36,90	47,41	56,11
INPC + 6,00%	1,16	1,16	3,78	8,75	17,24	31,05	44,93	59,03	71,61

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	07/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	34.084,43	0,00	12.172,60717000	2,8000928250
2	13/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	322.189,16	0,00	114.850,18798500	2,8052993700
3	13/01/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	977,89	446,64962300	2,1893895130
4	17/01/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	695,18	317,32507700	2,1907502750
5	20/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.540,22	0,00	12.435,87262200	2,6970540000
6	21/01/2022	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	4.000.000,00	2.628.402,38061100	1,5218370000
7	21/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	3.698.506,74	1.607.739,54118500	2,3004390000
8	24/01/2022	BB PREV RF IRF M	0,00	2.329.279,61	387.797,23711500	6,0064368362
9	24/01/2022	BB PREV RF IRF M	0,00	1.273.906,28	212.090,18380600	6,0064367890
10	24/01/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.273.906,28	0,00	580.591,96986600	2,1941507050
11	25/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	27.786,35	0,00	9.869,77696200	2,8152966480
12	25/01/2022	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	10.000.000,00	0,00	10.005.601,01538100	0,9994402120
13	25/01/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	50.167,13	0,00	22.856,76577100	2,1948481470
14	28/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	758.889,22	269.740,03647800	2,8134096440
15	28/01/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	49.163,37	22.378,68065900	2,1968842020
16	31/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	10.992,73	0,00	3.906,05743000	2,8142776180
17	31/01/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	170,00	77,35877800	2,1975528210
<b>Total</b>			<b>11.752.666,30</b>	<b>12.111.588,29</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.218.161,16

Value-At-Risk: 1,08%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TIBAGI		1,08	1,08			112.411.289,20	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,97%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF M		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,63	0,02	0,03			4.823.260,40	4,29
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,63	0,01	0,02			1.889.855,48	1,68
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,06	0,08	0,01			9.098.697,85	8,09
BB PREV RF IDKA2		1,36	0,23	0,38			20.963.021,19	18,65
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,60	0,02	0,26			1.778.358,58	1,58
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,10	0,18	0,04			20.860.339,57	18,56
BB PREV RF VII		0,77	0,00	2,08			45.640,61	0,04
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,11	0,09	1,75			9.948.462,34	8,85
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,74	0,08	0,76			15.582.660,26	13,86
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,87	0,05	0,87			9.963.372,46	8,86
<b>Sub-total</b>	1,76	1,00	0,76		-0,32	0,17	94.953.668,74	84,47

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC		0,04	0,00	0,00			1.792.089,32	1,59
BB INSTITUCIONAL FI RF		0,05	0,00	0,04			901.310,92	0,80
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		0,86	0,03	0,87			5.048.307,17	4,49
<b>Sub-total</b>	1,23	0,56	0,03		-0,33	0,32	7.741.707,41	6,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,85%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		11,27	0,01	0,10			210.110,66	0,19
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA		8,00	0,04	11,03			1.622.058,21	1,44
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI		10,69	0,23	2,50			4.050.746,17	3,60
<b>Sub-total</b>	14,91	8,85	0,28		0,15	2,92	5.882.915,04	5,23

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 1,19%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI		1,19	0,01	1,18			3.832.998,01	3,41
<b>Sub-total</b>	1,31	1,19	0,01		0,45	1,32	3.832.998,01	3,41