



LDB
EMPRESAS

SÃO VICENTE - CONSOLIDADO
NOVEMBRO 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 30.11.2021.

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

67,50%

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
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	7,03	3,95	-3,51	1.782.192,00	0,81	65.608.320,63	2,72
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,86	3,44	-1,71	4.263.234,15	1,93	7.086.428.606,24	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,84	3,44	-1,74	12.360.844,43	5,60	4.821.319.332,60	0,26
ITAU	ITAU	ITAU RF IMAB5+ FIC DE FI	9,16	4,45	-6,44	6.388.118,61	2,89	235.048.124,48	2,72
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9,12	4,35	-6,68	13.886.876,58	6,29	1.325.439.328,27	1,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,73	2,42	3,91	34.410.409,36	15,58	10.904.431.852,46	0,32
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,88	1,73	-1,30	13.275.241,83	6,01	7.834.893.808,79	0,17
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,89	2,99	-0,99	86.366.916,96	39,11		

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 RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,36	3,89	-1,55	7.984.625,63	3,62	671.314.831,93	1,19
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,12	0,59	3,55	5.023.329,67	2,27	24.307.961.479,31	0,02
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	9,20	4,41	-6,50	3.366.234,09	1,52	196.805.470,85	1,71
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,91	2,47	2,87	16.443.577,24	7,45	1.234.041.082,90	1,33
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,09	1,64	3,64	25.947.124,49	11,75	2.636.961.892,37	0,98
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,14	0,64	4,10	793.760,88	0,36	3.516.484.081,03	0,02
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,56	2,17	1,91	59.558.652,00	26,97		

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
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,34	0,80	4,36	3.140.141,34	1,42	756.831.719,31	0,41
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			0,34	0,80	4,36	3.140.141,34	1,42		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

3,96

2,60

0,12

149.065.710,30

67,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

23,39%

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
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	19,48	0,26	-11,36	3.155.307,59	1,43	844.564.387,94	0,37
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	18,67	-4,24	-18,28	817.472,16	0,37	422.222.967,12	0,19
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	18,31	-2,19	-17,97	426.783,51	0,19	1.000.433.428,63	0,04
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	23,64	-2,97	-19,23	7.244.976,47	3,28	435.071.823,46	1,67
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	23,46	-6,71	-31,32	5.189.774,33	2,35	1.947.793.507,85	0,27
QUELUZ	BEM	QUELUZ VALOR FI EM ACOES	19,58	-1,69	-26,90	1.096.435,35	0,50	99.268.318,13	1,10
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	19,73	-2,73	-19,06	3.760.835,22	1,70	224.686.885,13	1,67
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	20,30	0,63	-18,89	2.433.273,17	1,10	666.682.090,52	0,36
SOMMA	BEM	SOMMA BRASIL FIA	19,37	-2,50	-20,65	1.190.221,08	0,54	328.119.912,77	0,36
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	23,07	-7,60	-28,85	1.778.712,48	0,81	261.217.040,05	0,68
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	23,99	-3,24	-27,16	1.456.868,58	0,66	864.957.103,62	0,17
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	19,99	-2,67	-15,69	452.351,74	0,20	981.231.017,58	0,05
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVSPA - FIA	20,42	-1,37	-16,73	442.956,45	0,20	378.851.973,01	0,12
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			20,63	-3,24	-20,83	29.445.968,13	13,33		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SAFRA	SAFRA	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,93	0,33	1,87	2.491.115,99	1,13	427.424.879,40	0,58
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	12,64	-0,51	25,32	17.479.958,66	7,92	2.210.456.287,40	0,79
SICREDI	SICREDI	SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP	12,77	-0,46	12,47	2.237.655,98	1,01	339.141.315,58	0,66
Sub-total Artigo 8º III			10,93	-0,41	21,83	22.208.730,63	10,06		
Renda Variável			15,05	-2,04	-6,46	51.654.698,76	23,39		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

9,10%

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
MIRAE ASSET	SANTANDER	BOTZ GLOBAL X MIRAE ASSET ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD FIC FIA IE	23,02	-4,04	-3,31	1.450.408,65	0,66	11.522.421,47	12,59
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	18,77	-0,71	7,80	8.107.834,02	3,67	160.887.427,13	5,04
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	30,65	0,15	13,16	10.543.803,12	4,77	548.278.333,36	1,92
Sub-total Artigo 9º II			19,95	-0,71	10,24	20.102.045,79	9,10		
Investimentos no Exterior			19,95	-0,71	10,24	20.102.045,79	9,10		
Total			5,54	1,28	-1,90	220.822.454,85	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	86.366.916,96	39,11	0,00	55,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	59.558.652,00	26,97	0,00	10,00	40,00	0,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	3.140.141,34	1,42	0,00	0,00	5,00	0,00	10,00
	Total Renda Fixa	149.065.710,30	67,50					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	29.445.968,13	13,33	0,00	20,00	20,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	22.208.730,63	10,06	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável	51.654.698,76	23,39					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	20.102.045,79	9,10	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	20.102.045,79	9,10					10,00
Total		220.822.454,85	100,00					

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	2,99 510,38	-0,99 -27,50	0,76 50,36	-0,15 -5,87	3,24 85,85	2.517.276,47	-919.758,95
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	2,17 370,55	1,91 52,93	1,74 115,16	1,82 69,59	3,89 103,04	1.399.515,08	1.143.468,07
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,80 136,43	4,36 121,10	2,24 147,74	3,69 140,88	4,71 124,82	24.936,62	76.654,99
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,24 -1,71	-20,83 -6,46	-18,98 -4,78	-25,36 -6,11	-14,79 -8,38	-985.538,91	-8.505.805,72
Artigo 8º III % do CDI	-0,41 -70,06	21,83 605,59	1,95 129,12	9,97 380,99	25,08 664,39	-91.667,70	3.633.691,58
Artigo 9º II % do CDI	-0,71 -120,92	10,24 1.001,79				-61.540,36	819.408,52
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO (Total)						2.802.981,20	-3.752.341,51

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	13.048.976,06	0,00	0,00	0,00	13.275.241,83	226.265,77	-174.939,67
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.121.442,15	0,00	0,00	0,00	4.263.234,15	141.792,00	-74.371,29
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	1.714.400,00	0,00	0,00	0,00	1.782.192,00	67.792,00	-68.241,10
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	33.542.920,79	55.870,21	0,00	0,00	34.410.409,36	811.618,36	1.251.739,21
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	13.307.535,42	0,00	0,00	0,00	13.886.876,58	579.341,16	-994.546,73
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12.219.153,92	0,00	-276.829,90	0,00	12.360.844,43	418.520,41	-420.046,59
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	6.116.171,84	0,00	0,00	0,00	6.388.118,61	271.946,77	-439.352,78
					86.366.916,96	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	788.721,76	0,00	0,00	0,00	793.760,88	5.039,12	31.254,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	16.046.455,97	0,00	0,00	0,00	16.443.577,24	397.121,27	459.232,48
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	3.224.064,96	0,00	0,00	0,00	3.366.234,09	142.169,13	-234.197,28
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	33.761.616,56	1.357.850,95	-9.700.000,00	0,00	25.947.124,49	527.656,98	921.049,64
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	5.022.507,41	586.885,29	-614.750,41	0,00	5.023.329,67	28.687,38	91.217,42
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	7.685.784,43	0,00	0,00	0,00	7.984.625,63	298.841,20	-125.088,20
					59.558.652,00	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	3.115.204,72	0,00	0,00	0,00	3.140.141,34	24.936,62	76.654,99
					3.140.141,34	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST ACOES FIC FIA	853.696,17	0,00	0,00	0,00	817.472,16	-36.224,01	-182.920,28
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.866.246,77	0,00	0,00	0,00	3.760.835,22	-105.411,55	-885.442,32
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	7.466.576,91	0,00	0,00	0,00	7.244.976,47	-221.600,44	-1.848.905,70
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	3.147.089,39	0,00	0,00	0,00	3.155.307,59	8.218,20	-404.390,81
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	5.562.840,33	0,00	0,00	0,00	5.189.774,33	-373.066,00	-2.366.256,58
FIA CAIXA CONSUMO	1.924.986,59	0,00	0,00	0,00	1.778.712,48	-146.274,11	-721.287,52
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.505.716,73	0,00	0,00	0,00	1.456.868,58	-48.848,15	-543.131,42
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	2.418.030,07	0,00	0,00	0,00	2.433.273,17	15.243,10	-566.726,83
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	436.320,87	0,00	0,00	0,00	426.783,51	-9.537,36	-93.472,01
OCCAM FIC FIA	464.761,25	0,00	0,00	0,00	452.351,74	-12.409,51	-84.179,68
QUELUZ VALOR FI EM ACOES	1.115.336,99	0,00	0,00	0,00	1.096.435,35	-18.901,64	-403.564,65
SICREDI SCHRODERS IBOVSPA - FIA	449.120,14	0,00	0,00	0,00	442.956,45	-6.163,69	-89.010,79
SOMMA BRASIL FIA	1.220.784,83	0,00	0,00	0,00	1.190.221,08	-30.563,75	-309.778,92
					29.445.968,13	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	2.482.893,61	0,00	0,00	0,00	2.491.115,99	8.222,38	45.611,51
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	17.569.521,29	0,00	0,00	0,00	17.479.958,66	-89.562,63	3.350.424,09
SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP	2.247.983,43	0,00	0,00	0,00	2.237.655,98	-10.327,45	237.655,98
					22.208.730,63	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\$)
BOTZ GLOBAL X MIRAE ASSET ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD FIC FIA IE	1.511.480,68	0,00	0,00	0,00	1.450.408,65	-61.072,03	-49.591,35
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	4.432.401,75	3.700.000,00	0,00	0,00	8.107.834,02	-24.567,73	325.196,75
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	4.519.703,72	6.000.000,00	0,00	0,00	10.543.803,12	24.099,40	543.803,12
					20.102.045,79	0,00	0,00

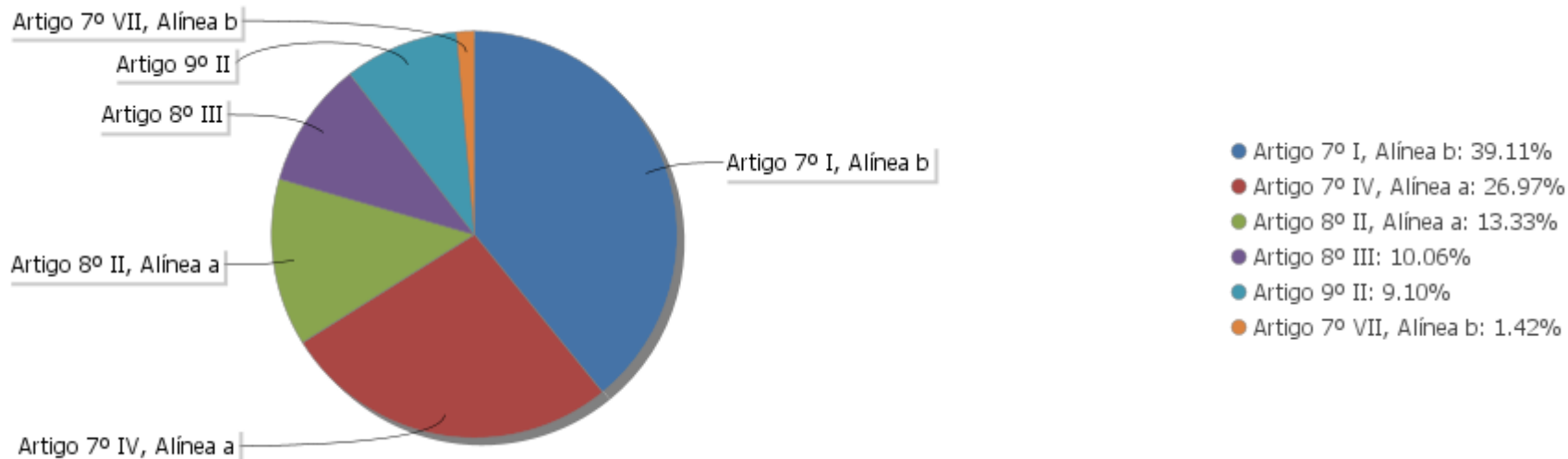
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

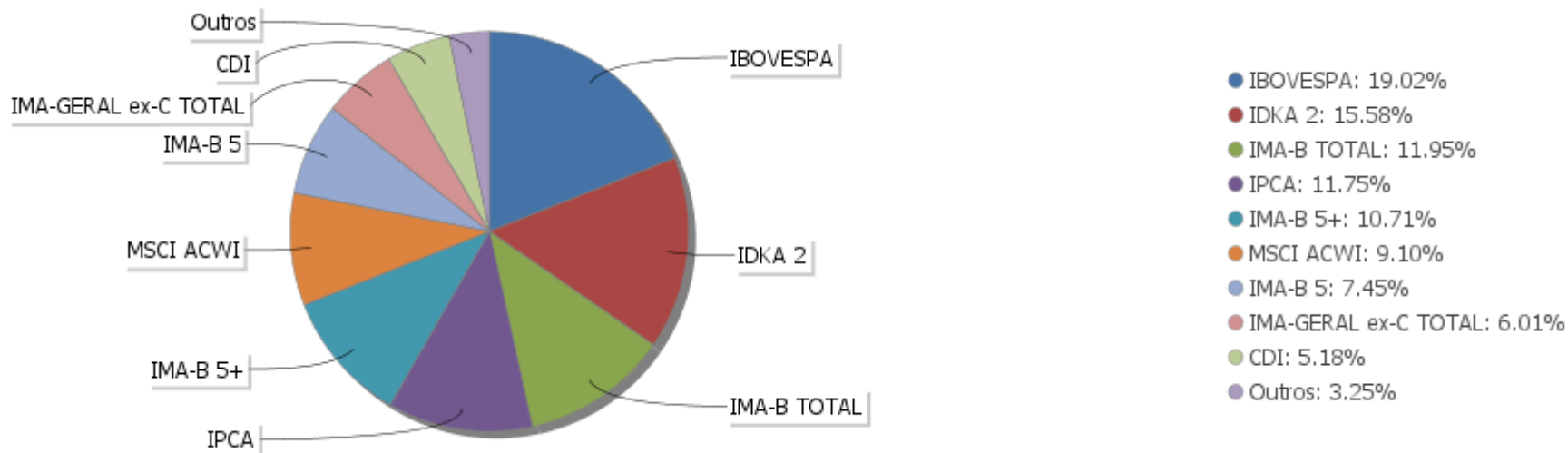
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	211.417.215,35	95,74	211.417.215,35	95,74
de 31 a 365 dias	7.623.047,50	3,45	219.040.262,85	99,19
acima de 365 dias	1.782.192,00	0,81	220.822.454,85	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

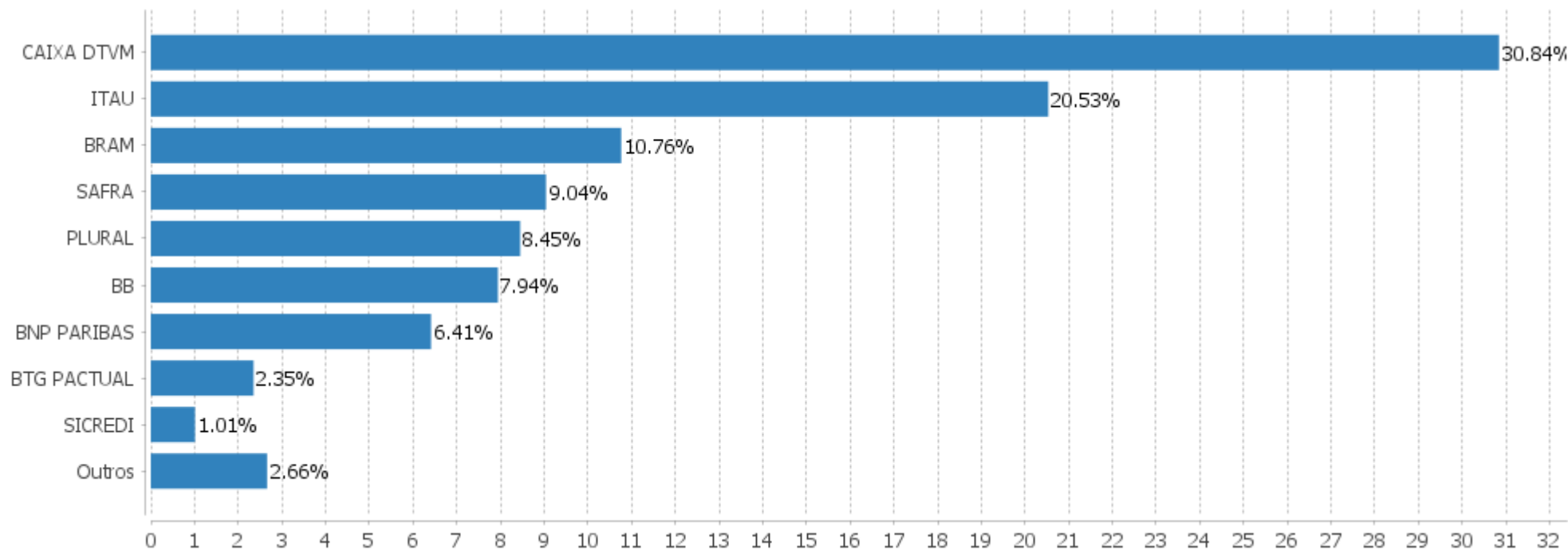


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,80	-1,08	0,50	1,25	1,35	0,53	-0,83	-0,87	-1,44	-1,75	1,28		-1,90
INPC + 5,47%	0,69	1,20	1,35	0,81	1,41	1,05	1,49	1,35	1,65	1,59	1,27		14,76
p.p. indexador	-1,50	-2,29	-0,85	0,44	-0,06	-0,51	-2,32	-2,22	-3,09	-3,34	0,01		-16,66
2020	0,37	-1,02	-8,71	2,51	2,16	2,34	3,92	-0,89	-1,68	-0,23	3,36	3,94	5,49
INPC + 6,00%	0,70	0,59	0,69	0,23	0,21	0,79	0,98	0,85	1,36	1,38	1,42	1,98	11,75
p.p. indexador	-0,34	-1,61	-9,40	2,27	1,94	1,55	2,94	-1,74	-3,04	-1,62	1,94	1,96	-6,26
2019	3,68	0,35	0,43	1,28	2,33	2,92	1,33	-0,10	2,15	2,38	-1,05	2,74	19,95
INPC + 6,00%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,44	0,57	1,01	1,71	10,78
p.p. indexador	2,81	-0,66	-0,78	0,19	1,67	2,47	0,69	-0,73	1,72	1,81	-2,06	1,03	9,17
2018	1,94	0,51	0,85	0,19	-2,24	-0,23	1,89	-0,53	0,08	5,08	0,90	1,26	9,96
INPC + 6,00%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	0,74	0,91	0,21	0,60	9,59
p.p. indexador	1,20	-0,08	0,29	-0,51	-3,16	-2,15	1,13	-1,07	-0,66	4,16	0,69	0,66	0,37
2017	1,43	2,24	1,15	0,15	-0,53	0,43	2,86	1,21	1,36	0,03	-0,23	0,89	11,50
INPC + 6,00%	0,93	0,66	0,85	0,50	0,87	0,19	0,66	0,50	0,44	0,86	0,64	0,72	8,12
p.p. indexador	0,50	1,58	0,29	-0,34	-1,40	0,24	2,21	0,71	0,91	-0,83	-0,88	0,16	3,39

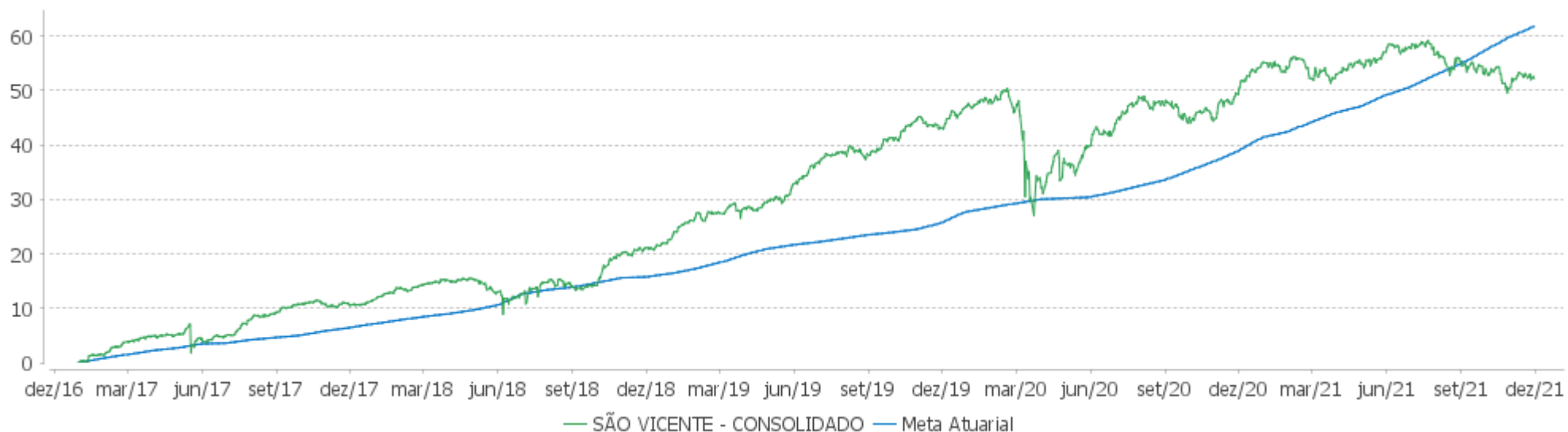
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

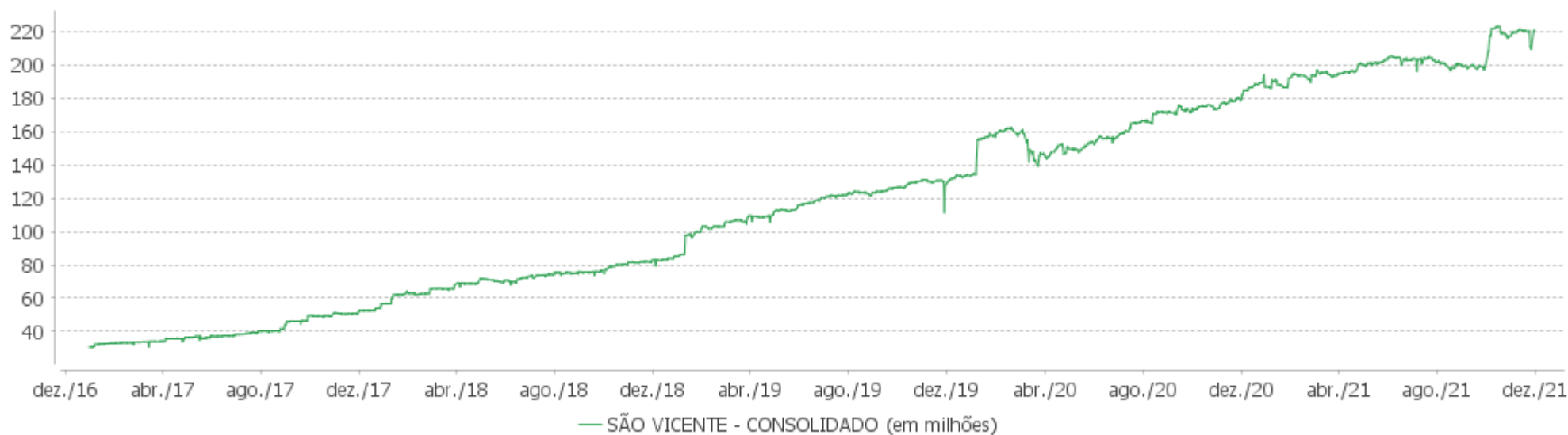
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	30	50,85	03 meses	-1,93	4,57	-6,50	6,44
Meses abaixo - Meta Atuarial	29	49,15	06 meses	-3,07	8,69	-11,76	5,82
			12 meses	1,96	17,03	-15,07	5,54
			24 meses	6,32	30,44	-24,11	9,91
Maior rentabilidade da Carteira	5,08	2018-10	36 meses	25,70	42,92	-17,22	8,41
Menor rentabilidade da Carteira	-8,71	2020-03	48 meses	37,70	56,81	-19,11	7,99
			Desde 30/12/2016	52,19	68,32	-16,13	7,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

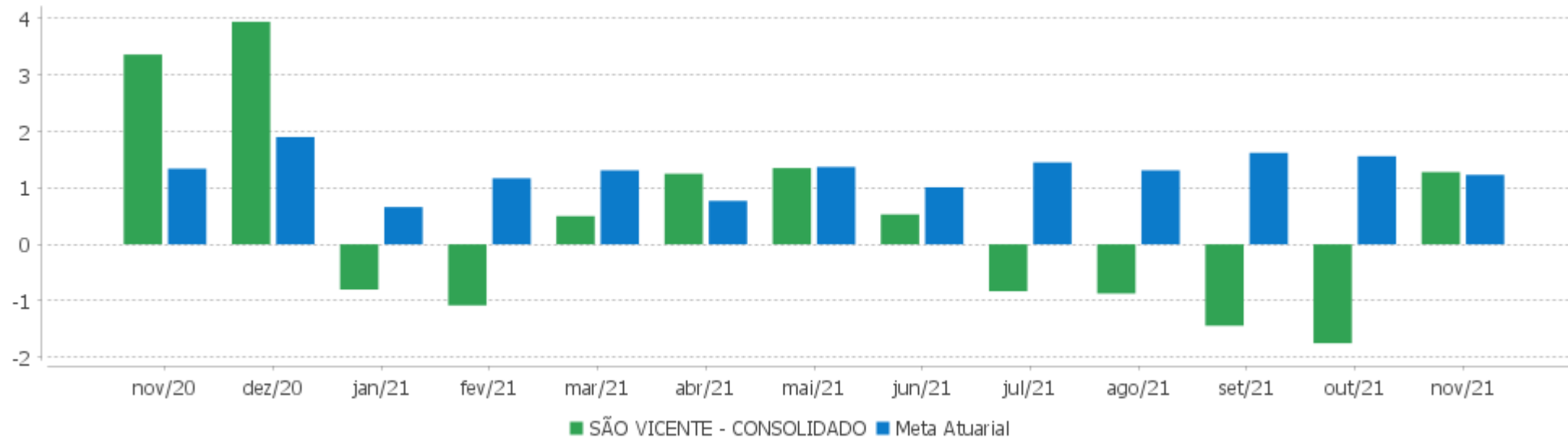


Patrimônio Líquido



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
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,44 -0,03	-1,74 -0,25	0,63 -0,07	-0,51 -0,16	3,02 -0,28	6,30 -0,63	29,85 -1,16
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,95 0,49	-3,51 -2,02	0,97 0,27	0,21 0,56	1,82 -1,48	6,64 -0,28	31,80 0,80
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,73	-1,30	0,07	-0,51	1,05	4,72	18,65
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	2,42 -0,09	3,91 -0,19	2,18 0,07	2,03 0,15	5,63 -0,28	13,49 -0,95	26,27 -1,77
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,44 -0,03	-1,71 -0,23	0,61 -0,09	-0,53 -0,18	3,04 -0,26	6,38 -0,55	30,01 -1,00
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	4,35 -0,12	-6,68 -0,45	-1,07 -0,23	-3,40 -0,42	0,37 -0,44	0,71 -0,79	29,69 -1,69
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	4,45 -0,03	-6,44 -0,20	-0,89 -0,06	-3,09 -0,11	0,53 -0,28	0,78 -0,71	29,86 -1,53
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	0,80 136,43	4,36 121,10	2,24 147,74	3,69 140,88	4,71 124,82	6,46 93,96	12,72 95,04
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	2,47 -0,03	2,87 -0,88	2,12 -0,13	2,04 -0,26	4,70 -0,95	12,32 -1,16	27,00 -1,56
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,64 108,89	4,10 113,73	1,72 113,75	2,98 113,71	4,32 114,55	6,70 97,56	13,06 97,60
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,89 0,42	-1,55 -0,07	0,55 -0,15	-0,24 0,11	3,31 0,01	8,02 1,10	34,05 3,04
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	0,59 101,03	3,55 98,58	1,55 102,33	2,68 102,49	3,79 100,36	6,51 94,66	12,83 95,85
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	4,41 -0,07	-6,50 -0,27	-1,00 -0,17	-3,43 -0,45	0,46 -0,35	0,26 -1,24	29,30 -2,09
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	1,64 0,69	3,64 -5,63	2,13 -1,27	2,90 -2,96	3,85 -6,89	6,97 -8,54	21,11 1,81
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO % do CDI	0,33 56,44	1,87 51,75	0,67 44,18	1,32 50,28	2,64 70,03	5,64 82,09	12,18 91,01
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-0,51 1,02	25,32 39,68	2,11 16,31	11,14 30,39	29,16 35,57	44,79 50,63	70,91 57,05
SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP	-0,46	26,25	2,21	11,40	29,95		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. S&P 500 p.p.	0,78	-5,24	-8,13	-5,28	-2,97		
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	0,63 2,16	-15,26 -0,90	-13,70 0,50	-20,14 -0,89	-7,57 -1,16	-2,65 3,19	36,96 23,09
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,19 -0,65	-19,01 -4,64	-15,01 -0,81	-22,06 -2,81	-12,56 -6,15	-21,15 -15,31	6,98 -6,88
SOMMA BRASIL FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,50 -0,97	-12,70 1,67	-14,66 -0,46	-20,26 -1,01	-6,49 -0,08	-11,85 -6,01	7,61 -6,26
BRADERCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,26 -0,63	-11,36 -3,47	-10,17 -2,46	-15,54 -3,84	-3,00 -3,35	-10,32 -10,61	3,63 -29,59
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,71 -5,17	-31,32 -16,95	-26,06 -11,86	-33,41 -14,16	-27,72 -21,31	-20,58 -14,74	6,14 -7,73
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-2,73 -1,19	-19,06 -4,69	-16,22 -2,02	-21,99 -2,74	-12,13 -5,73	-11,39 -5,55	19,12 5,26
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-7,60 -0,10	-26,96 -0,87	-21,72 -0,26	-28,51 -0,50	-23,39 -0,99	-21,41 -1,89	12,43 -3,07
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,24 -2,71	-18,28 -3,92	-15,69 -1,50	-23,77 -4,52	-12,02 -5,61	-15,53 -9,69	0,99 -12,87
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-3,24 -1,71	-20,50 -6,13	-20,74 -6,55	-27,90 -8,64	-14,46 -8,05	-13,42 -7,58	20,66 6,79
SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA - FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,37 0,16	-16,73 -2,36	-14,52 -0,33	-19,58 -0,33	-8,86 -2,45	-6,96 -1,12	16,35 2,49
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-2,97 -1,44	-19,23 -4,86	-20,76 -6,56	-27,12 -7,87	-12,36 -5,96	-11,04 -5,20	28,80 14,93
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,67 -1,14	-15,69 -1,32	-13,85 0,35	-19,80 -0,55	-7,17 -0,76	-2,33 3,51	23,31 9,44
QUELUZ VALOR FI EM ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-1,69 -0,16	-24,04 -9,67	-18,34 -4,14	-27,26 -8,01	-20,87 -14,46	-25,17 -19,33	-4,60 -18,47
BOTZ GLOBAL X MIRAE ASSET ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-4,04 -1,13	3,44 -9,34	6,55 -0,54	12,30 2,61			
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-0,71 2,20	17,68 -3,90	9,29 2,20	14,84 5,15	14,57 -9,29		
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	0,15 3,06	20,96 -0,62	9,57 2,47	23,82 14,13	21,00 -2,86		
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO Var. INPC + 5,04% p.p.	1,28 0,01	-1,90 -16,66	-1,93 -6,50	-3,07 -11,76	1,96 -15,01	6,32 -23,41	25,70 -15,74
CDI	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	-1,53	-14,37	-14,20	-19,25	-6,41	-5,84	13,87
INPC + 6,00%	1,31	15,28	4,70	8,96	17,56	31,03	43,57
IPCA + 6,00%	1,42	15,18	4,87	8,99	17,33	29,67	41,95

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
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+1 du	D+0	D+27	D+29	20% s/ 100 IBOVESPA	2,00
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	D+1 du	D+0	D+5 du	D+7 du	Cobrança semestral, no último dia útil de dezembro e junho ou no resgate total ou parcial das cotas, o que ocorrer primeiro	2,00
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	D+0	D+0	D+0	D+0		0,35
BOTZ GLOBAL X MIRAE ASSET ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD FIC FIA IE	D+1	D+1	D+1 du	D+5 du		
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		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
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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 IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA CONSUMO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,60
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	D+1 du	D+0	D+21 du	D+23 du		1,72
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	D+1	D+1	D+1	D+5		
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du		0,18
OCCAM FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+15 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+17 (isento de taxa de resgate)	-	3,00
QUELUZ VALOR FI EM ACOES	D+1 du	D+0	D+10	D+12	-	2,00
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+2 du		1,00
SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP	D+0	D+0	D+0	D+1		
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
SOMMA BRASIL FIA	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du	-	2,00

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	0,79	2,03	0,65	1,42	2,35	6,40	13,74	21,69	36,07
IRF-M 1+	2,19	-7,11	-2,04	-3,73	-4,28	1,46	17,30	31,09	53,93
IRF-M TOTAL	1,79	-3,81	-1,21	-2,06	-1,93	3,27	16,74	28,91	49,37
IMA-B 5	2,50	3,75	2,25	2,30	5,65	13,47	28,56	40,58	59,06
IMA-B 5+	4,47	-6,23	-0,84	-2,98	0,81	1,50	31,39	50,00	74,04
IMA-B TOTAL	3,47	-1,49	0,70	-0,35	3,30	6,93	31,01	46,92	69,13
IMA-GERAL TOTAL	1,80	0,09	0,46	0,31	2,12	6,38	20,34	32,04	50,44
IDKA 2	2,51	4,11	2,12	1,88	5,91	14,44	28,04	40,40	59,70
IDKA 20	6,09	-12,50	-3,62	-8,23	-2,56	-7,04	31,71	56,52	86,71
CDI	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38	20,72	33,50

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-1,53	-14,37	-14,20	-19,25	-6,41	-5,84	13,87	41,61	64,63
IBRX 100	-1,69	-13,88	-14,79	-20,36	-6,00	-4,38	17,37	45,94	70,57
IBRX 50	-1,81	-13,79	-14,84	-20,46	-5,66	-4,80	12,95	40,34	62,89
SMALL CAP	-2,29	-19,26	-20,02	-26,60	-13,19	-9,64	29,55	46,85	103,82
IFIX	-3,64	-10,16	-6,23	-8,45	-8,19	-10,79	12,08	16,51	40,35
Índice Consumo - ICON	-7,50	-26,09	-21,46	-28,01	-22,40	-19,51	15,50	11,72	36,98
Índice Dividendos - IDIV	0,89	-7,89	-7,71	-11,70	0,34	0,29	33,23	61,08	90,61

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	0,95	9,26	3,40	5,86	10,74	15,51	19,30	24,12	27,60
INPC	0,84	9,36	3,23	5,84	10,96	16,73	20,66	24,95	27,38
IGPM	0,02	16,77	0,02	2,08	17,89	46,79	52,62	67,39	65,94
SELIC	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38	20,73	33,53

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	-1,24	31,49	10,34	16,68	32,92	93,45	140,69	197,22	243,65
MSCI ACWI	-2,91	21,57	7,09	9,69	23,86	76,81	115,31	147,67	190,75

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,26	13,21	4,38	7,95	15,13	24,86	34,11	45,07	55,08
IPCA + 5,00%	1,34	14,19	4,63	8,47	16,23	27,25	37,99	50,70	62,64
IPCA + 5,50%	1,38	14,69	4,75	8,73	16,78	28,46	39,96	53,57	66,52
IPCA + 5,89%	1,41	15,07	4,84	8,93	17,21	29,40	41,51	55,84	69,61
IPCA + 6,00%	1,42	15,18	4,87	8,99	17,33	29,67	41,95	56,48	70,48
INPC + 4,00%	1,15	13,31	4,22	7,93	15,36	26,17	35,64	46,04	54,81
INPC + 6,00%	1,31	15,28	4,70	8,96	17,56	31,03	43,57	57,53	70,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
210	03/11/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	40.000,00	0,00	795,56685000	50,2786160000
214	04/11/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	192,08	3,81921000	50,2932030000
199	04/11/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	55.870,21	0,00	22.895,49701700	2,4402270000
215	08/11/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	310.152,95	6.163,28388000	50,3226780000
216	10/11/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	56.476,89	1.121,63949000	50,3520880000
200	10/11/2021	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	17.000,00	4.761,88340900	3,5700160000
201	11/11/2021	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.530,56	1.545,48847800	3,5785190000
211	12/11/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	200.271,28	0,00	3.975,10312000	50,3814050000
206	16/11/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	6.018,68	0,00	324,14244000	18,5680100000
217	17/11/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	17.279,14	342,76652000	50,4108170000
218	17/11/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	107.000,00	2.122,56033000	50,4108170000
219	19/11/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	123.649,35	2.451,36659000	50,4409870000
202	19/11/2021	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	102.047,03	28.351,28004800	3,5993800000
212	22/11/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	131.449,56	0,00	2.605,22943000	50,4560400000
207	22/11/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	20.662,96	0,00	1.111,65844000	18,5875080000
209	25/11/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	9.700.000,00	520.713,72566000	18,6282779232
203	29/11/2021	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	152.252,31	42.081,32896500	3,6180490000
204	29/11/2021	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	3.700.000,00	0,00	32.844,72890270	112,6512571000
205	29/11/2021	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	6.000.000,00	0,00	45.217,79804690	132,6911141000
213	30/11/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	215.164,45	0,00	4.256,76040000	50,5465260000
208	30/11/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1.331.169,31	0,00	71.254,95818000	18,6817780000
Total			11.700.606,45	10.591.580,31		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.866.746,54

Value-At-Risk: 2,66%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO		2,66	2,66			220.822.454,85	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,85%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF		3,37	0,02	0,92			1.782.192,00	0,81
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,74	0,04	0,04			4.263.234,15	1,93
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,71	0,11	0,02			12.360.844,43	5,60
ITAU RF IMAB5+ FIC DE FI		4,17	0,08	0,01			6.388.118,61	2,89
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		4,07	0,18	0,14			13.886.876,58	6,29
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,64	0,15	0,60			34.410.409,36	15,58
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,38	0,06	1,97			13.275.241,83	6,01
Sub-total	5,80	2,30	0,62		0,41	2,99	86.366.916,96	39,11

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO		2,95	0,07	0,41			7.984.625,63	3,62
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI		0,03	0,00	0,01			5.023.329,67	2,27
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+		4,22	0,04	0,12			3.366.234,09	1,52
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5		1,55	0,07	0,04			16.443.577,24	7,45
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		0,65	0,05	0,66			25.947.124,49	11,75
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,07	-0,00	0,06			793.760,88	0,36
Sub-total	2,91	1,31	0,24		0,55	2,17	59.558.652,00	26,97

Artigo 7º VII, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV		0,15	0,00	0,15			3.140.141,34	1,42
Sub-total	0,20	0,15	0,00		1,09	0,80	3.140.141,34	1,42

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,58%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FIA DIVIDENDOS		10,52	0,11	4,13			3.155.307,59	1,43
AZ QUEST ACOES FIC FIA		9,19	0,03	3,79			817.472,16	0,37
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA		10,47	0,02	4,16			426.783,51	0,19
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES		15,03	0,40	7,35			7.244.976,47	3,28
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		15,60	0,29	8,31			5.189.774,33	2,35
QUELUZ VALOR FI EM ACOES		9,91	0,03	3,55			1.096.435,35	0,50
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES		10,63	0,14	2,73			3.760.835,22	1,70
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS		12,31	0,10	2,19			2.433.273,17	1,10
SOMMA BRASIL FIA		11,37	0,05	1,92			1.190.221,08	0,54
FIA CAIXA CONSUMO		14,03	0,09	0,89			1.778.712,48	0,81
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		15,10	0,08	6,60			1.456.868,58	0,66
OCCAM FIC FIA		10,34	0,02	3,15			452.351,74	0,20
SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA - FIA		10,60	0,01	2,75			442.956,45	0,20
Sub-total	26,11	12,56	1,37		-0,15	-3,24	29.445.968,13	13,33

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO		0,46	0,00	0,46			2.491.115,99	1,13
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		7,15	0,32	10,97			17.479.958,66	7,92
SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP		7,32	0,04	7,22			2.237.655,98	1,01
Sub-total	13,25	6,38	0,37		-0,08	-0,41	22.208.730,63	10,06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,72%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BOTZ GLOBAL X MIRAE ASSET ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD FIC FIA IE		11,16	0,01	8,73			1.450.408,65	0,66
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE		8,65	-0,12	8,51			8.107.834,02	3,67
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		12,32	0,18	10,91			10.543.803,12	4,77
Sub-total	19,04	8,72	0,06		-0,07	-0,71	20.102.045,79	9,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso III, (10,06% dos recursos) está superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010.
- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso III, (10,06% dos recursos) está superior ao limite máximo estipulado em Política de Investimentos;