



LDB
EMPRESAS

HORTOLÂNDIA
DEZEMBRO 2021



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.12.2021.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

78,00%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	3,84	0,87	3,19	36.041.373,82	5,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	9,80	-1,41	-7,59	15.094.173,10	2,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,170000%)	2,77	1,22	2,11	19.877.285,30	3,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,020001%)	3,73	1,21	3,85	47.770.512,09	7,39
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		4,05	0,77	6,54	118.783.344,31	18,38

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,64	0,84	2,64	45.633.463,70	7,06	6.208.104.156,65	0,74
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,79	0,20	-1,51	71.319.331,08	11,04	7.081.253.604,41	1,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,76	0,72	4,66	101.547.634,98	15,71	10.998.710.156,34	0,92
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,84	0,91	-0,40	48.282.344,36	7,47	7.701.081.218,58	0,63
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,33	0,83	-0,11	61.099.715,89	9,46	12.561.638.596,69	0,49
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,64	0,67	0,97	327.882.490,01	50,74		

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
QUELUZ	ORLA	BRA1 FI RENDA FIXA	1,49	0,31	-1,30	397.228,27	0,06	9.524.029,01	4,17
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,10	0,86	4,53	49.294.066,98	7,63	2.626.754.965,66	1,88
VERITAS	RJI	FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	44,72	0,08	-40,33	604.301,57	0,09	92.133.689,04	0,66
GRAPHEN	RJI	LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	2,40	-1,16	-4,08	3.594.177,57	0,56	68.101.433,78	5,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,26	0,71	2,94	53.889.774,39	8,34		
Artigo 7º VII, Alínea a (Cota Sênior de FIDC)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	2,91	0,13	-0,81	1.820.932,04	0,28	72.092.375,62	2,53
FINAXIS	FINAXIS	FIDC PREMIUM	3,54	-0,30	-5,83	1.667.685,15	0,26	81.898.860,94	2,04
BRPP	BRPP	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
BRPP	GENIAL	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4.957,59	0,00
BRPP	GENIAL	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	7.125,27	0,00
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			2,25	-0,08	-3,28	3.488.617,19	0,54		
Renda Fixa			2,54	0,69	2,17	504.044.225,90	78,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

15,70%

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	BEM	BRAPRESO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	22,59	0,34	0,34	23.958.903,83	3,71	1.419.483.989,90	1,69
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	19,16	2,31	-9,66	45.867.496,84	7,10	1.378.837.386,58	3,33
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	19,98	-0,71	-19,63	0,00	0,00	205.904.381,47	0,00
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	17,92	0,97	-8,51	25.876.031,05	4,00	2.631.453.374,95	0,98
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			18,20	2,14	-12,92	95.702.431,72	14,81		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GRAPHEN	ORLA	LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	0,16	-0,44	-4,82	219.209,23	0,03	1.552.439,84	14,12
Sub-total Artigo 8º III			0,16	-0,44	-4,82	219.209,23	0,03		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRPP	BNY MELLON	GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	92,95	-0,31	142,81	529.361,65	0,08	19.444.814,12	2,72
QUELUZ	BNY MELLON	BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	0,38	-0,11	-1,31	1.511.026,03	0,23	27.978.870,59	5,40
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			17,18	-0,16	16,65	2.040.387,68	0,32		

Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	11,50	5,57	-4,78	2.049.800,00	0,32	1.322.246.699,64	0,16
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BRCR11	20,22	14,65	-12,05	235.951,74	0,04	2.861.919.636,26	0,01
AQUILLA	ÍNDIGO	ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	52,58	-0,20	-41,93	1.184.859,74	0,18	86.104.115,80	1,38
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			25,85	4,08	-13,99	3.470.611,48	0,54		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

17,18

2,09

-12,54

101.432.640,11

15,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,30%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21,30	-2,60	-5,83	14.125.569,64	2,19	1.410.026.256,25	1,00
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	17,42	1,64	28,48	26.602.191,95	4,12	360.428.150,55	7,38
Sub-total Artigo 9º A, II			17,71	-0,20	20,47	40.727.761,59	6,30		
Investimentos no Exterior			17,71	-0,20	20,47	40.727.761,59	6,30		
Total			4,19	0,80	-0,33	646.204.627,60	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 a	Títulos do Tesouro Nacional	118.783.344,31	18,38	5,00	10,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	327.882.490,01	50,74	10,00	52,50	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	53.889.774,39	8,34	0,00	10,00	40,00	0,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	3.488.617,19	0,54	0,00	0,50	3,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	504.044.225,90	78,00					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	95.702.431,72	14,81	5,00	17,50	20,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	219.209,23	0,03	0,00	0,50	5,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	2.040.387,68	0,32	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	3.470.611,48	0,54	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	101.432.640,11	15,70					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	40.727.761,59	6,30	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	40.727.761,59	6,30					10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,77 100,82	6,54 148,78	2,66 144,57	1,72 55,68	6,54 148,78	907.464,19	5.697.391,08
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,67 87,79	0,97 22,04	1,27 69,20	1,05 34,04	0,97 22,04	2.199.549,35	3.490.823,61
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,71 92,98	2,94 66,86	1,81 98,40	2,05 66,41	2,94 66,86	380.099,69	1.540.747,09
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-0,08 -9,91	-3,28 -74,52	-0,08 -4,08	-0,14 -4,64	-3,28 -74,52	-2.640,48	-118.137,14
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	2,14 -0,71	-12,92 -1,00	-8,12 -2,57	-20,45 -3,11	-12,92 -1,00	1.196.583,54	-14.436.783,54
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,44 -3,29	-4,82 7,11	-1,29 4,26	-2,48 14,86	-4,82 7,11	-960,91	-11.096,35
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,16 -3,01	16,65 28,58	-0,49 5,05	-0,96 16,37	16,65 28,58	-3.221,89	291.245,54
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	4,08 1,23	-13,99 -2,06	-1,96 3,59	-15,22 2,12	-13,99 -2,06	136.176,30	-695.527,55
Artigo 9º A, II % do CDI	-0,20 -26,46	20,47 465,84	4,50 244,53	11,53 373,59	20,47 465,84	33.287,90	1.487.422,41
HORTOLÂNDIA (Total)						4.846.337,69	-2.753.914,85

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (5,170000%)	19.636.930,38	0,00	0,00	0,00	19.877.285,30	240.354,92	412.459,06
NTN-B 150545	15.309.969,70	0,00	0,00	0,00	15.094.173,10	-215.796,60	-1.285.101,91
NTN-B 150824	35.729.986,33	0,00	0,00	0,00	36.041.373,82	311.387,49	1.108.684,06
NTN-B 150840 (5,020001%)	47.198.993,71	0,00	0,00	0,00	47.770.512,09	571.518,38	1.772.875,28
					118.783.344,31	0,00	0,00

Artigo 7º I, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	47.844.993,09	0,00	0,00	0,00	48.282.344,36	437.351,27	-193.144,77
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	71.174.572,90	0,00	0,00	0,00	71.319.331,08	144.758,18	-1.096.868,28
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	51.794.630,56	8.050.359,02	-14.602.978,33	0,00	45.633.463,70	391.452,45	1.966.845,41
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	100.822.007,66	0,00	0,00	0,00	101.547.634,98	725.627,32	4.051.781,24
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	60.599.355,76	0,00	0,00	0,00	61.099.715,89	500.360,13	-92.463,24
					327.882.490,01	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRA1 FI RENDA FIXA	441.879,62	0,00	0,00	45.878,80	397.228,27	1.227,45	-8.113,52
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	603.835,64	0,00	0,00	0,00	604.301,57	465,93	-434.205,23
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	48.873.374,78	0,00	0,00	0,00	49.294.066,98	420.692,20	2.136.023,64
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.636.463,46	0,00	0,00	0,00	3.594.177,57	-42.285,89	-152.957,80
					53.889.774,39	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC PREMIUM	1.672.648,03	0,00	0,00	0,00	1.667.685,15	-4.962,88	-103.207,31
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1.818.609,64	0,00	0,00	0,00	1.820.932,04	2.322,40	-14.929,83
					3.488.617,19	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	44.829.899,27	0,00	0,00	0,00	45.867.496,84	1.037.597,57	-4.553.272,07
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	24.048.761,02	0,00	-23.878.358,91	0,00	0,00	-170.402,11	-5.832.386,55
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	0,00	23.878.358,91	0,00	0,00	23.958.903,83	80.544,92	80.544,92

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	25.627.187,89	0,00	0,00	0,00	25.876.031,05	248.843,16	-2.406.185,45
					95.702.431,72	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	220.170,14	0,00	0,00	0,00	219.209,23	-960,91	-11.096,35
					219.209,23	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	1.512.614,47	0,00	0,00	0,00	1.511.026,03	-1.588,44	-20.025,30
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	530.995,10	0,00	0,00	0,00	529.361,65	-1.633,45	311.349,60
					2.040.387,68	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRCR11	207.419,40	0,00	0,00	0,00	1.623,00	235.951,74	30.155,34	-33.757,57
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	1.959.600,00	0,00	0,00	0,00	18.200,00	2.049.800,00	108.400,00	-107.400,00
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	1.187.238,78	0,00	0,00	0,00	0,00	1.184.859,74	-2.379,04	-855.426,22
						3.470.611,48	0,00	0,00

Artigo 9º A, II

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	14.502.094,98	0,00	0,00	0,00	14.125.569,64	-376.525,34	-874.430,36
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	16.192.378,71	10.000.000,00	0,00	0,00	26.602.191,95	409.813,24	2.361.852,77
					40.727.761,59	0,00	0,00

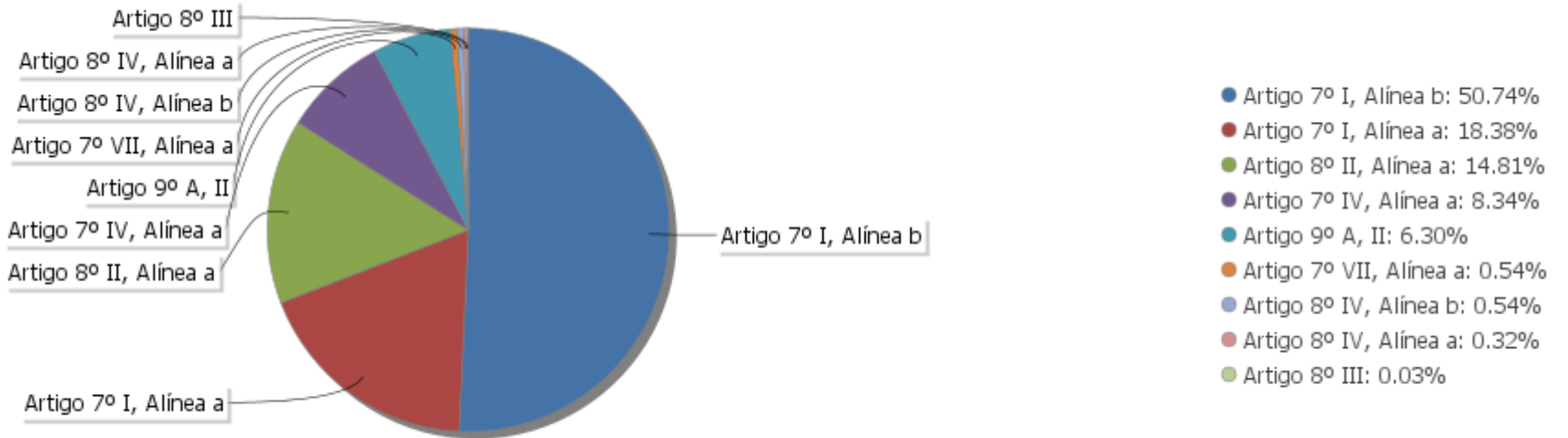
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

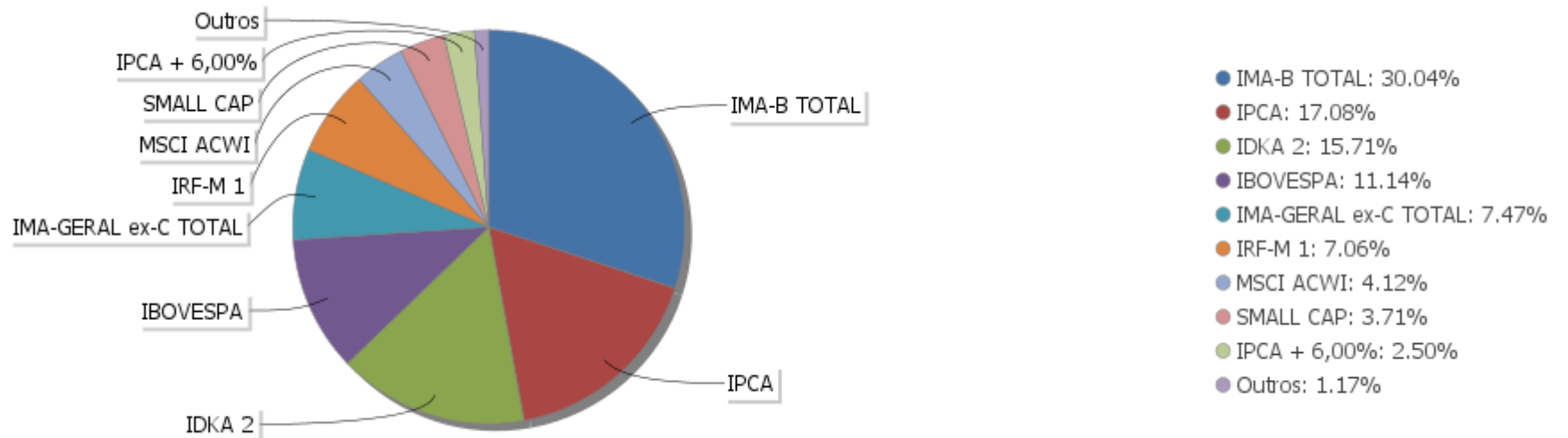
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	493.714.885,09	76,40	493.714.885,09	76,40
de 31 a 365 dias	25.876.031,05	4,00	519.590.916,14	80,41
acima de 365 dias	126.613.711,46	19,59	646.204.627,60	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

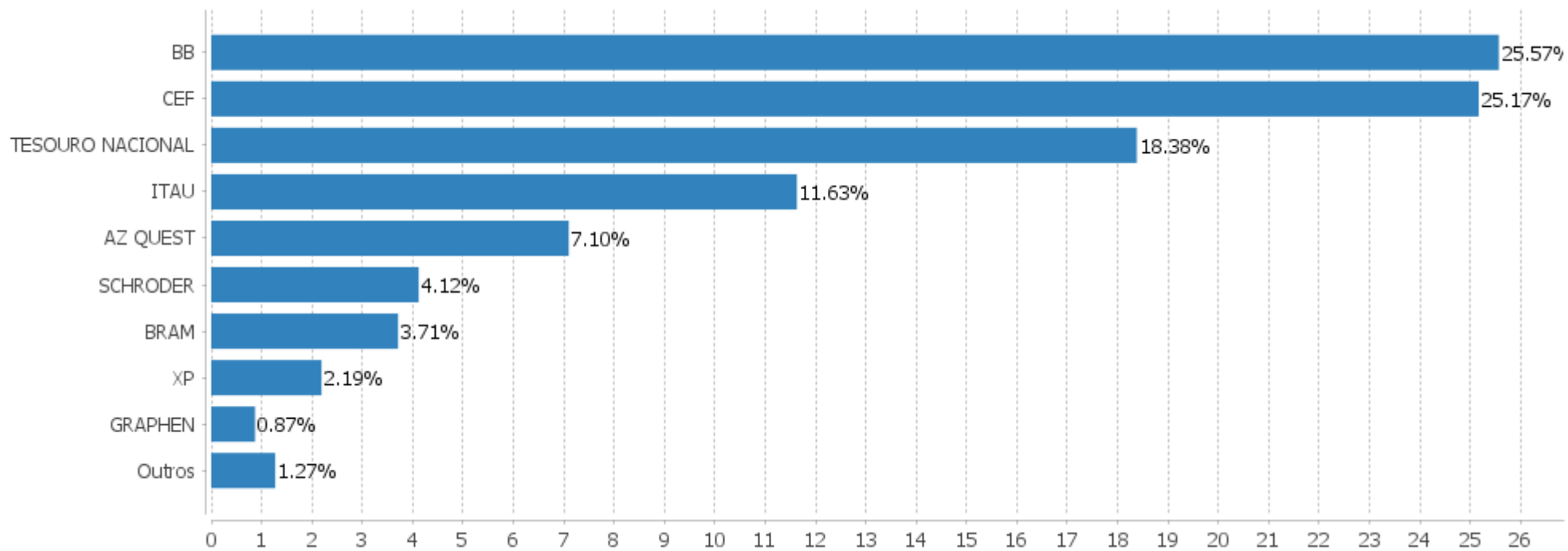


Alocação Por Estratégia



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	-0,37	-0,60	0,51	1,09	1,28	0,17	-0,77	-1,12	-0,53	-1,71	0,97	0,80	-0,33
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,67	1,37	1,22	15,99
p.p. indexador	-1,04	-1,84	-0,90	0,36	0,01	-0,80	-2,19	-2,46	-2,14	-3,38	-0,40	-0,42	-16,32
2020	0,74	-0,95	-6,76	0,85	2,01	1,95	2,67	-0,62	-1,01	0,15	2,81	2,88	4,40
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,63
p.p. indexador	0,03	-1,61	-7,33	0,71	1,94	1,21	1,79	-1,34	-2,13	-1,19	1,46	1,02	-6,22
2019	2,83	0,10	0,40	1,16	1,59	2,44	1,21	0,05	1,70	1,87	-0,25	2,19	16,35
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	2,00	-0,79	-0,79	0,10	0,95	1,99	0,49	-0,57	1,25	1,24	-1,23	0,55	5,76

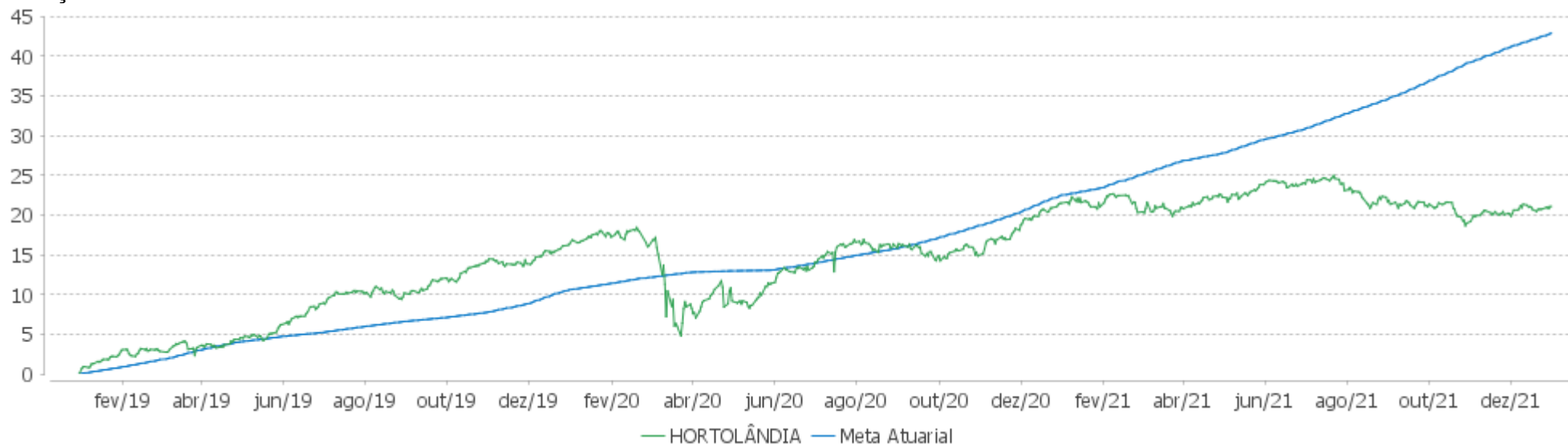
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

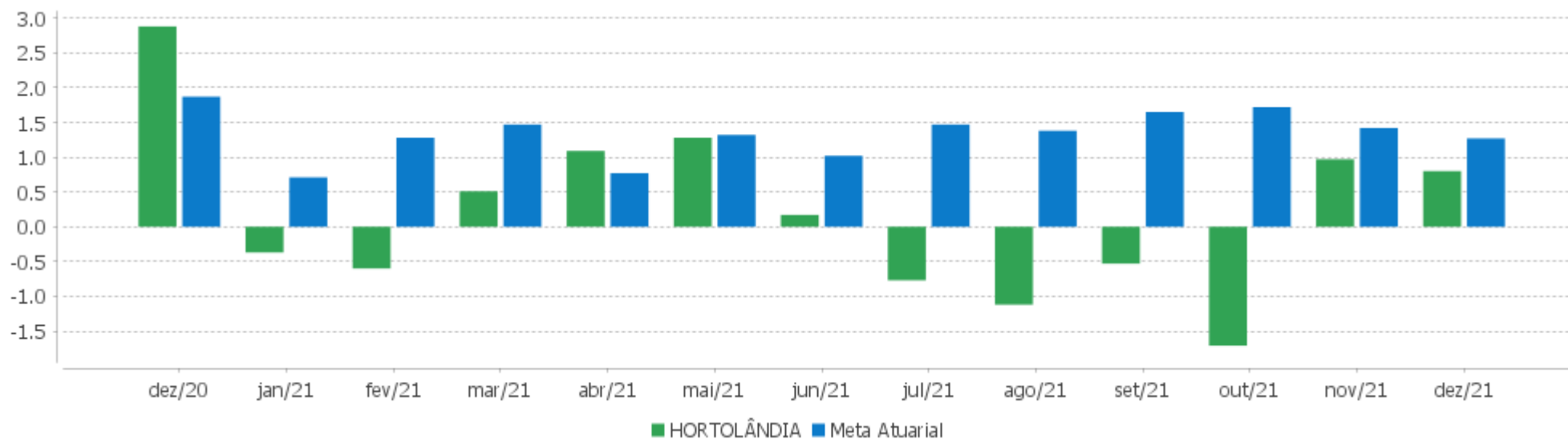
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	17	47,22	03 meses	0,04	4,32	-4,29	3,75
Meses abaixo - Meta Atuarial	19	52,78	06 meses	-2,37	8,94	-11,32	3,98
			12 meses	-0,33	15,99	-16,32	4,19
			24 meses	4,06	28,32	-24,26	7,63
			36 meses	21,07	41,91	-20,83	6,55
Maior rentabilidade da Carteira	2,88	2020-12	Desde 31/12/2018	21,07	41,91	-20,83	6,55
Menor rentabilidade da Carteira	-6,76	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150824 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,87 0,65	3,19 4,46	2,09 1,03	2,93 3,48	3,19 4,46	12,50 7,44	32,50 3,33
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,41 -1,63	-7,59 -6,33	-1,44 -2,50	-6,06 -5,52	-7,59 -6,33	-4,01 -9,07	28,20 -0,98
NTN-B 150840 (5,020001%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,21 0,99	10,03 11,29	4,34 3,28	5,76 6,31	10,03 11,29	14,53 9,47	18,54 -10,64
NTN-B 150535 (5,170000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,22 1,00	12,99 14,26	4,38 3,32	8,64 9,18	12,99 14,26	17,57 12,51	21,64 -7,53
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,91	-0,40	0,99	0,28	-0,40	4,67	18,35
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,83 0,10	-0,11 -10,17	1,07 -1,89	-0,82 -6,89	-0,11 -10,17	6,55 -8,48	24,06 4,07
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,84 -0,03	2,64 -0,29	1,10 -0,03	1,97 -0,12	2,64 -0,29	6,20 -0,68	13,10 -1,01
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,72 -0,11	4,66 -0,31	1,82 -0,02	3,05 0,00	4,66 -0,31	13,07 -0,95	25,72 -1,78
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,20 -0,02	-1,51 -0,25	0,97 -0,09	-0,70 -0,16	-1,51 -0,25	4,53 -0,53	28,20 -0,97
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3 % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-83,89 -1.151,69	-97,52 -712,46
FIDC PREMIUM % do CDI	-0,30 -38,86	-5,83 -132,60	-1,01 -55,04	-1,69 -54,74	-5,83 -132,60	-10,38 -142,44	-18,56 -135,59
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4 % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-83,89 -1.151,69	-97,52 -712,46
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2 % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-83,89 -1.151,69	-97,52 -712,46
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	0,13 16,72	-0,81 -18,50	0,80 43,46	1,32 42,65	-0,81 -18,50	-5,49 -75,37	-4,73 -34,55
BRA1 FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,31 0,08	-1,30 -0,04	0,37 -0,69	0,17 0,72	-1,30 -0,04	-21,57 -26,63	-68,15 -97,32
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,86 0,13	4,53 -5,53	2,16 -0,80	3,49 -2,58	4,53 -5,53	7,52 -7,51	20,33 0,34
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	-1,16	-4,08	-2,25	-3,94	-4,08	-6,22	4,92

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,39	-2,82	-3,31	-3,40	-2,82	-11,28	-24,25
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	0,08	-40,33	0,14	-40,17	-40,33	-39,25	-51,66
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,71	-44,90	-1,89	-43,41	-44,90	-52,22	-79,49
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3,75	-16,02	-7,40	-20,40	-16,02	-13,84	22,27
Var. IBOVESPA p.p.	0,89	-4,10	-1,85	-3,06	-4,10	-4,48	3,00
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	2,31	-9,66	-8,26	-20,26	-9,66	-12,51	30,94
Var. IBOVESPA p.p.	-0,54	2,27	-2,71	-2,92	2,27	-3,16	11,67
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	0,97	-8,51	-7,99	-18,47	-8,51	-12,97	26,43
Var. IBOVESPA p.p.	-1,88	3,42	-2,44	-1,14	3,42	-3,61	7,16
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	3,89	-9,84	-12,01	-20,59	-9,84	-11,55	27,79
Var. SMALL CAP p.p.	0,10	6,36	-0,73	4,20	6,36	5,20	-3,91
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V % do CDI	-0,44 -57,16	-4,82 -109,62	-1,29 -69,80	-2,48 -80,22	-4,82 -109,62	-1,11 -15,18	-2,07 -15,13
BRCR11	14,65	-12,05	0,58	-6,78	-12,05	-29,53	-6,41
Var. IBOVESPA p.p.	11,79	-0,12	6,13	10,55	-0,12	-20,17	-25,68
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	-0,20	-41,93	-0,10	-40,86	-41,93	-42,05	-48,87
Var. IFIX p.p.	-8,98	-39,65	-3,39	-42,67	-39,65	-29,76	-68,15
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII % do CDI	5,57 730,07	-4,78 -108,67	-3,09 -167,97	-5,00 -162,12	-4,78 -108,67	-27,83 -381,98	-88,94 -649,81
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	-0,31	142,81	-0,92	-1,83	142,81	-92,72	-92,65
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,57	126,18	-5,39	-11,08	126,18	-121,92	-135,52
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	-0,11	-1,31	-0,34	-0,65	-1,31	17,16	-22,19
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,37	-17,95	-4,81	-9,91	-17,95	-12,03	-65,06
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	1,64	28,48	6,78	17,53	28,48		
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,53	3,05	-2,37	0,57	3,05		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-2,60	7,25	1,63	4,93	7,25	105,18	
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-3,86	-9,39	-2,84	-4,32	-9,39	75,99	
HORTOLÂNDIA	0,80	-0,33	0,04	-2,37	-0,33	4,06	21,07
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,47	-16,96	-4,43	-11,63	-16,96	-25,13	-21,80
CDI	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69
IBOVESPA	2,85	-11,93	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27
INPC + 6,00%	1,27	16,74	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52
IPCA + 6,00%	1,27	16,64	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	20.0000000000000000 -	2,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du	0,00	0,30
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,10
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+1 du	D+0	D+27	D+29	20.0000000000000000 20% s/ 100 IBOVESPA	2,00
BRA1 FI RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1440	D+1445	0,00	1,30
BRANCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	1,50
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	Não se aplica	Não se aplica				
BRCR11	Não se aplica	Não se aplica				
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	Não se aplica	Não se aplica				
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	D+0	D+0	D+30 ou D+1800 (isento de taxa de resgate)	D+31 ou D+1801 (isento de taxa de resgate)	20.0000000000000000	0,00
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,40
FIDC PREMIUM	Não se aplica	Não se aplica				
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	Não se aplica	Não se aplica				
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3	Não se aplica	Não se aplica				
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4	Não se aplica	Não se aplica				
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA	Não se aplica	Não se aplica				
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du		1,90
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,40
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,00
LEME MULTISETORIAL IPCA FIDC	D+0	D+0				
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1008 du	D+1009 du	20.0000000000000000	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du	0,00	0,80
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	D+1 du	D+0				
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	Não se aplica	Não se aplica				

PERÍODO SEMESTRAL, C / VENCIMENTO NO ÚLTIMO DIA ÚTIL DE DEZEMBRO E JUNHO.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,88	2,93	1,13	2,10	2,93	6,88	14,10	22,06	35,63
IRF-M 1+	2,29	-4,99	0,93	-1,74	-4,99	3,04	17,72	32,16	54,19
IRF-M TOTAL	1,89	-1,99	0,98	-0,42	-1,99	4,57	17,15	29,72	49,44
IMA-B 5	0,79	4,57	2,03	3,24	4,57	12,97	27,83	40,44	58,11
IMA-B 5+	-0,34	-6,55	0,09	-4,11	-6,55	-1,41	28,53	48,33	67,24
IMA-B TOTAL	0,22	-1,26	1,06	-0,55	-1,26	5,06	29,17	46,04	64,72
IMA-GERAL TOTAL	0,87	0,96	1,34	0,82	0,96	6,35	19,98	32,02	48,95
IDKA 2	0,83	4,97	1,84	3,05	4,97	14,02	27,50	39,94	58,99
IDKA 20	-2,28	-14,50	-2,87	-11,27	-14,50	-12,61	26,07	51,79	70,27
CDI	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	20,99	33,03

Renda Variável

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

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

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,63	36,26	13,52	23,73	36,26	104,25	173,82	200,73	264,52
MSCI ACWI	3,17	25,42	9,15	16,96	25,42	84,89	138,58	148,21	206,39
MSCI World									

Meta Atuarial

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
100	01/12/2021	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	0,00	23.878.358,91	76.800,97429950	310,9121873000
95	02/12/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	130.000,00	46.808,88893700	2,7772502820
107	07/12/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	10.000.000,00	3.596.696,78575900	2,7803288950
99	07/12/2021	BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	23.878.358,91	0,00	2.304.839,38533120	10,3600967000
106	08/12/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	385.000,00	0,00	138.378,69522500	2,7822201920
108	08/12/2021	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	10.000.000,00	0,00	7.087.036,10299190	1,4110271000
105	10/12/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	5.670.359,02	0,00	2.036.767,47684000	2,7839991970
104	13/12/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	548.978,33	197.121,96361000	2,7849678440
94	13/12/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	550.000,00	0,00	197.488,81524200	2,7849678440
103	14/12/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	3.660.000,00	1.313.786,17223100	2,7858414690
96	14/12/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	100.000,00	35.895,79705500	2,7858414690
102	22/12/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	860.000,00	0,00	308.035,65028900	2,7918846380
97	22/12/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	114.000,00	40.832,63271300	2,7918846380
98	28/12/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	50.000,00	17.892,16395000	2,7945194410
101	29/12/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	585.000,00	0,00	209.308,28626200	2,7949204040
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 12.234.096,84

Value-At-Risk: 1,89%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
HORTOLÂNDIA		1,89	1,89			646.204.627,60	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,27%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824		1,72	0,07	1,65			36.041.373,82	5,58
NTN-B 150545		4,59	0,08	1,76			15.094.173,10	2,34
NTN-B 150535 (5,170000%)		0,10	0,00	2,95			19.877.285,30	3,08
NTN-B 150840 (5,020001%)		0,21	0,00	2,95			47.770.512,09	7,39
Sub-total	1,63	1,07	0,15		0,00	0,77	118.783.344,31	18,38

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,62	0,02	0,03			45.633.463,70	7,06
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,99	0,24	0,04			71.319.331,08	11,04
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,62	0,17	0,26			101.547.634,98	15,71
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,19	0,07	1,85			48.282.344,36	7,47
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,06	0,06	1,07			61.099.715,89	9,46
Sub-total	1,97	1,48	0,56		-0,05	0,67	327.882.490,01	50,74

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRA1 FI RENDA FIXA		0,88	0,00	2,53			397.228,27	0,06
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		0,61	0,03	0,63			49.294.066,98	7,63
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5		2,10	-0,00	2,46			604.301,57	0,09

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA		1,60	0,00	2,84			3.594.177,57	0,56
Sub-total	0,43	0,62	0,03		-0,12	0,71	53.889.774,39	8,34

Artigo 7º VII, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC		0,05	-0,00	0,06			1.820.932,04	0,28
FIDC PREMIUM		0,07	0,00	0,08			1.667.685,15	0,26
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
Sub-total	0,25	0,03	0,00		-3,35	-0,08	3.488.617,19	0,54

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 9,34%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		14,72	0,47	4,08			23.958.903,83	3,71
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,30	0,52	5,27			45.867.496,84	7,10
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		9,34	0,32	4,16			25.876.031,05	4,00
Sub-total	16,28	9,90	1,31		0,08	2,14	95.702.431,72	14,81

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V		0,01	-0,00	0,04			219.209,23	0,03
Sub-total	0,00	0,01	-0,00		-384,15	-0,44	219.209,23	0,03

Artigo 8º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA		0,07	0,00	0,10			529.361,65	0,08

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP		0,02	0,00	0,07			1.511.026,03	0,23
Sub-total	0,52	0,04	0,00		-1,76	-0,16	2.040.387,68	0,32

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII		0,53	0,00	0,53			2.049.800,00	0,32
BRCR11		2,95	-0,00	10,30			235.951,74	0,04
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII		2,39	0,00	4,10			1.184.859,74	0,18
Sub-total	9,09	1,07	0,00		0,36	4,08	3.470.611,48	0,54

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,53%

Artigo 9º A, II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		10,93	-0,05	10,92			14.125.569,64	2,19
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		8,08	-0,10	8,45			26.602.191,95	4,12
Sub-total	14,36	8,53	-0,16		-0,07	-0,20	40.727.761,59	6,30

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 14,12% do Patrimônio Líquido do fundo LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V, percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- O Instituto está com 5,40% do Patrimônio Líquido do fundo BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP, percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;