



Reunião Ordinária do Conselho Administrativo

Aos 11 (onze) dias do mês de janeiro do ano dois mil e vinte e dois, às 8:30 horas, na sede do Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do Município de Piracaia IPSPMP-PIRAPREV, sito a Rua Dona Elza Peçanha de Godoy, 170 Vila Elza, Piracaia SP. Reuniram-se a Senhora Claudia Leoncio da Silva, Superintendente Interina do IPSPMP Piraprev e os membros do Conselho Administrativo, nomeados através dos Decretos nº 4.815 de 11 de dezembro de 2020, nº 4.856 de 10 de fevereiro de 2021, nº 5.035 de 21 de setembro de 2021 e nº 5.050 de 26 de outubro de 2021. Presentes os membros Ronaldo Vasques, Renata Suyama da Silva, Tatiana Guimarães Moreira de Almeida, Lúvia Silva Pereira Ferreira, Eliana Fátima de Paula Gomes da Silva e Fábio Piola. Presentes também Márcia Soares da Cunha, Coordenadora Financeira, Robson Adão Martins Ribeiro, Auxiliar Financeiro e Anna Caroline Pacelli, Auxiliar de Seguridade. Com quórum suficiente para deliberação a reunião foi iniciada às 8:46 horas com a seguinte pauta: Sra. Claudia abre a reunião cumprimentando e agradecendo a todos pela presença, passando a palavra ao Sr. Robson que fará a apresentação do primeiro tema a ser abordado **1) Apresentação do cenário econômico, posição de ativos e enquadramento da Carteira de investimentos do Piraprev no site da LDB:** O mês de dezembro foi encerrado com rentabilidade positiva de 1,87%, acima da meta atuarial de 1,24, com um Patrimônio Líquido total de R\$ 117.926.532,42 (cento e dezessete milhões, novecentos e vinte e seis mil, quinhentos e trinta e dois reais e quarenta e dois centavos). Apresentou a rentabilidade por Artigo e Análise de liquidez, sendo 43,70% da carteira com liquidez de até 30 dias. Na alocação por Artigo verificou-se o enquadramento de todos os segmentos pela Resolução 4.963, A análise de risco x retorno demonstra VaR de 0,65% na Renda Fixa e de 6,91% na Renda Variável e Investimentos Estruturados. Em anexo o relatório completo do mês de dezembro. Em relação aos demais critérios, os investimentos são aderentes à Política de Investimentos do PIRAPREV/2022 e obedecem aos limites estabelecidos pela Resolução CMN 4.963/2021. **Item APROVADO.** **2) Apresentação dos Processos da área de Seguridade** Concedida aposentadoria por idade e tempo de contribuição para Sra. Helena Aparecida de Castro em 01/12/2021 e pensão por morte de servidor ativo Sr. Antonio Nogueira, deixando como pensionista a Sra. Josefina de Paula Nogueira em 29/12/2021. Sra. Ana Carolina apresentou os Processos explicando qual regra foi utilizada em cada benefício e após análise, aprovaram os atos por unanimidade **Item APROVADO.** **3) Informe Lei Taxa de Administração** Sra. Claudia informou a todos que entregou ofício, também assinado pelas Presidentes dos Conselhos para o Sr. Prefeito a fim de demonstrar os prejuízos de não adotar a alíquota majorada em 20% na taxa de administração no exercício 2022 para fins de Certificação institucional e profissional, solicitando a possibilidade de reconsiderar a Lei e submetê-la novamente ao Legislativo para inclusão de tal previsão. O ofício foi entregue em 30/12/2021 e até o presente momento não obtivemos resposta por parte do Executivo. **4) Certificação profissional.**



**Instituto de Previdência dos Servidores Públicos
do Município de Piracaia – PIRAPREV**

Tendo em vista a não aprovação da taxa de administração com majoração para a certificação não será possível a contratação de cursos de formação, fazendo-se necessário que os Conselheiros se adequem e se unam para que possam estudar todo conteúdo que será exigido nas provas de certificação. A equipe do PIRAPREV promoverá a organização e o compartilhamento de conteúdos para estudo individual, e em grupo sempre que possível. Nada mais a deliberar, deu-se por encerrada a reunião, por serem verdadeiros os fatos constantes, assinam os conselheiros presentes.

Eliana Fátima de Paula Gomes da Silva

Márcia Soares da Cunha
Coordenadora Financeira

Fábio Piola

Sandra Cristina dos Santos
Coordenadora Administrativa e de Seguridade

Renata Suyama da Silva

Claudia Leoncio da Silva
Superintendente Interina

Ronaldo Vasques

Robson Adão Martins Ribeiro
Auxiliar Financeiro

Lívia Silva Pereira Ferreira

Anna Caroline Pacelli
Auxiliar de Seguridade

Tatiana Guimarães Moreira de Almeida
Presidente do Conselho Administrativo



LDB
EMPRESAS

PIRACAIA
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 66,07%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,315000%)	2,80	1,24	3,38	20.113.558,69	17,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,510000%)	0,48	1,25	16,46	23.677.407,40	20,08
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,48	1,25	16,44	43.790.966,09	37,13

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
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	6,50	-0,13	-5,18	3.005.685,02	2,55	556.775.917,37	0,54
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,77	0,20	-1,62	1.945.064,70	1,65	597.312.070,50	0,33
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	4,01	0,81	3,11	3.131.288,05	2,66	942.926.867,08	0,33
BB	BB	BB PREV IPCA III	2,11	0,66	5,47	2.665.294,43	2,26	588.575.447,75	0,45
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,83	0,85	2,96	1.554.937,00	1,32	1.446.702.120,00	0,11
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,63	0,45	-1,40	12.302.269,20	10,43		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,79	0,22	-1,50	59.450,56	0,05	2.563.016.894,45	0,00
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			5,79	0,22	-1,50	59.450,56	0,05		

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
WESTERN	WESTERN	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,23	0,83	3,50	3.059.385,39	2,59	1.011.124.906,59	0,30
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,30	0,08	-1,47	4.028.045,11	3,42	625.914.328,31	0,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	6,96	0,23	-0,23	4.227.309,54	3,58	357.040.705,89	1,18
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,10	0,86	4,53	2.227.896,68	1,89	2.626.754.965,66	0,08
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,57	-0,01	6,77	6.302.720,55	5,34	1.517.893.916,47	0,42
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,76	0,46	6,00	1.913.053,35	1,62	1.723.608.994,11	0,11
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,88	0,30	3,57	21.758.410,62	18,45		
Renda Fixa			1,93	0,86	6,08	77.911.096,47	66,07		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

24,67%

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
ITAU	ITAU	ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	20,70	3,48	-11,30	187.551,27	0,16	44.401.980,61	0,42
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	24,78	4,24	-17,13	257.672,49	0,22	889.447.105,88	0,03
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	18,70	2,66	-11,49	6.786.693,98	5,76	542.903.933,54	1,25
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	17,92	0,97	-8,51	6.714.514,32	5,69	2.631.453.374,95	0,26
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	22,46	0,39	-17,09	1.313.500,58	1,11	617.111.122,63	0,21
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FIA	20,58	0,12	-12,82	862.439,57	0,73	1.094.729.532,50	0,08
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	20,16	5,25	-6,31	887.999,36	0,75	163.432.589,71	0,54
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			18,56	1,84	-10,72	17.010.371,57	14,42		

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 S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	13,24	5,42	32,11	10.109.929,85	8,57	2.394.295.587,10	0,42
Sub-total Artigo 8º III			13,24	5,42	32,11	10.109.929,85	8,57		

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
VINCI	BEM	VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP ME II - CLASSE A	55,53	42,66	32,86	1.827.651,72	1,55	98.102.740,42	1,86
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			55,53	42,66	32,86	1.827.651,72	1,55		

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
KINEA	KINEA	KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	43,31	-5,27	0,19	143.786,27	0,12	34.758.255,84	0,41
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			43,31	-5,27	0,19	143.786,27	0,12		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

15,54

4,96

0,67

29.091.739,41

24,67

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

9,26%

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	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	17,96	1,59	8,24	1.884.649,47	1,60	596.803.932,92	0,32
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,11	3,53	12,15	1.369.613,09	1,16	221.430.661,53	0,62
XP	BNP PARIBAS	J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	24,15	-1,22	-4,74	1.408.706,01	1,19	281.286.391,67	0,50
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21,30	-2,60	-6,14	1.267.073,49	1,07	1.410.026.256,25	0,09
VINCI	BEM	VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	14,64	1,81	14,52	873.273,13	0,74	156.098.975,27	0,56
Sub-total Artigo 9º A, II			13,54	0,60	13,99	6.803.315,19	5,77		

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,57	1,70	30,51	2.185.949,02	1,85	3.890.658.229,39	0,06
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	17,53	3,45	33,92	1.934.432,33	1,64	3.983.843.860,12	0,05
Sub-total Artigo 9º A, III			17,10	2,52	32,33	4.120.381,35	3,49		

Investimentos no Exterior			14,96	1,31	24,30	10.923.696,54	9,26		
Total			4,46	1,87	6,25	117.926.532,42	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	43.790.966,09	37,13	0,00	21,72	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	12.302.269,20	10,43	0,00	24,91	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	59.450,56	0,05	0,00	0,06	60,00	0,00	65,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	21.758.410,62	18,45	0,00	23,16	40,00	0,00	45,00
	Total Renda Fixa	77.911.096,47	66,07					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	17.010.371,57	14,42	0,00	16,19	20,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	10.109.929,85	8,57	0,00	4,08	15,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	1.827.651,72	1,55	0,00	0,48	5,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	143.786,27	0,12	0,00	0,25	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	29.091.739,41	24,67					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	6.803.315,19	5,77	0,00	0,82	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	4.120.381,35	3,49	0,00	8,33	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	10.923.696,54	9,26					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	1,25 163,19	16,44 374,00	4,44 241,29	8,80 285,01	16,44 374,00	538.928,81	4.073.882,58
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,45 59,58	-1,40 -31,89	0,81 44,19	-0,27 -8,66	-1,40 -31,89	55.709,31	-594.196,48
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,22 28,97	-1,50 -34,04	0,98 53,48	-0,68 -21,87	-1,50 -34,04	131,20	-902,98
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,30 39,57	3,57 81,19	1,43 77,48	2,54 82,23	3,57 81,19	63.911,70	1.020.083,77
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	1,84 -1,01	-10,72 1,21	-7,56 -2,01	-18,37 -1,04	-10,72 1,21	307.356,09	-2.079.585,45
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	5,42 2,57	32,11 44,04	12,80 18,35	14,10 31,43	32,11 44,04	495.641,32	1.629.541,88
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	42,66 39,81	32,86 44,79	42,43 47,98	40,09 57,43	32,86 44,79	546.567,87	559.362,33
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-5,27 -8,12	0,19 12,12	-4,25 1,30	6,93 24,26	0,19 12,12	-7.999,51	9.808,13
Artigo 9º A, II % do CDI	0,60 78,56	13,99 318,28	4,75 258,14	5,33 172,56	13,99 318,28	40.567,83	213.951,42
Artigo 9º A, III % do CDI	2,52 329,50	32,33 735,56	12,05 654,27	20,70 670,50	32,33 735,56	101.121,43	1.905.433,19
PIRACAIA (Total)						2.141.936,05	6.737.378,39

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 (5,315000%)	19.867.840,20	0,00	0,00	0,00	20.113.558,69	245.718,49	664.730,10
NTN-B 150826 (5,510000%)	23.384.197,08	0,00	0,00	0,00	23.677.407,40	293.210,32	3.409.152,48
					43.790.966,09	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 IPCA III	2.647.722,93	0,00	0,00	0,00	2.665.294,43	17.571,50	139.728,50
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	1.941.172,00	0,00	0,00	0,00	1.945.064,70	3.892,70	-152.973,28
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.541.822,00	0,00	0,00	0,00	1.554.937,00	13.115,00	44.444,50
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3.009.685,15	0,00	0,00	0,00	3.005.685,02	-4.000,13	-689.247,42
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	3.106.157,81	0,00	0,00	0,00	3.131.288,05	25.130,24	94.588,05
					12.302.269,20	0,00	0,00

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	59.319,36	0,00	0,00	0,00	59.450,56	131,20	-902,98
					59.450,56	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	6.353.093,55	0,00	-50.000,00	0,00	6.302.720,55	-373,00	527.323,36
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	2.208.883,03	0,00	0,00	0,00	2.227.896,68	19.013,65	197.162,24
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	2.353.296,91	0,00	-449.000,00	0,00	1.913.053,35	8.756,44	321.112,22
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	3.811.063,63	213.938,31	0,00	0,00	4.028.045,11	3.043,17	-109.848,71
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	3.928.116,16	290.842,87	0,00	0,00	4.227.309,54	8.350,51	-17.783,76
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	3.034.264,46	0,00	0,00	0,00	3.059.385,39	25.120,93	102.118,42
					21.758.410,62	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	247.180,73	0,00	0,00	0,00	257.672,49	10.491,76	-53.259,80
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	6.649.942,56	0,00	0,00	0,00	6.714.514,32	64.571,76	-624.375,77
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	181.251,17	0,00	0,00	0,00	187.551,27	6.300,10	-39.737,34
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	1.308.365,75	0,00	0,00	0,00	1.313.500,58	5.134,83	-294.753,36
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	843.736,40	0,00	0,00	0,00	887.999,36	44.262,96	-59.849,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)	
VINCI MOSAICO FIA	861.387,54	0,00	0,00	0,00	862.439,57	1.052,03	-126.849,73	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	6.611.151,33	0,00	0,00	0,00	6.786.693,98	175.542,65	-880.760,16	
					17.010.371,57	0,00	0,00	
Artigo 8º III								
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)	
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	8.357.298,89	1.256.989,64	0,00	0,00	10.109.929,85	495.641,32	1.629.541,88	
					10.109.929,85	0,00	0,00	
Artigo 8º IV, Alínea a								
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)	
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP ME II - CLASSE A	1.281.083,85	0,00	0,00	0,00	1.827.651,72	546.567,87	559.362,33	
					1.827.651,72	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\$)
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	151.785,78	0,00	0,00	0,00	0,00	143.786,27	-7.999,51	9.808,13
						143.786,27	0,00	0,00
Artigo 9º A, II								
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)	
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	1.855.186,25	0,00	0,00	0,00	1.884.649,47	29.463,22	107.824,43	
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.322.919,41	0,00	0,00	0,00	1.369.613,09	46.693,68	148.413,09	
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.426.047,71	0,00	0,00	0,00	1.408.706,01	-17.341,70	-70.093,99	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.300.848,08	0,00	0,00	0,00	1.267.073,49	-33.774,59	-82.926,51	
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO -	857.745,91	0,00	0,00	0,00	873.273,13	15.527,22	110.734,40	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
INVESTIMENTO NO EXTERIOR					6.803.315,19	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2.149.352,23	0,00	0,00	0,00	2.185.949,02	36.596,79	1.242.895,37
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	1.869.907,69	0,00	0,00	0,00	1.934.432,33	64.524,64	662.537,82
					4.120.381,35	0,00	0,00

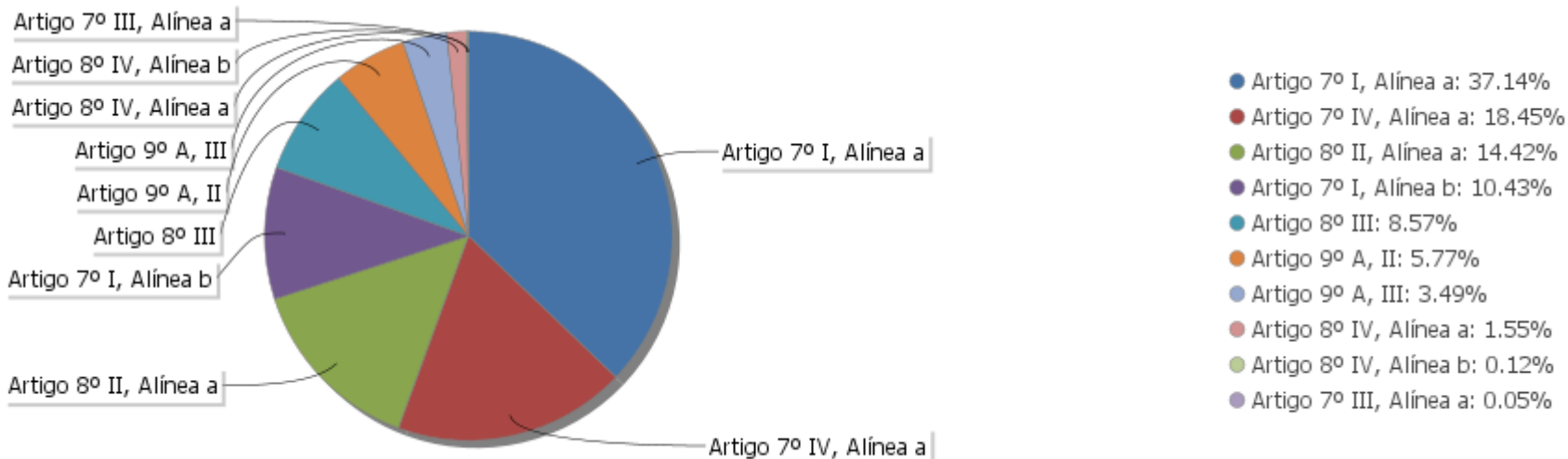
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

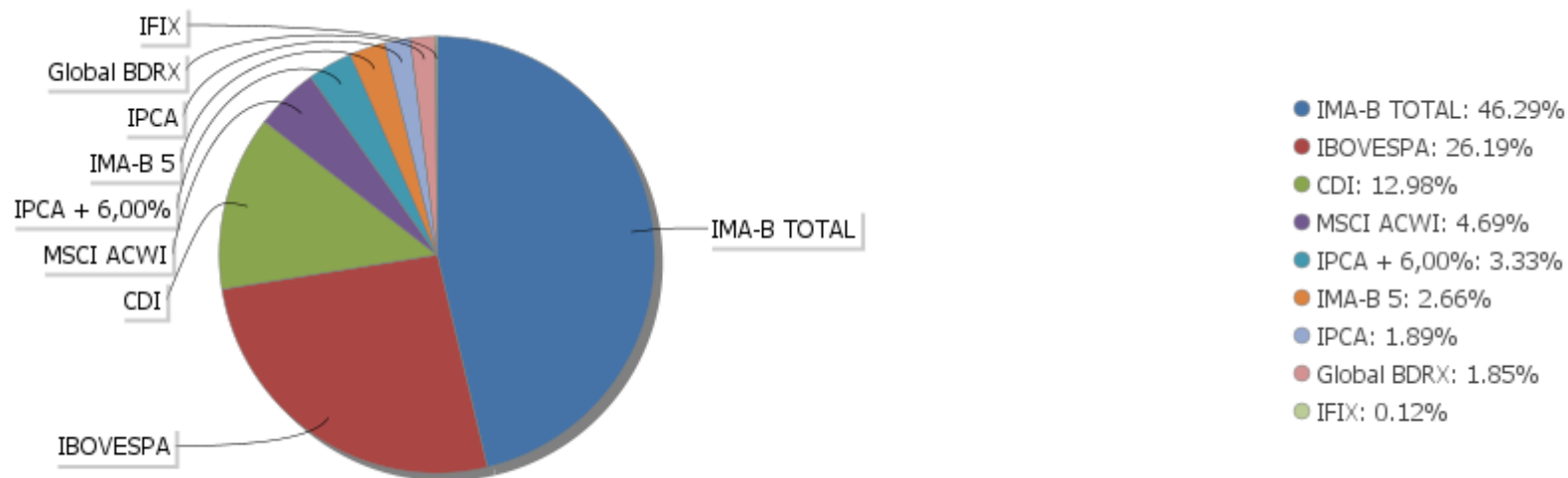
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	51.537.261,60	43,70	51.537.261,60	43,70
de 31 a 365 dias	16.550.421,58	14,03	68.087.683,18	57,74
acima de 365 dias	49.838.849,24	42,26	117.926.532,42	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

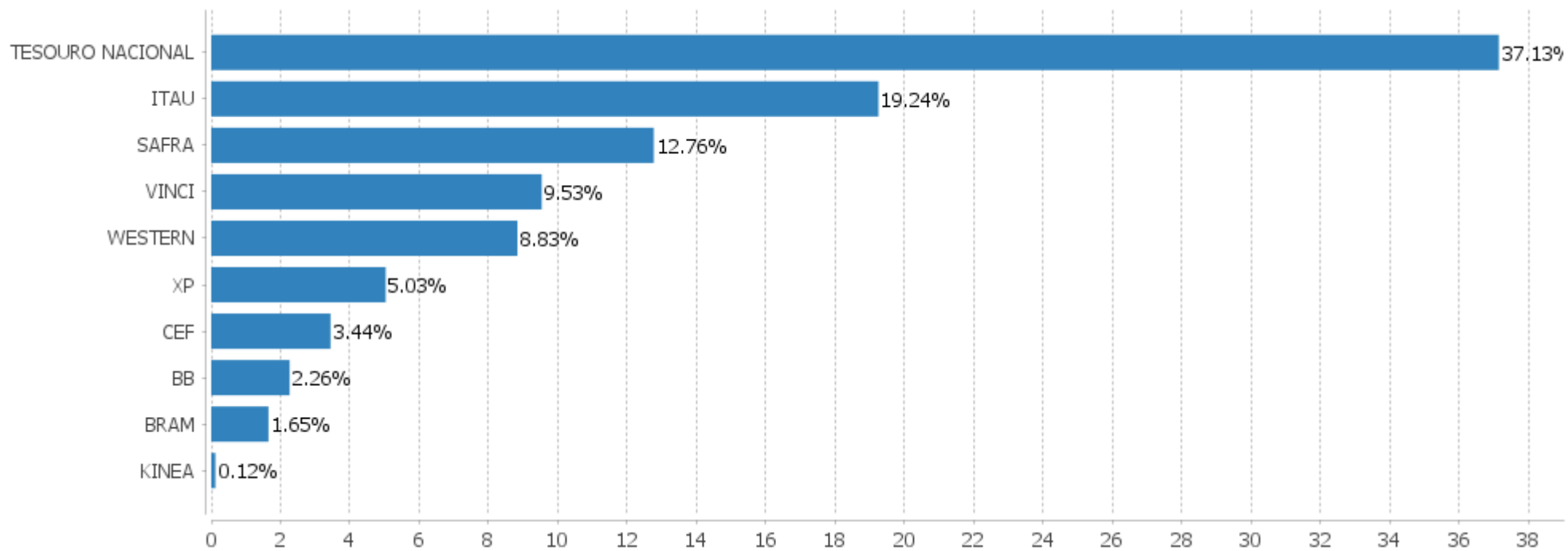


Alocação Por Estratégia



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	-0,04	-0,18	1,36	1,36	1,48	0,55	0,03	-0,07	-0,79	-0,37	0,92	1,87	6,25
IPCA + 5,42%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,68	1,37	1,24	16,03
p.p. indexador	-0,71	-1,42	-0,05	0,63	0,20	-0,42	-1,40	-1,40	-2,40	-2,05	-0,45	0,62	-9,78
2020	0,99	-1,89	-6,31	3,61	1,93	2,26	2,71	1,12	-1,49	-0,17	3,35	3,20	9,21
IPCA + 5,50%	0,68	0,63	0,54	0,11	0,04	0,71	0,85	0,69	1,09	1,31	1,32	1,82	10,24
p.p. indexador	0,31	-2,53	-6,85	3,50	1,89	1,55	1,85	0,44	-2,58	-1,48	2,03	1,37	-1,03
2019	3,15	0,30	0,52	1,27	1,20	2,42	1,40	0,52	1,52	1,46	0,53	2,59	18,22
IPCA + 5,50%	0,79	0,86	1,16	1,02	0,60	0,41	0,68	0,58	0,41	0,59	0,94	1,60	10,07
p.p. indexador	2,36	-0,56	-0,63	0,25	0,60	2,01	0,72	-0,06	1,12	0,87	-0,41	0,99	8,15

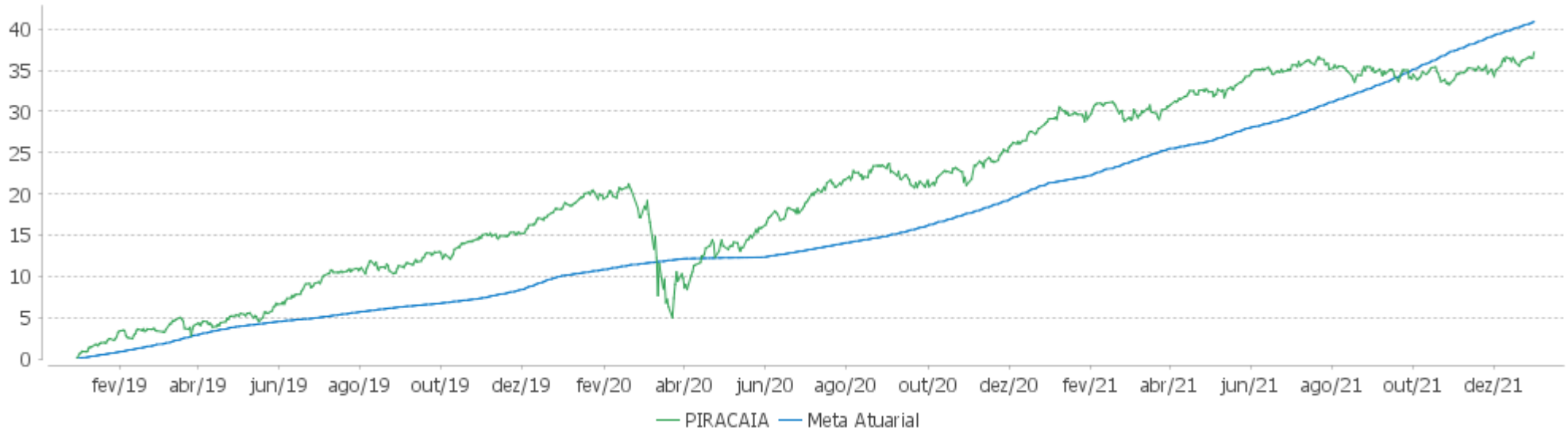
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

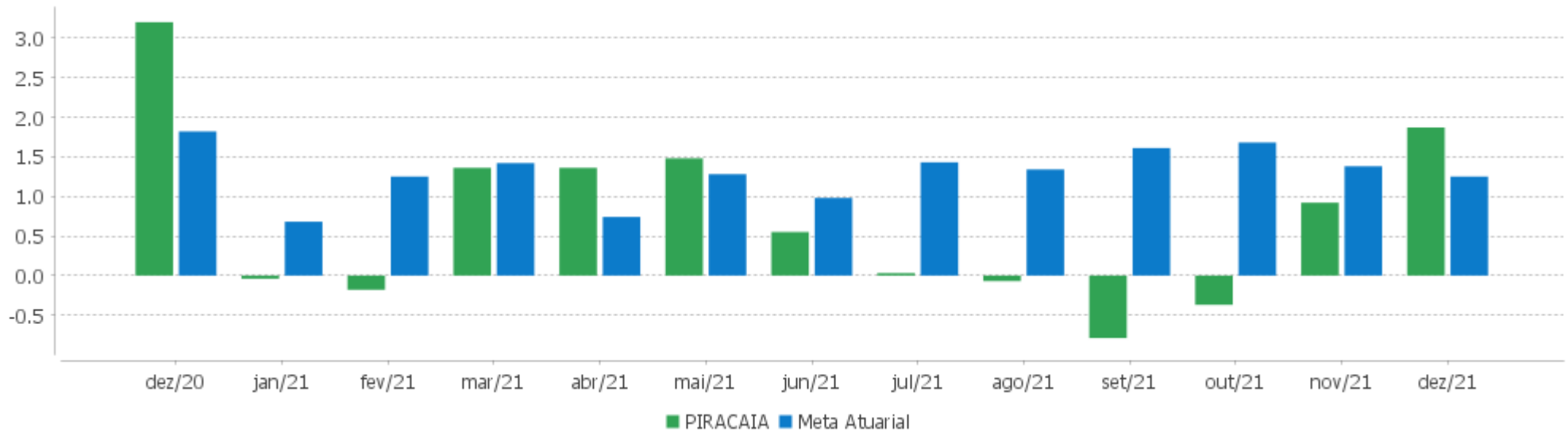
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	19	52,78	03 meses	2,42	4,35	-1,93	4,33
Meses abaixo - Meta Atuarial	17	47,22	06 meses	1,57	8,98	-7,41	4,38
			12 meses	6,25	16,03	-9,78	4,46
			24 meses	16,04	27,92	-11,88	8,23
			36 meses	37,18	40,79	-3,61	7,10
Maior rentabilidade da Carteira	3,61	2020-04	Desde 31/12/2018	37,18	40,79	-3,61	7,10
Menor rentabilidade da Carteira	-6,31	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 150826 (5,510000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,25 1,03	16,46 17,72	4,46 3,40	8,82 9,36	16,46 17,72	28,28 23,22	40,48 11,31
NTN-B 150535 (5,315000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,24 1,01	13,11 14,37	4,41 3,35	8,71 9,26	13,11 14,37	17,77 12,71	21,91 -7,26
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,22 -0,00	-1,50 -0,23	0,98 -0,08	-0,68 -0,13	-1,50 -0,23	4,46 -0,60	27,93 -1,24
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	0,81 0,02	0,00 -4,57	1,46 -0,57	1,23 -2,01	0,00 -4,57	10,18 -2,79	27,76 -0,08
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,85 0,63	2,96 4,22	2,04 0,98	2,81 3,35	2,96 4,22	11,98 6,92	31,57 2,40
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,13 -0,36	-5,18 -3,91	-0,28 -1,34	-3,07 -2,53	-5,18 -3,91	1,69 -3,37	25,53 -3,64
BB PREV IPCA III Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,66 -0,63	5,47 -11,20	1,89 -2,61	3,84 -5,44	5,47 -11,20	12,76 -16,46	27,06 -15,85
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,20 -0,02	-1,62 -0,36	0,97 -0,09	-0,72 -0,17	-1,62 -0,36	4,33 -0,73	27,84 -1,33
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	0,08 11,11	-1,47 -33,44	0,37 20,34	-0,61 -19,84	-1,47 -33,44	5,95 81,66	31,88 232,90
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,23 0,01	-5,84 -4,57	0,39 -0,67	-2,62 -2,07	-5,84 -4,57	2,25 -2,81	28,66 -0,51
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI % do CDI	0,83 108,43	2,52 57,27	1,74 94,40	2,42 78,36	2,52 57,27	7,57 103,87	16,15 118,02
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	0,46 60,51	6,00 136,51	2,19 118,80	4,92 159,42	6,00 136,51	10,36 142,18	
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI	-0,01 -0,73	6,77 154,01	1,82 98,96	5,44 176,28	6,77 154,01	13,94 191,32	26,12 190,81
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,86 0,10	4,53 -5,56	2,16 -0,83	3,49 -2,61	4,53 -5,56	7,52 -7,54	20,33 0,31
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	4,24 1,39	-17,13 -5,20	-11,61 -6,07	-25,64 -8,31	-17,13 -5,20	-19,81 -10,45	24,10 4,83
VINCI MOSAICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,12 -2,73	-12,82 -0,90	-5,04 0,51	-17,16 0,17	-12,82 -0,90	-9,79 -0,43	34,90 15,63
ITAÚ INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	0,39	-17,09	-13,88	-24,60	-17,09	-34,69	-8,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-2,46	-5,17	-8,34	-7,27	-5,17	-25,33	-27,95
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	2,66	-11,49	-6,29	-16,97	-11,49	-3,29	29,78
Var. IBOVESPA p.p.	-0,20	0,44	-0,74	0,37	0,44	6,07	10,51
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	3,48	-11,30	-6,26	-18,87	-11,30	-8,94	22,16
Var. IBOVESPA p.p.	0,62	0,62	-0,71	-1,54	0,62	0,42	2,89
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
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	5,25	-6,31	-5,20	-16,60	-6,31	-7,74	33,14
Var. IBOVESPA p.p.	2,39	5,61	0,35	0,73	5,61	1,62	13,87
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	5,42	32,11	12,80	14,10	32,11	48,74	96,32
Var. IBOVESPA p.p.	2,57	44,04	18,35	31,43	44,04	58,10	77,05
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	-5,27	0,19	-4,25	6,93	0,19	-6,91	-17,23
Var. IFIX p.p.	-14,05	2,47	-7,53	5,12	2,47	5,38	-36,51
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP ME II - CLASSE A	42,66	31,78	42,43	38,95	31,78	93,36	11.203,13
Var. IBOVESPA p.p.	39,81	43,70	47,98	56,29	43,70	102,72	11.183,86
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1,70	30,51	11,81	20,44	30,51	101,98	171,58
Var. Global BDRX p.p.	-0,01	-3,14	-0,48	-0,99	-3,14	-3,86	-7,67
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	3,45	33,92	12,50	21,19	33,92	93,45	165,70
Var. IBOVESPA p.p.	0,60	45,85	18,05	38,52	45,85	102,81	146,43
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1,81	14,52	5,43	13,80	14,52	56,99	60,70
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,36	-10,90	-3,71	-3,16	-10,90	-27,90	-77,88
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-1,22	-2,39	3,21	-0,02	-2,39		
Var. MSCI ACWI p.p.	-4,38	-27,82	-5,93	-16,98	-27,82		
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	1,59	14,71	3,09	2,29	14,71	63,78	
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,58	-10,71	-6,06	-14,67	-10,71	-21,11	
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.	-3,89	-9,42	-2,87	-4,35	-9,42	75,95	
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3,53	18,41	11,67	11,76	18,41	63,33	
Var. MSCI ACWI p.p.	0,36	-7,01	2,52	-5,20	-7,01	-21,55	
PIRACAIA	1,87	6,25	2,42	1,57	6,25	16,04	37,18
Var. IPCA + 5,50% p.p.	0,62	-9,87	-1,95	-7,45	-9,87	-11,97	-3,72
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%							
IPCA + 6,00%	1,29	16,67	4,50	9,28	16,67	29,23	42,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du	0,00	0,80
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du	0,00	0,80
BB PREV IPCA III	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	1,50
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du		1,90
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	0,90
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du		2,50
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,40
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+1 du	D+1 du	D+6 du		
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	Não se aplica	Não se aplica				
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du	0,00	0,80
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	0,00	1,50
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+0	D+0	D+3 du	D+4 du	0,00	0,30
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+2 du	0,00	1,00
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP ME II - CLASSE A	Não se aplica	Não se aplica				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	D+1 du	D+0	D+5 du	D+7 du	20.0000000000000 -	1,00
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+0	D+0	D+32	D+35	10.0000000000000 -	1,00
VINCI MOSAICO 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)	20.0000000000000 -	1,97
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	D+1 du	D+0	D+60	D+62	20.0000000000000	0,97
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,50
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,40
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	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	0,88	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	0,76	10,09	2,99	6,09	10,09	15,06	20,02	24,51	28,18
INPC									
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%	1,12	14,48	4,00	8,23	14,48	24,41	34,98	45,59	55,81
IPCA + 5,00%	1,21	15,57	4,25	8,76	15,57	26,81	38,91	51,26	63,41
IPCA + 5,50%	1,25	16,12	4,37	9,02	16,12	28,01	40,90	54,15	67,32
IPCA + 5,89%	1,28	16,55	4,47	9,22	16,55	28,96	42,47	56,44	70,42
IPCA + 6,00%	1,29	16,67	4,50	9,28	16,67	29,23	42,91	57,09	71,30
INPC + 4,00%									
INPC + 6,00%									

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
300	01/12/2021	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,00	449.000,00	40.313,31980000	11,1377580000
301	01/12/2021	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	0,00	50.000,00	3.802,44533000	13,1494330000
302	06/12/2021	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	317.997,69	0,00	1.040,08292100	305,7426320000
303	08/12/2021	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	22.770,00	0,00	1.976,73152000	11,5190150000
304	08/12/2021	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	167.945,53	0,00	535,50476900	313,6209790000
305	13/12/2021	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	455.061,55	0,00	1.461,59893100	311,3450210000
306	20/12/2021	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	290.842,87	0,00	81.832,86648862	3,5541083000
307	21/12/2021	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	315.984,87	0,00	1.016,97416600	310,7108130000
308	22/12/2021	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	16.966,48	0,00	1.481,87731000	11,4493150000
309	22/12/2021	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6.748,46	0,00	589,42042000	11,4493150000
310	30/12/2021	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	167.453,37	0,00	14.672,56952000	11,4126820000
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 2.333.669,27

Value-At-Risk: 1,98%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PIRACAIA		1,98	1,98			117.926.532,42	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,65%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,315000%)		0,10	-0,00	2,95			20.113.558,69	17,06
NTN-B 150826 (5,510000%)		0,10	-0,00	2,95			23.677.407,40	20,08
Sub-total	0,37	0,10	-0,00		1,30	1,25	43.790.966,09	37,13

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA		3,10	0,04	0,38			3.005.685,02	2,55
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		2,96	0,02	0,01			1.945.064,70	1,65
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF		1,72	0,02	0,60			3.131.288,05	2,66
BB PREV IPCA III		0,92	0,01	0,94			2.665.294,43	2,26
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,72	0,01	1,65			1.554.937,00	1,32
Sub-total	3,10	1,98	0,10		-0,10	0,45	12.302.269,20	10,43

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		2,99	0,00	0,08			59.450,56	0,05
Sub-total	4,59	2,99	0,00		-0,12	0,22	59.450,56	0,05

Artigo 7º IV, Alínea a

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI		0,42	0,00	0,41			3.059.385,39	2,59
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO		3,20	0,05	3,19			4.028.045,11	3,42
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF		3,41	0,06	0,58			4.227.309,54	3,58
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		0,61	0,00	0,63			2.227.896,68	1,89
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI		1,05	-0,02	1,06			6.302.720,55	5,34
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI		0,44	-0,00	0,45			1.913.053,35	1,62
Sub-total	1,69	1,19	0,10		-0,27	0,30	21.758.410,62	18,45

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 6,91%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI		10,67	0,01	1,16			187.551,27	0,16
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		15,53	0,03	7,85			257.672,49	0,22
VINCI SELECTION EQUITIES FIA		9,38	0,45	2,39			6.786.693,98	5,76
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		9,34	0,45	4,16			6.714.514,32	5,69
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		11,89	0,11	4,39			1.313.500,58	1,11
VINCI MOSAICO FIA		11,53	0,07	3,88			862.439,57	0,73
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA		12,00	0,08	4,17			887.999,36	0,75
Sub-total	15,55	9,74	1,20		0,07	1,84	17.010.371,57	14,42

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		6,41	0,42	9,38			10.109.929,85	8,57
Sub-total	16,39	6,41	0,42		0,28	5,42	10.109.929,85	8,57

Artigo 8º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP ME II - CLASSE A		1,55	0,00	10,13			1.827.651,72	1,55
Sub-total	117,61	1,55	0,00		0,36	42,66	1.827.651,72	1,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII		0,38	0,00	3,22			143.786,27	0,12
Sub-total	17,92	0,38	0,00		-0,34	-5,27	143.786,27	0,12

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,51%

Artigo 9º A, II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		8,37	0,08	7,80			1.884.649,47	1,60
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		10,04	0,06	8,75			1.369.613,09	1,16
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		8,42	-0,02	9,65			1.408.706,01	1,19
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		10,93	-0,01	10,92			1.267.073,49	1,07
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR		7,07	-0,01	6,57			873.273,13	0,74
Sub-total	11,86	6,06	0,09		-0,01	0,60	6.803.315,19	5,77

Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		8,18	0,03	0,67			2.185.949,02	1,85
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		8,41	0,04	13,95			1.934.432,33	1,64
Sub-total	18,11	8,12	0,07		0,10	2,52	4.120.381,35	3,49