



PATO BRANCO CONSOLIDADO
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 **75,06%**

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	3,52	1,88	-2,28	433.866,74	0,60	4.897.855.877,38	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,78	0,77	4,31	6.712.678,29	9,27	12.444.051.491,75	0,05
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,61	0,71	4,65	8.567.310,33	11,83	9.277.694.744,55	0,09
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,10	2,27	-5,31	427.371,64	0,59	1.203.780.064,86	0,04
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,52	1,87	-2,18	409.810,36	0,57	1.233.687.856,77	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,80	0,76	4,27	7.656.468,96	10,57	6.458.635.592,00	0,12
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,84	0,91	-0,40	6.847.190,62	9,46	7.701.081.218,58	0,09
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,33	0,83	-0,11	4.707.812,84	6,50	12.561.638.596,69	0,04
BB	BB	BB PREV IRF-M 1+	5,12	2,29	-5,27	563.957,38	0,78	171.563.551,43	0,33
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,67	0,85	2,38	36.326.467,16	50,17		

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
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,13	0,67	3,15	1.005.074,30	1,39	3.073.023.342,66	0,03
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,10	0,86	4,53	5.029.696,60	6,95	2.626.754.965,66	0,19
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,21	0,75	4,04	8.572.369,85	11,84	1.655.054.217,47	0,52
CEF	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,07	0,74	0,70	3.408.222,03	4,71	981.226.315,84	0,35
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,07	0,78	2,93	18.015.362,78	24,88		
Renda Fixa			2,33	0,83	2,45	54.341.829,94	75,06		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

21,73%

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,64	3,44	-11,53	2.310.535,88	3,19	994.621.415,62	0,23
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	20,75	2,86	-12,11	844.490,40	1,17	570.416.481,31	0,15
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			20,63	3,28	-11,64	3.155.026,28	4,36		

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
BB	BB	BB AÇÕES ENERGIA FI	19,32	0,09	-11,14	959.814,20	1,33	308.771.286,01	0,31
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	23,51	-0,04	-27,27	1.124.666,93	1,55	199.779.357,69	0,56
CEF	CEF	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	23,02	3,06	-8,16	1.463.051,62	2,02	327.680.893,60	0,45
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	17,92	0,97	-8,51	523.847,20	0,72	2.631.453.374,95	0,02
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	13,46	5,28	17,05	3.572.662,28	4,93	2.828.008.571,13	0,13
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	20,71	1,50	-13,05	886.072,76	1,22	1.395.905.233,31	0,06
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			17,53	2,89	-6,51	8.530.114,99	11,78		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,65	1,43	1,44	173.289,05	0,24	3.414.338.235,91	0,01
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	3,89	1,34	1,40	1.504.977,99	2,08	117.814.282,98	1,28
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,38	5,56	18,29	2.367.152,55	3,27	3.768.911.648,33	0,06
Sub-total Artigo 8º III			6,17	3,77	8,28	4.045.419,59	5,59		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

14,88

3,21

-4,04

15.730.560,86

21,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,22%

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	8,58	881.892,31	1,22	3.890.658.229,39	0,02
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	17,27	2,90	13,02	868.553,23	1,20	1.468.389.548,66	0,06
BB	BB	BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS FIC DE FIA - BDR ETF NÍVEL I	14,72	5,31	2,73	578.997,92	0,80	219.903.954,45	0,26
Sub-total Artigo 9º A, III			15,02	3,03	6,37	2.329.443,46	3,22		
Investimentos no Exterior			15,02	3,03	6,37	2.329.443,46	3,22		
Total			4,58	1,45	0,99	72.401.834,26	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	36.326.467,16	50,17	0,00	53,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	18.015.362,78	24,88	0,00	7,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	54.341.829,94	75,06					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	3.155.026,28	4,36	0,00	8,00	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	8.530.114,99	11,78	0,00	16,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	4.045.419,59	5,59	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	15.730.560,86	21,73					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	2.329.443,46	3,22	0,00	7,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	2.329.443,46	3,22					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 b % do CDI	0,85 111,75	2,38 54,18	1,58 85,75	1,81 58,58	2,38 54,18	307.334,76	840.771,95
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,78 101,97	2,93 66,57	1,89 102,49	2,06 66,80	2,93 66,57	115.226,93	332.179,91
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	3,28 0,43	-11,64 0,28	-6,18 -0,63	-18,56 -1,23	-11,64 0,28	100.327,99	-399.139,68
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	2,89 0,04	-6,51 5,42	-1,75 3,79	-8,92 8,41	-6,51 5,42	238.313,38	-528.792,03
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	3,77 0,92	8,28 20,21	6,68 12,23	5,80 23,13	8,28 20,21	147.043,42	292.121,68
Artigo 9º A, III % do CDI	3,03 396,23	6,37 264,45	10,84 588,34			68.405,86	142.231,04
PATO BRANCO CONSOLIDADO (Total)						976.652,34	679.372,87

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV IRF-M 1+	551.313,95	0,00	0,00	0,00	563.957,38	12.643,43	-31.344,56
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6.785.167,38	0,00	0,00	0,00	6.847.190,62	62.023,24	-18.903,23
BB PREV RF IDKA2	8.507.232,08	0,00	0,00	0,00	8.567.310,33	60.078,25	380.340,34
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	7.598.551,52	0,00	0,00	0,00	7.656.468,96	57.917,44	318.047,31
BB PREV RF IRF-M	425.874,31	0,00	0,00	0,00	433.866,74	7.992,43	-10.132,47
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.661.555,16	0,00	0,00	0,00	6.712.678,29	51.123,13	262.572,21
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	417.895,88	0,00	0,00	0,00	427.371,64	9.475,76	-47.440,23
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	402.282,71	0,00	0,00	0,00	409.810,36	7.527,65	-9.151,78
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	4.669.259,41	0,00	0,00	0,00	4.707.812,84	38.553,43	-3.215,64
					36.326.467,16	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	258.886,01	807.224,61	-64.419,50	0,00	1.005.074,30	3.383,18	15.257,80
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	3.383.057,70	0,00	0,00	0,00	3.408.222,03	25.164,33	20.317,97
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	5.137.351,89	3.386.567,22	0,00	0,00	8.572.369,85	48.450,74	130.116,69
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	4.225.744,76	765.723,16	0,00	0,00	5.029.696,60	38.228,68	166.487,45
					18.015.362,78	0,00	0,00

Artigo 8º I, Alinea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	2.233.721,18	0,00	0,00	0,00	2.310.535,88	76.814,70	-291.093,60
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	820.977,11	0,00	0,00	0,00	844.490,40	23.513,29	-108.046,08
					3.155.026,28	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	3.024.025,04	372.248,16	0,00	0,00	3.572.662,28	176.389,08	377.312,53
BB AÇÕES CONSUMO FIC	1.125.111,92	0,00	0,00	0,00	1.124.666,93	-444,99	-416.956,82
BB AÇÕES ENERGIA FI	958.996,20	0,00	0,00	0,00	959.814,20	818,00	-156.900,34
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	872.947,84	0,00	0,00	0,00	886.072,76	13.124,92	-167.956,01
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	1.419.662,95	0,00	0,00	0,00	1.463.051,62	43.388,67	-115.579,38
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	518.809,50	0,00	0,00	0,00	523.847,20	5.037,70	-48.712,01
					8.530.114,99	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	1.485.098,22	0,00	0,00	0,00	1.504.977,99	19.879,77	20.806,38
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.242.439,04	0,00	0,00	0,00	2.367.152,55	124.713,51	268.316,02
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	170.838,91	0,00	0,00	0,00	173.289,05	2.450,14	2.999,28
					4.045.419,59	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS FIC DE FIA - BDR ETF NÍVEL I	549.813,90	0,00	0,00	0,00	578.997,92	29.184,02	10.860,76
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	844.095,90	0,00	0,00	0,00	868.553,23	24.457,33	49.477,97
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	867.127,80	0,00	0,00	0,00	881.892,31	14.764,51	81.892,31
					2.329.443,46	0,00	0,00

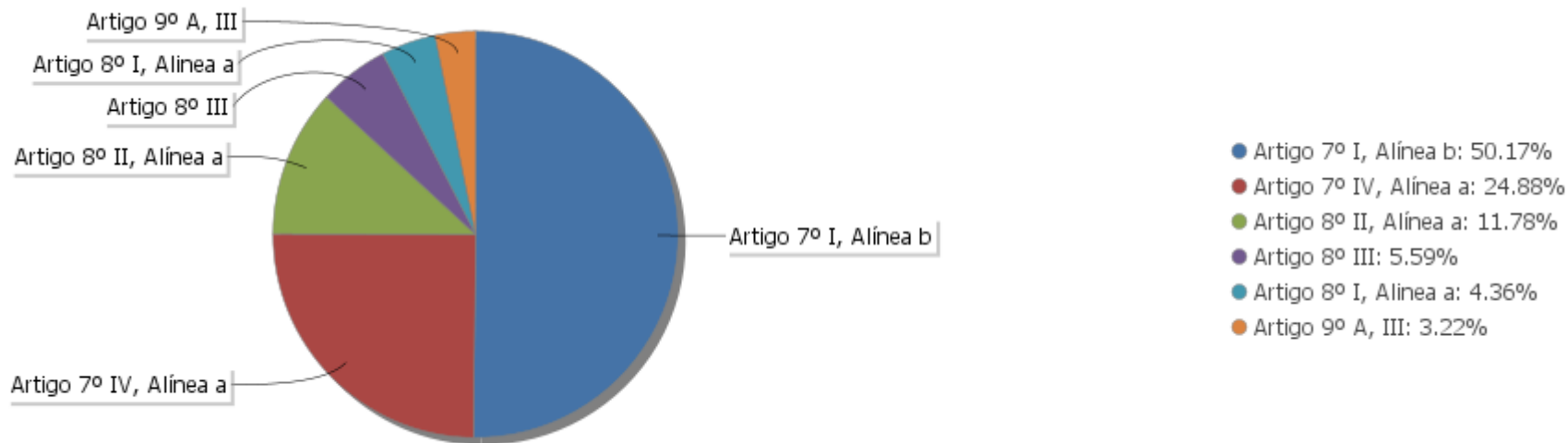
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

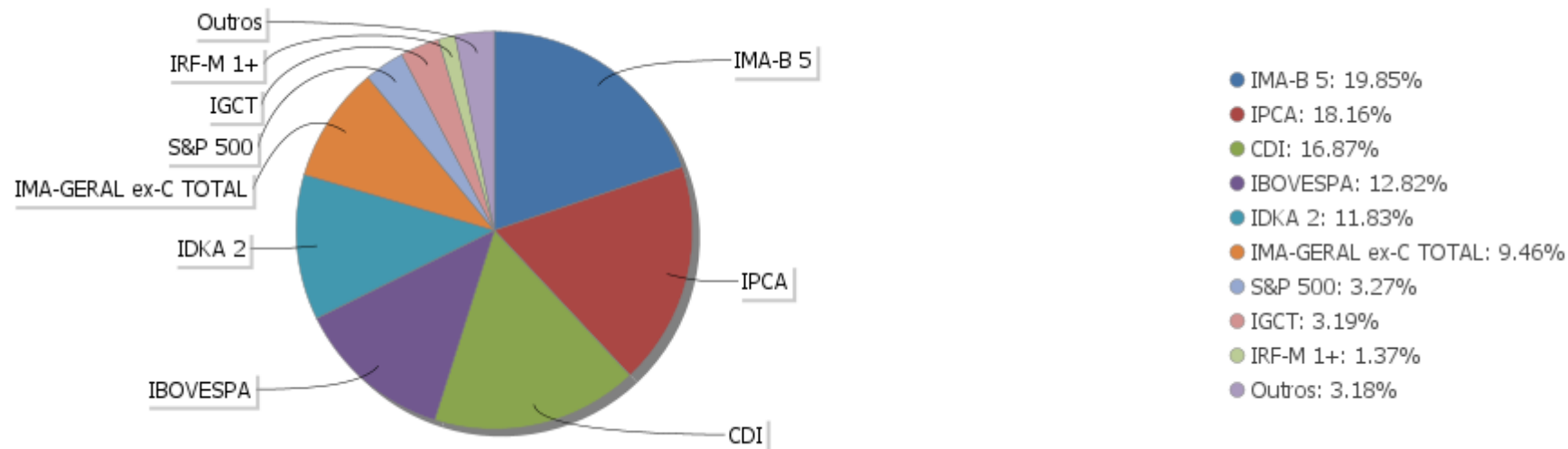
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	71.877.987,06	99,28	71.877.987,06	99,28
de 31 a 365 dias	523.847,20	0,72	72.401.834,26	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	72.401.834,26	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

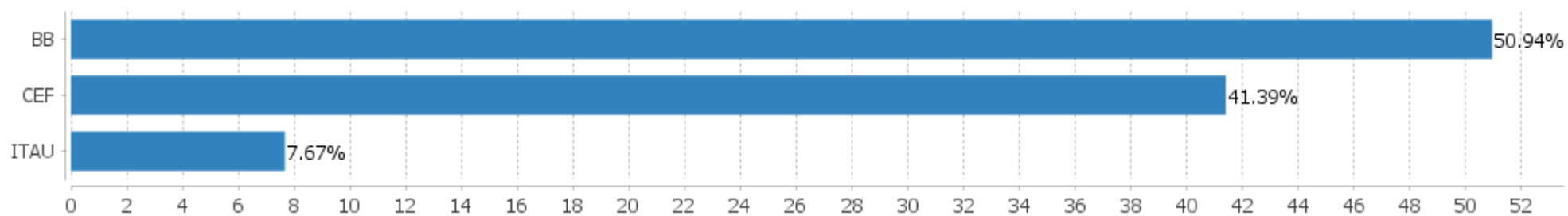


Alocação Por Estratégia



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	-0,68	-1,34	1,19	0,93	1,38	0,02	-0,65	-0,43	-0,72	-1,16	1,06	1,45	0,99
IPCA + 5,43%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,97	1,43	1,34	1,61	1,68	1,37	1,22	16,01
p.p. indexador	-1,35	-2,58	-0,23	0,20	0,11	-0,95	-2,08	-1,77	-2,33	-2,83	-0,32	0,23	-15,02
2020	0,47	-0,63	-5,97	2,01	2,51	1,89	2,32	-0,99	-1,37	-0,16	3,13	2,95	5,94
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,65
p.p. indexador	-0,25	-1,29	-6,54	1,87	2,44	1,15	1,43	-1,71	-2,49	-1,50	1,78	1,09	-4,70
2019	1,43	0,31	0,54	0,84	1,61	1,98	1,00	0,11	1,77	1,74	-0,36	1,55	13,24
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	0,60	-0,58	-0,66	-0,22	0,97	1,53	0,28	-0,51	1,32	1,11	-1,33	-0,09	2,65

Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

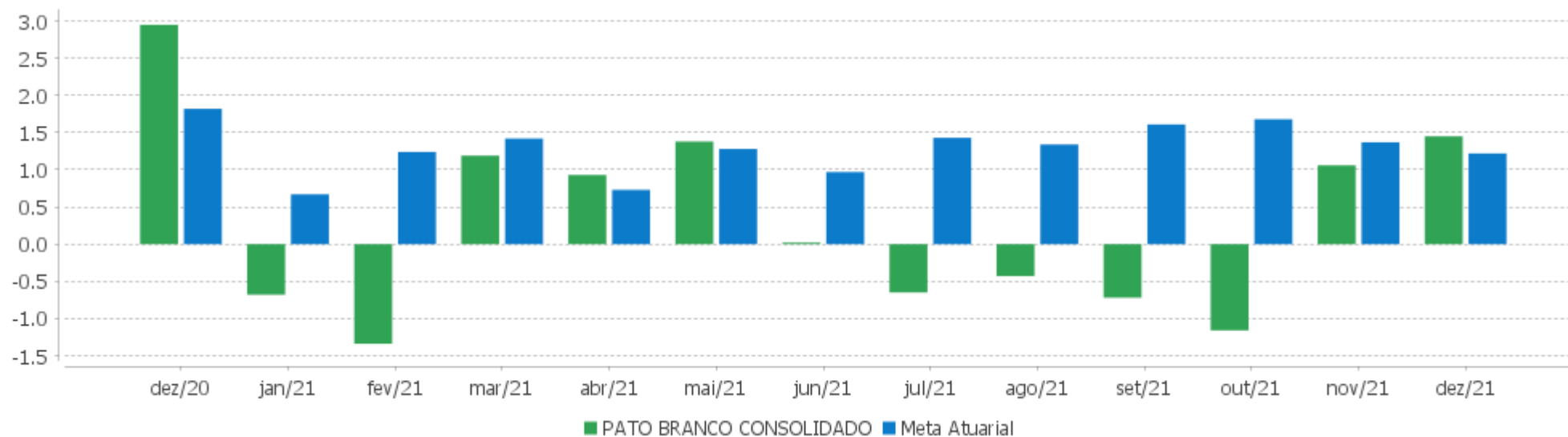
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	15	41,67	03 meses	1,33	4,33	-2,99	4,52
Meses abaixo - Meta Atuarial	21	58,33	06 meses	-0,48	8,95	-9,43	4,47
			12 meses	0,99	16,01	-15,02	4,58
			24 meses	7,00	28,37	-21,37	7,90
			36 meses	21,17	41,96	-20,79	6,61
			Desde 31/12/2018	21,17	41,96	-20,79	6,61
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	3,13	2020-11					
Menor rentabilidade da Carteira	-5,97	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
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	2,27 -0,02	-5,31 -0,32	0,86 -0,07	-1,95 -0,20	-5,31 -0,32	2,47 -0,58	16,70 -1,02
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,77 -0,02	4,31 -0,25	1,97 -0,06	3,12 -0,12	4,31 -0,25	12,39 -0,58	26,84 -0,99
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,71 -0,12	4,65 -0,33	1,86 0,02	3,18 0,13	4,65 -0,33	12,93 -1,09	25,58 -1,92
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
BB PREV IRF-M 1+ Var. IRF-M 1+ p.p.	2,29 0,01	-5,27 -0,28	0,90 -0,03	-1,94 -0,20	-5,27 -0,28	2,13 -0,91	
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 IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,76 -0,02	4,27 -0,30	1,94 -0,09	3,06 -0,17	4,27 -0,30	12,38 -0,59	26,87 -0,97
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,88 -0,01	-2,28 -0,29	0,93 -0,05	-0,59 -0,17	-2,28 -0,29	3,97 -0,60	16,22 -0,92
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,87 -0,01	-2,18 -0,19	0,97 -0,01	-0,51 -0,08	-2,18 -0,19	4,11 -0,46	16,27 -0,88
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,67 87,65	3,27 74,33	1,58 85,85	2,49 80,68	3,27 74,33	4,96 68,13	10,02 73,22
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,75 98,85	4,52 102,75	1,87 101,58	3,35 108,36	4,52 102,75	7,30 100,25	13,60 99,38
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA 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
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,74 0,01	0,70 -9,36	1,52 -1,44	-0,02 -6,09	0,70 -9,36		
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI % do CDI	1,34 175,31	1,40 31,90	1,91 103,67	0,73 23,71	1,40 31,90		
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	1,43 187,83	1,44 32,82	0,85 45,93	-1,63 -52,65	1,44 32,82	5,01 68,77	24,00 175,33
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	5,56 1,93	32,83 -3,44	13,07 -0,45	14,36 -9,37	32,83 -3,44	47,69 -56,56	94,62 -79,20
BB AÇÕES ENERGIA FI	0,09	-11,14	-3,38	-6,80	-11,14	-9,68	35,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	11,17	-253,43	-183,34	-220,27	-253,43	-132,88	258,62
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA Var. IBOVESPA p.p.	3,06 0,20	-8,16 3,77	-4,10 1,45	-10,41 6,92	-8,16 3,77	-7,65 1,71	42,52 23,25
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,28 2,42	30,30 42,22	12,24 17,78	12,99 30,32	30,30 42,22		
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	0,97 -1,88	-8,51 3,42	-7,99 -2,44	-18,47 -1,14	-8,51 3,42	-12,97 -3,61	26,43 7,16
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	1,50 -1,35	-13,05 -1,12	-10,15 -4,60	-23,04 -5,71	-13,05 -1,12	-16,06 -6,70	25,37 6,10
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	-0,04 -2,89	-27,27 -15,34	-16,67 -11,12	-29,23 -11,90	-27,27 -15,34	-26,63 -17,27	12,45 -6,81
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	2,86 0,01	-12,11 -0,19	-5,59 -0,04	-17,34 -0,00	-12,11 -0,19	-9,70 -0,34	18,30 -0,97
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	3,44 -0,04	-11,53 -0,72	-6,39 -0,19	-19,00 -0,31	-11,53 -0,72	-9,52 -1,66	21,15 -3,27
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	1,70 -0,01	30,51 -3,14	11,81 -0,48	20,44 -0,99	30,51 -3,14	101,98 -3,86	171,58 -7,67
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	2,90 0,05	32,16 44,09	12,22 17,76	22,40 39,73	32,16 44,09	94,37 103,73	153,08 133,81
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS FIC DE FIA - BDR ETF NÍVEL I Var. MSCI ACWI p.p.	5,31 2,14	14,92 -10,51	5,81 -3,34	3,99 -12,97	14,92 -10,51		
PATO BRANCO CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,43% p.p.	1,45 0,23	0,99 -15,02	1,33 -2,99	-0,48 -9,43	0,99 -15,02	7,00 -20,81	21,17 -19,41
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
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		
BB AÇÕES CONSUMO FIC	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	1,00
BB AÇÕES ENERGIA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	2,00
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	0,00	1,60
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	1,00
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	1,00
BB PREV IRF-M 1+	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,30
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	D+1 du	D+0		D+4 du		
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du	0,00	0,30
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	1,00
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IRF-M	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	1,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	0,50
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	2,00
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	0,70
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	0,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,40
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	D+0	D+0		D +1		
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	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 INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração

FICFI

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
310	01/12/2021	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	30.322,28	0,00	19.245,15006100	1,5755803360
311	01/12/2021	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	96.036,39	0,00	60.953,02651700	1,5755803360
305	06/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	40.000,00	0,00	18.424,64934000	2,1710046830
304	10/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	26.171,81	12.042,45204200	2,1732957630
313	15/12/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	1.089.397,73	0,00	720.448,25412900	1,5121110000
306	16/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.501,45	0,00	690,01673300	2,1759617220
303	17/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.029,66	932,47882900	2,1766285060
309	20/12/2021	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	60.587,58	0,00	38.014,38288400	1,5938067490
308	20/12/2021	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	86.990,47	0,00	54.580,31223300	1,5938067490
302	20/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	36.218,03	16.634,42567500	2,1772938900
312	22/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	765.723,16	0,00	351.469,91566800	2,1786307330
314	22/12/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	2.297.169,49	0,00	1.516.398,59791300	1,5148850000
307	23/12/2021	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	98.311,44	0,00	59.433,04200300	1,6541546030
315	23/12/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	765.723,16	0,00	40.736,31062000	18,7970670000
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.342.123,36

Value-At-Risk: 1,85%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PATO BRANCO CONSOLIDADO		1,85	1,85			72.401.834,26	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,89%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M		1,78	0,01	0,02			433.866,74	0,60
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,20	0,07	0,02			6.712.678,29	9,27
BB PREV RF IDKA2		1,37	0,09	0,38			8.567.310,33	11,83
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		2,44	0,01	0,02			427.371,64	0,59
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,78	0,01	0,02			409.810,36	0,57
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,20	0,07	0,04			7.656.468,96	10,57
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,19	0,07	1,85			6.847.190,62	9,46
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,06	0,03	1,07			4.707.812,84	6,50
BB PREV IRF-M 1+		2,44	0,01	0,04			563.957,38	0,78
Sub-total	1,92	1,21	0,37		0,05	0,85	36.326.467,16	50,17

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC		0,04	0,00	0,01			1.005.074,30	1,39
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		0,61	0,02	0,63			5.029.696,60	6,95
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,10	0,00	0,09			8.572.369,85	11,84
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,54	0,01	0,54			3.408.222,03	4,71
Sub-total	0,20	0,27	0,04		0,07	0,78	18.015.362,78	24,88

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 6,88%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		10,65	0,29	0,08			2.310.535,88	3,19
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA		10,09	0,10	0,15			844.490,40	1,17
Sub-total	19,16	10,49	0,39		0,13	3,28	3.155.026,28	4,36

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES ENERGIA FI		9,70	0,10	9,70			959.814,20	1,33
BB AÇÕES CONSUMO FIC		14,32	0,18	8,27			1.124.666,93	1,55
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA		10,93	0,19	4,73			1.463.051,62	2,02
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		9,34	0,06	4,16			523.847,20	0,72
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA		6,15	0,19	9,40			3.572.662,28	4,93
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI		11,45	0,13	3,08			886.072,76	1,22
Sub-total	15,19	7,61	0,85		0,14	2,89	8.530.114,99	11,78

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP		1,81	0,00	1,81			173.289,05	0,24
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI		1,91	0,04	1,91			1.504.977,99	2,08
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,48	0,14	5,81			2.367.152,55	3,27
Sub-total	10,76	4,30	0,18		0,28	3,77	4.045.419,59	5,59

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,85%

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	0,00	0,67			881.892,31	1,22
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I		8,39	0,00	14,02			868.553,23	1,20
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS FIC DE FIA - BDR ETF NÍVEL I		6,56	0,02	7,81			578.997,92	0,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	15,13	6,85	0,03		0,15	3,03	2.329.443,46	3,22