



ITACURUBA

 Março/2022

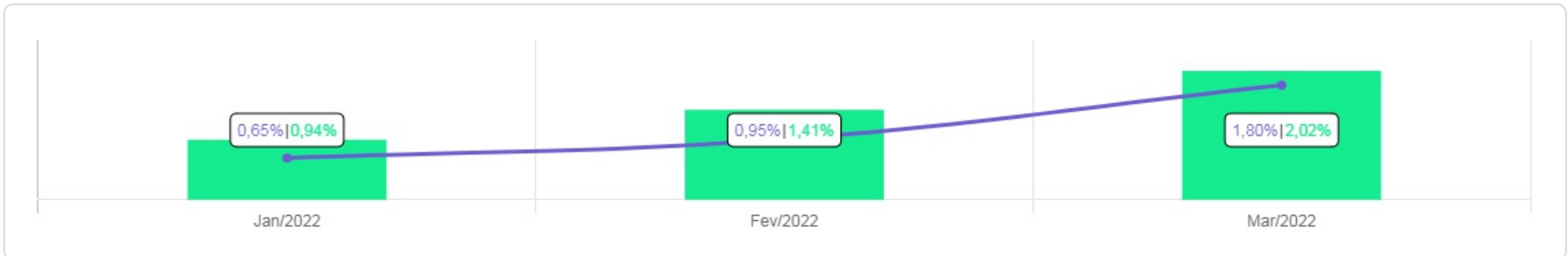


| | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|--|-----|-------|-------|-------|---|-----|-------|-------|-------|--|-----|-------|--------|--------|-------------------------|
| <p>Patrimônio</p> <p>R\$ 18.887.472,04</p> | <p>Rentabilidade</p> <table border="1"> <tr> <td>Mês</td> <td>Acum.</td> </tr> <tr> <td>1,80%</td> <td>3,43%</td> </tr> </table> | Mês | Acum. | 1,80% | 3,43% | <p>Meta</p> <table border="1"> <tr> <td>Mês</td> <td>Acum.</td> </tr> <tr> <td>2,02%</td> <td>4,44%</td> </tr> </table> | Mês | Acum. | 2,02% | 4,44% | <p>Gap</p> <table border="1"> <tr> <td>Mês</td> <td>Acum.</td> </tr> <tr> <td>-0,22%</td> <td>-1,01%</td> </tr> </table> | Mês | Acum. | -0,22% | -1,01% | <p>VaR</p> <p>0,41%</p> |
| Mês | Acum. | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1,80% | 3,43% | | | | | | | | | | | | | | | |
| Mês | Acum. | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2,02% | 4,44% | | | | | | | | | | | | | | | |
| Mês | Acum. | | | | | | | | | | | | | | | |
| -0,22% | -1,01% | | | | | | | | | | | | | | | |





Evolução do Patrimônio

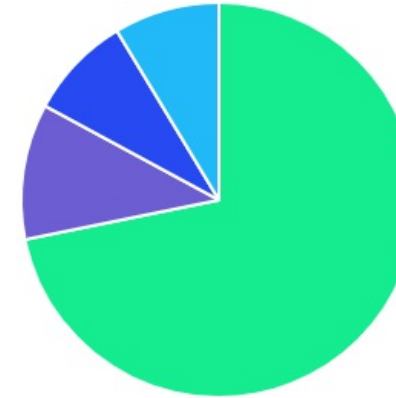







Comparativo (Rentabilidade | Metas)

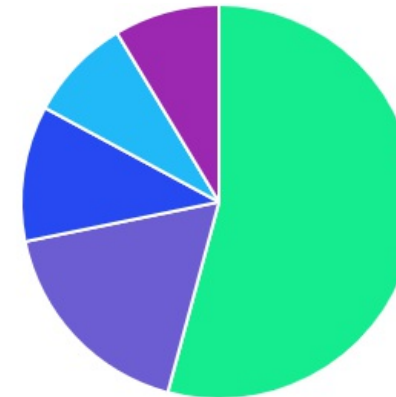


| ATIVO | SALDO | CARTEIRA(%) | RESGATE | RETORNO (R\$) | (%) |
|---|--------------------------|----------------|---------|-----------------------|--------------|
| BB IMA-B 5 FIC RF PREVID LP | R\$ 3.473.716,04 | 18.52% | D+1 | R\$ 87.324,61 | 2,58% |
| BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVID | R\$ 2.012.260,23 | 10.73% | D+0 | R\$ 17.314,05 | 0,87% |
| BB IDKA 2 TP FI RF PREVID | R\$ 3.515.619,06 | 18.74% | D+1 | R\$ 89.632,40 | 2,62% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID | R\$ 1.161.935,68 | 6.19% | D+1 | R\$ 15.391,03 | 1,34% |
| BB PERFIL FIC RF REF DI PREVIDENC | R\$ 3.302.724,60 | 17.61% | D+0 | R\$ 31.520,45 | 0,96% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | R\$ 334.263,87 | 1.78% | D+23 | R\$ 17.553,12 | 5,54% |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVID | R\$ 701.224,44 | 3.74% | D+3 | R\$ 40.290,78 | 6,10% |
| BB MULTISSETORIAL QUANTITATIVO FIC AÇÕES | R\$ 1.050.630,26 | 5.60% | D+3 | R\$ 50.630,26 | 5,06% |
| BB AÇÕES ESG FI AÇÕES - BDR NÍVEL I | R\$ 766.062,78 | 4.08% | D+4 | R\$ -33.937,22 | -4,24% |
| BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | R\$ 822.306,26 | 4.38% | D+2 | R\$ -2.333,27 | -0,28% |
| BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP | R\$ 810.168,26 | 4.32% | D+1 | R\$ 10.168,26 | 1,27% |
| BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS | R\$ 807.599,75 | 4.31% | D+1 | R\$ 7.599,75 | 0,95% |
| Total investimentos | R\$ 18.758.511,23 | 100.00% | | R\$ 331.154,22 | 1,80% |
| Disponibilidade | R\$ 128.960,79 | - | | - | - |
| Total patrimônio | R\$ 18.887.472,02 | 100.00% | | - | - |

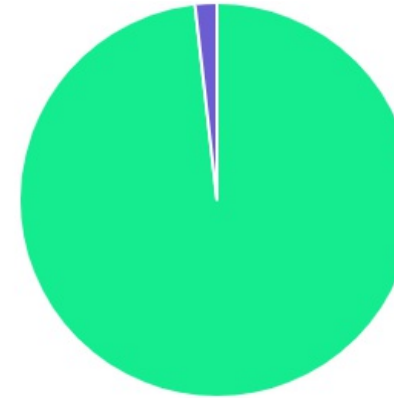
| CLASSE | PERCENTUAL | VALOR | LEG. |
|----------------|----------------|--------------------------|---|
| Renda Fixa | 71,79% | R\$ 13.466.255,61 |  |
| Renda Variável | 11,12% | R\$ 2.086.118,57 |  |
| Exterior | 8,47% | R\$ 1.588.369,04 |  |
| Estruturados | 8,62% | R\$ 1.617.768,01 |  |
| Total | 100,00% | R\$ 18.758.511,23 | |



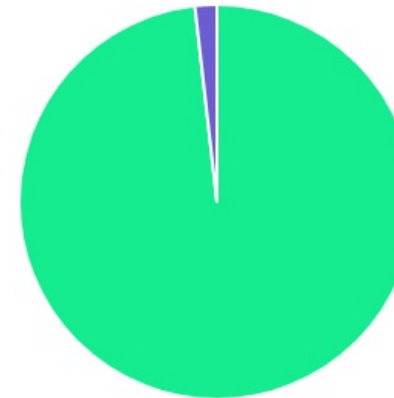
| ENQUADRAMENTO | PERCENTUAL | VALOR | LEG. |
|-------------------------------------|----------------|--------------------------|---|
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 54,18% | R\$ 10.163.531,01 |  |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 17,61% | R\$ 3.302.724,60 |  |
| Artigo 8º, Inciso I | 11,12% | R\$ 2.086.118,57 |  |
| Artigo 9º, Inciso III | 8,47% | R\$ 1.588.369,04 |  |
| Artigo 10º, Inciso I | 8,62% | R\$ 1.617.768,01 |  |
| Total | 100,00% | R\$ 18.758.511,23 | |










| GESTOR | PERCENTUAL | VALOR LEG. |
|--------------------------------|----------------|--------------------------|
| BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A | 98,22% | R\$ 18.424.247,36 |
| ITAU UNIBANCO S.A. | 1,78% | R\$ 334.263,87 |
| Total | 100,00% | R\$ 18.758.511,23 |



| ADMINISTRADOR | PERCENTUAL | VALOR LEG. |
|--------------------------------|----------------|--------------------------|
| BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A | 98,22% | R\$ 18.424.247,36 |
| ITAU UNIBANCO S.A. | 1,78% | R\$ 334.263,87 |
| Total | 100,00% | R\$ 18.758.511,23 |



| BENCHMARK | PERCENTUAL | VALOR | LEG. |
|----------------|----------------|--------------------------|---|
| IMA-B 5 | 18,52% | R\$ 3.473.716,04 |  |
| IRF-M 1 | 10,73% | R\$ 2.012.260,23 |  |
| IDKA IPCA 2A | 18,74% | R\$ 3.515.619,06 |  |
| IMA Geral ex-C | 6,19% | R\$ 1.161.935,68 |  |
| CDI | 26,23% | R\$ 4.920.492,61 |  |
| IBOVESPA | 11,12% | R\$ 2.086.118,57 |  |
| GLOBAL BDRX | 8,47% | R\$ 1.588.369,04 |  |
| Total | 100,00% | R\$ 18.758.511,23 | |



| RENDA FIXA | RESOLUÇÃO(%) | CARTEIRA (R\$) | (%) | POLÍTICA DE INVESTIMENTO | | |
|--|--------------|--------------------------|---------------|--------------------------|---------|-------------|
| | | | | Inferior(%) | Alvo(%) | Superior(%) |
| Títulos Tesouro Nacional – SELIC - 7, I "a" | 100% | R\$ 0,00 | 0.00% | 0,00% | 4,00% | 100,00% |
| FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b" | 100% | R\$ 10.163.531,01 | 54.18% | 40,00% | 50,00% | 100,00% |
| FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN - 7, I "c" | 100% | R\$ 0,00 | 0.00% | 0,00% | 0,00% | 100,00% |
| Operações Compromissadas - 7, II | 5% | R\$ 0,00 | 0.00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| FI Renda Fixa - 7, III "a" | 60% | R\$ 3.302.724,60 | 17.61% | 0,00% | 13,00% | 60,00% |
| FI de Índices Renda Fixa - 7, III "b" | 60% | R\$ 0,00 | 0.00% | 0,00% | 0,00% | 60,00% |
| Ativos Bancários - 7, IV | 20% | R\$ 0,00 | 0.00% | 0,00% | 3,00% | 20,00% |
| FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - 7, V "a" | 5% | R\$ 0,00 | 0.00% | 0,00% | 1,00% | 5,00% |
| FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, V "b" | 5% | R\$ 0,00 | 0.00% | 0,00% | 1,00% | 5,00% |
| FI Debêntures - 7, V "c" | 5% | R\$ 0,00 | 0.00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| Total Renda Fixa | | R\$ 13.466.255,61 | 71,79% | | | |
| RENDA VARIÁVEL | RESOLUÇÃO(%) | CARTEIRA (R\$) | (%) | POLÍTICA DE INVESTIMENTO | | |
| | | | | Inferior(%) | Alvo(%) | Superior(%) |
| FI Ações - 8, I | 30% | R\$ 2.086.118,57 | 11.12% | 0,00% | 8,00% | 30,00% |
| FI de Índices Ações - 8, II | 30% | R\$ 0,00 | 0.00% | 0,00% | 2,00% | 30,00% |
| Total Renda Variável | | R\$ 2.086.118,57 | 11,12% | | | |
| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | RESOLUÇÃO(%) | CARTEIRA (R\$) | (%) | POLÍTICA DE INVESTIMENTO | | |
| | | | | Inferior(%) | Alvo(%) | Superior(%) |
| FI Renda Fixa - Dívida Externa - 9, I | 10% | R\$ 0,00 | 0.00% | 0,00% | 1,00% | 10,00% |
| FI Investimento no Exterior - 9, II | 10% | R\$ 0,00 | 0.00% | 0,00% | 1,00% | 10,00% |

| | | | | | | |
|---------------------------------|-----|------------------|-------|-------|-------|--------|
| FI Ações – BDR Nível I - 9, III | 10% | R\$ 1.588.369,04 | 8,47% | 0,00% | 4,00% | 10,00% |
| Total Investimentos no Exterior | | R\$ 1.588.369,04 | 8,47% | | | |

| FUNDOS ESTRUTURADOS | RESOLUÇÃO(%) | CARTEIRA (R\$) | (%) | POLÍTICA DE INVESTIMENTO | | |
|--|--------------|--------------------------|----------------|--------------------------|---------|-------------|
| | | | | Inferior(%) | Alvo(%) | Superior(%) |
| FI Multimercado - aberto - 10, I | 10% | R\$ 1.617.768,01 | 8.62% | 0,00% | 8,00% | 10,00% |
| FI em Participações - 10, II | 5% | R\$ 0,00 | 0.00% | 0,00% | 1,00% | 5,00% |
| FI "Ações - Mercado de Acesso" - 10, III | 5% | R\$ 0,00 | 0.00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| Total Fundos Estruturados | | R\$ 1.617.768,01 | 8,62% | | | |
| FUNDOS IMOBILIÁRIOS | RESOLUÇÃO(%) | CARTEIRA (R\$) | (%) | POLÍTICA DE INVESTIMENTO | | |
| | | | | Inferior(%) | Alvo(%) | Superior(%) |
| FI Imobiliário - 11 | 5% | R\$ 0,00 | 0.00% | 0,00% | 1,00% | 5,00% |
| Total Fundos Imobiliários | | R\$ 0,00 | 0,00% | | | |
| EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS | RESOLUÇÃO(%) | CARTEIRA (R\$) | (%) | Inferior(%) | Alvo(%) | Superior(%) |
| | | | | | | |
| Empréstimos Consignados - 12 | 5% | R\$ 0,00 | 0.00% | 0,00% | 2,00% | 5,00% |
| Total Empréstimos Consignados | | R\$ 0,00 | 0,00% | | | |
| Total Global | | R\$ 18.758.511,23 | 100,00% | | | |

| PERÍODO | SALDO ANTERIOR | SALDO FINAL | META | RENTABILIDADE | GAP |
|--------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|---------------|----------------|
| 2022 | | | IPCA + 4.9% a.a. | | |
| Janeiro | R\$ 18.010.284,13 | R\$ 18.127.960,87 | 0,94% | 0,65% | -0,29% |
| Fevereiro | R\$ 18.127.960,87 | R\$ 18.292.903,58 | 1,41% | 0,95% | -0,46% |
| Março | R\$ 18.292.903,58 | R\$ 18.758.511,25 | 2,02% | 1,80% | -0,22% |
| Total | R\$ 18.292.903,58 | R\$ 18.758.511,25 | 21,18% | 3,43% | -17,75% |
| 2021 | | | IPCA + 5.42% a.a. | | |
| Janeiro | R\$ 16.926.679,59 | R\$ 17.090.237,68 | 0,69% | -0,61% | -1,31% |
| Fevereiro | R\$ 17.090.237,68 | R\$ 16.911.561,51 | 1,30% | -1,05% | -2,35% |
| Março | R\$ 16.911.561,51 | R\$ 17.063.868,97 | 1,37% | 0,42% | -0,95% |
| Abril | R\$ 17.063.868,97 | R\$ 17.223.584,12 | 0,75% | 0,94% | 0,19% |
| Maiο | R\$ 17.223.584,12 | R\$ 17.580.537,09 | 1,27% | 1,25% | -0,02% |
| Junho | R\$ 17.580.537,09 | R\$ 17.616.855,96 | 0,97% | 0,21% | -0,76% |
| Julho | R\$ 17.616.855,96 | R\$ 17.507.534,40 | 1,40% | -0,62% | -2,02% |
| Agosto | R\$ 17.507.534,40 | R\$ 17.400.273,99 | 1,31% | -0,61% | -1,92% |
| Setembro | R\$ 17.400.273,99 | R\$ 17.290.265,39 | 1,60% | -0,63% | -2,23% |
| Outubro | R\$ 17.290.265,39 | R\$ 16.931.045,99 | 1,69% | -2,08% | -3,77% |
| Novembro | R\$ 16.931.045,99 | R\$ 17.183.881,45 | 1,39% | 1,49% | 0,10% |
| Dezembro | R\$ 17.183.881,45 | R\$ 18.010.284,13 | 1,17% | 0,98% | -0,19% |
| Total | R\$ 17.183.881,45 | R\$ 18.010.284,13 | 16,03% | -0,38% | -16,41% |

| ATIVO | CNPJ | RENTABILIDADE | | | | |
|---|--------------------|---------------|---------|--------------|--------------|------------|
| | | Mês (%) | Ano (%) | 12 meses (%) | 24 meses (%) | Início (%) |
| BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVID | 11.328.882/0001-35 | 0,87% | 1,61% | - | - | 1,60% |
| BB PERFIL FIC RF REF DI PREVIDENC | 13.077.418/0001-49 | 0,96% | 0,96% | - | - | 0,96% |
| BB IDKA 2 TP FI RF PREVID | 13.322.205/0001-35 | 2,62% | 3,74% | - | - | 3,71% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID | 25.078.994/0001-90 | 1,34% | 1,97% | - | - | 1,97% |
| BB IMA-B 5 FIC RF PREVID LP | 03.543.447/0001-03 | 2,58% | 2,97% | - | - | 2,97% |
| BB IMA-B TP FI RF | 07.442.078/0001-05 | - | 0,53% | - | - | - |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVID | 10.418.335/0001-88 | 6,10% | 6,95% | - | - | 6,95% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 24.571.992/0001-75 | 5,54% | 4,26% | - | - | 4,26% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RF PREVID. | 35.292.588/0001-89 | - | 0,67% | - | - | - |
| BB MULTISSETORIAL QUANTITATIVO FIC AÇÕES | 07.882.792/0001-14 | 5,06% | 5,06% | - | - | 5,06% |
| BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVID | 35.292.597/0001-70 | - | 1,00% | - | - | - |
| BB AÇÕES ESG FI AÇÕES - BDR NÍVEL I | 21.470.644/0001-13 | -4,24% | -4,24% | - | - | -4,24% |
| BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 38.236.242/0001-51 | -0,28% | -0,28% | - | - | -0,28% |
| BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS | 06.015.368/0001-00 | 0,95% | 0,95% | - | - | 0,95% |
| BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP | 05.962.491/0001-75 | 1,27% | 1,27% | - | - | 1,27% |
| ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES | 16.718.302/0001-30 | - | - | - | - | - |
| ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES | 42.318.981/0001-60 | - | - | - | - | - |