



BERTIOGA
OUTUBRO 2022



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 31.10.2022.

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

RENTA FIXA **78,86%**

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	7,78	0,70	5,42	111.118.711,59	15,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	2,92	1,91	8,36	10.766.053,01	1,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	10,17	0,33	5,09	11.471.188,10	1,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	9,06	0,41	5,89	8.973.755,04	1,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	2,02	2,26	9,72	23.892.034,89	3,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,540000%)	2,79	0,53	9,27	15.944.581,02	2,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,670000%)	2,83	0,54	8,47	10.547.804,93	1,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	2,85	0,54	9,05	10.598.996,25	1,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,054000%)	4,14	0,57	1,02	10.102.225,77	1,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,305000%)	4,26	0,58	0,68	15.103.876,43	2,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,540000%)	2,76	0,53	9,27	37.212.379,78	5,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,670000%)	2,81	0,54	8,47	21.097.339,69	3,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,720000%)	2,83	0,54	9,04	37.110.459,80	5,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,750000%)	2,85	0,54	4,18	25.323.052,84	3,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,822000%)	2,97	0,55	0,95	6.861.460,37	0,98

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,858000%)	2,95	0,55	0,96	14.712.751,70	2,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,621000%)	0,65	0,53	8,43	10.250.459,77	1,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,690000%)	0,65	0,54	9,01	15.454.141,42	2,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,966000%)	2,97	0,56	0,99	9.811.788,65	1,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,540000%)	0,65	0,53	9,27	20.689.305,15	2,97
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,670000%)	0,65	0,54	8,47	20.517.134,13	2,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730000%)	0,65	0,54	9,05	15.461.122,69	2,22
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		4,28	0,69	6,51	463.020.623,02	66,36

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	6,28	1,07	6,72	16.529.346,52	2,37	734.034.559,46	2,25
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	3,73	1,89	110,27	20.578.231,44	2,95	223.452.229,62	9,21
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,93	1,89	9,75	1.923.336,48	0,28	182.134.006,20	1,06
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,01	2,24	9,55	17.832.638,10	2,56	3.736.730.846,68	0,48
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			57,27	1,76	15,56	56.863.552,54	8,15		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,12	1,03	9,99	30.365.054,18	4,35	5.900.862.114,35	0,51
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,12	1,03	9,92	30.365.054,18	4,35		
Renda Fixa			6,09	0,82	7,96	550.249.229,74	78,86		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

14,03%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	18,82	6,11	9,26	15.438.526,22	2,21	344.176.821,53	4,49
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,09	6,04	14,91	4.118.478,21	0,59	998.009.273,18	0,41
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	18,94	9,46	14,10	5.247.279,32	0,75	52.647.842,90	9,97
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	20,06	6,12	12,79	31.818.658,46	4,56	519.673.528,79	6,12
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	18,71	8,89	3,12	19.006.415,83	2,72	1.146.083.351,86	1,66
WESTERN	BNP PARIBAS	WA ASSET VALUATION FIA	22,36	7,42	11,28	5.079.715,97	0,73	84.480.149,84	6,01
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	24,46	7,78	6,99	17.175.588,16	2,46	1.534.573.593,33	1,12
Sub-total Artigo 8º I			19,86	7,18	8,64	97.884.662,17	14,03		
Renda Variável			20,49	7,18	8,64	97.884.662,17	14,03		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,74%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	21,42	0,98	-25,24	4.248.581,59	0,61	380.417.805,41	1,12
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	38,26	-1,68	-47,14	5.561.454,41	0,80	529.565.364,86	1,05
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,91	3,61	-28,99	7.832.773,43	1,12	1.037.465.638,26	0,75
Sub-total Artigo 9º II			23,86	1,25	-35,22	17.642.809,43	2,53		

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	24,16	1,70	-29,79	4.293.645,02	0,62	2.030.078.847,62	0,21
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	24,28	2,32	-31,47	4.144.182,41	0,59	1.004.133.508,36	0,41
Sub-total Artigo 9º III			23,78	2,00	-30,63	8.437.827,43	1,21		

Investimentos no Exterior			21,98	1,50	-33,80	26.080.636,86	3,74		
---------------------------	--	--	-------	------	--------	---------------	------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,38%

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
KINEA	LIONS TRUST	FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	0,00	0,00	0,00	2.115.600,32	0,30	170.201.832,22	1,24
KINEA	LIONS TRUST	FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	4,26	0,92	9,86	0,00	0,00	170.201.832,22	0,00
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	53,89	0,23	27,79	21.442.080,93	3,07	342.001.196,79	6,27
Sub-total Artigo 10º II			45,39	0,29	23,67	23.557.681,25	3,38		
Investimentos Estruturados			45,39	0,29	23,67	23.557.681,25	3,38		
Total			6,69	1,68	5,72	697.772.210,02	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								Pró-Gestão Nível 2
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	463.020.623,02	66,36	40,00	59,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	56.863.552,54	8,15	5,00	7,90	40,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	30.365.054,18	4,35	0,50	4,60	40,00	0,00	70,00
	Total Renda Fixa	550.249.229,74	78,86					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	97.884.662,17	14,03	0,00	18,00	30,00	0,00	40,00
	Total Renda Variável	97.884.662,17	14,03					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	17.642.809,43	2,53	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	8.437.827,43	1,21	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	26.080.636,86	3,74					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º II	Fundo de Participação	23.557.681,25	3,38	0,00	4,50	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	23.557.681,25	3,38					15,00
Total		697.772.210,02	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,69 67,66	6,51 65,08	1,99 60,41	3,27 50,26	11,14 96,96	3.175.430,22	29.492.812,96
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,76 172,30	15,56 155,53	9,12 276,80	9,96 153,04	19,50 169,66	982.740,98	5.278.607,44
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,03 101,35	9,92 99,22	3,32 100,78	6,54 100,47		313.698,96	3.053.750,79
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	0,40 3,97	0,00 0,00	0,00 0,00		0,00	17.164,80
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	7,18 1,73	8,64 -2,06	13,13 0,65	7,46 -0,10		6.556.010,88	6.842.223,91
Artigo 9º II % do CDI	1,25 122,93	-35,22 -352,12	-7,19 -218,04	-8,00 -122,97	-36,70 -319,32	218.615,77	-9.591.726,20
Artigo 9º III % do CDI	2,00 196,27	-30,63 -306,20	-9,38 -284,54	-5,74 -88,23	-29,10 -253,18	165.713,39	-3.724.899,18
Artigo 10º II % do CDI	0,29 28,80	23,67 236,61	0,98 29,81	-0,07 -1,14		69.062,51	5.929.237,23
BERTIOGA (Total)						11.481.272,71	37.297.171,75

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150523	23.364.382,05	0,00	0,00	0,00	23.892.034,89	527.652,84	2.164.456,80
NTN-B 150535	110.341.453,23	0,00	0,00	0,00	111.118.711,59	777.258,36	5.816.831,82
NTN-B 150545	8.937.237,07	0,00	0,00	0,00	8.973.755,04	36.517,97	507.627,82
NTN-B 150545 (5,540000%)	15.861.118,37	0,00	0,00	0,00	15.944.581,02	83.462,65	1.379.017,07
NTN-B 150545 (5,670000%)	10.491.563,17	0,00	0,00	0,00	10.547.804,93	56.241,76	839.232,48
NTN-B 150545 (5,730000%)	10.542.001,42	0,00	0,00	0,00	10.598.996,25	56.994,83	896.513,12
NTN-B 150545 (6,054000%)	10.045.465,29	0,00	0,00	0,00	10.102.225,77	56.760,48	102.153,87
NTN-B 150545 (6,305000%)	15.016.190,52	0,00	0,00	0,00	15.103.876,43	87.685,91	102.596,16
NTN-B 150555 (5,540000%)	37.017.592,97	0,00	0,00	0,00	37.212.379,78	194.786,81	3.217.829,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,670000%)	20.984.837,12	0,00	0,00	0,00	21.097.339,69	112.502,57	1.678.395,03
NTN-B 150555 (5,720000%)	36.911.191,55	0,00	0,00	0,00	37.110.459,80	199.268,25	3.135.984,93
NTN-B 150555 (5,750000%)	25.186.494,25	0,00	0,00	0,00	25.323.052,84	136.558,59	1.026.220,62
NTN-B 150824	10.564.105,09	0,00	0,00	0,00	10.766.053,01	201.947,92	852.958,82
NTN-B 150826 (5,822000%)	6.824.090,21	0,00	0,00	0,00	6.861.460,37	37.370,16	64.911,75
NTN-B 150832 (5,858000%)	14.632.227,34	0,00	0,00	0,00	14.712.751,70	80.524,36	140.819,59
NTN-B 150840 (5,621000%)	10.196.179,96	0,00	0,00	0,00	10.250.459,77	54.279,81	819.073,26
NTN-B 150840 (5,690000%)	15.371.505,65	0,00	0,00	0,00	15.454.141,42	82.635,77	1.315.380,84
NTN-B 150840 (5,966000%)	9.757.305,49	0,00	0,00	0,00	9.811.788,65	54.483,16	97.170,50
NTN-B 150850	11.433.556,85	0,00	0,00	0,00	11.471.188,10	37.631,25	562.444,82
NTN-B 150850 (5,540000%)	20.580.994,71	0,00	0,00	0,00	20.689.305,15	108.310,44	1.807.011,90
NTN-B 150850 (5,670000%)	20.407.725,96	0,00	0,00	0,00	20.517.134,13	109.408,17	1.645.992,23
NTN-B 150850 (5,730000%)	15.377.974,53	0,00	0,00	0,00	15.461.122,69	83.148,16	1.320.189,79
					463.020.623,02	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IPCA	17.441.503,59	0,00	0,00	0,00	17.832.638,10	391.134,51	1.588.904,44
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1.887.730,47	0,00	0,00	0,00	1.923.336,48	35.606,01	518.064,30
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	20.196.577,05	0,00	0,00	0,00	20.578.231,44	381.654,39	1.589.722,82
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	16.355.000,45	0,00	0,00	0,00	16.529.346,52	174.346,07	1.078.341,81
					56.863.552,54	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	27.944.355,22	4.707.000,00	-2.600.000,00	0,00	30.365.054,18	313.698,96	2.739.386,40
					30.365.054,18	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST ACOES FIC FIA	14.550.166,17	0,00	0,00	0,00	15.438.526,22	888.360,05	1.271.292,52
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	17.454.304,28	0,00	0,00	0,00	19.006.415,83	1.552.111,55	574.874,34
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	15.935.311,22	0,00	0,00	0,00	17.175.588,16	1.240.276,94	58.234,90
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	4.793.992,51	0,00	0,00	0,00	5.247.279,32	453.286,81	679.758,74
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	3.883.736,69	0,00	0,00	0,00	4.118.478,21	234.741,52	534.319,93
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	29.982.436,67	0,00	0,00	0,00	31.818.658,46	1.836.221,79	3.241.705,24
WA ASSET VALUATION FIA	4.728.703,75	0,00	0,00	0,00	5.079.715,97	351.012,22	482.038,24
					97.884.662,17	0,00	0,00

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	4.207.426,01	0,00	0,00	0,00	4.248.581,59	41.155,58	-1.434.491,02
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	5.656.560,07	0,00	0,00	0,00	5.561.454,41	-95.105,66	-4.959.022,65
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	7.560.207,58	0,00	0,00	0,00	7.832.773,43	272.565,85	-3.198.212,53
					17.642.809,43	0,00	0,00

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4.221.748,43	0,00	0,00	0,00	4.293.645,02	71.896,59	-1.821.943,80
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	4.050.365,61	0,00	0,00	0,00	4.144.182,41	93.816,80	-1.902.955,38
					8.437.827,43	0,00	0,00

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	2.119.452,74	0,00	-2.115.600,32	23.292,55	0,00	19.440,13	340.731,79
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	0,00	2.115.600,32	0,00	0,00	2.115.600,32	0,00	0,00
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	21.392.458,55	0,00	0,00	0,00	21.442.080,93	49.622,38	5.588.505,44

Carteira: BERTIOGA

Data Extrato: 31/10/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					23.557.681,25	0,00	0,00

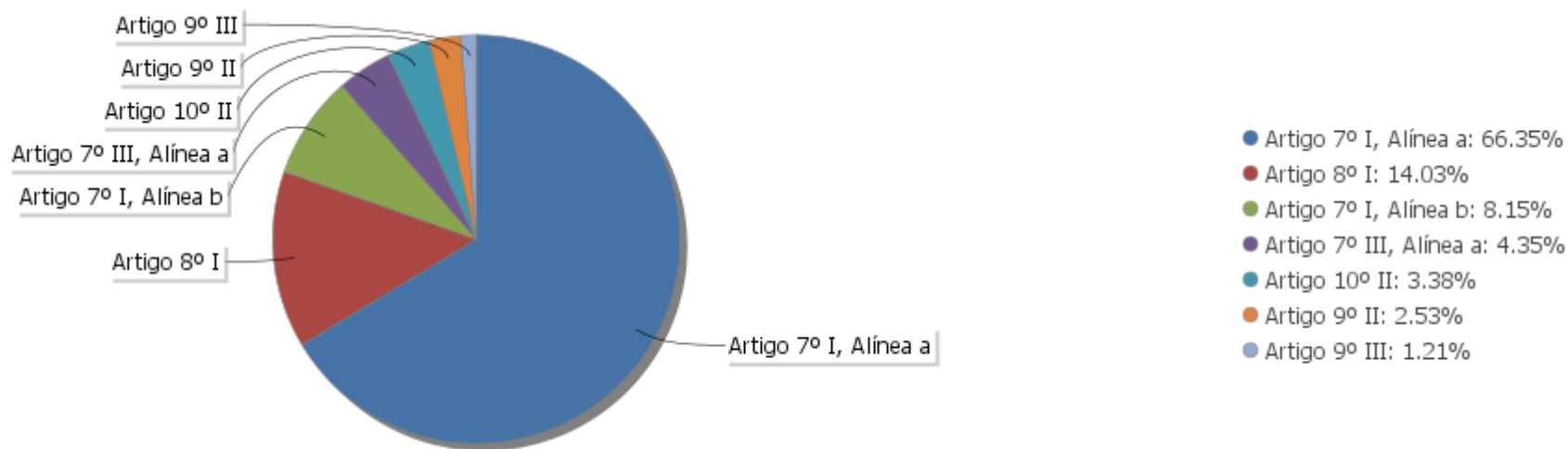
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

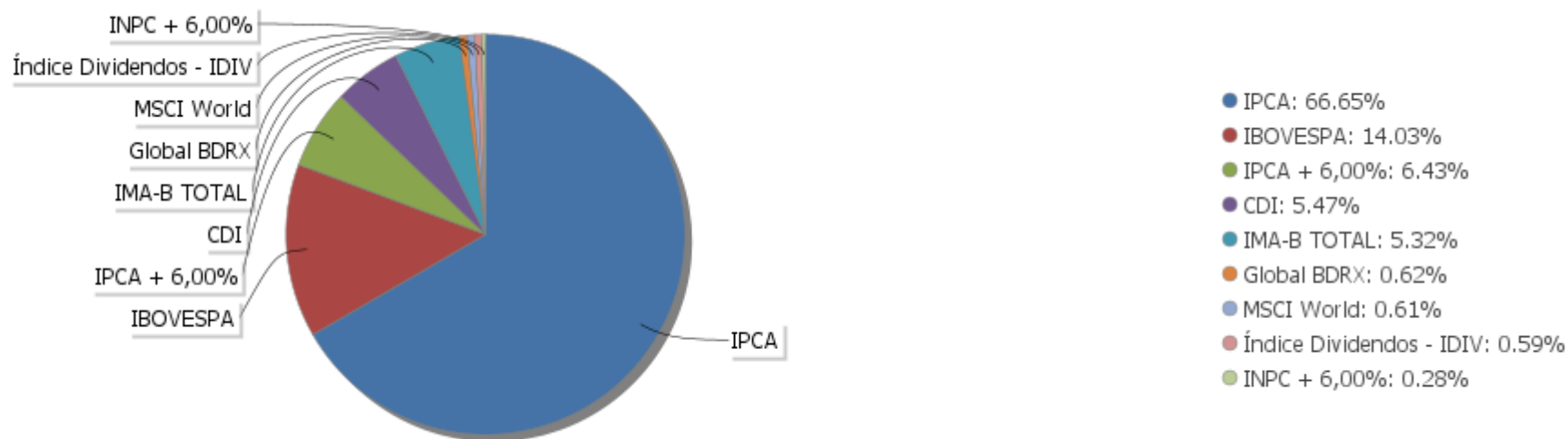
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	135.151.887,16	19,37	135.151.887,16	19,37
de 31 a 365 dias	63.018.739,36	9,03	198.170.626,52	28,40
acima de 365 dias	499.601.583,50	71,60	697.772.210,02	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

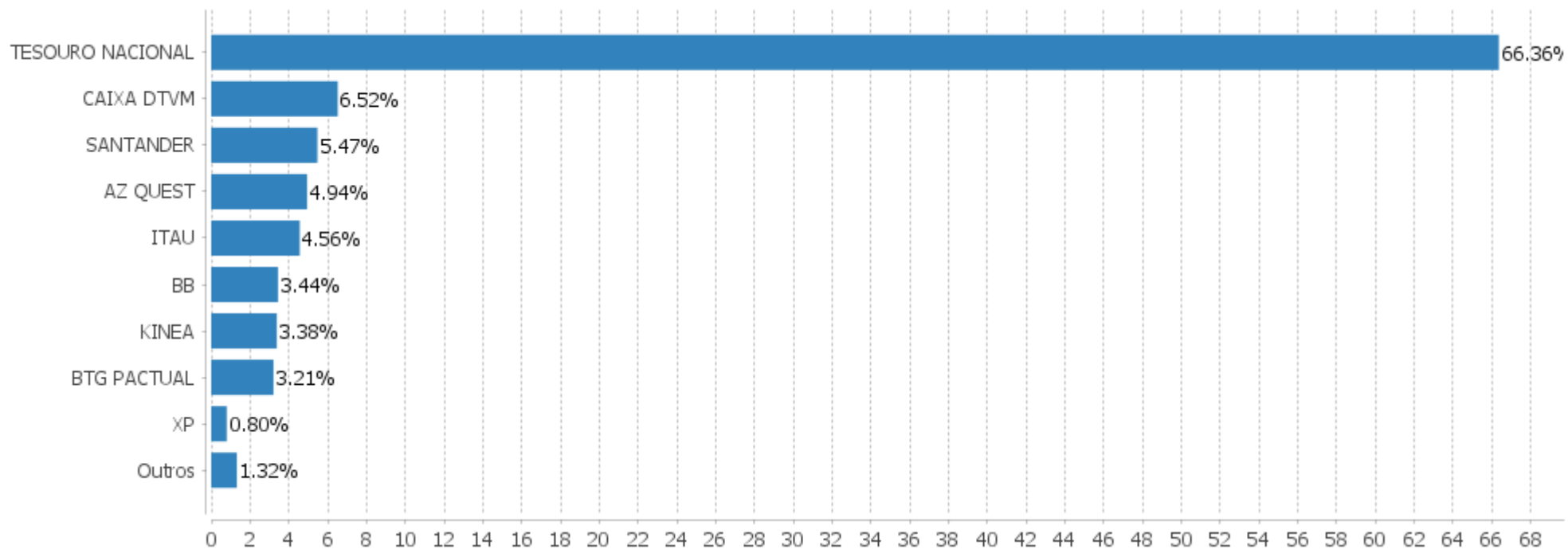


Alocação Por Estratégia



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
2022	0,33	0,74	2,69	-1,28	0,73	-1,39	0,77	1,15	0,23	1,68			5,72
IPCA + 4,99%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,90	1,08	-0,28	0,08	0,12	0,98			9,02
p.p. indexador	-0,62	-0,64	0,64	-2,71	-0,17	-2,46	1,05	1,06	0,11	0,70			-3,30
2021	-0,82	-0,86	0,46	1,08	1,44	0,49	-1,18	-1,50	-1,56	-2,74	0,82	0,65	-3,75
IPCA + 5,46%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,98	1,43	1,34	1,61	1,68	1,38	1,22	16,05
p.p. indexador	-1,49	-2,11	-0,96	0,35	0,17	-0,48	-2,61	-2,84	-3,17	-4,41	-0,56	-0,57	-19,79
2020	0,98	-1,02	-11,57	3,30	2,82	3,36	4,26	-1,37	-1,94	-0,52	3,57	4,22	5,06
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	0,27	-1,68	-12,15	3,15	2,75	2,62	3,37	-2,09	-3,06	-1,87	2,22	2,36	-5,59
2019	4,65	-0,50	0,16	1,38	2,73	3,38	1,58	0,31	1,87	2,49	-0,78	2,81	21,87
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	3,82	-1,39	-1,04	0,32	2,09	2,93	0,86	-0,31	1,42	1,86	-1,76	1,17	11,28
2018	4,47	0,74	0,98	-0,04	-4,30	-1,08	2,86	-1,15	0,17	6,78	0,37	1,36	11,27
IPCA + 6,00%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	3,67	-0,00	0,40	-0,75	-5,19	-2,83	2,02	-1,60	-0,75	5,82	0,11	0,75	1,35
2017	2,46	3,79	0,60	-0,18	-1,48	0,41	6,44	2,39	2,45	-0,71	-1,44	1,85	17,56
IPCA + 6,00%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	1,57	3,04	-0,19	-0,74	-2,30	0,16	5,71	1,67	1,83	-1,62	-2,18	0,95	8,52

Performance Sobre a Meta Atuarial

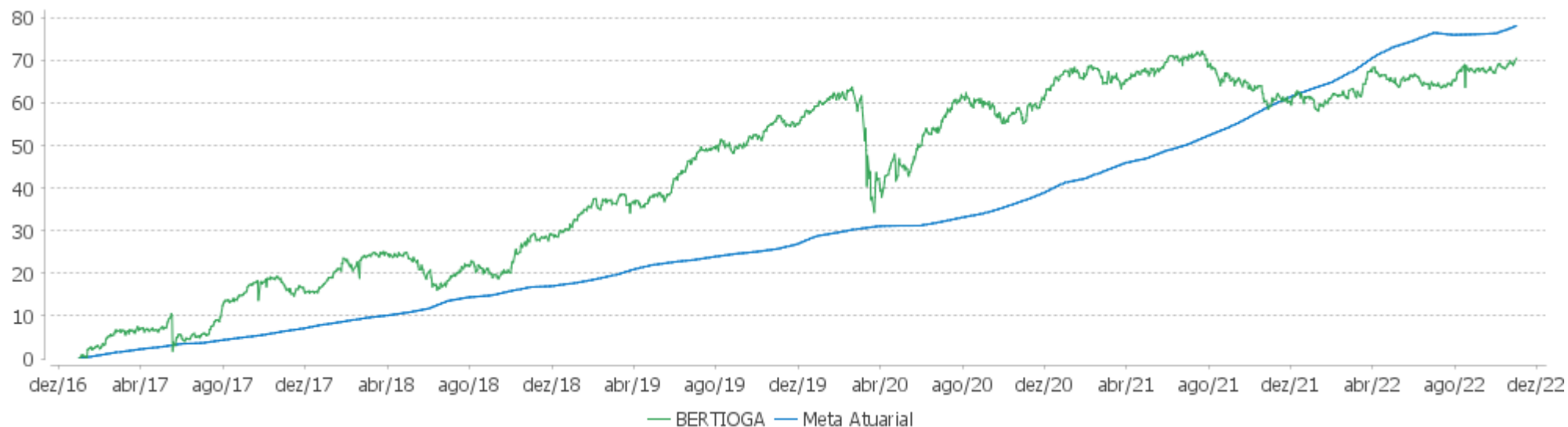
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	35	50,00	03 meses	3,07	1,18	1,89	9,48
Meses abaixo - Meta Atuarial	35	50,00	06 meses	3,18	2,91	0,27	7,41
			12 meses	7,28	11,87	-4,59	6,69
			24 meses	9,83	30,60	-20,77	6,51
			36 meses	9,06	43,67	-34,61	10,15
			48 meses	32,54	56,15	-23,61	9,27
			60 meses	45,53	72,98	-27,46	9,15
			Desde 30/12/2016	70,42	85,56	-15,14	9,70

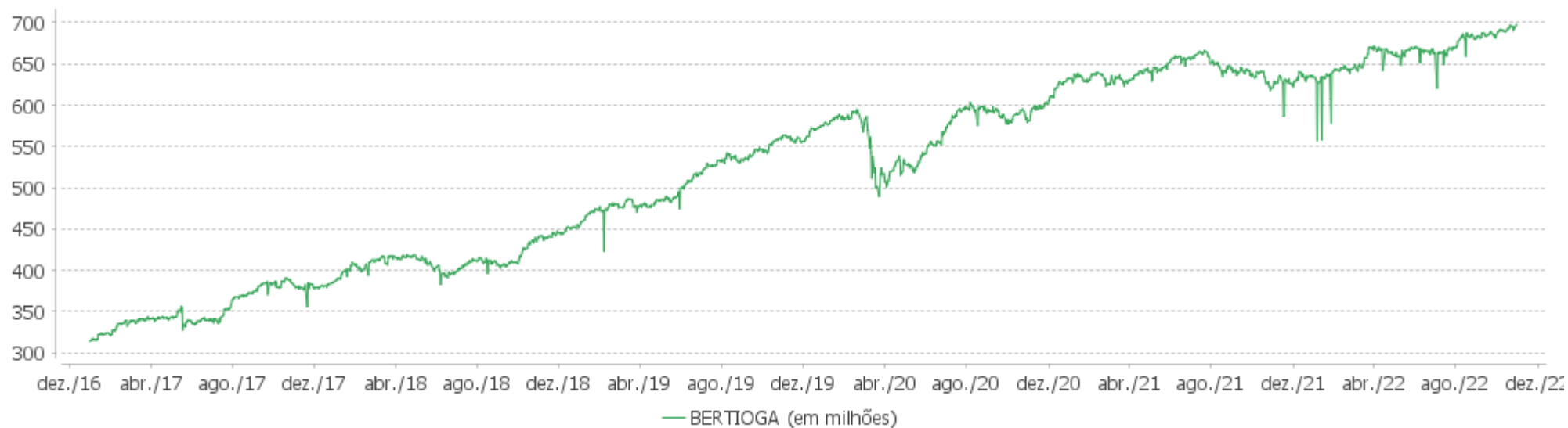
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	6,78	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-11,57	2020-03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

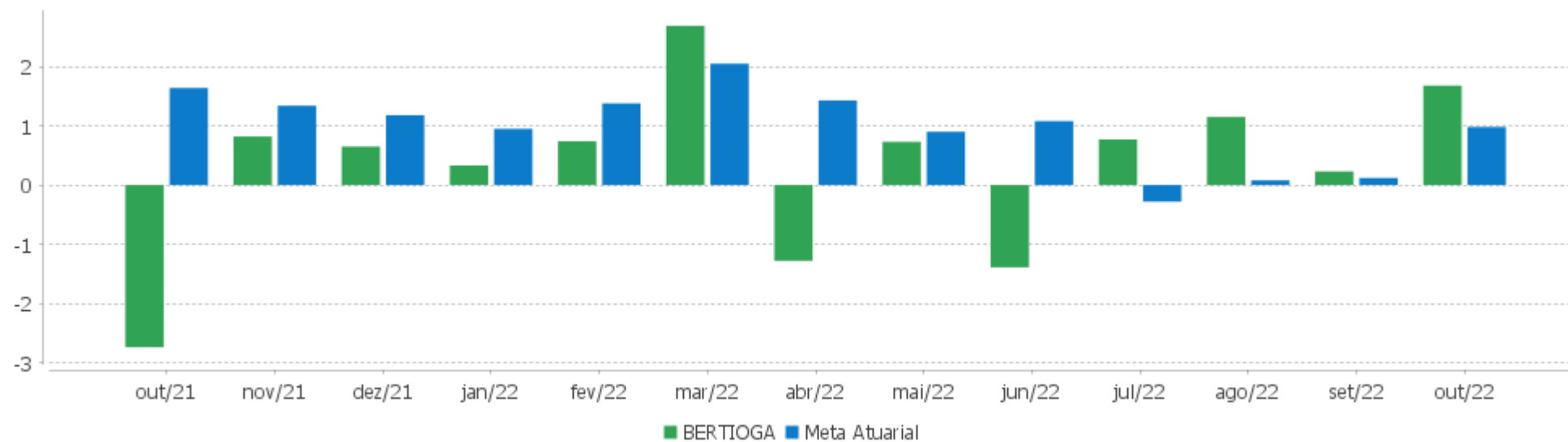


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	0,41 -0,18	5,89 1,19	6,49 6,55	3,93 3,54	9,14 2,67	8,31 -9,52	0,24 -22,21
NTN-B 150824 Var. IPCA p.p.	1,91 1,32	8,36 3,66	2,26 2,33	3,12 2,73	12,29 5,82	16,49 -1,34	22,55 0,10
NTN-B 150840 (5,690000%) Var. IPCA p.p.	0,54 -0,05	9,66 4,96	0,61 0,67	3,56 3,16	12,94 6,47	24,46 6,62	28,69 6,24
NTN-B 150840 (5,966000%) Var. IPCA p.p.	0,56 -0,03	6,76 2,06	0,68 0,74	3,69 3,30	10,00 3,53	21,32 3,49	25,55 3,10
NTN-B 150850 Var. IPCA p.p.	0,33 -0,26	5,09 0,39	7,06 7,13	4,17 3,78	8,93 2,46	6,41 -11,43	-3,91 -26,36
NTN-B 150545 (6,305000%) Var. IPCA p.p.	0,58 -0,01	6,92 2,21	0,76 0,82	0,78 0,39	6,95 0,48	18,05 0,22	22,26 -0,19
NTN-B 150555 (5,720000%) Var. IPCA p.p.	0,54 -0,05	9,69 4,98	0,62 0,68	3,57 3,18	9,86 3,39	21,14 3,31	25,33 2,88
NTN-B 150535 Var. IPCA p.p.	0,70 0,11	5,42 0,72	4,89 4,96	3,09 2,69	10,64 4,17	10,31 -7,53	5,94 -16,51
NTN-B 150850 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	0,54 -0,05	9,64 4,94	0,60 0,67	3,55 3,15	12,91 6,44	24,48 6,65	28,77 6,32
NTN-B 150545 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	0,54 -0,05	9,64 4,94	0,60 0,67	3,55 3,15	9,80 3,33	21,03 3,20	25,17 2,72
NTN-B 150523 Var. IPCA p.p.	2,26 1,67	9,72 5,02	2,23 2,29	3,21 2,81	12,68 6,21	18,65 0,81	25,90 3,45
NTN-B 150545 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	0,53 -0,06	9,53 4,83	0,57 0,64	3,48 3,09	9,72 3,25	20,90 3,07	25,00 2,55
NTN-B 150850 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	0,54 -0,05	9,70 4,99	0,62 0,68	3,58 3,18	12,98 6,51	24,57 6,74	28,87 6,42
NTN-B 150850 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	0,53 -0,06	9,53 4,83	0,57 0,64	3,48 3,09	12,78 6,31	24,30 6,47	28,55 6,10
NTN-B 150555 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	0,54 -0,05	9,64 4,94	0,60 0,67	3,55 3,15	9,83 3,36	21,10 3,26	25,28 2,83
NTN-B 150832 (5,858000%) Var. IPCA p.p.	0,55 -0,04	6,69 1,99	0,65 0,71	3,64 3,25	9,91 3,44	21,14 3,31	25,29 2,84
NTN-B 150826 (5,822000%)	0,55	6,65	0,64	3,62	9,85	21,02	25,09

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	-0,04	1,94	0,70	3,23	3,38	3,18	2,64
NTN-B 150545 (6,054000%)	0,57	6,80	0,70	0,75	6,88	17,92	22,06
Var. IPCA p.p.	-0,02	2,10	0,76	0,35	0,41	0,08	-0,39
NTN-B 150545 (5,730000%)	0,54	9,70	0,62	3,58	9,84	21,09	25,25
Var. IPCA p.p.	-0,05	4,99	0,68	3,18	3,37	3,26	2,80
NTN-B 150555 (5,750000%)	0,54	9,71	0,62	3,59	9,87	21,16	25,37
Var. IPCA p.p.	-0,05	5,01	0,69	3,19	3,40	3,33	2,92
NTN-B 150555 (5,540000%)	0,53	9,53	0,57	3,48	9,75	20,99	25,15
Var. IPCA p.p.	-0,06	4,83	0,64	3,09	3,28	3,15	2,70
NTN-B 150840 (5,621000%)	0,53	9,60	0,59	3,52	12,86	24,35	28,55
Var. IPCA p.p.	-0,06	4,90	0,65	3,13	6,39	6,51	6,10
BB PREV RF IPCA	2,24	9,55	2,18	3,12	12,46	18,19	25,17
Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,19	-0,34	0,76	-0,29	-0,40	-14,14	-20,53
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	1,07	6,72	3,30	3,26	11,70	12,05	11,58
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,17	-0,70	-0,57	-0,31	0,30	-1,39	-0,73
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,89	9,75	2,20	3,72	12,72	19,13	25,05
Var. INPC + 6,00% p.p.	0,95	-0,25	0,87	0,41	-0,13	-13,68	-22,38
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	1,89	8,20	2,26	3,05	12,07	15,97	21,70
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,66	0,77	-1,61	-0,52	0,67	2,53	9,40
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	1,03	9,99	3,32	6,54	11,45	15,15	18,28
% do CDI	101,35	99,88	100,78	100,47	99,67	99,68	96,66
WA ASSET VALUATION FIA	7,42	11,28	13,34	7,13	6,92	-1,01	-9,53
Var. IBOVESPA p.p.	1,97	0,58	0,86	-0,44	-5,19	-24,52	-17,75
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	7,78	6,99	13,61	9,35	-0,87	-16,53	-15,40
Var. IBOVESPA p.p.	2,33	-3,71	1,13	1,78	-12,98	-40,04	-23,63
AZ QUEST ACOES FIC FIA	6,11	9,26	12,85	6,11	6,93	7,23	-6,26
Var. IBOVESPA p.p.	0,65	-1,43	0,37	-1,45	-5,19	-16,28	-14,48
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	6,04	14,91	9,71	6,36	15,89	28,52	15,62
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	2,01	1,30	3,20	2,60	-0,57	-3,98	-2,87
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	8,89	3,12	12,88	3,14	1,30	11,17	4,12
Var. IBOVESPA p.p.	3,44	-7,58	0,40	-4,43	-10,81	-12,34	-4,10
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	6,12	12,79	13,77	10,74	12,55	15,91	5,34
Var. IBOVESPA p.p.	0,67	2,10	1,29	3,18	0,43	-7,60	-2,88
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	9,46	14,10	11,96	7,98	9,97	10,79	-0,27
Var. IBOVESPA p.p.	4,00	3,40	-0,51	0,41	-2,14	-12,72	-8,49
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1,70	-29,79	-9,82	-6,27	-29,23	-5,49	51,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Global BDRX p.p.	0,37	0,07	0,16	0,29	-0,10	-2,53	-3,28
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	2,32	-31,47	-8,91	-5,19	-28,95	-5,65	39,53
Var. IBOVESPA p.p.	-3,14	-42,17	-21,39	-12,76	-41,07	-29,16	31,31
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	0,98	-25,24	-6,17	-5,31	-24,08	4,31	
Var. MSCI World p.p.							
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3,61	-28,99	-5,17	-4,14	-29,80	-7,93	49,11
% do CDI	353,22	-289,87	-157,01	-63,66	-259,33	-52,21	259,71
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-1,68	-47,14	-10,60	-14,70	-49,97	-41,16	
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-2,74	-57,02	-12,03	-18,11	-62,83	-73,50	
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	0,23	27,79	0,82	-0,72	26,21	59,07	109,68
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,82	17,90	-0,60	-4,12	13,36	26,74	63,98
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	0,00	0,00					
Var. IPCA p.p.	0,00	0,00					
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	0,96	9,91	2,63	4,78	9,81	8,37	-11,05
% do CDI	93,84	99,05	79,94	73,36	85,39	55,06	-58,41
BERTIOGA	1,68	5,72	3,07	3,18	7,28	9,83	9,06
Var. IPCA + 4,99% p.p.	0,70	-3,30	1,89	0,27	-4,50	-20,00	-32,54
CDI	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91
IBOVESPA	5,45	10,70	12,48	7,57	12,11	23,51	8,22
INPC + 6,00%	0,94	10,00	1,33	3,32	12,85	32,81	47,43
IPCA + 6,00%	1,06	9,89	1,43	3,41	12,86	32,34	45,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AZ QUEST ACOES FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	Para informações adicionais, vide o Regulamento	2,00
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	-	2,00
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,07
BB PREV RF IPCA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)		3,00
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,50
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	Não se aplica	Não se aplica				
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II						
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	D+1 du	D+0	D+2 du	D+4 du		1,50
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	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		0,80
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+8 du		1,00
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
WA ASSET VALUATION FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,50

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	1,00	9,68	3,38	6,44	11,52	13,50	18,11	26,53	35,47
IRF-M 1+	0,92	7,22	5,18	6,95	12,08	5,46	10,35	30,15	43,64
IRF-M TOTAL	0,93	7,95	4,44	6,64	11,95	8,26	13,06	29,67	41,90
IMA-B 5	1,91	9,12	2,35	3,50	12,73	17,73	24,45	41,60	54,77
IMA-B 5+	0,65	5,79	5,62	3,73	10,15	9,03	2,65	40,63	55,93
IMA-B TOTAL	1,23	7,43	3,86	3,57	11,40	13,44	12,30	42,33	56,98
IMA-GERAL TOTAL	1,01	8,88	3,72	5,61	11,80	12,98	15,99	33,17	45,02
IDKA 2	1,78	8,84	2,04	3,22	12,50	17,69	25,62	40,76	54,48
IDKA 20	-0,33	3,63	10,36	4,51	7,43	2,00	-11,54	37,24	53,99
CDI	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91	26,30	34,57

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,45	10,70	12,48	7,57	12,11	23,51	8,22	32,73	56,16
IBRX 100	5,57	10,25	12,01	6,76	11,78	23,41	9,78	37,01	60,34
IBRX 50	5,32	10,92	12,53	7,34	13,01	26,17	10,50	32,80	56,33
SMALL CAP	7,30	-1,35	16,81	0,91	0,06	3,68	-2,72	39,01	46,73
IFIX	0,02	6,66	6,30	6,34	11,80	8,12	7,14	33,40	34,37
Índice Consumo - ICON	6,28		12,02	1,65	-14,96	-22,29	-23,79	10,51	-0,91
Índice Dividendos - IDIV	4,03	13,61	6,51	3,76	16,46	32,51	18,49	64,97	73,53

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	0,59	4,70	-0,06	0,39	6,47	17,83	22,45	25,55	31,28
INPC	0,47	4,81	-0,16	0,30	6,46	18,26	23,90	27,06	32,15
IGPM	-0,97	5,58	-2,59	-1,31	6,52	29,66	56,80	61,74	79,20
SELIC	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91	26,30	34,58

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	5,00	-23,47	-5,01	0,15	-21,68	7,85	67,36	101,91	141,21
MSCI ACWI	3,03	-26,82	-6,84	-4,13	-26,70	-3,07	44,06	71,11	89,42

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,90	8,17	0,94	2,41	10,73	27,41	37,65	46,79	59,57
IPCA + 5,00%	0,98	9,03	1,18	2,91	11,79	29,86	41,64	52,49	67,35
IPCA + 5,50%	1,02	9,46	1,31	3,16	12,33	31,10	43,66	55,41	71,35
IPCA + 5,89%	1,05	9,79	1,40	3,35	12,74	32,06	45,25	57,71	74,53
IPCA + 6,00%	1,06	9,89	1,43	3,41	12,86	32,34	45,71	58,36	75,43
INPC + 4,00%	0,78	8,27	0,84	2,32	10,72	27,87	39,28	48,55	60,63
INPC + 6,00%	0,94	10,00	1,33	3,32	12,85	32,81	47,43	60,26	76,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
265	04/10/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	120.000,00	0,00	3.710,23233900	32,3429880000
266	07/10/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	3.100.000,00	0,00	95.701,09064700	32,3925253000
267	24/10/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	1.324.000,00	0,00	40.662,17829200	32,5609708000
269	26/10/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.274.638,70	39.106,00508300	32,5944493000
270	26/10/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.325.361,30	40.662,17829200	32,5944493000
271	31/10/2022	FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	2.115.600,32	0,00	8.869,15490100	238,5346007700
272	31/10/2022	FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	0,00	2.115.600,32	8.869,15488642	238,5346007700
268	31/10/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	163.000,00	0,00	4.993,19825400	32,6444078000
Total			6.822.600,32	4.715.600,32		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 13.244.043,46

Value-At-Risk: 1,90%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BERTIOGA		1,90	1,90			697.772.210,02	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,15%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535		4,03	0,47	4,04			111.118.711,59	15,92
NTN-B 150824		1,53	0,01	1,51			10.766.053,01	1,54
NTN-B 150850		5,44	0,07	5,45			11.471.188,10	1,64
NTN-B 150545		4,92	0,05	4,92			8.973.755,04	1,29
NTN-B 150523		0,79	0,01	0,75			23.892.034,89	3,42
NTN-B 150545 (5,540000%)		0,18	-0,00	0,19			15.944.581,02	2,29
NTN-B 150545 (5,670000%)		0,18	-0,00	0,19			10.547.804,93	1,51
NTN-B 150545 (5,730000%)		0,18	-0,00	0,19			10.598.996,25	1,52
NTN-B 150545 (6,054000%)		0,18	-0,00	0,19			10.102.225,77	1,45
NTN-B 150545 (6,305000%)		0,18	-0,00	0,19			15.103.876,43	2,16
NTN-B 150555 (5,540000%)		0,18	-0,00	0,19			37.212.379,78	5,33
NTN-B 150555 (5,670000%)		0,18	-0,00	0,19			21.097.339,69	3,02
NTN-B 150555 (5,720000%)		0,18	-0,00	0,19			37.110.459,80	5,32
NTN-B 150555 (5,750000%)		0,18	-0,00	0,19			25.323.052,84	3,63
NTN-B 150826 (5,822000%)		0,18	-0,00	0,19			6.861.460,37	0,98
NTN-B 150832 (5,858000%)		0,18	-0,00	0,19			14.712.751,70	2,11
NTN-B 150840 (5,621000%)		0,18	-0,00	0,19			10.250.459,77	1,47
NTN-B 150840 (5,690000%)		0,18	-0,00	0,19			15.454.141,42	2,21
NTN-B 150840 (5,966000%)		0,18	-0,00	0,19			9.811.788,65	1,41
NTN-B 150850 (5,540000%)		0,18	-0,00	0,19			20.689.305,15	2,97

Carteira: BERTIOGA

Data Extrato: 31/10/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150850 (5,670000%)		0,18	-0,00	0,19			20.517.134,13	2,94
NTN-B 150850 (5,730000%)		0,18	-0,00	0,19			15.461.122,69	2,22
Sub-total	1,38	1,22	0,59		-0,24	0,69	463.020.623,02	66,36

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF		2,91	0,05	0,81			16.529.346,52	2,37
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..		1,54	0,02	2,06			20.578.231,44	2,95
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI		1,16	0,00	1,15			1.923.336,48	0,28
BB PREV RF IPCA		0,79	0,00	0,75			17.832.638,10	2,56
Sub-total	1,65	1,35	0,08		0,45	1,76	56.863.552,54	8,15

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI		0,01	-0,00	0,01			30.365.054,18	4,35
Sub-total	0,01	0,01	-0,00		1,57	1,03	30.365.054,18	4,35

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,81%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST ACOES FIC FIA		9,88	0,19	2,41			15.438.526,22	2,21
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		8,97	0,04	1,82			4.118.478,21	0,59
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES		9,23	0,06	4,60			5.247.279,32	0,75
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		10,50	0,41	1,64			31.818.658,46	4,56
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,80	0,21	4,90			19.006.415,83	2,72
WA ASSET VALUATION FIA		11,41	0,07	2,98			5.079.715,97	0,73
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		10,92	0,24	5,83			17.175.588,16	2,46
Sub-total	29,00	9,81	1,23		0,21	7,18	97.884.662,17	14,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 11,68%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI		10,53	-0,01	10,53			4.248.581,59	0,61
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		20,55	0,01	20,56			5.561.454,41	0,80
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		10,26	-0,01	10,26			7.832.773,43	1,12
Sub-total	34,66	12,58	-0,02		0,01	1,25	17.642.809,43	2,53

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		13,73	0,01	2,44			4.293.645,02	0,62
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		11,18	0,01	15,42			4.144.182,41	0,59
Sub-total	32,52	12,30	0,02		0,03	2,00	8.437.827,43	1,21

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,03%

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II		0,00	0,00	0,16			2.115.600,32	0,30
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME		0,04	0,00	0,17			21.442.080,93	3,07
Sub-total	0,76	0,03	0,00		-0,96	0,29	23.557.681,25	3,38