



CARAGUATATUBA
FEVEREIRO 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 25.02.2022.

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 **67,71%**

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 150523 (5,900000%)	4,12	1,13	2,30	38.987.047,30	7,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,560000%)	3,97	0,77	0,77	15.799.934,81	2,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,710000%)	3,98	0,38	0,38	30.124.306,66	5,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	4,00	0,17	0,17	10.014.114,58	1,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,781000%)	4,01	0,00	0,00	9.996.671,18	1,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822 (6,090000%)	2,94	1,15	2,32	15.336.391,58	2,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822 (6,920000%)	2,96	0,83	0,83	3.820.367,55	0,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,708000%)	4,05	0,00	0,00	9.997.454,66	1,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,650000%)	2,83	0,69	0,69	850.165,72	0,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,770000%)	4,03	0,00	0,00	9.998.289,94	1,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,713000%)	3,97	0,46	0,46	10.044.220,86	1,83
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,27	1,13	2,30	154.968.964,84	28,25

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	3,55	0,57	0,44	0,00	0,00	4.398.251.592,64	0,00
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,70	0,76	1,40	365.828,45	0,07	159.545.310,04	0,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,59	0,42	-0,33	0,00	0,00	239.259.525,29	0,00
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,70	0,74	1,36	14.118.065,59	2,57	5.025.689.167,39	0,28
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,63	0,33	-0,44	0,00	0,00	6.297.272.158,07	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,61	0,42	-0,34	0,00	0,00	4.318.650.723,31	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,81	-0,02	-1,65	21.422.988,84	3,91	936.801.809,27	2,29
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,74	1,05	1,15	4.581.371,19	0,84	1.207.319.730,40	0,38
ITAU	ITAU	ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	8,81	0,60	-1,04	0,00	0,00	198.360.674,63	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,75	0,02	-1,60	34.502.731,44	6,29	1.307.933.038,85	2,64
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	5,10	0,45	-0,09	32.646.470,93	5,95	912.609.648,90	3,58
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,75	1,15	1,17	11.875.371,09	2,17	10.680.932.817,60	0,11
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,55	0,38	0,31	0,00	0,00	962.262.156,33	0,00
BB	BB	BB PREV RF VII	1,65	1,13	1,70	472.603,84	0,09	245.088.375,73	0,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,15	0,93	1,46	2.484.966,18	0,45	2.413.852.979,92	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,24	0,81	1,48	39.437.385,28	7,19	10.665.837.627,38	0,37
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,85	0,50	0,00	161.907.782,83	29,52		

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
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,21	0,98	1,82	3.589.728,98	0,65	1.885.212.416,73	0,19
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,16	0,76	-0,34	25.631.776,90	4,67	439.852.043,31	5,83
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,22	0,82	1,61	24.361.057,52	4,44	10.660.917.138,14	0,23
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			2,47	0,80	0,45	53.582.563,40	9,77		

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	11,32	-0,34	-0,07	930.174,53	0,17	40.395.435,01	2,30
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			11,32	-0,34	-0,07	930.174,53	0,17		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

4,31

0,70

0,46

371.389.485,60

67,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

16,21%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	20,05	-1,95	4,70	5.182.774,86	0,94	473.420.430,45	1,09
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	18,20	-0,23	7,21	1.449.088,52	0,26	701.897.950,08	0,21
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	22,76	-1,44	2,47	6.211.874,51	1,13	1.330.917.641,81	0,47
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	19,42	0,96	7,60	15.044.966,51	2,74	614.965.214,36	2,45
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	19,24	0,80	7,55	24.325.362,29	4,43	1.039.411.814,62	2,34
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	19,48	0,97	10,53	7.475.937,54	1,36	739.508.223,24	1,01
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,33	-0,71	8,04	13.425.273,64	2,45	985.463.082,71	1,36
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	17,41	-1,21	0,11	5.793.690,60	1,06	2.516.394.706,99	0,23
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	25,05	1,17	6,89	9.979.352,81	1,82	316.535.744,51	3,15
Sub-total Artigo 8º I			16,70	0,18	6,74	88.888.321,28	16,21		
Renda Variável			16,44	0,18	6,74	88.888.321,28	16,21		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,73%

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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16,47	-5,29	-17,18	1.324.616,43	0,24	1.637.204.903,14	0,08
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	14,61	-2,25	-7,44	1.545.137,53	0,28	851.927.966,47	0,18
Sub-total Artigo 9º II			15,17	-3,68	-12,20	2.869.753,96	0,52		

Artigo 9º III (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	18,56	-7,12	-16,17	39.529.471,10	7,21	2.975.370.153,41	1,33
Sub-total Artigo 9º III			18,56	-7,12	-16,17	39.529.471,10	7,21		
Investimentos no Exterior			18,29	-6,89	-15,91	42.399.225,06	7,73		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

8,36%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	14,37	-2,18	-7,36	45.837.036,67	8,36	2.075.819.919,23	2,21
Sub-total Artigo 10º I			14,37	-2,18	-7,36	45.837.036,67	8,36		
Investimentos Estruturados			19,79	-2,18	-7,36	45.837.036,67	8,36		
Total			5,69	-0,27	-0,80	548.514.068,61	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								Pró-Gestão Nível 1
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	154.968.964,84	28,25	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	161.907.782,83	29,52	10,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	53.582.563,40	9,77	3,00	14,25	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	930.174,53	0,17	0,00	0,25	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	371.389.485,60	67,71					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	88.888.321,28	16,21	0,00	5,50	35,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	88.888.321,28	16,21					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	2.869.753,96	0,52	0,00	2,96	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	39.529.471,10	7,21	0,00	7,04	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	42.399.225,06	7,73					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	45.837.036,67	8,36	0,00	9,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	45.837.036,67	8,36					15,00

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	1,13 150,89	2,30 154,55				946.724,20	1.564.948,72
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,50 66,52	0,00 0,25	0,64 28,27	0,43 11,24	-0,29 -5,10	1.202.028,61	-125.676,06
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,80 106,88	0,45 30,24				399.418,04	266.639,77
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,34 -45,32	-0,07 -4,72				-3.170,93	-652,84
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	0,18 -0,71	6,74 -1,20				160.777,22	5.612.503,78
Artigo 9º II % do CDI	-3,68 -490,64	-12,20 -820,57	-9,36 -413,63			-109.570,75	-398.931,36
Artigo 9º III % do CDI	-7,12 -949,45	-16,17 -1.087,12	-14,74 -651,65	-6,50 -170,69	-0,12 -2,15	-3.028.796,87	-7.624.433,79
Artigo 10º I % do CDI	-2,18 -291,32	-7,36 -494,51				-1.023.289,01	-3.638.973,29
CARAGUATATUBA (Total)						-1.455.879,49	-4.344.575,07

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 (5,900000%)	38.550.732,30	0,00	0,00	0,00	38.987.047,30	436.315,00	874.702,56
NTN-B 150535 (5,560000%)	0,00	15.679.053,04	0,00	0,00	15.799.934,81	120.881,77	120.881,77
NTN-B 150545 (5,710000%)	0,00	30.010.566,72	0,00	0,00	30.124.306,66	113.739,94	113.739,94
NTN-B 150545 (5,760000%)	0,00	9.997.615,52	0,00	0,00	10.014.114,58	16.499,06	16.499,06
NTN-B 150545 (5,781000%)	0,00	9.996.671,18	0,00	0,00	9.996.671,18	0,00	0,00
NTN-B 150822 (6,090000%)	15.610.946,54	0,00	0,00	450.641,91	15.336.391,58	176.086,95	355.923,91
NTN-B 150822 (6,920000%)	0,00	3.901.262,75	0,00	112.660,48	3.820.367,55	31.765,28	31.765,28
NTN-B 150830 (5,708000%)	0,00	9.997.454,66	0,00	0,00	9.997.454,66	0,00	0,00
NTN-B 150840 (5,650000%)	0,00	868.334,25	0,00	23.996,68	850.165,72	5.828,15	5.828,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150840 (5,770000%)	0,00	9.998.289,94	0,00	0,00	9.998.289,94	0,00	0,00
NTN-B 150850 (5,713000%)	0,00	9.998.612,81	0,00	0,00	10.044.220,86	45.608,05	45.608,05
					154.968.964,84	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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	16.240.381,13	0,00	-16.293.292,20	0,00	0,00	52.911,07	-72.761,79
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	21.427.462,99	0,00	0,00	0,00	21.422.988,84	-4.474,15	-359.077,12
BB PREV RF IRF-M	16.103.617,90	0,00	-16.182.782,80	0,00	0,00	79.164,90	58.642,62
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	12.543.312,61	1.479.179,36	0,00	0,00	14.118.065,59	95.573,62	166.772,62
BB PREV RF VII	480.990,20	0,00	-13.725,13	0,00	472.603,84	5.338,77	8.037,86
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11.740.792,19	0,00	0,00	0,00	11.875.371,09	134.578,90	136.787,25
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	34.495.437,07	0,00	0,00	0,00	34.502.731,44	7.294,37	-560.179,16
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	45.189.679,65	0,00	-45.357.484,59	0,00	0,00	167.804,94	-176.953,21
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	32.500.181,54	0,00	0,00	0,00	32.646.470,93	146.289,39	-29.188,58
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.885.923,29	0,00	-4.904.460,44	0,00	0,00	18.537,15	15.026,68
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	43.737.750,46	0,00	-4.652.779,52	0,00	39.437.385,28	352.414,34	676.707,52
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2.462.104,79	0,00	0,00	0,00	2.484.966,18	22.861,39	35.655,72
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	11.615.009,72	0,00	-11.663.723,85	0,00	0,00	48.714,13	-38.580,96
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	4.131.859,31	0,00	-4.156.630,06	0,00	0,00	24.770,75	-43.500,99
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	362.040,06	1.028,70	0,00	0,00	365.828,45	2.759,69	5.045,50
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	4.533.881,84	0,00	0,00	0,00	4.581.371,19	47.489,35	51.889,98
					161.907.782,83	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\$)
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	19.919.934,27	8.116.653,11	-3.847.257,44	0,00	24.361.057,52	171.727,58	291.087,38
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	3.525.749,93	29.230,27	0,00	0,00	3.589.728,98	34.748,78	63.740,33
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	25.438.835,22	0,00	0,00	0,00	25.631.776,90	192.941,68	-88.187,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					53.582.563,40	0,00	0,00

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC ITALIA SENIOR	933.345,46	0,00	0,00	0,00	930.174,53	-3.170,93	-652,84
					930.174,53	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1.452.396,82	0,00	0,00	0,00	1.449.088,52	-3.308,30	97.510,59
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	24.131.851,28	0,00	0,00	0,00	24.325.362,29	193.511,01	1.708.013,42
BRADESCO F I A SELECTION	5.285.583,75	0,00	0,00	0,00	5.182.774,86	-102.808,89	232.599,16
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	6.302.433,11	0,00	0,00	0,00	6.211.874,51	-90.558,60	149.633,80
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	7.404.373,93	0,00	0,00	0,00	7.475.937,54	71.563,61	712.512,80
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	13.520.648,73	0,00	0,00	0,00	13.425.273,64	-95.375,09	999.568,19
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	5.864.753,85	0,00	0,00	0,00	5.793.690,60	-71.063,25	6.590,85
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	14.901.691,05	0,00	0,00	0,00	15.044.966,51	143.275,46	1.062.694,76
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	9.863.811,54	0,00	0,00	0,00	9.979.352,81	115.541,27	643.380,21
					88.888.321,28	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\$)
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.398.600,60	0,00	0,00	0,00	1.324.616,43	-73.984,17	-274.813,64
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	1.580.724,11	0,00	0,00	0,00	1.545.137,53	-35.586,58	-124.117,72
					2.869.753,96	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	42.558.267,97	0,00	0,00	0,00	39.529.471,10	-3.028.796,87	-7.624.433,79
					39.529.471,10	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	46.860.325,68	0,00	0,00	0,00	45.837.036,67	-1.023.289,01	-3.638.973,29
					45.837.036,67	0,00	0,00

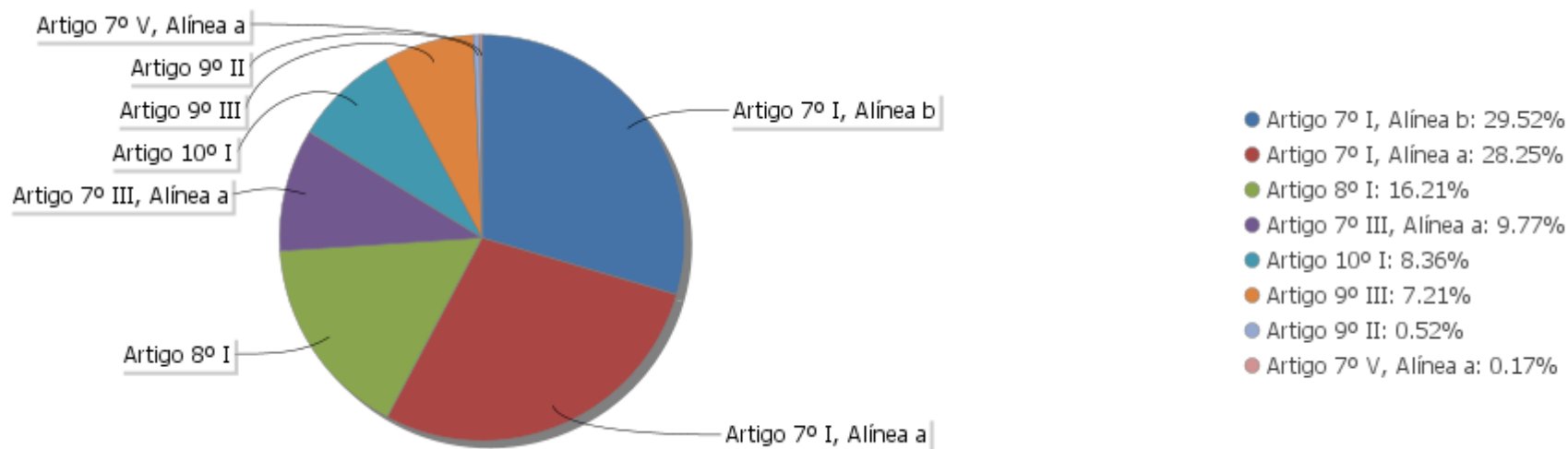
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

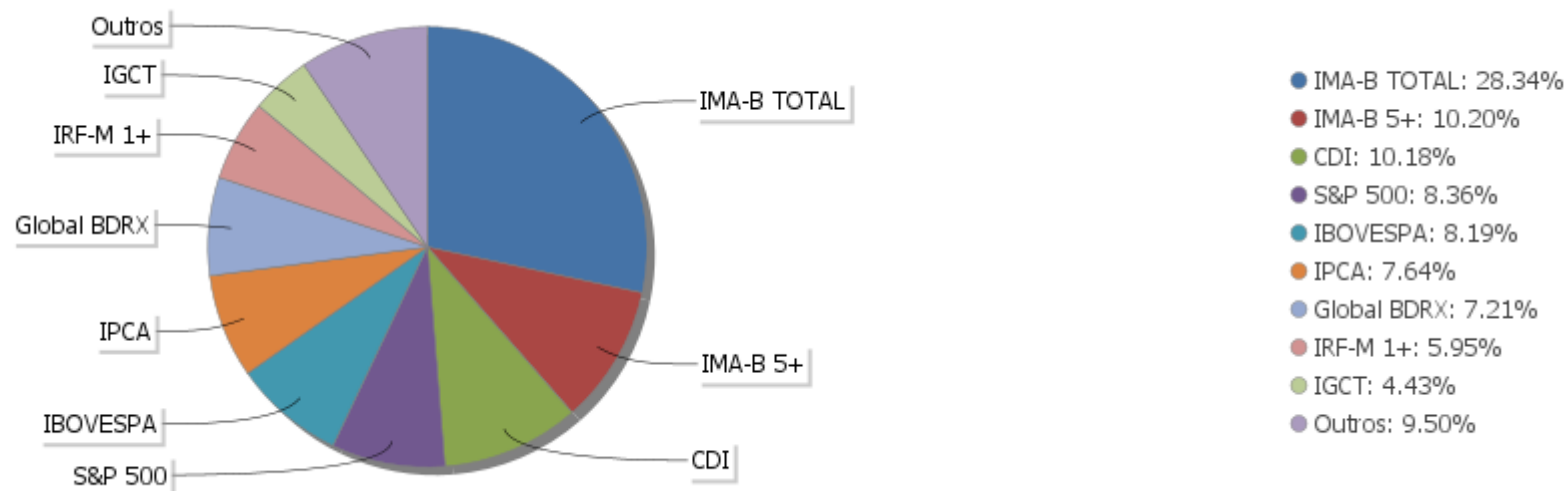
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	365.447.423,62	66,62	365.447.423,62	66,62
de 31 a 365 dias	47.254.439,28	8,61	412.701.862,90	75,24
acima de 365 dias	135.812.205,71	24,76	548.514.068,61	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

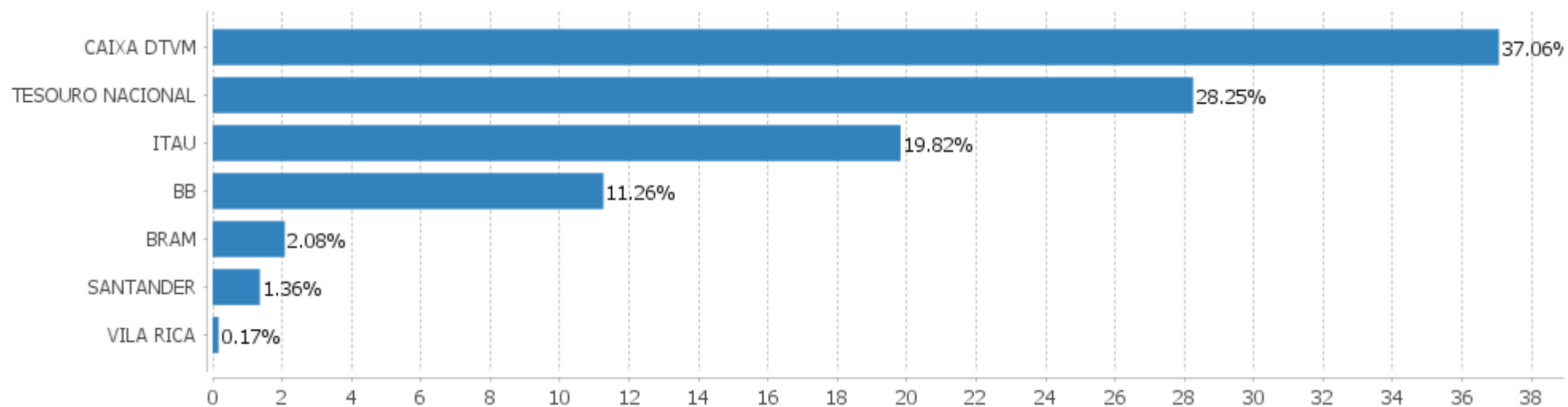


Alocação Por Estratégia



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	-0,53	-0,27											-0,80
IPCA + 5,46%	0,99	1,42											2,42
p.p. indexador	-1,52	-1,69											-3,22
2021	-0,94	-1,45	0,38	1,02	1,49	0,37	-0,80	-0,98	-1,64	-1,55	1,37	1,32	-1,47
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	-1,61	-2,69	-1,04	0,29	0,21	-0,60	-2,23	-2,32	-3,25	-3,23	-0,00	0,10	-17,51
2020	0,26	-1,20	-8,82	2,26	2,04	2,60	3,94	-1,32	-1,68	-0,06	3,29	4,43	5,12
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	-0,45	-1,86	-9,40	2,11	1,97	1,86	3,06	-2,04	-2,80	-1,40	1,94	2,58	-5,52
2019	1,51	0,37	0,41	0,94	1,99	2,58	1,16	0,11	1,85	2,11	-0,78	2,17	15,34
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	0,68	-0,53	-0,78	-0,12	1,35	2,13	0,44	-0,51	1,40	1,47	-1,75	0,52	4,75

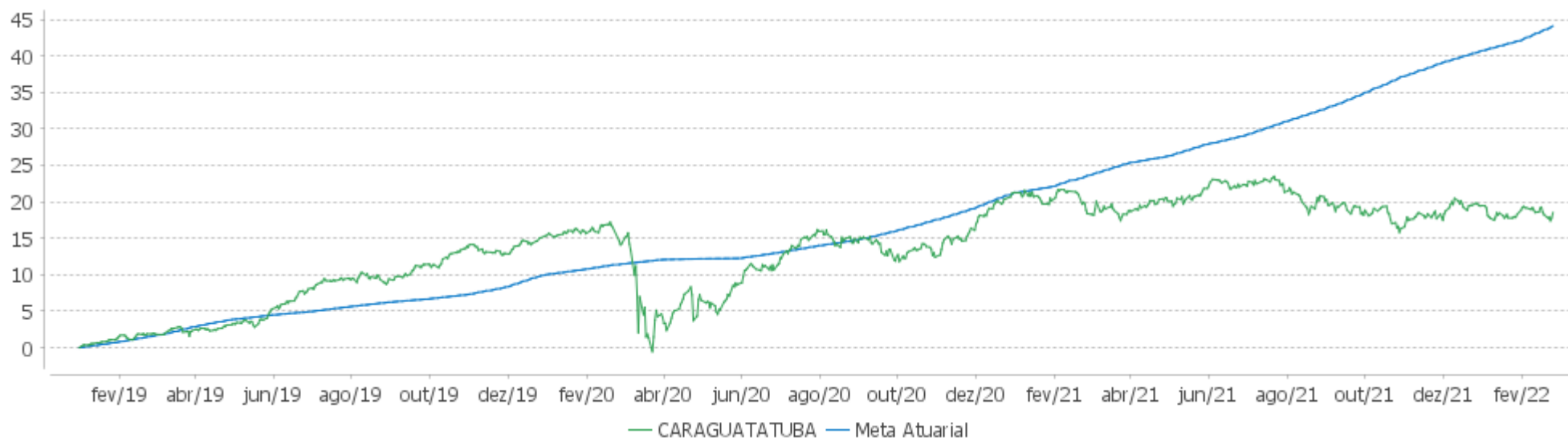
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

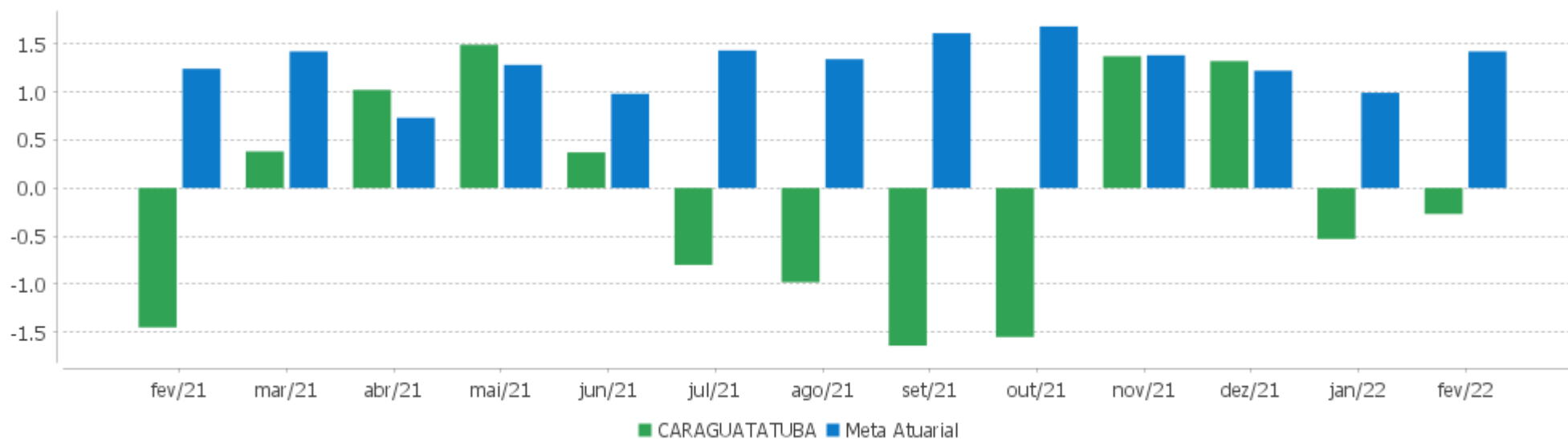
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	16	42,11	03 meses	0,51	3,67	-3,16	5,23
Meses abaixo - Meta Atuarial	22	57,89	06 meses	-1,34	8,58	-9,91	5,93
			12 meses	0,12	16,60	-16,49	5,69
			24 meses	3,72	29,72	-25,99	10,07
			36 meses	16,32	42,95	-26,63	8,53
			Desde 31/12/2018	18,51	45,43	-26,92	8,31
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	4,43	2020-12					
Menor rentabilidade da Carteira	-8,82	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 150545 (5,781000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,12 0,58	2,28 2,47	3,58 3,55	5,63 4,90	10,54 9,61	15,68 11,57	20,33 -2,52
NTN-B 150545 (5,760000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,12 0,58	2,27 2,47	3,58 3,55	5,63 4,90	10,53 9,61	15,67 11,56	20,31 -2,54
NTN-B 150830 (5,708000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,73 -2,27	-0,61 -0,42	0,65 0,62	5,57 4,84	10,41 9,48	15,42 11,31	19,93 -2,92
NTN-B 150535 (5,560000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,11 0,56	2,24 2,44	3,53 3,50	5,56 4,83	10,38 9,46	15,37 11,26	19,86 -3,00
NTN-B 150840 (5,770000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,71 -2,25	-0,58 -0,39	0,68 0,65	5,62 4,89	10,51 9,59	15,63 11,52	20,26 -2,60
NTN-B 150840 (5,650000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,11 0,57	2,26 2,45	3,55 3,52	8,60 7,87	13,60 12,68	18,83 14,71	23,53 0,67
NTN-B 150822 (6,920000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,20 0,66	2,45 2,64	3,86 3,83	9,24 8,51	14,82 13,89	21,14 17,02	26,98 4,12
NTN-B 150523 (5,900000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,13 0,59	2,30 2,49	3,61 3,58	5,61 4,88	10,49 9,57	15,59 11,48	20,19 -2,67
NTN-B 150850 (5,713000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,67 -2,22	-0,55 -0,36	0,71 0,68	5,63 4,90	10,54 9,62	15,69 11,57	20,34 -2,52
NTN-B 150822 (6,090000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,15 0,60	2,32 2,52	3,66 3,63	8,82 8,09	13,95 13,02	19,39 15,27	24,32 1,46
NTN-B 150545 (5,710000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,12 0,57	2,27 2,46	3,57 3,54	5,62 4,89	10,52 9,59	15,64 11,53	20,27 -2,59
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	-0,34 -45,32	-0,07 -4,72	0,40 17,82	6,99 183,62	-3,11 -55,03	1.450,89 17.795,93	21.917,25 154.442,29
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,76 0,02	1,40 0,02	2,25 -0,02	2,90 -0,03	4,12 -0,14	7,05 -0,42	13,74 -0,73
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,53 -0,02	-0,23 -0,04	-0,03 -0,06	0,61 -0,12	0,65 -0,27	3,48 -0,63	21,73 -1,13
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,05 -0,02	1,15 -0,03	1,92 -0,05	4,16 -0,10	6,09 -0,23	12,50 -0,44	25,90 -0,78
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,74 -0,01	1,36 -0,02	2,21 -0,05	2,84 -0,09	4,00 -0,26	6,81 -0,65	13,48 -1,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,59	0,52	2,40	1,12	0,24	3,13	15,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,01	0,02	0,00	-0,04	-0,24	-0,38	-0,79
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,02	-1,60	-1,93	-2,98	-4,67	-3,94	16,68
Var. IMA-B 5+ p.p.	0,01	-0,00	-0,00	-0,23	-0,43	-0,61	-1,31
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,93	1,46	2,33	4,51	5,85	8,44	18,85
Var. IPCA p.p.	-0,08	-0,10	0,03	-1,26	-4,70	-7,85	-2,10
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	-0,01	-1,63	-1,98	-2,86	-4,47	-4,00	16,74
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,02	-0,04	-0,05	-0,11	-0,23	-0,67	-1,24
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	0,45	-0,09	2,18	-0,02	-2,12	0,50	14,45
Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,03	-0,07	-0,09	-0,20	-0,43	-0,57	-1,00
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	0,53	-0,22	-0,01	0,64	0,71	3,60	21,95
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,02	-0,04	-0,09	-0,21	-0,52	-0,91
BB PREV RF VII	1,13	1,70	2,29	4,89	8,08	13,76	24,11
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,58	1,89	2,26	4,16	7,16	9,65	1,25
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,81	1,48	2,32	2,92	1,86	6,59	21,76
Var. IPCA p.p.	-0,20	-0,08	0,02	-2,85	-8,68	-9,70	0,81
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,15	1,17	1,89	4,12	6,30	13,18	24,90
Var. IDKA 2 p.p.	-0,11	-0,14	-0,26	-0,19	-0,40	-0,93	-1,99
BB PREV RF IRF-M	0,57	0,44	2,32	1,00	0,13	2,89	14,85
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,02	-0,06	-0,07	-0,16	-0,35	-0,62	-0,94
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,53	-0,24	-0,04	0,58	0,65	3,56	21,95
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,04	-0,07	-0,15	-0,27	-0,56	-0,91
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,02	-1,65	-1,97	-2,92	-4,52	-4,01	17,00
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,03	-0,05	-0,04	-0,17	-0,28	-0,68	-0,99
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,98	1,82	2,63	4,42	6,66	8,96	14,80
% do CDI	130,77	122,24	116,47	116,13	117,90	109,84	104,26
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	0,76	-0,34	-0,26	0,29	0,88	4,64	25,18
% do CDI	101,18	-23,05	-11,42	7,67	15,61	56,88	177,42
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82	1,61	2,38	4,08	6,03	8,15	13,91
% do CDI	109,27	108,41	105,17	107,18	106,73	99,97	98,05
BRANDESCO F I A SELECTION	-1,95	4,70	6,80	-12,25	-8,58	-5,36	1,17
Var. IBOVESPA p.p.	-2,84	-3,24	-4,22	-7,50	-11,40	-13,97	-17,20
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	0,97	10,53	10,60	-4,55	1,20	0,98	30,44
Var. IBOVESPA p.p.	0,08	2,60	-0,42	0,20	-1,63	-7,64	12,07
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-1,21	0,11	1,09	-13,89	-7,48	-3,23	16,23
Var. IBOVESPA p.p.	-2,10	-7,82	-9,93	-9,14	-10,30	-11,84	-2,14
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	-0,71	8,04	7,69	-2,49	5,01	4,82	25,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,61	3,06	1,03	-0,93	-4,18	-0,51	-2,47
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	1,17 0,28	6,89 -1,05	5,18 -5,83				
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	0,96 0,07	7,60 -0,34	9,62 -1,39	-8,53 -3,79	-4,48 -7,30	-1,32 -9,93	14,43 -3,94
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	0,80 -0,15	7,55 -0,30	11,25 -0,35	-6,12 -0,53	1,23 -0,95	6,67 -2,11	20,17 -3,39
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	-0,23 -1,12	7,21 -0,72	8,96 -2,06	-4,34 0,41	-0,44 -3,26	-8,14 -16,75	1,10 -17,27
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	-1,44 3,75	2,47 4,42	6,46 4,69	-13,36 5,24	-4,34 8,98	-3,15 8,26	23,29 3,07
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-7,12 -0,30	-16,17 -0,19	-14,74 -0,20	-6,50 -0,69	-0,12 -1,95	68,54 -3,73	113,78 -6,06
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	-5,29 -705,71	-17,18 -1.155,21	-16,45 -727,04	-10,52 -276,10	-7,32 -129,60	59,72 732,49	
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI Var. MSCI ACWI p.p.	-2,25 4,34	-7,44 7,34	-2,25 9,83	-2,07 3,77	15,79 17,01		
ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI Var. S&P 500 p.p.	-2,18 4,67	-7,36 7,92	-2,22 9,98	-0,12 3,01	19,95 13,04	49,66 -19,89	65,12 -51,36
CARAGUATATUBA Var. IPCA + 5,46% p.p.	-0,27 -1,69	-0,80 -3,22	0,51 -3,16	-1,34 -9,91	0,12 -16,49	3,72 -25,55	16,32 -25,45
CDI	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19
IBOVESPA	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	18,37
INPC + 6,00%	1,44	2,62	3,92	8,81	17,47	32,17	45,56
IPCA + 6,00%	1,45	2,50	3,80	8,85	17,20	30,60	43,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+2 du	D+2 du		0,20
BB PREV RF IRF-M	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREV RF VII	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	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 DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	D+1 du	D+0	D+21 du	D+23 du		1,72
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
FIDC ITALIA SENIOR	Não se aplica	Não se aplica				
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du		1,90
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	D+1 du	D+0	D+2 du	D+4 du		1,50
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FICFI						
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI			D+0	D+0		0,18
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,18
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,00
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI						
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du		0,18
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,18
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+8 du		1,00
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI						
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,10

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	0,74	1,38	2,27	2,93	4,26	7,47	14,48	22,35	34,40
IRF-M 1+	0,48	-0,02	2,26	0,18	-1,69	1,08	15,45	28,42	46,68
IRF-M TOTAL	0,58	0,50	2,40	1,16	0,48	3,51	15,79	27,30	43,94
IMA-B 5	1,06	1,18	1,97	4,26	6,32	12,94	26,68	39,47	55,81
IMA-B 5+	0,01	-1,60	-1,93	-2,75	-4,23	-3,33	17,98	38,31	53,22
IMA-B TOTAL	0,54	-0,19	0,03	0,73	0,92	4,12	22,86	40,19	55,41
IMA-GERAL TOTAL	0,74	0,95	1,83	2,30	2,88	6,29	18,28	30,05	44,43
IDKA 2	1,26	1,31	2,15	4,31	6,70	14,12	26,89	39,82	57,21
IDKA 20	-0,58	-3,49	-5,69	-9,10	-12,75	-14,41	8,86	34,44	45,63
CDI	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19	21,51	32,41

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	18,37	32,56	69,72
IBRX 100	1,46	8,43	11,83	-4,71	2,87	9,99	22,25	38,00	76,75
IBRX 50	1,74	9,53	13,65	-3,21	4,78	13,29	20,78	33,87	72,89
SMALL CAP	-5,19	-1,95	1,77	-18,60	-13,32	-11,41	20,21	34,33	77,03
IFIX	-1,29	-2,27	6,31	-0,32	-5,04	-7,51	12,59	18,59	35,11
Índice Consumo - ICON	-2,51		-0,33	-21,72	-21,21	-20,40	7,27	6,67	33,15
Índice Dividendos - IDIV	-2,32	4,98	6,66	-1,56	9,19	5,34	28,12	49,91	76,56

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	1,01	1,56	2,30	5,77	10,54	16,29	20,94	25,65	29,22
INPC	1,00	1,68	2,42	5,73	10,80	17,68	22,30	27,12	29,42
IGPM	1,83	3,68	4,59	4,61	16,12	49,73	59,94	72,10	71,38
SELIC	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19	21,52	32,43

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	-6,85	-15,28	-12,20	-3,13	6,92	69,56	116,47	155,90	207,13
MSCI ACWI	-6,59	-14,77	-12,07	-5,84	-1,21	55,63	90,73	113,55	160,11

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,31	2,19	3,30	7,83	14,98	25,74	35,98	46,92	57,07
IPCA + 5,00%	1,38	2,35	3,55	8,34	16,09	28,16	39,93	52,64	64,73
IPCA + 5,50%	1,42	2,42	3,68	8,60	16,65	29,37	41,93	55,56	68,67
IPCA + 5,89%	1,45	2,48	3,77	8,79	17,08	30,33	43,50	57,86	71,80
IPCA + 6,00%	1,45	2,50	3,80	8,85	17,20	30,60	43,95	58,52	72,69
INPC + 4,00%	1,30	2,31	3,43	7,79	15,25	27,25	37,51	48,64	57,31
INPC + 6,00%	1,44	2,62	3,92	8,81	17,47	32,17	45,56	60,37	72,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
20	01/02/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	98.622,84	0,00	25.009,36112300	3,9434370000
21	02/02/2022	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	714,35	0,00	20,42846000	34,9683870000
22	03/02/2022	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	314,35	0,00	8,98484000	34,9867220000
23	07/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	214.005,52	0,00	75.774,36057400	2,8242471250
24	08/02/2022	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	26.493,25	0,00	7,81882000	3.388,3949240422
25	08/02/2022	ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	0,00	4.156.630,06	156.814,57747000	26,5066560000
26	09/02/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	57.000,00	14.418,15537700	3,9533490000
27	09/02/2022	NTN-B 150822 (6,920000%)	3.901.262,75	0,00	1.000,00000000	3.901,2627490000
28	09/02/2022	NTN-B 150535 (5,560000%)	15.679.053,04	0,00	3.900,00000000	4.020,2700110000
29	09/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	8.379,03	0,00	2.968,28539300	2,8228518790
30	09/02/2022	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	16.293.292,20	2.540.399,85078200	6,4136723190
31	11/02/2022	NTN-B 150840 (5,650000%)	868.334,25	0,00	213,00000000	4.076,6865970000
32	15/02/2022	BB PREV RF VII	0,00	13.725,13	6.923,69603600	1,9823415020
33	16/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	4.904.460,44	2.122.413,53188100	2,3107939929
34	17/02/2022	NTN-B 150850 (5,713000%)	9.998.612,81	0,00	2.514,00000000	3.977,1729560000
35	17/02/2022	BB PREV RF IRF-M	0,00	4.500.000,00	747.800,86087200	6,0176448510
36	17/02/2022	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	30.009.179,53	8.278.910,49844800	3,6247740000
37	18/02/2022	NTN-B 150545 (5,710000%)	30.010.566,72	0,00	7.457,00000000	4.024,4825960000
38	18/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	46.721,45	0,00	16.509,75632000	2,8299297150
39	18/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.201.288,58	0,00	424.494,13977700	2,8299297150
40	18/02/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.416.067,16	0,00	1.113.515,63512500	3,9658780000
41	22/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	8.784,78	0,00	3.102,07345000	2,8319058660
42	22/02/2022	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	9.997.615,52	2.763.023,99875300	3,6183600000
43	23/02/2022	NTN-B 150545 (5,760000%)	9.997.615,52	0,00	2.494,00000000	4.008,6670100000
44	24/02/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	188.435,29	47.432,44221000	3,9727090000
45	24/02/2022	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.350.689,54	1.476.062,05847700	3,6249760000
46	24/02/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.040.699,54	765.396,99962600	3,9727090000
47	24/02/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	26.706,13	0,00	6.722,39773900	3,9727090000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
48	24/02/2022	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	0,00	11.663.723,85	307.606,68532000	37,9176539608
49	25/02/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.014.134,37	0,00	758.404,06339500	3,9743120000
50	25/02/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	561.122,61	0,00	141.187,35771100	3,9743120000
51	25/02/2022	NTN-B 150545 (5,781000%)	9.996.671,18	0,00	2.496,00000000	4.005,0765960000
52	25/02/2022	NTN-B 150830 (5,708000%)	9.997.454,66	0,00	2.555,00000000	3.912,8981050000
53	25/02/2022	NTN-B 150840 (5,770000%)	9.998.289,94	0,00	2.538,00000000	3.939,4365400000
54	25/02/2022	BB PREV RF IRF-M	0,00	11.682.782,80	1.936.134,37692500	6,0340764230
55	25/02/2022	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	4.652.779,52	3.030.956,91023300	1,5350860000
56	25/02/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	561.122,61	141.187,35756200	3,9743120000
57	25/02/2022	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.737,02	0,00	0,80203000	3.412,6118270000
Total			110.073.952,31	107.072.136,03		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 13.205.061,62

Value-At-Risk: 2,41%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARAGUATATUBA		2,41	2,41			548.514.068,61	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,03%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150523 (5,900000%)		0,23	0,00	2,13			38.987.047,30	7,11
NTN-B 150535 (5,560000%)		0,22	0,00	2,13			15.799.934,81	2,88
NTN-B 150545 (5,710000%)		0,22	0,00	2,13			30.124.306,66	5,49
NTN-B 150545 (5,760000%)		0,22	0,00	2,13			10.014.114,58	1,83
NTN-B 150545 (5,781000%)		0,22	0,00	2,13			9.996.671,18	1,82
NTN-B 150822 (6,090000%)		0,09	-0,00	2,13			15.336.391,58	2,80
NTN-B 150822 (6,920000%)		0,09	0,00	2,13			3.820.367,55	0,70
NTN-B 150830 (5,708000%)		0,22	-0,00	2,16			9.997.454,66	1,82
NTN-B 150840 (5,650000%)		0,09	-0,00	2,13			850.165,72	0,15
NTN-B 150840 (5,770000%)		0,22	-0,00	2,16			9.998.289,94	1,82
NTN-B 150850 (5,713000%)		0,22	-0,00	2,16			10.044.220,86	1,83
Sub-total	0,23	0,16	0,00		1,68	1,13	154.968.964,84	28,25

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,57	0,00	0,75			365.828,45	0,07
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,57	0,00	0,02			14.118.065,59	2,57
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		3,60	0,06	0,08			21.422.988,84	3,91
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,17	0,00	0,01			4.581.371,19	0,84
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		3,56	0,10	0,08			34.502.731,44	6,29
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,53	0,07	0,03			32.646.470,93	5,95
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,60	0,01	0,25			11.875.371,09	2,17
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BB PREV RF VII		0,77	0,00	2,03			472.603,84	0,09
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		0,59	0,00	0,61			2.484.966,18	0,45
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,75	0,02	0,78			39.437.385,28	7,19
Sub-total	3,16	1,98	0,26		-0,08	0,50	161.907.782,83	29,52

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,08	-0,00	0,06			3.589.728,98	0,65
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO		2,38	0,05	2,37			25.631.776,90	4,67
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,07	0,00	0,06			24.361.057,52	4,44
Sub-total	2,05	1,15	0,05		0,03	0,80	53.582.563,40	9,77

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR		0,03	-0,00	0,05			930.174,53	0,17
Sub-total	1,24	0,03	-0,00		-0,88	-0,34	930.174,53	0,17

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,20%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO F I A SELECTION		11,31	0,08	3,56			5.182.774,86	0,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS		9,96	0,02	3,60			1.449.088,52	0,26
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		13,38	0,12	4,88			6.211.874,51	1,13
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		9,70	0,21	1,97			15.044.966,51	2,74
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		10,34	0,36	0,10			24.325.362,29	4,43
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS		10,42	0,11	2,21			7.475.937,54	1,36
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		9,37	0,18	2,51			13.425.273,64	2,45
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		8,62	0,07	5,21			5.793.690,60	1,06
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		13,13	0,18	6,78			9.979.352,81	1,82
Sub-total	11,49	10,20	1,33		-0,05	0,18	88.888.321,28	16,21

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 8,67%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI		8,67	0,51	6,12			45.837.036,67	8,36
Sub-total	21,99	8,67	0,51		-0,13	-2,18	45.837.036,67	8,36

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,45%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,26	0,00	9,27			1.324.616,43	0,24
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI		8,29	0,01	6,22			1.545.137,53	0,28
Sub-total	20,01	7,81	0,02		-0,22	-3,68	2.869.753,96	0,52

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		9,66	0,23	0,82			39.529.471,10	7,21
Sub-total	27,41	9,66	0,23		-0,29	-7,12	39.529.471,10	7,21