



LDB
EMPRESAS

CARAGUATATUBA
MARÇO 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 31.03.2022.

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

RENDA FIXA

67,41%

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%)	4,13	1,77	4,10	39.676.621,09	7,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,560000%)	3,97	1,74	2,52	16.074.873,08	2,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,821000%)	4,07	1,46	1,46	18.766.550,03	3,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,710000%)	3,99	1,75	2,14	30.652.299,64	5,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	4,01	1,76	1,92	10.190.049,44	1,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,781000%)	4,02	1,76	1,76	10.172.484,03	1,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,815000%)	4,02	1,46	1,46	10.145.792,45	1,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822 (6,090000%)	2,95	1,78	4,15	15.610.079,26	2,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822 (6,920000%)	2,97	1,85	2,70	3.891.193,25	0,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,892000%)	4,13	1,39	1,39	5.147.283,80	0,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,708000%)	4,06	1,75	1,75	10.172.662,34	1,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,650000%)	2,83	1,75	2,45	865.024,10	0,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,770000%)	4,04	1,76	1,76	10.174.036,57	1,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,713000%)	3,98	1,75	2,22	10.220.290,81	1,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,815000%)	4,03	1,46	1,46	10.145.731,73	1,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,916000%)	4,09	1,16	1,16	3.640.138,85	0,65
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,39	1,76	4,10	205.545.110,47	36,61

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
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,72	0,84	2,25	369.747,60	0,07	166.196.159,10	0,22
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,72	0,87	2,23	10.624.556,70	1,89	5.022.847.839,72	0,21
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,77	3,52	1,82	22.177.544,66	3,95	945.847.891,90	2,34
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,68	2,59	3,76	4.699.893,03	0,84	1.176.353.590,24	0,40
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,70	3,53	1,88	0,00	0,00	1.258.653.751,76	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	5,07	0,82	0,73	32.913.672,98	5,86	898.382.942,61	3,66
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,71	2,63	3,82	37.187.273,73	6,62	10.820.442.688,05	0,34
BB	BB	BB PREV RF VII	1,59	2,29	4,03	483.438,39	0,09	250.707.080,03	0,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,16	1,16	2,64	2.513.872,64	0,45	2.425.114.860,62	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,10	0,82	2,32	1.266.490,12	0,23	9.043.444.595,41	0,01
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,90	2,48	2,48	112.236.489,85	19,99		

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	0,20	0,91	2,75	4.820,09	0,00	2.282.543.250,44	0,00
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,12	3,50	3,14	26.528.300,68	4,72	452.865.096,70	5,86
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,21	0,93	2,55	32.983.904,27	5,87	11.946.672.563,32	0,28
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			2,74	2,17	2,63	59.517.025,04	10,60		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	27,71	28,76	28,67	1.197.651,99	0,21	40.395.435,01	2,96
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea a	27,71	28,76	28,67	1.197.651,99	0,21		
		Renda Fixa	4,13	2,01	2,48	378.496.277,35	67,41		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

16,79%

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	BRDESCO F I A SELECTION	20,06	6,89	11,91	5.539.946,24	0,99	506.532.544,48	1,09
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	17,78	7,48	15,24	1.557.518,51	0,28	742.021.949,59	0,21
BRAM	BEM	BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	22,75	9,09	11,78	6.776.561,19	1,21	1.286.829.307,44	0,53
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	19,04	4,64	12,59	15.742.673,92	2,80	616.631.969,58	2,55
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	19,04	6,10	14,11	25.808.246,39	4,60	1.088.008.450,35	2,37
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	19,15	5,79	16,94	7.909.024,45	1,41	785.355.221,64	1,01
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,45	7,07	15,68	14.374.492,83	2,56	1.055.290.766,99	1,36
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	17,68	5,54	5,66	6.114.795,43	1,09	2.555.347.096,74	0,24
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	24,68	4,95	12,19	10.473.566,57	1,87	320.772.868,33	3,27
Sub-total Artigo 8º I			18,23	6,08	13,23	94.296.825,53	16,79		
Renda Variável			16,31	6,08	13,23	94.296.825,53	16,79		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,25%

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	16,16	-6,90	-22,90	1.233.154,51	0,22	1.416.865.842,79	0,09
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	14,64	3,29	-4,39	1.595.898,60	0,28	808.624.508,53	0,20
Sub-total Artigo 9º II			16,43	-1,42	-13,45	2.829.053,11	0,50		

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	18,89	-4,11	-19,62	37.904.101,00	6,75	2.671.897.209,12	1,42
Sub-total Artigo 9º III			18,89	-4,11	-19,62	37.904.101,00	6,75		

Investimentos no Exterior			18,57	-3,93	-19,22	40.733.154,11	7,25		
----------------------------------	--	--	--------------	--------------	---------------	----------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

8,54%

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	14,99	4,58	-3,11	47.937.119,31	8,54	2.089.574.099,71	2,29
Sub-total Artigo 10º I			14,99	4,58	-3,11	47.937.119,31	8,54		
Investimentos Estruturados			20,66	4,58	-3,11	47.937.119,31	8,54		
Total			5,75	2,35	1,53	561.463.376,30	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	205.545.110,47	36,61	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	112.236.489,85	19,99	10,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	59.517.025,04	10,60	3,00	14,25	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.197.651,99	0,21	0,00	0,25	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	378.496.277,35	67,41					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	94.296.825,53	16,79	0,00	5,50	35,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	94.296.825,53	16,79					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	2.829.053,11	0,50	0,00	2,96	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	37.904.101,00	6,75	0,00	7,04	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	40.733.154,11	7,25					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	47.937.119,31	8,54	0,00	9,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	47.937.119,31	8,54					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	1,76 190,95	4,10 169,21	4,10 169,21			3.404.765,08	4.969.713,80
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	2,48 268,30	2,48 102,35	2,48 102,35	3,30 76,63	2,77 43,19	2.770.758,85	2.645.082,79
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	2,17 235,23	2,63 108,55	2,63 108,55			1.149.707,00	1.416.346,77
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	28,76 3.113,94	28,67 1.182,31	28,67 1.182,31			267.477,46	266.824,62
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	6,08 0,02	13,23 -1,24	13,23 -1,24			5.408.504,25	11.021.008,03
Artigo 9º II % do CDI	-1,42 -153,58	-13,45 -554,74	-13,45 -554,74	-5,70 -132,18		-40.700,85	-439.632,21
Artigo 9º III % do CDI	-4,11 -445,27	-19,62 -809,07	-19,62 -809,07	-10,12 -234,80	-7,40 -115,44	-1.625.370,10	-9.249.803,89
Artigo 10º I % do CDI	4,58 496,14	-3,11 -128,29	-3,11 -128,29			2.100.082,64	-1.538.890,65
CARAGUATATUBA (Total)						13.435.224,33	9.090.649,26

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%)	38.987.047,30	0,00	0,00	0,00	39.676.621,09	689.573,79	1.564.276,35
NTN-B 150535 (5,560000%)	15.799.934,81	0,00	0,00	0,00	16.074.873,08	274.938,27	395.820,04
NTN-B 150535 (5,821000%)	0,00	18.496.592,49	0,00	0,00	18.766.550,03	269.957,54	269.957,54
NTN-B 150545 (5,710000%)	30.124.306,66	0,00	0,00	0,00	30.652.299,64	527.992,98	641.732,92
NTN-B 150545 (5,760000%)	10.014.114,58	0,00	0,00	0,00	10.190.049,44	175.934,86	192.433,92
NTN-B 150545 (5,781000%)	9.996.671,18	0,00	0,00	0,00	10.172.484,03	175.812,85	175.812,85
NTN-B 150555 (5,815000%)	0,00	9.999.880,10	0,00	0,00	10.145.792,45	145.912,35	145.912,35
NTN-B 150822 (6,090000%)	15.336.391,58	0,00	0,00	0,00	15.610.079,26	273.687,68	629.611,59
NTN-B 150822 (6,920000%)	3.820.367,55	0,00	0,00	0,00	3.891.193,25	70.825,70	102.590,98

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150824 (5,892000%)	0,00	5.076.784,86	0,00	0,00	5.147.283,80	70.498,94	70.498,94
NTN-B 150830 (5,708000%)	9.997.454,66	0,00	0,00	0,00	10.172.662,34	175.207,68	175.207,68
NTN-B 150840 (5,650000%)	850.165,72	0,00	0,00	0,00	865.024,10	14.858,38	20.686,53
NTN-B 150840 (5,770000%)	9.998.289,94	0,00	0,00	0,00	10.174.036,57	175.746,63	175.746,63
NTN-B 150850 (5,713000%)	10.044.220,86	0,00	0,00	0,00	10.220.290,81	176.069,95	221.678,00
NTN-B 150850 (5,815000%)	0,00	9.999.829,83	0,00	0,00	10.145.731,73	145.901,90	145.901,90
NTN-B 150850 (5,916000%)	0,00	3.598.293,27	0,00	0,00	3.640.138,85	41.845,58	41.845,58
					205.545.110,47	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-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	21.422.988,84	0,00	0,00	0,00	22.177.544,66	754.555,82	395.478,70
BB PREV RF IRF M	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	58.642,62
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	14.118.065,59	1.500.921,08	-5.076.784,86	0,00	10.624.556,70	82.354,89	249.127,51
BB PREV RF VII	472.603,84	0,00	0,00	0,00	483.438,39	10.834,55	18.872,41
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11.875.371,09	25.000.000,00	0,00	0,00	37.187.273,73	311.902,64	448.689,89
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	34.502.731,44	0,00	-35.720.719,23	0,00	0,00	1.217.987,79	657.808,63
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	32.646.470,93	0,00	0,00	0,00	32.913.672,98	267.202,05	238.013,47
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	39.437.385,28	0,00	-38.146.302,42	0,00	1.266.490,12	-24.592,74	652.114,78
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2.484.966,18	0,00	0,00	0,00	2.513.872,64	28.906,46	64.562,18
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	365.828,45	833,60	0,00	0,00	369.747,60	3.085,55	8.131,05
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	4.581.371,19	0,00	0,00	0,00	4.699.893,03	118.521,84	170.411,82
					112.236.489,85	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	24.361.057,52	11.748.237,33	-3.367.926,44	0,00	32.983.904,27	242.535,86	533.623,24
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	3.589.728,98	2.737,02	-3.598.293,27	0,00	4.820,09	10.647,36	74.387,69
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	25.631.776,90	0,00	0,00	0,00	26.528.300,68	896.523,78	808.335,84

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					59.517.025,04	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	930.174,53	0,00	0,00	0,00	1.197.651,99	267.477,46	266.824,62
					1.197.651,99	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	1.449.088,52	0,00	0,00	0,00	1.557.518,51	108.429,99	205.940,58
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	24.325.362,29	0,00	0,00	0,00	25.808.246,39	1.482.884,10	3.190.897,52
BRADESCO F I A SELECTION	5.182.774,86	0,00	0,00	0,00	5.539.946,24	357.171,38	589.770,54
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	6.211.874,51	0,00	0,00	0,00	6.776.561,19	564.686,68	714.320,48
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	7.475.937,54	0,00	0,00	0,00	7.909.024,45	433.086,91	1.145.599,71
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	13.425.273,64	0,00	0,00	0,00	14.374.492,83	949.219,19	1.948.787,38
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	5.793.690,60	0,00	0,00	0,00	6.114.795,43	321.104,83	327.695,68
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	15.044.966,51	0,00	0,00	0,00	15.742.673,92	697.707,41	1.760.402,17
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	9.979.352,81	0,00	0,00	0,00	10.473.566,57	494.213,76	1.137.593,97
					94.296.825,53	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	1.324.616,43	0,00	0,00	0,00	1.233.154,51	-91.461,92	-366.275,56
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	1.545.137,53	0,00	0,00	0,00	1.595.898,60	50.761,07	-73.356,65
					2.829.053,11	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	39.529.471,10	0,00	0,00	0,00	37.904.101,00	-1.625.370,10	-9.249.803,89
					37.904.101,00	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	45.837.036,67	0,00	0,00	0,00	47.937.119,31	2.100.082,64	-1.538.890,65
					47.937.119,31	0,00	0,00

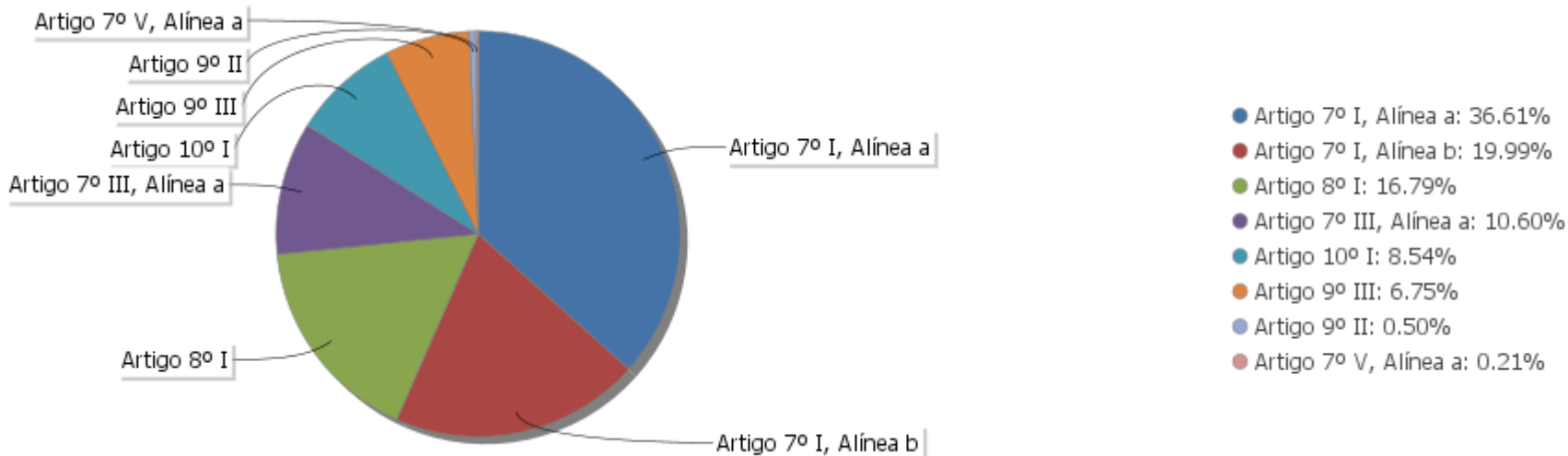
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

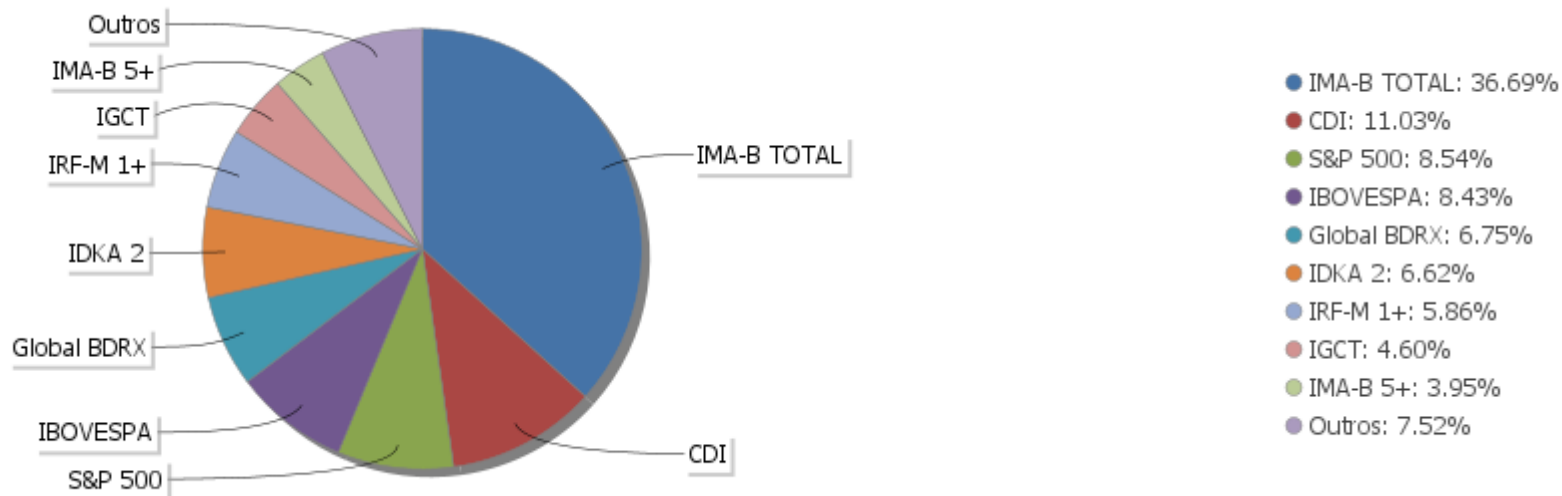
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	325.838.862,74	58,03	325.838.862,74	58,03
de 31 a 365 dias	49.580.675,60	8,83	375.419.538,34	66,86
acima de 365 dias	186.043.837,96	33,14	561.463.376,30	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

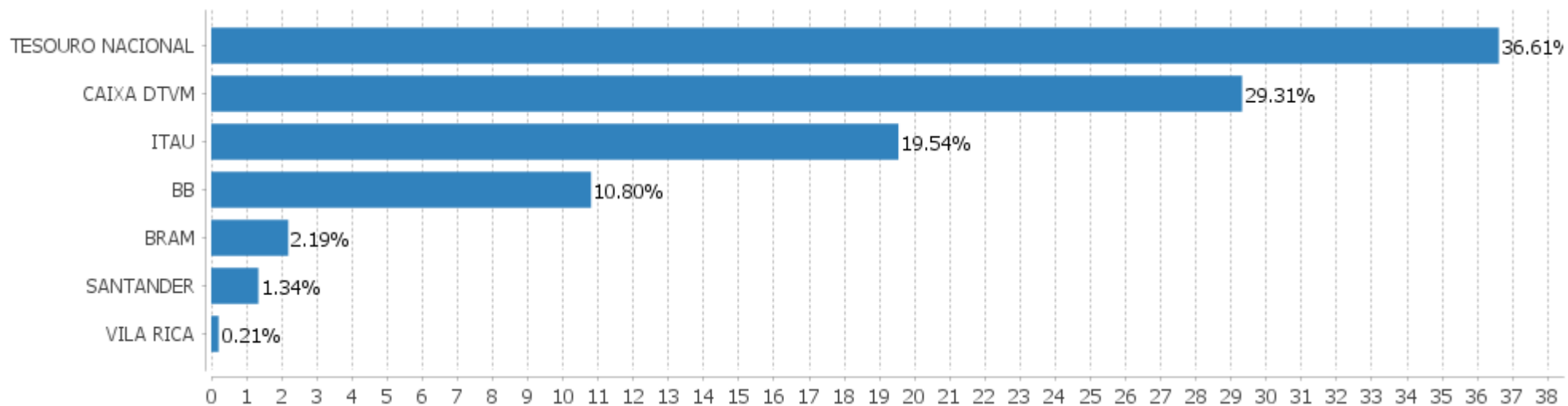


Alocação Por Estratégia



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	2,35										1,53
IPCA + 5,46%	0,99	1,42	2,09										4,56
p.p. indexador	-1,52	-1,69	0,26										-3,03
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

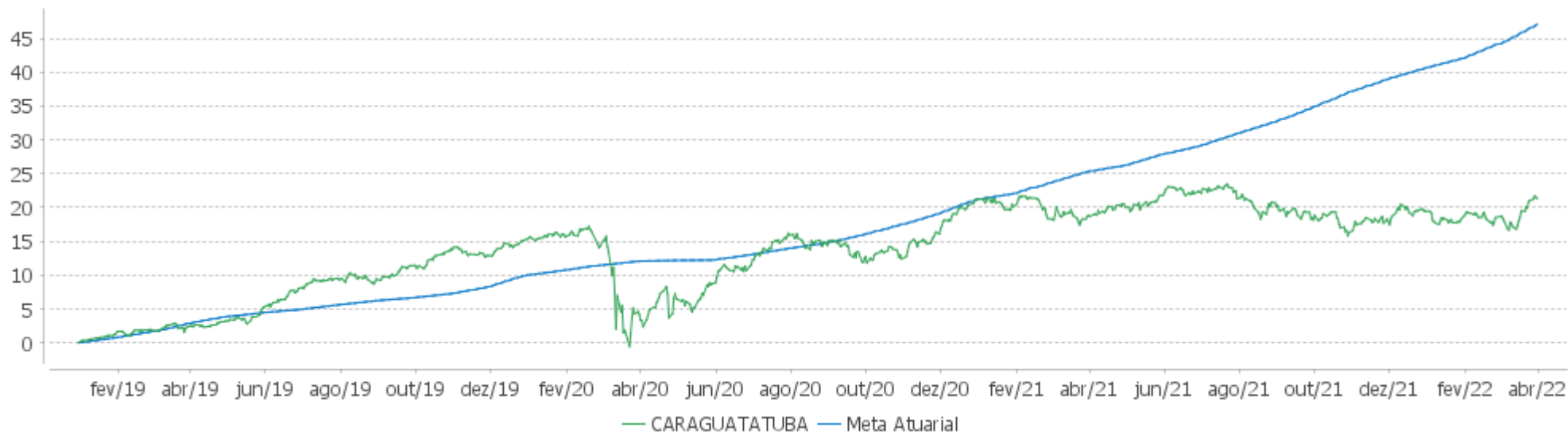
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

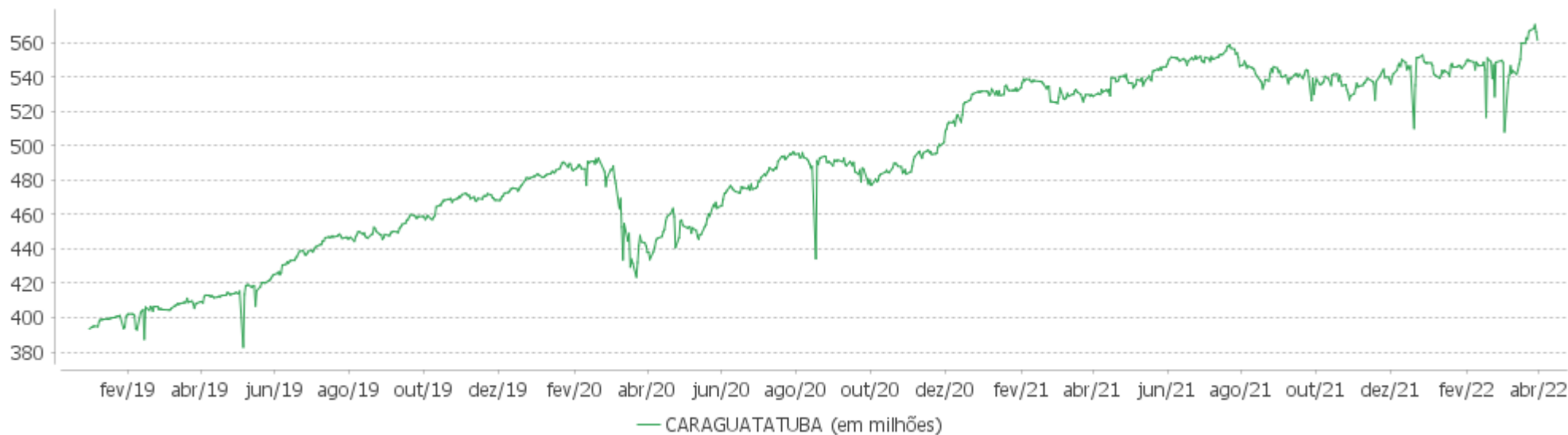
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	17	43,59	03 meses	1,53	4,56	-3,03	6,02
Meses abaixo - Meta Atuarial	22	56,41	06 meses	2,67	9,09	-6,42	6,13
			12 meses	2,08	17,38	-15,29	5,75
			24 meses	16,44	31,68	-15,24	6,94
			36 meses	18,57	44,22	-25,65	8,58
Maior rentabilidade da Carteira	4,43	2020-12	Desde 31/12/2018	21,30	48,47	-27,18	8,29
Menor rentabilidade da Carteira	-8,82	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

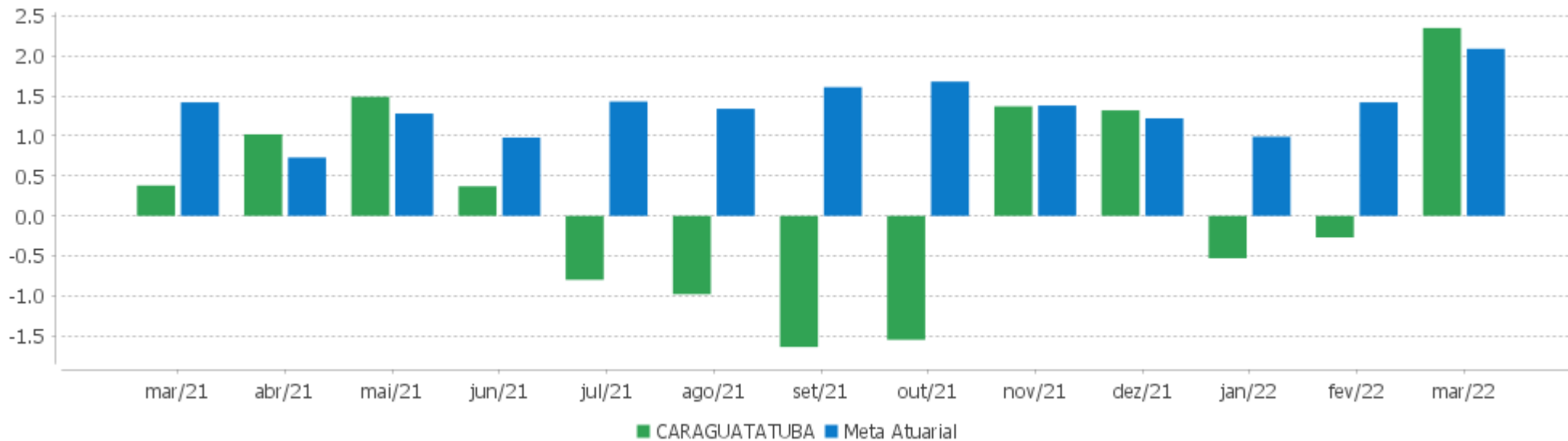


Patrimônio Líquido



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
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,91 99,00	2,75 113,38	2,75 113,38	4,82 111,82	7,41 115,51	9,68 110,20	15,32 104,13
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	3,50 378,77	3,14 129,63	3,14 129,63	3,53 81,87	5,19 80,98	15,35 174,83	28,99 197,09
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,93 100,44	2,55 105,38	2,55 105,38	4,49 104,26	6,91 107,69	9,00 102,47	14,44 98,16
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	28,76 3.113,94	28,67 1.182,31	28,67 1.182,31	29,73 689,59	24,76 386,09	1.666,94 18.982,39	13.660,12 92.875,79
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	0,82 0,01	0,73 -0,06	0,73 -0,06	1,59 -0,14	0,17 -0,39	1,78 -0,60	14,71 -0,95
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,84 -0,05	2,25 -0,03	2,25 -0,03	3,36 -0,07	5,00 -0,14	7,34 -0,43	14,18 -0,77
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	2,59 -0,02	3,76 -0,05	3,76 -0,05	5,82 -0,11	8,48 -0,23	17,46 -0,49	28,17 -0,80
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,29 -0,78	4,03 1,16	4,03 1,16	5,92 1,96	10,12 5,62	17,95 2,60	26,13 0,23
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,87 -0,02	2,23 -0,04	2,23 -0,04	3,36 -0,08	4,88 -0,26	7,10 -0,67	13,96 -0,99
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,82 -0,80	2,32 -0,89	2,32 -0,89	3,41 -2,85	2,39 -8,91	7,61 -10,48	22,09 0,11
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	2,63 0,09	3,82 -0,06	3,82 -0,06	5,71 -0,08	8,69 -0,41	17,87 -0,58	27,34 -1,91
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	3,53 -0,03	1,88 -0,03	1,88 -0,03	1,73 -0,26	-0,11 -0,46	11,63 -0,77	20,27 -1,38
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	1,16 -0,46	2,64 -0,56	2,64 -0,56	4,85 -1,40	6,92 -4,38	9,12 -8,97	19,76 -2,22
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	3,52 -0,04	1,82 -0,09	1,82 -0,09	1,82 -0,17	0,03 -0,31	11,51 -0,88	20,62 -1,04
NTN-B 150545 (5,781000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,76 -1,31	4,08 1,20	4,08 1,20	5,75 1,79	10,61 6,11	16,85 1,50	21,28 -4,62
NTN-B 150535 (5,560000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,74 -1,33	4,02 1,15	4,02 1,15	5,68 1,71	10,45 5,95	16,53 1,18	20,80 -5,10
NTN-B 150840 (5,650000%)	1,75	4,04	4,04	8,72	13,68	20,02	24,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,32	1,17	1,17	4,76	9,18	4,67	-1,40
NTN-B 150824 (5,892000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,77 -1,30	1,12 -1,75	1,12 -1,75	5,73 1,77	10,56 6,06	16,75 1,40	21,14 -4,76
NTN-B 150523 (5,900000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,77 -1,30	4,10 1,23	4,10 1,23	5,73 1,77	10,56 6,06	16,76 1,40	21,14 -4,76
NTN-B 150822 (6,920000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,85 -1,22	4,35 1,48	4,35 1,48	9,37 5,40	14,89 10,38	22,36 7,00	27,99 2,09
NTN-B 150850 (5,916000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,77 -1,30	1,16 -1,71	1,16 -1,71	5,77 1,81	10,65 6,15	16,94 1,59	21,42 -4,48
NTN-B 150850 (5,713000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,75 -1,32	1,19 -1,68	1,19 -1,68	5,75 1,79	10,61 6,11	16,86 1,50	21,29 -4,61
NTN-B 150850 (5,815000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,76 -1,31	1,17 -1,70	1,17 -1,70	5,76 1,80	10,63 6,13	16,90 1,54	21,35 -4,55
NTN-B 150545 (5,760000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,76 -1,31	4,07 1,20	4,07 1,20	5,75 1,79	10,60 6,10	16,84 1,48	21,26 -4,64
NTN-B 150830 (5,708000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,75 -1,32	1,13 -1,74	1,13 -1,74	5,69 1,73	10,48 5,98	16,59 1,23	20,88 -5,02
NTN-B 150555 (5,815000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,76 -1,31	4,08 1,21	4,08 1,21	5,77 1,80	10,64 6,14	16,92 1,56	21,38 -4,52
NTN-B 150840 (5,770000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,76 -1,31	1,16 -1,71	1,16 -1,71	5,74 1,78	10,58 6,08	16,80 1,44	21,20 -4,70
NTN-B 150535 (5,821000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,76 -1,31	4,09 1,21	4,09 1,21	5,74 1,77	10,58 6,08	16,79 1,44	21,19 -4,71
NTN-B 150822 (6,090000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,78 -1,29	4,15 1,28	4,15 1,28	8,95 4,98	14,02 9,52	20,59 5,24	25,30 -0,60
NTN-B 150545 (5,710000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,75 -1,32	4,06 1,19	4,06 1,19	5,74 1,78	10,59 6,09	16,81 1,46	21,22 -4,68
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	6,89 0,83	11,91 -2,56	11,91 -2,56	2,27 -5,85	-2,43 -5,32	47,77 -16,57	7,89 -17,88
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	5,79 -0,27	16,94 2,46	16,94 2,46	9,73 1,61	1,88 -1,01	55,05 -9,28	40,48 14,71
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	5,54 -0,52	5,66 -8,82	5,66 -8,82	-2,78 -10,90	-4,38 -7,26	51,19 -13,15	24,77 -0,99
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	7,07 -2,93	15,68 0,21	15,68 0,21	11,65 -1,72	6,45 -5,20	54,59 -1,00	35,48 -8,02
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	4,64	12,59	12,59	2,47	-3,79	50,39	20,69

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-1,42	-1,89	-1,89	-5,65	-6,68	-13,95	-5,07
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	4,95	12,19	12,19				
Var. IBOVESPA p.p.	-1,11	-2,29	-2,29				
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	6,10	14,11	14,11	6,82	1,59	63,59	27,76
Var. IGCT p.p.	-0,09	-0,41	-0,41	-0,60	-0,96	-3,48	-3,64
BB AÇÕES DIVIDENDOS	7,48	15,24	15,24	9,42	1,08	39,81	10,17
Var. IBOVESPA p.p.	1,42	0,76	0,76	1,30	-1,81	-24,53	-15,60
BRANCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	9,09	11,78	11,78	-1,64	1,21	54,57	35,25
Var. SMALL CAP p.p.	0,28	5,10	5,10	3,70	11,00	6,11	4,57
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-4,11	-19,62	-19,62	-10,12	-7,40	52,03	93,17
Var. Global BDRX p.p.	-0,13	-0,29	-0,29	-0,72	-2,26	-4,80	-5,60
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-6,90	-22,90	-22,90	-17,79	-15,88	44,92	74,35
% do CDI	-747,72	-944,53	-944,53	-412,67	-247,72	511,58	505,54
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	3,29	-4,39	-4,39	6,39	13,45		
Var. MSCI ACWI p.p.	9,38	15,57	15,57	19,04	25,57		
ITAUI PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	4,58	-3,11	-3,11	9,51	20,44	84,11	69,32
Var. S&P 500 p.p.	9,33	16,19	16,19	17,90	25,61	24,37	-25,02
CARAGUATATUBA	2,35	1,53	1,53	2,67	2,08	16,44	18,57
Var. IPCA + 5,46% p.p.	0,26	-3,03	-3,03	-6,42	-15,29	-14,84	-24,51
CDI	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71
IBOVESPA	6,06	14,48	14,48	8,13	2,89	64,34	25,77
INPC + 6,00%	2,23	4,91	4,91	9,38	18,43	34,19	47,02
IPCA + 6,00%	2,14	4,69	4,69	9,37	17,98	32,62	45,29

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-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+2 du	D+2 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 IRF-M 1+ TITULOS 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 FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI			D+0	D+0		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						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
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	0,89	2,28	2,28	3,43	5,14	7,77	14,95	22,64	34,09
IRF-M 1+	0,81	0,79	0,79	1,73	0,56	2,39	15,66	27,47	45,50
IRF-M TOTAL	0,84	1,35	1,35	2,35	2,19	4,49	16,08	26,70	43,00
IMA-B 5	2,61	3,81	3,81	5,92	8,72	17,96	28,97	40,83	57,68
IMA-B 5+	3,56	1,91	1,91	1,99	0,35	12,40	21,66	42,68	57,29
IMA-B TOTAL	3,07	2,87	2,87	3,96	4,50	15,36	25,90	43,16	58,53
IMA-GERAL TOTAL	1,57	2,54	2,54	3,91	4,91	10,14	19,47	30,83	44,94
IDKA 2	2,54	3,88	3,88	5,80	9,10	18,45	29,25	41,12	58,63
IDKA 20	4,00	0,37	0,37	-2,51	-7,51	6,54	12,87	41,87	51,51
CDI	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71	21,98	32,24

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,06	14,48	14,48	8,13	2,89	64,34	25,77	40,57	84,66
IBRX 100	5,96	14,89	14,89	8,55	2,79	66,70	29,68	46,11	91,79
IBRX 50	5,43	15,47	15,47	10,28	4,13	71,54	27,56	41,05	86,31
SMALL CAP	8,81	6,69	6,69	-5,35	-9,80	48,46	30,68	46,05	95,46
IFIX	1,42	-0,88	-0,88	2,37	-2,35	11,46	11,96	17,92	36,76
Índice Consumo - ICON	5,74			-11,99	-18,58	22,89	14,32	13,52	40,45
Índice Dividendos - IDIV	10,00	15,48	15,48	13,37	11,66	55,59	43,49	63,17	97,87

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	1,62	3,20	3,20	6,25	11,30	18,09	21,99	27,57	30,99
INPC	1,71	3,42	3,42	6,26	11,73	19,48	23,44	29,20	31,22
IGPM	1,74	5,49	5,49	7,11	14,77	50,46	60,70	73,99	74,34
SELIC	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71	21,99	32,26

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	-4,75	-19,30	-19,30	-8,39	-5,17	59,75	94,34	144,53	186,72
MSCI ACWI	-6,10	-19,97	-19,97	-12,65	-12,11	46,60	70,12	100,67	137,04

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,97	4,20	4,20	8,34	15,75	27,68	37,22	49,19	59,20
IPCA + 5,00%	2,05	4,45	4,45	8,86	16,86	30,14	41,22	55,00	66,95
IPCA + 5,50%	2,10	4,57	4,57	9,11	17,42	31,38	43,24	57,97	70,94
IPCA + 5,89%	2,13	4,66	4,66	9,31	17,85	32,35	44,84	60,31	74,11
IPCA + 6,00%	2,14	4,69	4,69	9,37	17,98	32,62	45,29	60,98	75,01
INPC + 4,00%	2,06	4,42	4,42	8,35	16,20	29,19	38,85	51,10	59,47
INPC + 6,00%	2,23	4,91	4,91	9,38	18,43	34,19	47,02	63,04	75,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
58	04/03/2022	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	38.146.302,42	24.872.383,76785600	1,5336810004
59	07/03/2022	NTN-B 150555 (5,815000%)	9.999.880,10	0,00	2.490,00000000	4.016,0161044177
60	07/03/2022	NTN-B 150850 (5,815000%)	9.999.829,83	0,00	2.530,00000000	3.952,5019090909
61	07/03/2022	NTN-B 150535 (5,821000%)	18.496.592,49	0,00	4.657,00000000	3.971,7827979386
62	07/03/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	5.076.784,86	1.792.138,73198000	2,8328079570
63	07/03/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	92.634,18	0,00	23.270,92027400	3,9806840000
64	08/03/2022	NTN-B 150824 (5,892000%)	5.076.784,86	0,00	1.315,00000000	3.860,6728973384
65	08/03/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	235.747,24	0,00	83.166,42051800	2,8346445420
66	08/03/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	8.784,78	0,00	3.099,07639900	2,8346445420
67	08/03/2022	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	833,60	0,00	23,69671412	35,1778730000
68	10/03/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	8.379,03	0,00	2.953,16282800	2,8373071470
69	10/03/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	26.493,25	0,00	6.647,74462300	3,9852990000
70	10/03/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	57.000,00	14.302,56553800	3,9852990000
71	10/03/2022	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,00	3.598.293,27	1.051,29587264	3.422,7217700000
72	11/03/2022	NTN-B 150850 (5,916000%)	3.598.293,27	0,00	920,00000000	3.911,1883369565
73	14/03/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	18.748,30	4.700,60680800	3,9884850000
74	17/03/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	325.166,97	0,00	81.421,71190700	3,9936150000
75	18/03/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.201.288,58	0,00	422.030,23890900	2,8464514370
76	18/03/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.797.382,09	0,00	950.434,48280800	3,9954170000
77	18/03/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	280.561,30	0,00	70.220,78045900	3,9954170000
78	22/03/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	46.721,45	0,00	16.402,33539000	2,8484632760
79	29/03/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	92.946,66	0,00	23.192,98102000	4,0075340000
80	30/03/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	27.946,61	0,00	6.970,23932800	4,0094190000
81	30/03/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.096.126,24	772.213,19129600	4,0094190000
82	30/03/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	196.051,90	48.897,83316600	4,0094190000
83	31/03/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.000.000,00	0,00	9.597.566,36429200	2,6048270000
84	31/03/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	35.720.719,23	13.408.794,16037500	2,6639769992
85	31/03/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.105.106,27	0,00	1.771.327,47852500	4,0111760000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
86	31/03/2022	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.737,02	0,00	0,79476517	3.443,8096920000
Total			85.424.109,58	85.910.026,22		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 14.669.542,77

Value-At-Risk: 2,61%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARAGUATATUBA		2,61	2,61			561.463.376,30	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,65%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150523 (5,900000%)		0,25	0,00	1,95			39.676.621,09	7,07
NTN-B 150535 (5,560000%)		0,25	0,00	1,95			16.074.873,08	2,86
NTN-B 150535 (5,821000%)		0,25	0,00	1,95			18.766.550,03	3,34
NTN-B 150545 (5,710000%)		0,25	0,00	1,95			30.652.299,64	5,46
NTN-B 150545 (5,760000%)		0,25	0,00	1,95			10.190.049,44	1,81
NTN-B 150545 (5,781000%)		0,25	0,00	1,95			10.172.484,03	1,81
NTN-B 150555 (5,815000%)		0,25	0,00	1,95			10.145.792,45	1,81
NTN-B 150822 (6,090000%)		0,12	-0,00	1,97			15.610.079,26	2,78
NTN-B 150822 (6,920000%)		0,12	-0,00	1,97			3.891.193,25	0,69
NTN-B 150824 (5,892000%)		0,25	-0,00	2,00			5.147.283,80	0,92
NTN-B 150830 (5,708000%)		0,25	-0,00	2,00			10.172.662,34	1,81
NTN-B 150840 (5,650000%)		0,12	-0,00	1,97			865.024,10	0,15
NTN-B 150840 (5,770000%)		0,25	-0,00	2,00			10.174.036,57	1,81
NTN-B 150850 (5,713000%)		0,25	-0,00	2,00			10.220.290,81	1,82
NTN-B 150850 (5,815000%)		0,25	-0,00	2,00			10.145.731,73	1,81
NTN-B 150850 (5,916000%)		0,25	-0,00	2,00			3.640.138,85	0,65
Sub-total	0,48	0,18	0,00		1,77	1,76	205.545.110,47	36,61

Artigo 7º I, Alínea b

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,32	0,00	0,43			369.747,60	0,07
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,33	0,00	0,01			10.624.556,70	1,89
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		3,27	0,06	0,09			22.177.544,66	3,95
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,04	0,00	0,03			4.699.893,03	0,84
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		2,41	0,07	0,03			32.913.672,98	5,86
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,11	0,02	0,20			37.187.273,73	6,62
BB PREV RF VII		0,73	0,00	1,95			483.438,39	0,09
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		0,37	0,00	0,36			2.513.872,64	0,45
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,35	0,00	0,36			1.266.490,12	0,23
Sub-total	5,95	1,63	0,15		0,26	2,48	112.236.489,85	19,99

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,07	-0,00	0,06			4.820,09	0,00
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO		2,30	0,05	2,30			26.528.300,68	4,72
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,06	0,00	0,04			32.983.904,27	5,87
Sub-total	3,02	1,03	0,05		0,41	2,17	59.517.025,04	10,60

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR		1,19	-0,00	1,18			1.197.651,99	0,21
Sub-total	85,54	1,19	-0,00		0,33	28,76	1.197.651,99	0,21

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,26%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRANCO F I A SELECTION		10,73	0,08	4,00			5.539.946,24	0,99
BB AÇÕES DIVIDENDOS		8,10	0,02	3,29			1.557.518,51	0,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		13,08	0,13	3,69			6.776.561,19	1,21
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		10,12	0,24	2,49			15.742.673,92	2,80
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		9,15	0,34	0,09			25.808.246,39	4,60
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS		8,28	0,10	1,79			7.909.024,45	1,41
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		7,57	0,16	2,40			14.374.492,83	2,56
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		8,84	0,08	5,12			6.114.795,43	1,09
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		11,78	0,17	6,26			10.473.566,57	1,87
Sub-total	21,11	9,26	1,31		0,24	6,08	94.296.825,53	16,79

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 9,40%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI		9,40	0,68	6,56			47.937.119,31	8,54
Sub-total	22,06	9,40	0,68		0,17	4,58	47.937.119,31	8,54

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,17%

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		9,00	0,01	9,01			1.233.154,51	0,22
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI		8,77	0,02	6,47			1.595.898,60	0,28
Sub-total	21,79	8,05	0,03		-0,11	-1,42	2.829.053,11	0,50

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		10,42	0,39	0,97			37.904.101,00	6,75
Sub-total	25,75	10,42	0,39		-0,20	-4,11	37.904.101,00	6,75