



CARAGUATATUBA
MAIO 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 31.05.2022.

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

70,14%

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 (5,831000%)	2,93	1,46	2,95	19.996.698,46	3,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,900000%)	2,94	1,47	7,52	39.801.862,47	7,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,560000%)	2,83	1,44	5,83	16.134.790,69	2,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,821000%)	2,89	1,46	4,77	18.832.022,03	3,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,710000%)	2,84	1,45	5,45	30.771.459,03	5,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	2,85	1,45	5,24	10.228.700,74	1,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,781000%)	2,86	1,46	5,07	10.210.658,67	1,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,815000%)	2,86	1,46	4,77	10.184.346,65	1,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	2,88	1,32	1,32	9.846.294,58	1,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822 (6,090000%)	2,96	1,48	7,59	16.126.376,54	2,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822 (6,550000%)	4,17	0,10	0,10	6.005.615,03	1,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822 (6,920000%)	2,98	1,55	6,23	4.024.988,74	0,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822 (7,410000%)	4,20	0,06	0,06	11.987.062,33	2,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,892000%)	4,15	1,47	4,71	5.315.904,93	0,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,708000%)	4,08	1,45	5,06	10.502.950,64	1,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,650000%)	2,85	1,44	5,76	893.030,06	0,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,770000%)	4,05	1,45	5,07	10.505.358,57	1,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,713000%)	4,00	1,45	5,54	10.552.201,41	1,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,780000%)	4,03	1,46	1,97	10.196.769,47	1,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,815000%)	4,05	1,46	4,77	10.476.869,04	1,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,916000%)	4,10	1,47	4,48	3.759.531,66	0,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,920000%)	4,11	0,70	0,70	10.069.259,85	1,78
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,57	1,46	7,50	276.422.751,59	48,85

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	0,74	0,94	3,96	377.603,41	0,07	144.009.410,61	0,26
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,74	0,92	3,90	10.797.493,69	1,91	5.107.140.425,93	0,21
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,64	0,76	6,16	15.001.481,82	2,65	1.354.094.140,52	1,11
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,09	0,37	0,57	32.862.546,33	5,81	813.136.848,33	4,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,70	0,85	6,17	38.029.789,17	6,72	11.182.665.779,99	0,34
BB	BB	BB PREV RF VII	1,54	0,65	6,84	496.525,75	0,09	257.494.076,66	0,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,16	0,99	4,45	2.558.423,17	0,45	2.722.459.745,02	0,09
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,07	1,07	4,35	1.291.639,27	0,23	7.455.971.013,11	0,02
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,69	0,70	4,03	101.415.502,61	17,92		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,00	0,92	4,86	695.183,16	0,12	432.189.467,27	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,20	1,08	4,49	9.491.656,58	1,68	12.704.053.440,98	0,07
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,20	1,15	4,74	10.421,90	0,00	2.407.202.176,83	0,00
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	1,07	1,69	7.693.987,88	1,36	9.967.340.356,95	0,08
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			2,25	1,01	4,59	17.891.249,52	3,16		

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	25,98	-0,61	27,83	1.189.854,13	0,21	40.395.435,01	2,95
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			25,98	-0,61	27,83	1.189.854,13	0,21		
Renda Fixa			3,85	1,21	5,17	396.919.357,85	70,14		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL

15,62%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	18,24	2,49	10,78	1.497.293,92	0,26	698.204.129,73	0,21
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	23,43	1,54	2,82	6.233.233,22	1,10	1.136.895.114,73	0,55
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	19,58	3,10	5,02	14.683.539,76	2,59	535.242.726,45	2,74
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	19,75	2,93	5,66	23.896.846,12	4,22	974.253.508,27	2,45
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	19,63	2,96	9,61	7.413.253,97	1,31	725.030.152,57	1,02
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,99	3,11	11,39	13.841.496,13	2,45	982.155.022,61	1,41
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,06	3,78	2,73	5.945.053,93	1,05	2.255.264.253,11	0,26
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	20,63	3,33	6,94	5.293.783,90	0,94	484.305.597,88	1,09
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	23,43	-1,18	2,55	9.574.409,19	1,69	287.575.522,63	3,33
Sub-total Artigo 8º I			18,37	2,50	6,13	88.378.910,14	15,62		
Renda Variável			17,06	2,50	6,13	88.378.910,14	15,62		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,43%

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	16,67	-4,83	-29,50	1.127.615,84	0,20	1.151.663.557,05	0,10
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	19,23	0,26	-11,19	1.482.508,86	0,26	644.015.059,07	0,23
Sub-total Artigo 9º II			18,24	-2,00	-20,15	2.610.124,70	0,46		

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	20,04	-4,44	-28,42	33.752.061,60	5,96	2.266.073.116,40	1,49
Sub-total Artigo 9º III			20,04	-4,44	-28,42	33.752.061,60	5,96		
Investimentos no Exterior			19,59	-4,27	-27,89	36.362.186,30	6,43		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,81%

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	18,36	0,95	-10,63	44.217.491,89	7,81	1.578.611.795,86	2,80
Sub-total Artigo 10º I			18,36	0,95	-10,63	44.217.491,89	7,81		
Investimentos Estruturados			24,23	0,95	-10,63	44.217.491,89	7,81		
Total			5,94	1,01	0,81	565.877.946,18	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	276.422.751,59	48,85	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	101.415.502,61	17,92	10,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	17.891.249,52	3,16	3,00	14,25	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.189.854,13	0,21	0,00	0,25	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	396.919.357,85	70,14					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	88.378.910,14	15,62	0,00	5,50	35,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	88.378.910,14	15,62					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	2.610.124,70	0,46	0,00	2,96	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	33.752.061,60	5,96	0,00	7,04	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	36.362.186,30	6,43					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	44.217.491,89	7,81	0,00	9,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	44.217.491,89	7,81					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	1,46 141,62	7,50 172,71	5,09 180,73			3.684.543,48	12.656.674,04
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,70 67,48	4,03 92,66	4,02 142,86	4,69 91,16	2,86 36,25	700.725,20	4.193.547,72
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,01 98,37	4,59 105,60	4,12 146,34			339.116,53	2.233.534,40
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,61 -59,21	27,83 640,61	27,92 991,84			-7.308,10	259.026,76
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	2,50 -0,72	6,13 -0,10	-0,57 1,01			2.155.410,68	5.103.092,64
Artigo 9º II % do CDI	-2,00 -194,11	-20,15 -463,81	-9,05 -321,42	-17,56 -341,55		-53.303,06	-658.560,62
Artigo 9º III % do CDI	-4,44 -430,35	-28,42 -654,28	-14,62 -519,25	-27,20 -529,17	-14,82 -187,70	-1.567.108,51	-13.401.843,29
Artigo 10º I % do CDI	0,95 91,81	-10,63 -244,67	-3,53 -125,53			414.636,08	-5.258.518,07
CARAGUATATUBA (Total)						5.666.712,30	5.126.953,58

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 (5,831000%)	20.290.439,71	0,00	0,00	586.793,39	19.996.698,46	293.052,14	585.864,31
NTN-B 150523 (5,900000%)	40.384.997,73	0,00	0,00	1.168.678,35	39.801.862,47	585.543,09	2.858.196,08
NTN-B 150535 (5,560000%)	16.357.899,24	0,00	0,00	455.784,56	16.134.790,69	232.676,01	911.522,21
NTN-B 150535 (5,821000%)	19.100.535,30	0,00	0,00	544.253,50	18.832.022,03	275.740,23	879.683,04
NTN-B 150545 (5,710000%)	31.195.349,82	0,00	0,00	871.483,45	30.771.459,03	447.592,66	1.632.375,76
NTN-B 150545 (5,760000%)	10.370.950,88	0,00	0,00	291.468,38	10.228.700,74	149.218,24	522.553,60
NTN-B 150545 (5,781000%)	10.353.223,22	0,00	0,00	291.702,11	10.210.658,67	149.137,56	505.689,60
NTN-B 150555 (5,815000%)	10.326.311,49	0,00	0,00	291.000,90	10.184.346,65	149.036,06	475.467,45
NTN-B 150555 (5,850000%)	0,00	9.999.060,06	0,00	282.820,16	9.846.294,58	130.054,68	130.054,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150822 (6,090000%)	15.890.926,96	0,00	0,00	0,00	16.126.376,54	235.449,58	1.145.908,87
NTN-B 150822 (6,550000%)	0,00	5.999.379,06	0,00	0,00	6.005.615,03	6.235,97	6.235,97
NTN-B 150822 (6,920000%)	3.963.530,42	0,00	0,00	0,00	4.024.988,74	61.458,32	236.386,47
NTN-B 150822 (7,410000%)	0,00	11.980.454,50	0,00	0,00	11.987.062,33	6.607,83	6.607,83
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.239.149,42	0,00	0,00	0,00	5.315.904,93	76.755,51	239.120,07
NTN-B 150830 (5,708000%)	10.352.863,39	0,00	0,00	0,00	10.502.950,64	150.087,25	505.495,98
NTN-B 150840 (5,650000%)	880.311,19	0,00	0,00	0,00	893.030,06	12.718,87	48.692,49
NTN-B 150840 (5,770000%)	10.354.715,98	0,00	0,00	0,00	10.505.358,57	150.642,59	507.068,63
NTN-B 150850 (5,713000%)	10.401.377,25	0,00	0,00	0,00	10.552.201,41	150.824,16	553.588,60
NTN-B 150850 (5,780000%)	10.050.464,34	0,00	0,00	0,00	10.196.769,47	146.305,13	197.454,53
NTN-B 150850 (5,815000%)	10.326.249,99	0,00	0,00	0,00	10.476.869,04	150.619,05	477.039,21
NTN-B 150850 (5,916000%)	3.705.173,38	0,00	0,00	0,00	3.759.531,66	54.358,28	161.238,39
NTN-B 150850 (5,920000%)	0,00	9.998.829,58	0,00	0,00	10.069.259,85	70.430,27	70.430,27
					276.422.751,59	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 IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	10.698.893,34	0,00	0,00	0,00	10.797.493,69	98.600,35	422.064,50
BB PREV RF VII	493.329,20	0,00	0,00	0,00	496.525,75	3.196,55	31.959,77
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	37.708.072,90	0,00	0,00	0,00	38.029.789,17	321.716,27	1.291.205,33
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	32.740.434,14	0,00	0,00	0,00	32.862.546,33	122.112,19	186.886,82
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1.278.027,92	0,00	0,00	0,00	1.291.639,27	13.611,35	677.263,93
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	2.533.385,92	0,00	0,00	0,00	2.558.423,17	25.037,25	109.112,71
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	373.265,18	833,60	0,00	0,00	377.603,41	3.504,63	14.319,66
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	14.888.535,21	0,00	0,00	0,00	15.001.481,82	112.946,61	472.000,61
					101.415.502,61	0,00	0,00

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	13.953.085,93	1.614.121,08	-7.998.829,59	0,00	7.693.987,88	125.610,46	206.607,89
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	27.419.033,28	9.310.478,59	-27.448.952,21	0,00	9.491.656,58	211.096,92	977.877,79
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	7.595,03	2.737,02	0,00	0,00	10.421,90	89,85	74.515,46
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6.692.863,86	0,00	-6.000.000,00	0,00	695.183,16	2.319,30	974.533,26
					17.891.249,52	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	1.197.162,23	0,00	0,00	0,00	1.189.854,13	-7.308,10	259.026,76
					1.189.854,13	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	1.460.952,26	0,00	0,00	0,00	1.497.293,92	36.341,66	145.715,99
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	23.217.255,38	0,00	0,00	0,00	23.896.846,12	679.590,74	1.279.497,25
BRADESCO F I A SELECTION	5.122.967,10	0,00	0,00	0,00	5.293.783,90	170.816,80	343.608,20
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	6.138.469,04	0,00	0,00	0,00	6.233.233,22	94.764,18	170.992,51
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	7.199.902,89	0,00	0,00	0,00	7.413.253,97	213.351,08	649.829,23
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	13.424.507,79	0,00	0,00	0,00	13.841.496,13	416.988,34	1.415.790,68
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	5.728.670,52	0,00	0,00	0,00	5.945.053,93	216.383,41	157.954,18
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	14.241.627,95	0,00	0,00	0,00	14.683.539,76	441.911,81	701.268,01
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	9.689.146,53	0,00	0,00	0,00	9.574.409,19	-114.737,34	238.436,59
					88.378.910,14	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	1.184.808,51	0,00	0,00	0,00	1.127.615,84	-57.192,67	-471.814,23
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	1.478.619,25	0,00	0,00	0,00	1.482.508,86	3.889,61	-186.746,39

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					2.610.124,70	0,00	0,00

Artigo 9º III (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	35.319.170,11	0,00	0,00	0,00	33.752.061,60	-1.567.108,51	-13.401.843,29
					33.752.061,60	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	43.802.855,81	0,00	0,00	0,00	44.217.491,89	414.636,08	-5.258.518,07
					44.217.491,89	0,00	0,00

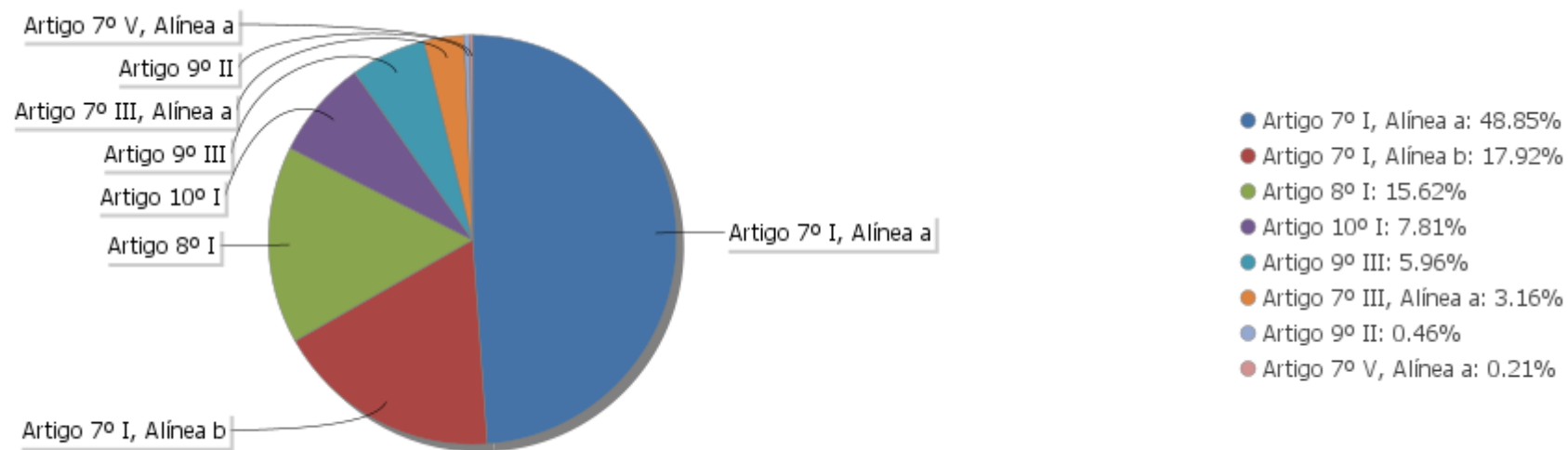
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

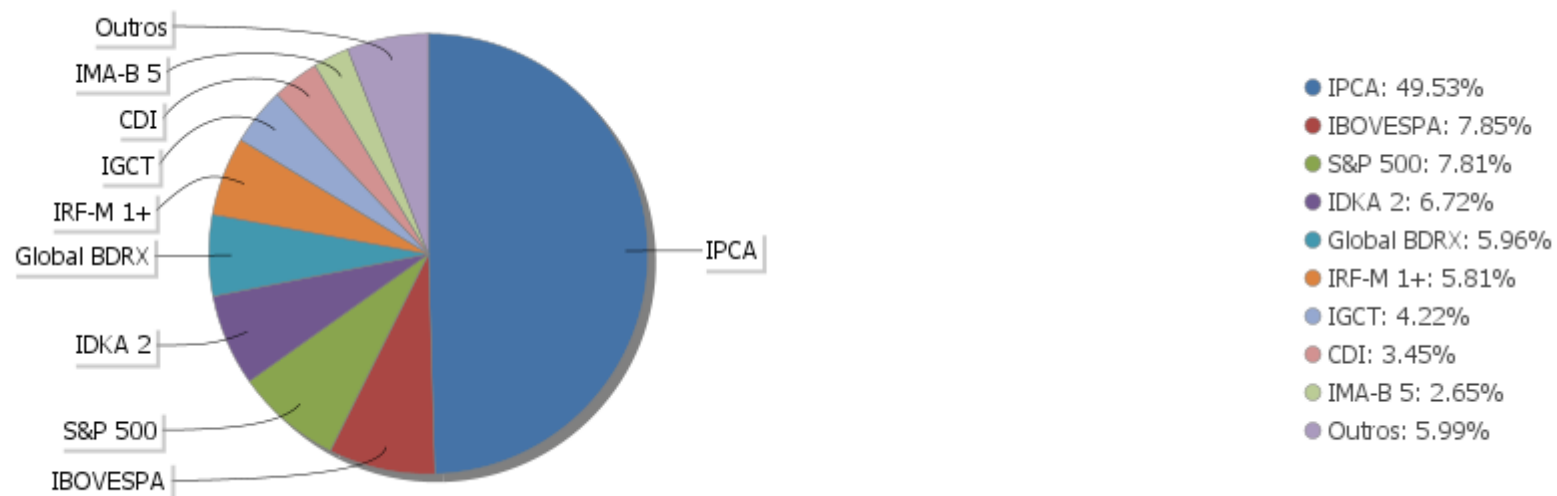
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	250.994.601,49	44,35	250.994.601,49	44,35
de 31 a 365 dias	136.403.196,67	24,10	387.397.798,16	68,46
acima de 365 dias	178.480.148,02	31,54	565.877.946,18	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

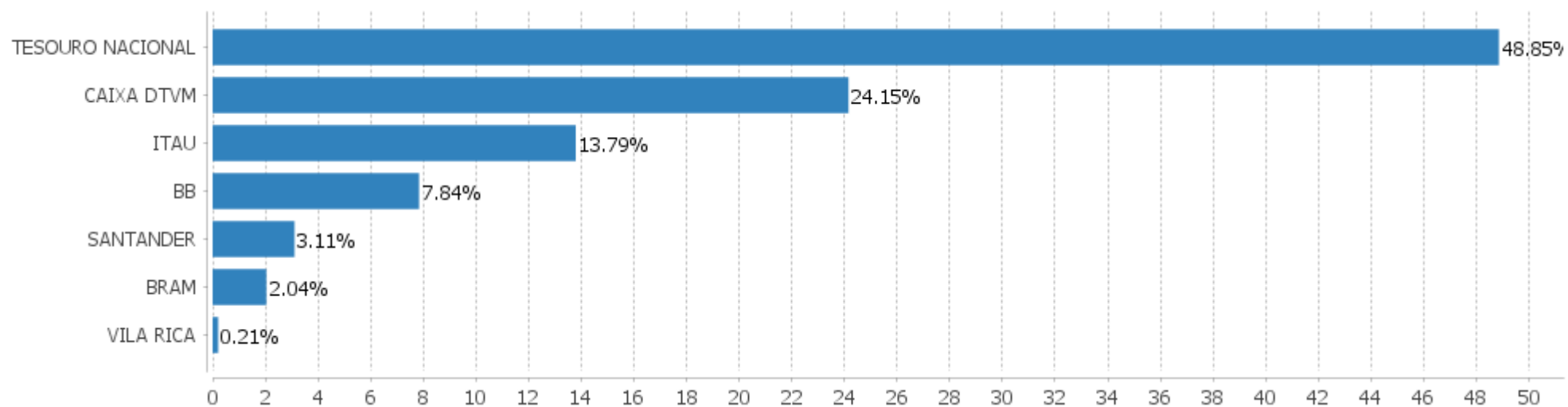


Alocação Por Estratégia



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	-1,70	1,01								0,81
IPCA + 4,99%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,90								6,89
p.p. indexador	-1,48	-1,65	0,30	-3,13	0,11								-6,08
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

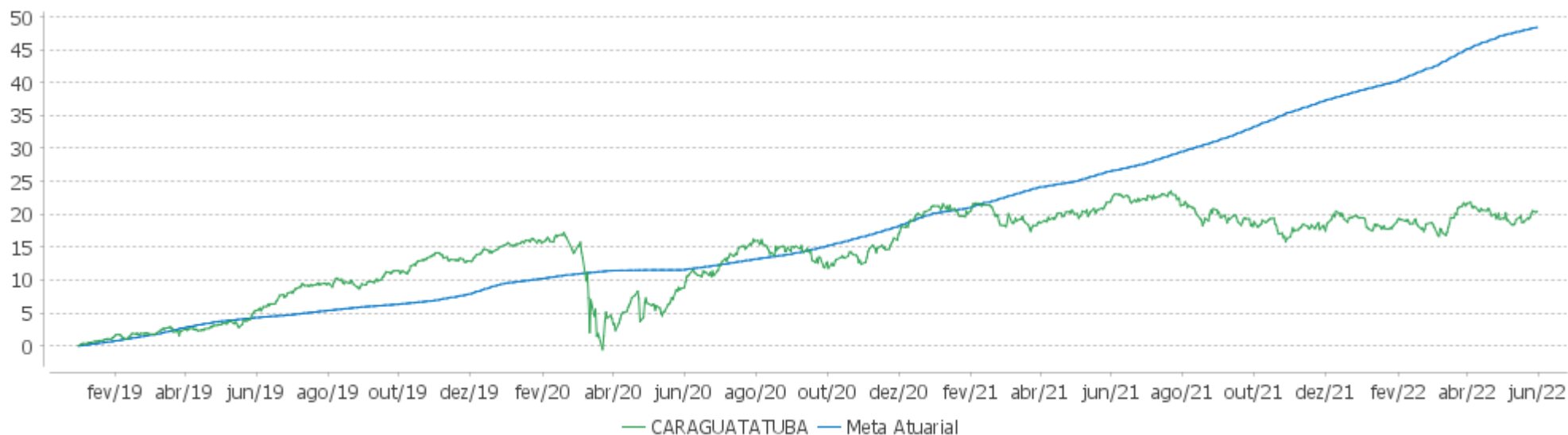
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

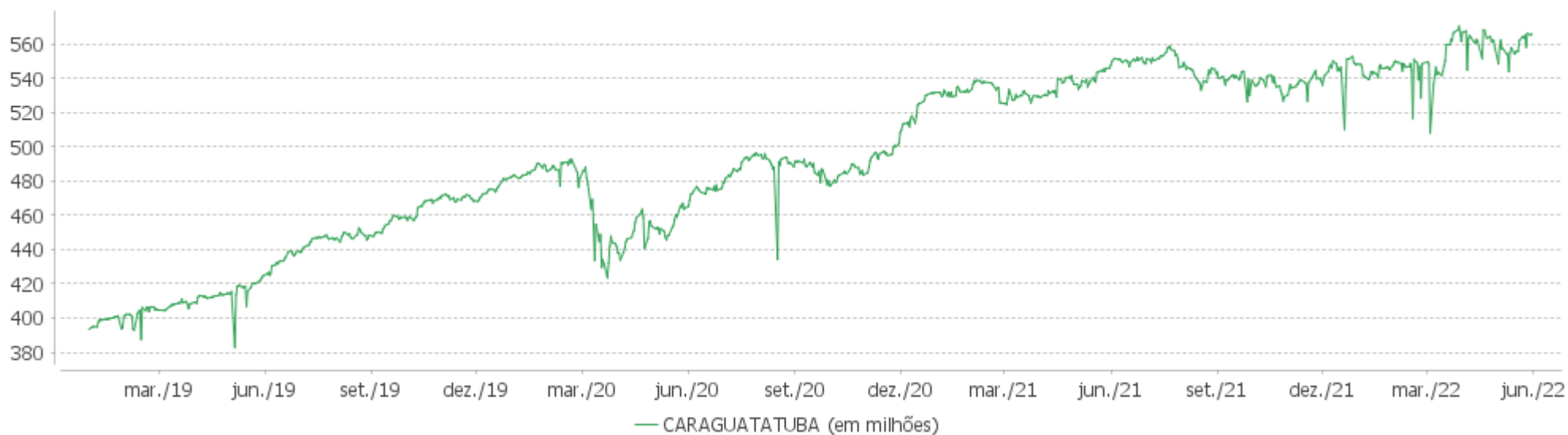
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	18	43,90	03 meses	1,63	4,44	-2,82	6,63
Meses abaixo - Meta Atuarial	23	56,10	06 meses	2,15	8,20	-6,05	5,95
			12 meses	-1,14	17,62	-18,76	5,94
			24 meses	10,80	34,33	-23,53	6,06
			36 meses	14,35	44,96	-30,61	8,67
			Desde 31/12/2018	20,44	51,79	-31,35	8,19
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	4,43	2020-12					
Menor rentabilidade da Carteira	-8,82	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

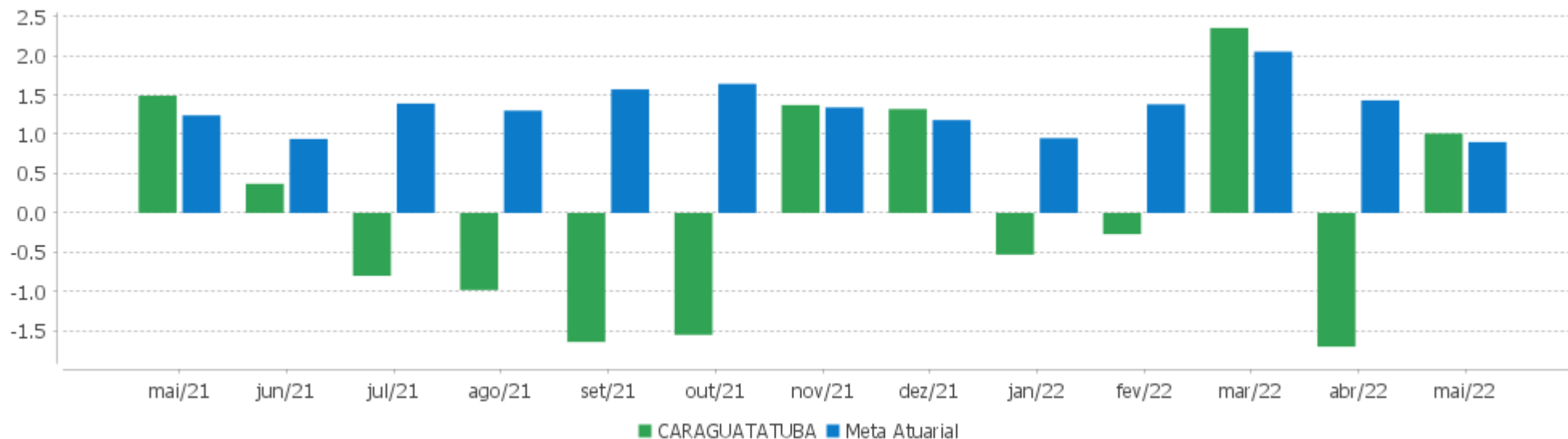


Patrimônio Líquido



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	1,15 111,34	4,75 109,27	2,88 102,19	5,59 108,68	8,90 112,72	11,44 111,74	16,34 104,59
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,92 -0,05	4,86 0,13	5,22 0,29	4,95 -0,01	4,70 0,11	13,70 -0,48	24,04 2,23
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,07 103,41	4,47 102,93	2,84 100,83	5,31 103,21	8,23 104,30	10,70 104,45	15,42 98,68
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,08 104,41	4,49 103,32	2,83 100,55	5,28 102,65	8,37 106,04	10,69 104,34	15,39 98,47
NTN-B 150523 (5,831000%) Var. IPCA p.p.	1,46 0,99	7,49 2,70	5,09 1,91	8,87 3,32	15,20 3,47	23,51 2,78	25,85 2,85
NTN-B 150545 (5,781000%) Var. IPCA p.p.	1,46 0,99	7,47 2,68	5,07 1,89	8,84 3,29	15,23 3,50	23,66 2,93	26,12 3,12
NTN-B 150822 (6,550000%) Var. IPCA p.p.	1,52 1,05	4,68 -0,10	5,26 2,08	6,09 0,54	12,62 0,89	21,47 0,74	24,48 1,48
NTN-B 150535 (5,560000%) Var. IPCA p.p.	1,44 0,97	7,37 2,59	5,02 1,84	8,73 3,18	15,03 3,30	23,28 2,55	25,56 2,57
NTN-B 150840 (5,650000%) Var. IPCA p.p.	1,44 0,97	7,41 2,63	5,04 1,86	8,77 3,22	15,13 3,40	23,48 2,75	25,86 2,86
NTN-B 150824 (5,892000%) Var. IPCA p.p.	1,47 1,00	4,44 -0,35	5,10 1,92	5,78 0,23	11,97 0,24	20,12 -0,62	22,45 -0,55
NTN-B 150555 (5,850000%) Var. IPCA p.p.	1,43 0,96	7,46 2,68	5,06 1,88	8,84 3,29	15,26 3,53	23,73 3,00	26,23 3,23
NTN-B 150523 (5,900000%) Var. IPCA p.p.	1,47 1,00	7,52 2,73	5,10 1,92	8,90 3,35	15,28 3,54	23,66 2,93	26,06 3,06
NTN-B 150822 (6,920000%) Var. IPCA p.p.	1,55 1,08	7,94 3,15	5,36 2,18	9,42 3,87	16,35 4,62	25,89 5,15	29,38 6,38
NTN-B 150850 (5,916000%) Var. IPCA p.p.	1,47 1,00	4,48 -0,31	5,11 1,93	5,82 0,27	12,06 0,33	20,31 -0,42	22,74 -0,26
NTN-B 150850 (5,713000%) Var. IPCA p.p.	1,45 0,98	4,47 -0,31	5,06 1,88	5,80 0,25	12,02 0,29	20,22 -0,51	22,61 -0,39
NTN-B 150850 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	1,46 0,99	4,48 -0,31	5,08 1,90	5,81 0,26	12,04 0,31	20,26 -0,47	22,67 -0,32
NTN-B 150545 (5,760000%)	1,45	7,46	5,07	8,83	15,22	23,64	26,09

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.	0,98	2,67	1,89	3,28	3,49	2,91	3,09
NTN-B 150830 (5,708000%) Var. IPCA p.p.	1,45 0,98	4,41 -0,37	5,06 1,88	5,74 0,19	11,89 0,16	19,94 -0,79	22,19 -0,81
NTN-B 150840 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	1,45 0,98	4,46 -0,33	5,07 1,89	5,79 0,24	11,99 0,26	20,16 -0,57	22,52 -0,48
NTN-B 150555 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	1,46 0,99	7,48 2,70	5,08 1,90	8,86 3,31	15,27 3,54	23,74 3,01	26,23 3,23
NTN-B 150850 (5,920000%) Var. IPCA p.p.	1,44 0,97	4,45 -0,34	5,08 1,90	5,80 0,25	12,04 0,31	20,28 -0,45	22,71 -0,29
NTN-B 150535 (5,821000%) Var. IPCA p.p.	1,46 0,99	7,48 2,70	5,08 1,90	8,86 3,31	15,24 3,51	23,64 2,91	26,06 3,06
NTN-B 150850 (5,780000%) Var. IPCA p.p.	1,46 0,99	4,48 -0,31	5,07 1,89	5,81 0,26	12,04 0,31	20,25 -0,48	22,65 -0,35
NTN-B 150822 (6,090000%) Var. IPCA p.p.	1,48 1,01	7,59 2,81	5,15 1,97	9,00 3,45	15,47 3,74	24,07 3,33	26,66 3,67
NTN-B 150545 (5,710000%) Var. IPCA p.p.	1,45 0,98	7,44 2,65	5,06 1,88	8,80 3,25	15,19 3,45	23,59 2,86	26,02 3,02
NTN-B 150822 (7,410000%) Var. IPCA p.p.	1,59 1,12	5,02 0,23	5,48 2,30	6,51 0,96	13,49 1,76	23,30 2,57	27,21 4,21
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	0,37 -0,02	0,57 -0,08	0,66 -0,01	2,85 -0,10	-1,22 -0,33	-1,68 -0,51	11,49 -0,82
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,94 -0,01	3,96 -0,06	2,52 -0,08	4,83 -0,10	6,27 -0,15	8,23 -0,44	14,81 -0,74
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,76 -0,02	6,16 -0,10	4,95 -0,06	6,97 -0,12	9,31 -0,25	17,10 -0,55	27,98 -0,79
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,65 -0,32	6,84 2,12	5,06 0,13	7,47 2,50	11,81 7,22	19,48 5,30	27,02 5,21
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,07 0,60	4,35 -0,44	2,83 -0,35	5,21 -0,34	3,49 -8,24	7,06 -13,67	19,89 -3,10
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,92 -0,03	3,90 -0,12	2,51 -0,10	4,78 -0,16	6,14 -0,29	7,98 -0,69	14,50 -1,04
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,85 0,00	6,17 -0,17	4,95 -0,02	6,94 -0,29	9,11 -0,13	17,79 -0,70	27,49 -1,70
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,99 0,52	4,45 -0,33	2,96 -0,22	5,35 -0,20	8,41 -3,32	10,30 -10,43	18,95 -4,05
FIDC ITALIA SENIOR	-0,61	27,83	27,92	28,43	37,30	1.830,52	2.407,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-59,21	640,61	991,84	553,10	472,52	17.872,62	15.405,07
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	3,33 0,11	6,94 0,71	2,14 3,73	9,08 -0,17	-14,92 -3,15	22,53 -4,87	0,89 -13,86
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	2,96 -0,26	9,61 3,38	-0,84 0,74	9,67 0,41	-12,42 -0,64	23,72 -3,68	27,15 12,39
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	3,78 0,56	2,73 -3,50	2,61 4,20	3,73 -5,53	-16,42 -4,65	25,66 -1,74	17,86 3,10
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	3,10 -0,12	5,02 -1,21	-2,40 -0,82	6,99 -2,27	-16,98 -5,20	16,47 -10,92	10,39 -4,37
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	3,11 -1,16	11,39 -2,76	3,10 -5,64	11,03 -4,95	-5,63 -8,04	29,12 -12,06	27,60 -5,81
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-1,18 -4,40	2,55 -3,67	-4,06 -2,47	0,92 -8,34			
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	2,93 -0,13	5,66 -0,56	-1,76 -0,25	9,29 -0,62	-13,66 -0,85	26,13 -2,76	15,98 -3,44
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	2,49 -0,73	10,78 4,55	3,33 4,91	12,58 3,33	-10,92 0,86	18,33 -9,07	-0,08 -14,84
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	1,54 3,37	2,82 6,84	0,34 2,45	6,82 7,19	-17,62 9,25	16,89 1,53	20,01 6,60
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	-4,83 -468,19	-29,50 -679,09	-14,87 -528,38	-28,87 -561,68	-21,11 -267,43	8,49 82,91	63,03 403,31
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI Var. MSCI ACWI p.p.	0,26 4,26	-11,19 15,53	-4,05 9,96	-6,21 18,18	-0,28 16,79		
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-4,44 -0,12	-28,42 -0,24	-14,62 -0,09	-27,20 -0,25	-14,82 -1,78	13,58 -3,06	74,74 -4,50
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI Var. S&P 500 p.p.	0,95 4,81	-10,63 15,90	-3,53 9,75	-5,67 18,19	4,89 16,06	44,06 25,77	59,77 -20,41
CARAGUATATUBA Var. IPCA + 4,99% p.p.	1,01 0,11	0,81 -6,08	1,63 -2,82	2,15 -6,01	-1,14 -18,45	10,80 -22,26	14,35 -27,94
CDI	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63
IBOVESPA	3,22	6,23	-1,58	9,26	-11,78	27,40	14,76
INPC + 6,00%	0,96	7,49	4,75	8,85	18,61	36,88	48,04
IPCA + 6,00%	0,98	7,31	4,69	8,67	18,43	35,62	46,43

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 IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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 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	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	
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	D+0	D+0	D+21 du	D+24 du		
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	0,95	4,02	2,61	4,93	6,43	8,67	15,54	23,85	33,97
IRF-M 1+	0,39	0,65	0,67	2,95	-0,89	-1,17	12,32	30,13	44,56
IRF-M TOTAL	0,58	1,82	1,31	3,74	1,60	2,33	13,90	29,08	42,46
IMA-B 5	0,78	6,25	5,02	7,09	9,55	17,65	28,78	45,80	60,12
IMA-B 5+	1,16	3,17	4,84	2,82	-0,25	10,41	15,02	52,46	63,45
IMA-B TOTAL	0,96	4,73	4,93	4,96	4,59	14,18	21,81	50,71	63,86
IMA-GERAL TOTAL	0,92	4,04	3,06	4,94	5,26	9,68	18,01	34,24	46,62
IDKA 2	0,85	6,35	4,97	7,23	9,24	18,49	29,19	44,76	60,19
IDKA 20	1,21	0,35	3,98	-1,94	-10,01	4,21	1,84	54,09	61,61
CDI	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63	22,99	32,44

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,22	6,23	-1,58	9,26	-11,78	27,40	14,76	45,08	77,56
IBRX 100	3,23	6,61	-1,68	9,95	-12,43	29,27	17,73	50,94	83,12
IBRX 50	3,30	6,74	-2,55	10,76	-11,91	31,55	16,59	45,38	78,31
SMALL CAP	-1,82	-4,02	-2,10	-0,37	-26,87	15,36	13,41	44,72	71,86
IFIX	0,26	0,56	2,89	9,39	0,14	6,12	10,49	27,39	37,13
Índice Consumo - ICON	-3,02		-12,01	-12,30	-36,86	-19,27	-13,06	7,05	10,44
Índice Dividendos - IDIV	4,26	14,16	8,74	15,99	2,41	41,18	33,41	82,88	105,54

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	0,47	4,78	3,18	5,55	11,73	20,73	23,00	28,73	32,40
INPC	0,45	4,96	3,23	5,73	11,90	21,85	24,35	30,30	32,59
IGPM	0,52	7,54	3,71	8,47	10,72	51,73	61,61	73,96	81,38
SELIC	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63	23,00	32,46

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-3,86	-26,53	-13,29	-23,87	-11,17	18,29	80,18	91,96	149,78
MSCI ACWI	-3,99	-26,71	-14,01	-24,39	-17,07	11,67	59,19	61,99	105,20

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,81	6,48	4,20	7,64	16,20	30,56	38,31	50,52	60,94
IPCA + 5,00%	0,90	6,90	4,45	8,16	17,32	33,08	42,33	56,38	68,79
IPCA + 5,50%	0,94	7,10	4,57	8,41	17,88	34,35	44,37	59,37	72,83
IPCA + 5,89%	0,97	7,26	4,67	8,61	18,31	35,34	45,97	61,73	76,03
IPCA + 6,00%	0,98	7,31	4,69	8,67	18,43	35,62	46,43	62,40	76,94
INPC + 4,00%	0,79	6,66	4,25	7,82	16,37	31,77	39,83	52,36	61,17
INPC + 6,00%	0,96	7,49	4,75	8,85	18,61	36,88	48,04	64,38	77,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
118	02/05/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	136.912,34	0,00	33.846,14814100	4,0451380000
119	02/05/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	9.999.060,05	2.471.871,18294100	4,0451380000
120	03/05/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	5.625,64	1.390,09030200	4,0469600000
121	03/05/2022	NTN-B 150555 (5,850000%)	9.999.060,06	0,00	2.420,00000000	4.131,8430000000
122	05/05/2022	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	833,60	0,00	23,27655680	35,8128570000
123	06/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	235.747,24	0,00	94.491,86172300	2,4948946470
124	10/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.379,03	0,00	3.355,00277600	2,4974733430
125	10/05/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	53.000,00	13.062,33661300	4,0574670000
126	11/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.998.829,59	1.600.370,96939300	2,4986891580
127	11/05/2022	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	0,00	6.000.000,00	506.078,97851669	11,8558570000
128	12/05/2022	NTN-B 150850 (5,920000%)	9.998.829,58	0,00	2.466,00000000	4.054,6754176805
129	13/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.784,78	0,00	3.512,35703100	2,5011067840
130	13/05/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	26.493,25	0,00	6.519,82173900	4,0634930000
131	16/05/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.000,00	245,98564400	4,0652770000
132	18/05/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.783.984,80	0,00	1.175.655,01689700	4,0692080000
133	19/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	46.721,45	0,00	18.642,73790200	2,5061474470
134	20/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.201.288,58	0,00	479.102,41429100	2,5073732550
135	20/05/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.961.633,63	0,00	972.619,91865200	4,0731570000
136	20/05/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	280.561,30	0,00	68.880,55137500	4,0731570000
137	26/05/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	27.946,61	0,00	6.848,08492500	4,0809380000
138	26/05/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.103.295,39	760.436,78917000	4,0809380000
139	26/05/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	181.937,57	44.582,29197900	4,0809380000
140	26/05/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	5.999.379,06	1.470.098,06538500	4,0809380000
141	27/05/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	92.946,66	0,00	22.764,98029900	4,0828790000
142	27/05/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	12.000,00	2.939,10251700	4,0828790000
143	27/05/2022	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.737,02	0,00	0,78037416	3.507,3175790000
144	27/05/2022	NTN-B 150822 (6,550000%)	5.999.379,06	0,00	1.491,00000000	4.023,7284104628
145	30/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.000.000,00	1.590.701,37377900	2,5146140350

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
146	30/05/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	8.093.654,50	1.981.390,80281088	4,0848350000
147	30/05/2022	NTN-B 150822 (7,410000%)	11.980.454,50	0,00	2.981,000000000	4.018,9381080174
148	31/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	113.200,00	0,00	44.994,31958200	2,5158731380
Total			48.905.893,49	41.447.781,80		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 15.444.671,28

Value-At-Risk: 2,73%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARAGUATATUBA		2,73	2,73			565.877.946,18	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,35%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150523 (5,831000%)		0,26	-0,00	0,27			19.996.698,46	3,53
NTN-B 150523 (5,900000%)		0,26	-0,00	0,27			39.801.862,47	7,03
NTN-B 150535 (5,560000%)		0,26	-0,00	0,27			16.134.790,69	2,85
NTN-B 150535 (5,821000%)		0,26	-0,00	0,27			18.832.022,03	3,33
NTN-B 150545 (5,710000%)		0,26	-0,00	0,27			30.771.459,03	5,44
NTN-B 150545 (5,760000%)		0,26	-0,00	0,27			10.228.700,74	1,81
NTN-B 150545 (5,781000%)		0,26	-0,00	0,27			10.210.658,67	1,80
NTN-B 150555 (5,815000%)		0,26	-0,00	0,27			10.184.346,65	1,80
NTN-B 150555 (5,850000%)		0,27	0,00	0,27			9.846.294,58	1,74
NTN-B 150822 (6,090000%)		0,26	-0,00	0,27			16.126.376,54	2,85
NTN-B 150822 (6,550000%)		0,40	-0,00	0,42			6.005.615,03	1,06
NTN-B 150822 (6,920000%)		0,26	-0,00	0,27			4.024.988,74	0,71
NTN-B 150822 (7,410000%)		0,40	-0,00	0,42			11.987.062,33	2,12
NTN-B 150824 (5,892000%)		0,40	-0,00	0,42			5.315.904,93	0,94
NTN-B 150830 (5,708000%)		0,40	-0,00	0,42			10.502.950,64	1,86
NTN-B 150840 (5,650000%)		0,26	-0,00	0,27			893.030,06	0,16
NTN-B 150840 (5,770000%)		0,39	-0,00	0,41			10.505.358,57	1,86
NTN-B 150850 (5,713000%)		0,39	-0,00	0,41			10.552.201,41	1,86
NTN-B 150850 (5,780000%)		0,39	-0,00	0,41			10.196.769,47	1,80
NTN-B 150850 (5,815000%)		0,39	-0,00	0,41			10.476.869,04	1,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150850 (5,916000%)		0,40	-0,00	0,42			3.759.531,66	0,66
NTN-B 150850 (5,920000%)		0,40	-0,00	0,42			10.069.259,85	1,78
Sub-total	0,44	0,24	-0,01		0,96	1,46	276.422.751,59	48,85

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,30	0,00	0,38			377.603,41	0,07
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,31	0,00	0,01			10.797.493,69	1,91
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,09	0,01	0,01			15.001.481,82	2,65
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		2,33	0,06	0,03			32.862.546,33	5,81
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,35	0,03	0,33			38.029.789,17	6,72
BB PREV RF VII		0,69	0,00	2,06			496.525,75	0,09
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		0,29	0,00	0,30			2.558.423,17	0,45
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,54	0,00	0,55			1.291.639,27	0,23
Sub-total	2,29	1,30	0,11		-0,15	0,70	101.415.502,61	17,92

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO		2,36	0,00	0,39			695.183,16	0,12
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,04	0,00	0,03			9.491.656,58	1,68
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,07	-0,00	0,07			10.421,90	0,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,04	0,00	0,03			7.693.987,88	1,36
Sub-total	0,52	0,10	0,00		-0,03	1,01	17.891.249,52	3,16

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR		1,13	-0,00	1,12			1.189.854,13	0,21
Sub-total	2,07	1,13	-0,00		-0,79	-0,61	1.189.854,13	0,21

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,19%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS		8,80	0,02	3,90			1.497.293,92	0,26
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		10,69	0,10	4,40			6.233.233,22	1,10
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		9,61	0,21	1,94			14.683.539,76	2,59
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		9,86	0,34	0,17			23.896.846,12	4,22
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS		9,22	0,10	1,65			7.413.253,97	1,31
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		8,34	0,16	2,61			13.841.496,13	2,45
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		9,40	0,08	5,57			5.945.053,93	1,05
BRADESCO F I A SELECTION		9,65	0,07	3,11			5.293.783,90	0,94
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		10,36	0,14	5,34			9.574.409,19	1,69
Sub-total	19,26	9,19	1,23		0,08	2,50	88.378.910,14	15,62

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 13,19%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI		13,19	0,94	8,19			44.217.491,89	7,81
Sub-total	30,58	13,19	0,94		-0,00	0,95	44.217.491,89	7,81

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,54%

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		9,64	0,01	9,64			1.127.615,84	0,20
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI		12,04	0,02	10,95			1.482.508,86	0,26
Sub-total	24,08	9,86	0,03		-0,13	-2,00	2.610.124,70	0,46

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		10,80	0,42	1,87			33.752.061,60	5,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	24,56	10,80	0,42		-0,22	-4,44	33.752.061,60	5,96