



**LDB**  
EMPRESAS

**CARAGUATATUBA**  
JULHO 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 29.07.2022.

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 70,96%

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%)	2,95	0,48	4,47	20.293.173,45	3,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,900000%)	2,95	0,49	9,12	40.396.389,28	7,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,560000%)	2,84	0,46	7,35	16.367.031,69	2,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,821000%)	2,91	0,48	6,32	19.110.942,16	3,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,710000%)	2,85	0,47	7,00	31.221.755,35	5,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	2,87	0,47	6,79	10.379.209,09	1,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,781000%)	2,87	0,48	6,62	10.361.238,51	1,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,815000%)	2,87	0,48	6,32	10.335.091,11	1,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	2,89	0,48	2,82	9.992.614,49	1,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822 (10,250000%)	4,29	0,82	1,71	32.546.335,76	5,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822 (6,090000%)	2,98	0,50	9,23	16.372.145,85	2,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822 (6,550000%)	4,18	0,54	1,70	6.101.558,52	1,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822 (6,920000%)	3,00	0,57	7,99	4.091.645,42	0,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822 (7,410000%)	4,21	0,60	1,79	12.194.783,04	2,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,892000%)	4,16	0,48	6,27	5.395.247,04	0,94

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,708000%)	4,09	0,47	6,59	10.656.605,53	1,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,650000%)	2,86	0,47	7,30	906.012,50	0,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,770000%)	4,06	0,47	6,62	10.660.103,10	1,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,713000%)	4,01	0,47	7,08	10.706.666,28	1,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,780000%)	4,04	0,48	3,48	10.347.126,67	1,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,815000%)	4,06	0,48	6,32	10.631.946,89	1,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,916000%)	4,11	0,49	6,04	3.815.782,69	0,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,920000%)	4,12	0,49	2,21	10.220.024,68	1,78
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,59</b>	<b>0,52</b>	<b>9,16</b>	<b>313.103.429,10</b>	<b>54,51</b>

## 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	1,00	5,97	386.941,90	0,07	142.719.815,45	0,27
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,75	1,04	5,95	11.010.184,12	1,92	4.977.668.769,91	0,22
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,62	-0,01	6,49	15.048.562,29	2,62	1.121.658.731,38	1,34
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,76	-0,29	6,10	38.003.633,43	6,62	10.530.457.571,28	0,36
BB	BB	BB PREV RF VII	1,73	0,82	8,06	502.173,83	0,09	260.423.123,57	0,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	1,17	0,80	6,12	2.599.195,60	0,45	2.528.329.321,31	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,02	0,79	5,41	1.304.792,42	0,23	6.217.671.822,00	0,02
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>4,49</b>	<b>0,06</b>	<b>4,28</b>	<b>68.855.483,59</b>	<b>11,99</b>		

## 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	6,04	-1,10	3,03	683.023,78	0,12	410.715.265,69	0,17
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,19	1,01	6,66	12.826.610,19	2,23	12.954.528.143,84	0,10
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,19	1,05	7,00	656.769,37	0,11	2.757.466.423,76	0,02
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	1,04	3,80	10.883.485,65	1,89	10.247.937.610,00	0,11
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>1,89</b>	<b>0,95</b>	<b>6,63</b>	<b>25.049.888,99</b>	<b>4,36</b>		

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	26,03	-0,11	28,23	557.561,72	0,10	40.395.435,01	1,38
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>			<b>26,03</b>	<b>-0,11</b>	<b>28,23</b>	<b>557.561,72</b>	<b>0,10</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>3,57</b>	<b>0,47</b>	<b>6,55</b>	<b>407.566.363,40</b>	<b>70,96</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

14,36%

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	18,73	2,86	2,75	1.388.786,27	0,24	624.042.325,57	0,22
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	24,80	5,81	-7,79	5.589.898,63	0,97	978.721.458,42	0,57
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	20,10	5,09	-0,85	13.862.733,62	2,41	457.167.843,62	3,03
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,35	4,42	-2,68	22.011.308,00	3,83	839.233.210,18	2,62
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	19,94	4,88	2,53	6.934.865,36	1,21	657.270.090,12	1,06
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,06	3,36	4,73	13.013.835,08	2,27	911.664.271,76	1,43
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,86	6,01	-3,20	5.602.115,77	0,98	1.957.830.490,61	0,29
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	21,19	6,30	0,97	4.998.366,04	0,87	466.800.295,62	1,07
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	22,49	6,36	-2,56	9.097.277,63	1,58	248.637.980,11	3,66
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>18,17</b>	<b>4,90</b>	<b>-0,93</b>	<b>82.499.186,40</b>	<b>14,36</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>17,79</b>	<b>4,90</b>	<b>-0,93</b>	<b>82.499.186,40</b>	<b>14,36</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,86%

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	18,13	6,78	-25,12	1.197.682,42	0,21	1.161.561.395,32	0,10
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	20,69	7,94	-10,23	1.498.522,48	0,26	558.583.958,06	0,27
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>18,36</b>	<b>7,42</b>	<b>-17,51</b>	<b>2.696.204,90</b>	<b>0,47</b>		

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	21,74	7,88	-22,14	36.712.014,61	6,39	2.340.707.282,75	1,57
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>21,74</b>	<b>7,88</b>	<b>-22,14</b>	<b>36.712.014,61</b>	<b>6,39</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>21,20</b>	<b>7,85</b>	<b>-21,84</b>	<b>39.408.219,51</b>	<b>6,86</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,82%

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	20,51	10,09	-9,27	44.888.118,71	7,82	1.437.147.092,41	3,12
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>20,51</b>	<b>10,09</b>	<b>-9,27</b>	<b>44.888.118,71</b>	<b>7,82</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>24,38</b>	<b>10,09</b>	<b>-9,27</b>	<b>44.888.118,71</b>	<b>7,82</b>		
<b>Total</b>			<b>6,03</b>	<b>2,27</b>	<b>1,31</b>	<b>574.361.888,02</b>	<b>100,00</b>		



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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	313.103.429,10	54,51	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	68.855.483,59	11,99	10,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	25.049.888,99	4,36	3,00	14,25	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	557.561,72	0,10	0,00	0,25	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>407.566.363,40</b>	<b>70,96</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	82.499.186,40	14,36	0,00	5,50	35,00	0,00	35,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>82.499.186,40</b>	<b>14,36</b>					35,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	2.696.204,90	0,47	0,00	2,96	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	36.712.014,61	6,39	0,00	7,04	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>39.408.219,51</b>	<b>6,86</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	44.888.118,71	7,82	0,00	9,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>44.888.118,71</b>	<b>7,82</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>574.361.888,02</b>	<b>100,00</b>					

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades por Artigo**

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,52 50,33	9,16 141,13	3,03 97,29	7,92 138,45		1.622.415,69	17.338.196,68
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,06 5,58	4,28 65,95	0,94 30,35	4,80 83,90	3,32 35,33	39.770,11	4.343.064,01
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,95 91,87	6,63 102,18	2,99 96,13	7,01 122,54		229.285,01	2.669.191,87
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,11 -10,49	28,23 434,83	-0,30 -9,55	27,88 487,65		-1.297,47	262.776,07
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	4,90 0,21	-0,93 0,65	-4,32 0,05	-7,02 0,99		3.851.831,39	-776.631,10
Artigo 9º II % do CDI	7,42 717,33	-17,51 -269,77	1,23 39,56	-9,50 -166,19		186.315,82	-572.480,42
Artigo 9º III % do CDI	7,88 761,18	-22,14 -341,09	3,94 126,76	-13,74 -240,24	-11,05 -117,69	2.680.663,62	-10.441.890,28
Artigo 10º I % do CDI	10,09 975,05	-9,27 -142,83	2,48 79,64	-4,21 -73,60		4.114.235,75	-4.587.891,25
<b>CARAGUATATUBA (Total)</b>						<b>12.723.219,92</b>	<b>8.234.335,58</b>

**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%)	20.196.333,29	0,00	0,00	0,00	20.293.173,45	96.840,16	882.339,30
NTN-B 150523 (5,900000%)	40.201.407,91	0,00	0,00	0,00	40.396.389,28	194.981,37	3.452.722,89
NTN-B 150535 (5,560000%)	16.292.396,92	0,00	0,00	0,00	16.367.031,69	74.634,77	1.143.763,21
NTN-B 150535 (5,821000%)	19.019.879,74	0,00	0,00	0,00	19.110.942,16	91.062,42	1.158.603,17
NTN-B 150545 (5,710000%)	31.075.695,93	0,00	0,00	0,00	31.221.755,35	146.059,42	2.082.672,08
NTN-B 150545 (5,760000%)	10.330.243,97	0,00	0,00	0,00	10.379.209,09	48.965,12	673.061,95
NTN-B 150545 (5,781000%)	10.312.195,95	0,00	0,00	0,00	10.361.238,51	49.042,56	656.269,44
NTN-B 150555 (5,815000%)	10.285.898,57	0,00	0,00	0,00	10.335.091,11	49.192,54	626.211,91
NTN-B 150555 (5,850000%)	9.944.759,84	0,00	0,00	0,00	9.992.614,49	47.854,65	276.374,59

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150822 (10,250000%)	32.280.760,61	0,00	0,00	0,00	32.546.335,76	265.575,15	547.180,89
NTN-B 150822 (6,090000%)	16.290.696,69	0,00	0,00	0,00	16.372.145,85	81.449,16	1.391.678,18
NTN-B 150822 (6,550000%)	6.069.005,66	0,00	0,00	0,00	6.101.558,52	32.552,86	102.179,46
NTN-B 150822 (6,920000%)	4.068.644,79	0,00	0,00	0,00	4.091.645,42	23.000,63	303.043,15
NTN-B 150822 (7,410000%)	12.121.644,17	0,00	0,00	0,00	12.194.783,04	73.138,87	214.328,54
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.369.235,02	0,00	0,00	0,00	5.395.247,04	26.012,02	318.462,18
NTN-B 150830 (5,708000%)	10.606.777,39	0,00	0,00	0,00	10.656.605,53	49.828,14	659.150,87
NTN-B 150840 (5,650000%)	901.816,70	0,00	0,00	0,00	906.012,50	4.195,80	61.674,93
NTN-B 150840 (5,770000%)	10.609.732,01	0,00	0,00	0,00	10.660.103,10	50.371,09	661.813,16
NTN-B 150850 (5,713000%)	10.656.562,08	0,00	0,00	0,00	10.706.666,28	50.104,20	708.053,47
NTN-B 150850 (5,780000%)	10.298.156,67	0,00	0,00	0,00	10.347.126,67	48.970,00	347.811,73
NTN-B 150850 (5,815000%)	10.581.330,90	0,00	0,00	0,00	10.631.946,89	50.615,99	632.117,06
NTN-B 150850 (5,916000%)	3.797.317,63	0,00	0,00	0,00	3.815.782,69	18.465,06	217.489,42
NTN-B 150850 (5,920000%)	10.170.520,97	0,00	0,00	0,00	10.220.024,68	49.503,71	221.195,10
					313.103.429,10	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	10.896.626,75	0,00	0,00	0,00	11.010.184,12	113.557,37	634.754,93
BB PREV RF VII	498.071,24	0,00	0,00	0,00	502.173,83	4.102,59	37.607,85
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	38.115.104,30	0,00	0,00	0,00	38.003.633,43	-111.470,87	1.265.049,59
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1.294.615,37	0,00	0,00	0,00	1.304.792,42	10.177,05	690.417,08
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2.578.514,12	0,00	0,00	0,00	2.599.195,60	20.681,48	149.885,14
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	382.320,07	801,16	0,00	0,00	386.941,90	3.820,67	21.654,67
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	15.049.660,47	0,00	0,00	0,00	15.048.562,29	-1.098,18	519.081,08
					68.855.483,59	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	9.280.606,66	1.500.298,45	0,00	0,00	10.883.485,65	102.580,54	396.235,16
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.522.111,83	4.581.645,88	-3.405.935,63	0,00	12.826.610,19	128.788,11	1.230.406,19
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	13.273,07	637.949,27	0,00	0,00	656.769,37	5.547,03	80.176,64
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	690.654,45	0,00	0,00	0,00	683.023,78	-7.630,67	962.373,88
					25.049.888,99	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	1.194.900,91	0,00	0,00	636.041,72	557.561,72	-1.297,47	262.776,07
					557.561,72	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	1.350.190,37	0,00	0,00	0,00	1.388.786,27	38.595,90	37.208,34
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21.080.181,62	0,00	0,00	0,00	22.011.308,00	931.126,38	-606.040,87
BRADESCO F I A SELECTION	4.702.300,55	0,00	0,00	0,00	4.998.366,04	296.065,49	48.190,34
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	5.283.098,67	0,00	0,00	0,00	5.589.898,63	306.799,96	-472.342,08
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	6.612.074,80	0,00	0,00	0,00	6.934.865,36	322.790,56	171.440,62
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	12.590.569,11	0,00	0,00	0,00	13.013.835,08	423.265,97	588.129,63
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	5.284.762,05	0,00	0,00	0,00	5.602.115,77	317.353,72	-184.983,98
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	13.190.714,13	0,00	0,00	0,00	13.862.733,62	672.019,49	-119.538,13
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	8.553.463,71	0,00	0,00	0,00	9.097.277,63	543.813,92	-238.694,97
					82.499.186,40	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	1.121.654,53	0,00	0,00	0,00	1.197.682,42	76.027,89	-401.747,65
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	1.388.234,55	0,00	0,00	0,00	1.498.522,48	110.287,93	-170.732,77

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					2.696.204,90	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	34.031.350,99	0,00	0,00	0,00	36.712.014,61	2.680.663,62	-10.441.890,28
					36.712.014,61	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	40.773.882,96	0,00	0,00	0,00	44.888.118,71	4.114.235,75	-4.587.891,25
					44.888.118,71	0,00	0,00

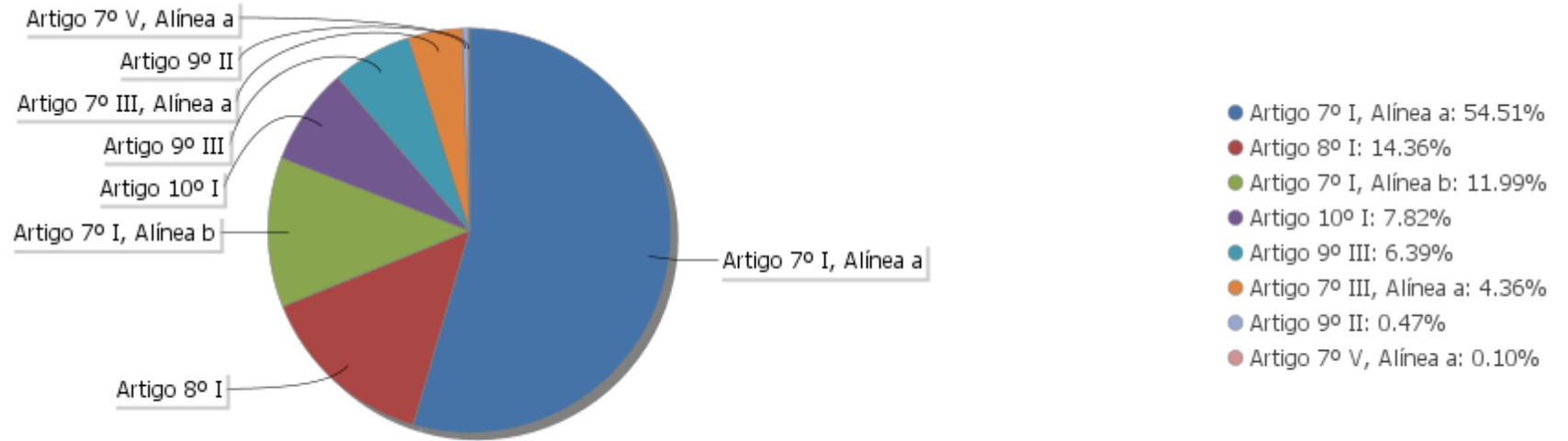
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

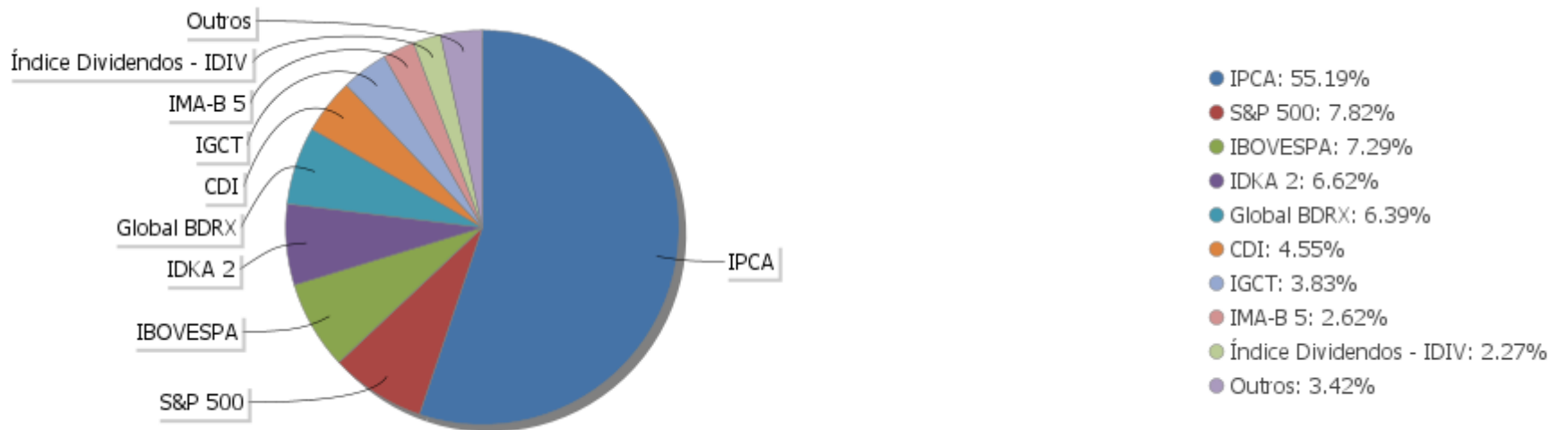
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	297.359.271,95	51,77	297.359.271,95	51,77
de 31 a 365 dias	95.895.218,29	16,70	393.254.490,24	68,47
acima de 365 dias	181.107.397,78	31,53	574.361.888,02	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

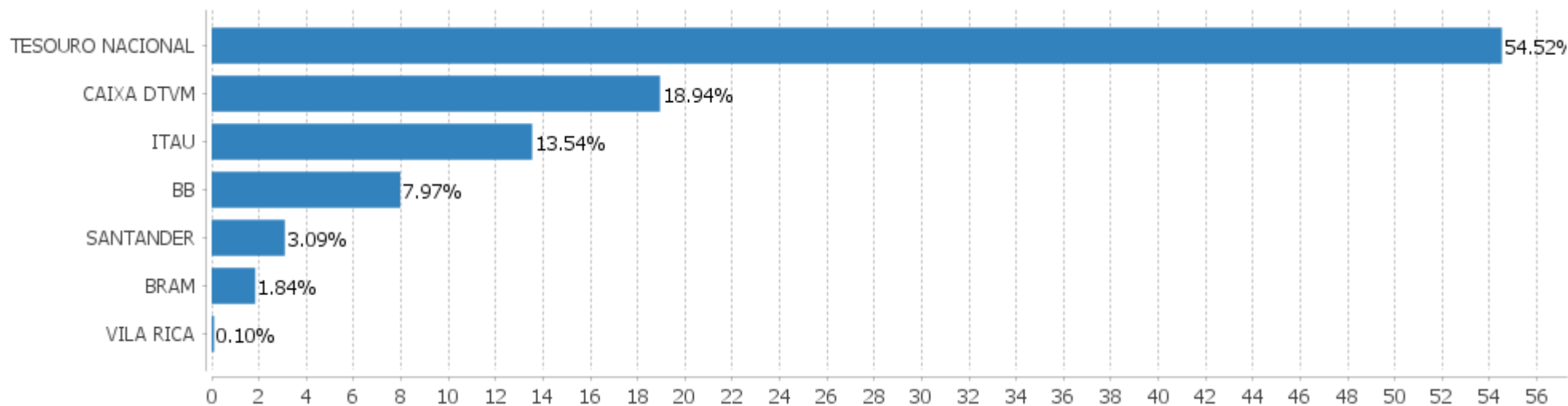


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor





## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2022	-0,53	-0,27	2,35	-1,70	1,01	-1,73	2,27						1,31
IPCA + 4,99%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,90	1,08	-0,28						7,75
p.p. indexador	-1,48	-1,65	0,30	-3,13	0,11	-2,81	2,54						-6,43
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

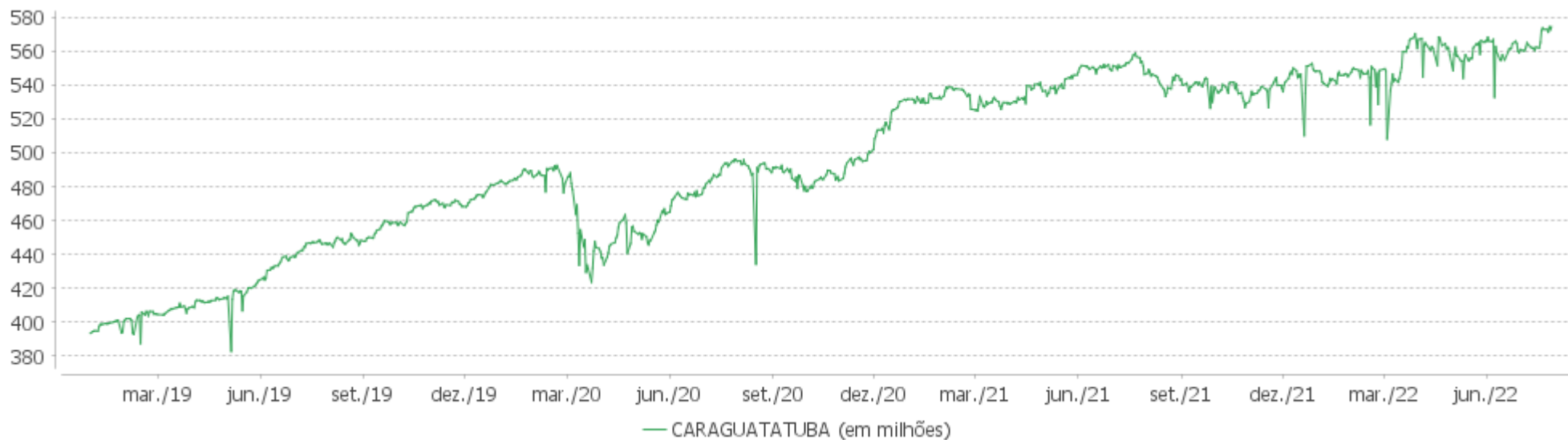
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	19	44,19	03 meses	1,51	1,71	-0,20	5,56
Meses abaixo - Meta Atuarial	24	55,81	06 meses	1,85	6,73	-4,88	5,91
			12 meses	-0,22	15,76	-15,98	6,03
			24 meses	4,41	33,23	-28,82	5,98
			36 meses	10,75	44,42	-33,67	8,72
Maior rentabilidade da Carteira	4,43	2020-12	Desde 31/12/2018	21,04	53,00	-31,96	8,08
Menor rentabilidade da Carteira	-8,82	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

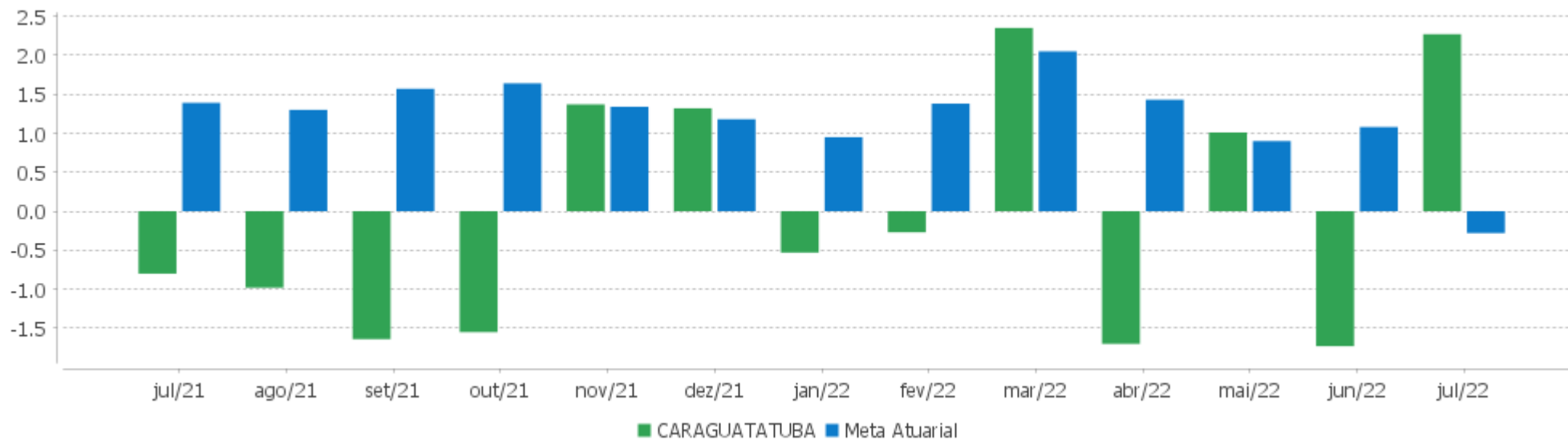


Patrimônio Líquido



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
NTN-B 150523 (5,831000%) Var. IPCA p.p.	0,48 1,16	9,08 4,31	2,96 2,51	7,85 3,64	14,10 4,03	23,74 3,77	26,35 3,61
NTN-B 150822 (6,550000%) Var. IPCA p.p.	0,54 1,22	6,36 1,59	3,14 2,69	5,09 0,89	11,55 1,48	21,69 1,72	24,97 2,24
NTN-B 150545 (5,781000%) Var. IPCA p.p.	0,48 1,16	9,05 4,28	2,95 2,50	7,82 3,61	14,13 4,07	23,89 3,92	26,62 3,88
NTN-B 150535 (5,560000%) Var. IPCA p.p.	0,46 1,14	8,92 4,15	2,90 2,44	7,71 3,50	13,94 3,87	23,51 3,54	26,06 3,33
NTN-B 150824 (5,892000%) Var. IPCA p.p.	0,48 1,16	5,99 1,22	2,98 2,52	4,79 0,58	10,90 0,83	20,34 0,37	22,94 0,21
NTN-B 150840 (5,650000%) Var. IPCA p.p.	0,47 1,15	8,97 4,20	2,92 2,46	7,76 3,55	14,03 3,96	23,71 3,74	26,36 3,63
NTN-B 150555 (5,850000%) Var. IPCA p.p.	0,48 1,16	9,06 4,29	2,94 2,48	7,83 3,62	14,16 4,09	23,96 3,99	26,73 4,00
NTN-B 150523 (5,900000%) Var. IPCA p.p.	0,49 1,17	9,12 4,35	2,98 2,53	7,88 3,67	14,17 4,11	23,89 3,92	26,57 3,83
NTN-B 150822 (6,920000%) Var. IPCA p.p.	0,57 1,25	9,73 4,96	3,23 2,78	8,39 4,18	15,24 5,17	26,11 6,14	29,89 7,16
NTN-B 150850 (5,713000%) Var. IPCA p.p.	0,47 1,15	6,00 1,23	2,94 2,48	4,81 0,61	10,95 0,88	20,44 0,47	23,10 0,36
NTN-B 150850 (5,916000%) Var. IPCA p.p.	0,49 1,17	6,04 1,27	2,99 2,53	4,83 0,63	10,99 0,92	20,53 0,56	23,23 0,49
NTN-B 150850 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	0,48 1,16	6,02 1,25	2,96 2,51	4,82 0,62	10,97 0,90	20,49 0,52	23,16 0,43
NTN-B 150545 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	0,47 1,15	9,04 4,27	2,95 2,49	7,81 3,60	14,12 4,05	23,87 3,90	26,59 3,86
NTN-B 150822 (10,250000%) Var. IPCA p.p.	0,82 1,50	8,41 3,64	4,04 3,58	6,82 2,61	15,23 5,16	29,61 9,64	37,01 14,27
NTN-B 150830 (5,708000%) Var. IPCA p.p.	0,47 1,15	5,94 1,17	2,93 2,48	4,75 0,54	10,82 0,75	20,16 0,20	22,68 -0,06
NTN-B 150840 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	0,47 1,15	6,00 1,23	2,95 2,49	4,80 0,59	10,93 0,86	20,39 0,42	23,01 0,28
NTN-B 150555 (5,815000%)	0,48	9,07	2,96	7,84	14,17	23,97	26,73

## 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.	1,16	4,30	2,50	3,63	4,10	4,00	3,99
NTN-B 150535 (5,821000%) Var. IPCA p.p.	0,48 1,16	9,08 4,31	2,96 2,51	7,84 3,63	14,14 4,07	23,87 3,90	26,56 3,83
NTN-B 150850 (5,920000%) Var. IPCA p.p.	0,49 1,17	6,01 1,24	2,96 2,50	4,81 0,60	10,97 0,90	20,50 0,53	23,20 0,46
NTN-B 150850 (5,780000%) Var. IPCA p.p.	0,48 1,16	6,02 1,25	2,95 2,50	4,82 0,61	10,97 0,90	20,47 0,50	23,14 0,40
NTN-B 150822 (6,090000%) Var. IPCA p.p.	0,50 1,18	9,23 4,47	3,03 2,57	7,98 3,77	14,37 4,30	24,29 4,32	27,17 4,43
NTN-B 150822 (7,410000%) Var. IPCA p.p.	0,60 1,28	6,84 2,07	3,35 2,90	5,50 1,29	12,40 2,33	23,51 3,55	27,72 4,98
NTN-B 150545 (5,710000%) Var. IPCA p.p.	0,47 1,15	9,01 4,24	2,93 2,48	7,79 3,58	14,09 4,02	23,82 3,85	26,52 3,79
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,00 -0,05	5,97 -0,12	2,89 -0,07	5,30 -0,12	7,85 -0,26	9,76 -0,49	15,50 -0,83
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-0,01 -0,02	6,49 -0,13	1,07 -0,05	6,39 -0,11	9,81 -0,23	15,10 -0,50	25,05 -0,77
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,82 1,70	8,06 4,63	1,79 2,08	7,45 3,26	11,96 8,71	19,27 13,41	26,12 11,63
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,79 1,47	5,41 0,64	2,09 1,64	4,71 0,50	5,36 -4,71	6,31 -13,66	16,60 -6,13
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,04 -0,01	5,95 -0,14	2,91 -0,05	5,30 -0,13	7,86 -0,25	9,57 -0,69	15,29 -1,04
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,29 -0,12	6,10 -0,56	0,78 -0,37	6,08 -0,53	9,41 -0,70	15,38 -1,21	24,72 -1,99
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,80 1,48	6,12 1,35	2,60 2,14	5,57 1,36	9,65 -0,42	10,96 -9,01	16,73 -6,00
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	-0,11 -10,49	28,23 434,83	-0,30 -9,55	27,88 487,65	37,19 396,07	1.603,63 13.305,51	2.139,49 12.739,70
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	1,05 101,53	7,01 107,92	3,33 107,04	6,13 107,13	10,32 109,89	13,29 110,24	17,66 105,15
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,10 -0,23	3,03 -0,40	-0,85 -0,56	4,17 -0,03	2,64 -0,61	4,88 -0,98	15,21 0,72
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,04 100,13	6,64 102,22	3,16 101,60	5,81 101,57	9,68 103,11	12,43 103,16	16,64 99,06
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,01	6,66	3,18	5,83	9,79	12,43	16,61

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	97,30	102,58	102,12	101,90	104,24	103,16	98,92
<b>BRADESCO F I A SELECTION</b> Var. IBOVESPA p.p.	<b>6,30</b> 1,61	<b>0,97</b> 2,55	<b>-2,43</b> 1,94	<b>-5,43</b> 2,57	<b>-17,29</b> -1,99	<b>-3,51</b> -3,75	<b>-9,68</b> -11,01
<b>FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS</b> Var. IBOVESPA p.p.	<b>4,88</b> 0,19	<b>2,53</b> 4,12	<b>-3,68</b> 0,69	<b>-6,34</b> 1,67	<b>-14,00</b> 1,30	<b>-2,76</b> -3,01	<b>8,41</b> 7,08
<b>ITAU ACOES DUNAMIS FIC</b> Var. IBOVESPA p.p.	<b>6,01</b> 1,31	<b>-3,20</b> -1,62	<b>-2,21</b> 2,16	<b>-4,48</b> 3,53	<b>-18,57</b> -3,27	<b>0,76</b> 0,51	<b>-0,16</b> -1,49
<b>ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI</b> Var. IBOVESPA p.p.	<b>5,09</b> 0,40	<b>-0,85</b> 0,73	<b>-2,66</b> 1,71	<b>-6,97</b> 1,03	<b>-18,36</b> -3,06	<b>-6,66</b> -6,91	<b>-2,59</b> -3,92
<b>ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI</b> Var. IBOVESPA p.p.	<b>6,36</b> 1,67	<b>-2,56</b> -0,98	<b>-6,11</b> -1,74	<b>-7,77</b> 0,24			
<b>FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS</b> Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	<b>3,36</b> 1,38	<b>4,73</b> -1,93	<b>-3,06</b> -0,48	<b>-3,75</b> -2,99	<b>-6,73</b> -6,24	<b>7,17</b> -6,48	<b>12,21</b> -5,43
<b>BB AÇÕES DIVIDENDOS</b> Var. IBOVESPA p.p.	<b>2,86</b> -1,83	<b>2,75</b> 4,33	<b>-4,94</b> -0,57	<b>-4,38</b> 3,63	<b>-11,91</b> 3,39	<b>-3,55</b> -3,80	<b>-10,31</b> -11,64
<b>BB AÇÕES GOVERNANÇA FI</b> Var. IGCT p.p.	<b>4,42</b> -0,09	<b>-2,68</b> -0,55	<b>-5,19</b> -0,16	<b>-8,79</b> -0,40	<b>-17,73</b> -0,72	<b>-1,62</b> -1,87	<b>1,81</b> -2,81
<b>BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS</b> Var. SMALL CAP p.p.	<b>5,81</b> 0,65	<b>-7,79</b> 7,75	<b>-8,94</b> 4,68	<b>-11,31</b> 7,03	<b>-24,18</b> 8,39	<b>-10,73</b> 8,27	<b>-2,31</b> 10,32
<b>FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I</b> Var. Global BDRX p.p.	<b>7,88</b> 0,23	<b>-22,14</b> -0,07	<b>3,94</b> 0,13	<b>-13,74</b> -0,16	<b>-11,05</b> -0,39	<b>16,19</b> -2,81	<b>80,64</b> -4,31
<b>SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b> % do CDI	<b>6,78</b> 654,99	<b>-25,12</b> -386,90	<b>1,09</b> 34,93	<b>-14,37</b> -251,23	<b>-18,03</b> -192,02	<b>8,51</b> 70,62	<b>70,20</b> 418,02
<b>SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI</b> Var. MSCI ACWI p.p.	<b>7,94</b> 2,10	<b>-10,23</b> 11,22	<b>1,35</b> -1,55	<b>-5,20</b> 8,71	<b>-2,76</b> 8,03	<b>29,53</b> 14,31	
<b>ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI</b> Var. S&P 500 p.p.	<b>10,09</b> 2,01	<b>-9,27</b> 10,16	<b>2,48</b> -2,96	<b>-4,21</b> 7,21	<b>1,10</b> 5,90	<b>36,82</b> 10,92	<b>49,16</b> -41,82
<b>CARAGUATATUBA</b> Var. IPCA + 4,99% p.p.	<b>2,27</b> 2,54	<b>1,31</b> -6,43	<b>1,51</b> -0,20	<b>1,85</b> -4,88	<b>-0,22</b> -15,76	<b>4,41</b> -27,76	<b>10,75</b> -31,24
<b>CDI</b>	<b>1,03</b>	<b>6,49</b>	<b>3,11</b>	<b>5,72</b>	<b>9,39</b>	<b>12,05</b>	<b>16,79</b>
<b>IBOVESPA</b>	<b>4,69</b>	<b>-1,58</b>	<b>-4,37</b>	<b>-8,01</b>	<b>-15,30</b>	<b>0,25</b>	<b>1,33</b>
<b>INPC + 6,00%</b>	<b>-0,12</b>	<b>8,56</b>	<b>1,96</b>	<b>7,31</b>	<b>16,71</b>	<b>35,83</b>	<b>47,90</b>
<b>IPCA + 6,00%</b>	<b>-0,20</b>	<b>8,34</b>	<b>1,95</b>	<b>7,24</b>	<b>16,65</b>	<b>34,70</b>	<b>46,11</b>

## 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
BRDESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRDESCO 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 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 IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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	1,05	6,09	2,96	5,43	8,11	10,26	16,33	24,81	34,03
IRF-M 1+	1,20	1,94	1,68	2,45	1,01	-2,37	9,37	29,67	40,37
IRF-M TOTAL	1,15	3,36	2,11	3,45	3,42	1,97	11,97	29,08	39,48
IMA-B 5	0,01	6,62	1,13	6,50	10,04	15,61	25,82	43,53	55,41
IMA-B 5+	-1,84	0,16	-1,79	1,79	-3,22	-2,89	4,70	45,06	51,68
IMA-B TOTAL	-0,88	3,43	-0,28	4,20	3,25	5,86	14,50	45,94	55,35
IMA-GERAL TOTAL	0,47	4,98	1,83	4,76	5,95	7,72	15,62	33,41	43,39
IDKA 2	-0,17	6,66	1,15	6,61	10,11	16,59	26,71	42,67	55,48
IDKA 20	-3,59	-6,10	-5,30	-3,27	-15,47	-16,49	-12,36	41,45	43,04
CDI	1,03	6,49	3,11	5,72	9,39	12,05	16,79	24,21	33,01

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	4,69	-1,58	-4,37	-8,01	-15,30	0,25	1,33	30,22	56,50
IBRX 100	4,40	-1,57	-4,69	-7,90	-16,32	1,03	3,22	35,06	60,67
IBRX 50	4,54	-1,43	-4,61	-8,44	-15,95	2,74	2,97	30,16	56,41
SMALL CAP	5,16	-15,55	-13,62	-18,34	-32,57	-19,00	-12,63	25,78	39,30
IFIX	0,66	0,33	0,04	1,34	-0,35	2,96	5,81	30,62	36,20
Índice Consumo - ICON	9,18		-9,26	-19,73	-38,06	-36,23	-28,49	-1,52	0,77
Índice Dividendos - IDIV	1,98	6,66	-2,58	-0,76	-0,49	13,65	17,63	66,49	85,47

## 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	-0,68	4,77	0,46	4,21	10,07	19,97	22,74	26,69	32,37
INPC	-0,60	4,98	0,47	4,28	10,12	20,98	24,23	28,16	32,79
IGPM	0,21	8,39	1,32	6,45	10,08	47,31	60,97	71,26	85,37
SELIC	1,03	6,49	3,11	5,72	9,39	12,05	16,79	24,21	33,03

**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	8,08	-19,43	5,43	-11,42	-4,80	25,90	90,98	102,65	177,09
MSCI ACWI	5,85	-21,45	2,90	-13,91	-10,79	15,22	67,60	69,52	121,29

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	-0,35	7,16	1,46	6,24	14,45	29,70	38,02	48,12	60,90
IPCA + 5,00%	-0,28	7,75	1,71	6,74	15,55	32,19	42,03	53,87	68,75
IPCA + 5,50%	-0,24	8,05	1,83	6,99	16,10	33,44	44,06	56,81	72,78
IPCA + 5,89%	-0,21	8,28	1,93	7,18	16,53	34,43	45,66	59,14	75,99
IPCA + 6,00%	-0,20	8,34	1,95	7,24	16,65	34,70	46,11	59,80	76,90
INPC + 4,00%	-0,27	7,37	1,47	6,31	14,51	30,79	39,70	49,84	61,41
INPC + 6,00%	-0,12	8,56	1,96	7,31	16,71	35,83	47,90	61,65	77,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
168	04/07/2022	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	801,16	0,00	21,97216318	36,4625000000
169	06/07/2022	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	636.041,72	0,00	178,85033751	3.556,2791150000
170	07/07/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	235.124,61	0,00	92.277,70080700	2,5480111440
171	08/07/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.379,03	0,00	3.286,84625200	2,5492613150
172	08/07/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	61.000,00	14.725,59217300	4,1424480000
173	11/07/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.784,78	0,00	3.444,36798200	2,5504766170
174	11/07/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	26.493,25	0,00	6.392,40446700	4,1444890000
175	13/07/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	46.721,45	0,00	18.300,24174700	2,5530509730
176	15/07/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.000,00	240,82128300	4,1524560000
177	20/07/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.201.288,58	0,00	469.411,91028700	2,5591352790
178	20/07/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.246.561,94	0,00	1.021.163,11102300	4,1585540000
179	20/07/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	280.561,30	0,00	67.466,07113900	4,1585540000
180	28/07/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.158.435,87	757.403,23485600	4,1700850000
181	28/07/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	28.029,39	0,00	6.721,53924900	4,1700850000
182	28/07/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	185.499,76	44.483,44811700	4,1700850000
183	29/07/2022	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1.907,55	0,00	0,53186740	3.586,5142390000
<b>Total</b>			<b>6.720.694,76</b>	<b>3.405.935,63</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Análise de Risco**

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

Value-At-Risk (R\$): 16.914.293,07

Value-At-Risk: 2,94%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARAGUATATUBA		2,94	2,94			574.361.888,02	100,00

**Renda Fixa**

Value-At-Risk: 0,32%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150523 (5,831000%)		0,31	-0,00	0,30			20.293.173,45	3,53
NTN-B 150523 (5,900000%)		0,31	-0,00	0,30			40.396.389,28	7,03
NTN-B 150535 (5,560000%)		0,31	-0,00	0,30			16.367.031,69	2,85
NTN-B 150535 (5,821000%)		0,31	-0,00	0,30			19.110.942,16	3,33
NTN-B 150545 (5,710000%)		0,31	-0,00	0,30			31.221.755,35	5,44
NTN-B 150545 (5,760000%)		0,31	-0,00	0,30			10.379.209,09	1,81
NTN-B 150545 (5,781000%)		0,31	-0,00	0,30			10.361.238,51	1,80
NTN-B 150555 (5,815000%)		0,31	-0,00	0,30			10.335.091,11	1,80
NTN-B 150555 (5,850000%)		0,31	0,00	0,30			9.992.614,49	1,74
NTN-B 150822 (10,250000%)		0,31	0,00	0,30			32.546.335,76	5,67
NTN-B 150822 (6,090000%)		0,31	-0,00	0,30			16.372.145,85	2,85
NTN-B 150822 (6,550000%)		0,31	-0,00	0,30			6.101.558,52	1,06
NTN-B 150822 (6,920000%)		0,31	-0,00	0,30			4.091.645,42	0,71
NTN-B 150822 (7,410000%)		0,31	-0,00	0,30			12.194.783,04	2,12
NTN-B 150824 (5,892000%)		0,31	-0,00	0,30			5.395.247,04	0,94
NTN-B 150830 (5,708000%)		0,31	-0,00	0,30			10.656.605,53	1,86
NTN-B 150840 (5,650000%)		0,31	-0,00	0,30			906.012,50	0,16
NTN-B 150840 (5,770000%)		0,31	-0,00	0,30			10.660.103,10	1,86
NTN-B 150850 (5,713000%)		0,31	-0,00	0,30			10.706.666,28	1,86
NTN-B 150850 (5,780000%)		0,31	-0,00	0,30			10.347.126,67	1,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150850 (5,815000%)		0,31	-0,00	0,30			10.631.946,89	1,85
NTN-B 150850 (5,916000%)		0,31	-0,00	0,30			3.815.782,69	0,66
NTN-B 150850 (5,920000%)		0,31	0,00	0,30			10.220.024,68	1,78
<b>Sub-total</b>	0,52	0,31	-0,00		-0,99	0,52	313.103.429,10	54,51

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,24	0,00	0,33			386.941,90	0,07
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,24	0,00	0,02			11.010.184,12	1,92
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,19	0,01	0,01			15.048.562,29	2,62
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,48	0,03	0,39			38.003.633,43	6,62
BB PREV RF VII		0,98	0,00	2,14			502.173,83	0,09
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		0,24	0,00	0,35			2.599.195,60	0,45
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,23	0,00	1,25			1.304.792,42	0,23
<b>Sub-total</b>	2,40	1,11	0,04		-0,41	0,06	68.855.483,59	11,99

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO		2,45	0,00	0,37			683.023,78	0,12
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,03	-0,00	0,03			12.826.610,19	2,23
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,06	0,00	0,05			656.769,37	0,11
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,04	0,00	0,03			10.883.485,65	1,89
<b>Sub-total</b>	0,15	0,07	0,00		-0,55	0,95	25.049.888,99	4,36

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR		1,14	-0,00	1,15			557.561,72	0,10
<b>Sub-total</b>	0,38	1,14	-0,00		-3,04	-0,11	557.561,72	0,10

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,25%

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS		8,86	0,02	3,63			1.388.786,27	0,24
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		12,54	0,10	3,48			5.589.898,63	0,97
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		9,66	0,20	1,79			13.862.733,62	2,41
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		9,53	0,30	0,10			22.011.308,00	3,83
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS		8,95	0,09	1,73			6.934.865,36	1,21
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		8,29	0,15	1,97			13.013.835,08	2,27
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		9,82	0,08	4,56			5.602.115,77	0,98
BRADESCO F I A SELECTION		10,40	0,07	3,10			4.998.366,04	0,87
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		9,57	0,13	4,99			9.097.277,63	1,58
<b>Sub-total</b>	16,10	9,25	1,15		0,24	4,90	82.499.186,40	14,36

## Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 14,89%

## Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI		14,89	1,11	8,71			44.888.118,71	7,82
<b>Sub-total</b>	18,71	14,89	1,11		0,48	10,09	44.888.118,71	7,82

## Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,58%

## Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,18	0,01	9,18			1.197.682,42	0,21
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI		13,31	0,02	12,44			1.498.522,48	0,26
<b>Sub-total</b>	14,91	10,05	0,03		0,43	7,42	2.696.204,90	0,47

## Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		12,98	0,61	3,19			36.712.014,61	6,39

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
<b>Sub-total</b>	24,12	12,98	0,61		0,28	7,88	36.712.014,61	6,39