



LDB
EMPRESAS

CARAGUATATUBA
SETEMBRO 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 30.09.2022.

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

74,43%

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	0,12	4,57	20.312.269,76	3,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,900000%)	2,95	0,13	9,24	40.438.987,08	6,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,980000%)	4,12	0,14	0,17	10.014.404,84	1,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,560000%)	2,84	0,10	7,41	16.375.103,80	2,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,821000%)	2,91	0,12	6,42	19.128.616,95	3,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,710000%)	2,85	0,11	7,08	31.244.879,29	5,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	2,87	0,12	6,88	10.387.750,25	1,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,781000%)	2,88	0,12	6,72	10.370.129,39	1,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,815000%)	2,88	0,12	6,42	10.344.542,17	1,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	2,89	0,13	2,92	10.002.367,99	1,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,892000%)	2,98	0,13	6,38	5.246.140,31	0,91
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,480000%)	4,25	0,17	0,22	20.042.043,70	3,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,708000%)	2,94	0,11	6,67	10.363.913,43	1,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,650000%)	0,66	0,11	7,37	881.539,90	0,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,770000%)	2,92	0,12	6,71	10.370.479,74	1,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,713000%)	2,88	0,11	7,16	10.418.924,74	1,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,780000%)	2,90	0,12	3,57	10.067.641,55	1,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,815000%)	2,92	0,12	6,42	10.344.017,42	1,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,916000%)	2,95	0,13	6,16	3.711.657,39	0,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,920000%)	2,96	0,13	2,32	9.941.013,81	1,72
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,65	0,13	9,29	270.006.423,51	46,68

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	1,12	8,47	397.801,69	0,07	158.144.148,14	0,25
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,73	1,09	8,39	11.263.766,93	1,95	6.071.749.354,31	0,19
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,69	0,40	6,91	561.397,04	0,10	889.444.204,66	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,92	0,51	6,53	2.031.669,26	0,35	8.482.726.221,67	0,02
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,84	1,53	8,40	2.655.120,48	0,46	2.451.788.610,47	0,11
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,69	1,24	8,29	1.340.444,51	0,23	5.850.800.339,33	0,02
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,90	1,08	6,41	18.250.199,91	3,16		

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	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,09	1,47	5,45	699.082,22	0,12	444.503.225,14	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,16	1,11	9,12	96.648.375,12	16,71	13.954.428.357,23	0,69
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,17	1,12	9,49	14.817.852,10	2,56	3.261.035.114,65	0,45
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,14	1,09	6,17	14.679.023,85	2,54	11.863.594.899,56	0,12
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,14	1,12	2,24	14.824.540,38	2,56	2.713.701.445,40	0,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI									
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,66	1,11	9,10	141.668.873,67	24,49		
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	25,30	0,17	28,99	560.860,55	0,10	22.044.959,18	2,54
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			25,30	0,17	28,99	560.860,55	0,10		
Renda Fixa			2,93	0,49	7,39	430.486.357,64	74,43		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

12,66%

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	18,04	-0,03	8,50	1.466.494,28	0,25	643.661.333,34	0,23
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	25,11	-1,34	-2,76	5.894.786,80	1,02	1.002.602.097,35	0,59
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	19,93	0,80	6,29	749.619,60	0,13	489.228.783,31	0,15
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,30	-0,13	3,58	23.428.058,53	4,05	882.000.687,94	2,66
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	19,68	1,28	9,36	7.396.376,04	1,28	686.461.522,28	1,08
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,62	-0,09	8,36	13.464.296,02	2,33	940.722.110,37	1,43
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,75	-1,00	2,10	5.908.659,35	1,02	1.961.836.267,82	0,30
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	21,23	-1,35	8,17	5.354.557,10	0,93	493.369.883,54	1,09
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	22,13	-1,60	2,44	9.563.597,96	1,65	252.608.332,81	3,79
Sub-total Artigo 8º I			18,57	-0,43	4,67	73.226.445,68	12,66		
Renda Variável			18,28	-0,43	4,67	73.226.445,68	12,66		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,05%

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	18,94	-5,52	-31,46	1.096.186,99	0,19	1.006.692.313,90	0,11
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	21,83	-7,33	-20,23	1.331.562,27	0,23	429.662.284,25	0,31
Sub-total Artigo 9º II			18,05	-6,52	-25,73	2.427.749,26	0,42		

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	22,78	-7,72	-30,97	32.551.554,65	5,63	2.057.509.929,37	1,58
Sub-total Artigo 9º III			22,78	-7,72	-30,97	32.551.554,65	5,63		
Investimentos no Exterior			22,19	-7,64	-30,63	34.979.303,91	6,05		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

6,86%

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	21,97	-8,62	-19,75	39.703.853,09	6,86	1.207.167.139,22	3,29
Sub-total Artigo 10º I			21,97	-8,62	-19,75	39.703.853,09	6,86		
Investimentos Estruturados			23,79	-8,62	-19,75	39.703.853,09	6,86		
Total			5,71	-0,83	0,98	578.395.960,32	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	270.006.423,51	46,68	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	18.250.199,91	3,16	0,00	10,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	141.668.873,67	24,49	0,00	14,25	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	560.860,55	0,10	0,00	0,25	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	430.486.357,64	74,43					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	73.226.445,68	12,66	0,00	5,50	35,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	73.226.445,68	12,66					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	2.427.749,26	0,42	0,00	1,96	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	32.551.554,65	5,63	0,00	7,04	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	34.979.303,91	6,05					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	39.703.853,09	6,86	0,00	9,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	39.703.853,09	6,86					15,00
Total		578.395.960,32	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,13 11,72	9,29 104,49	0,64 19,28	4,98 78,93		338.734,89	17.593.203,67
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,08 100,46	6,41 72,05	2,10 63,31	3,83 60,66	7,26 66,62	194.437,87	4.741.722,71
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,11 103,48	9,10 102,34	3,28 99,21	6,30 99,81		1.534.205,39	5.274.153,40
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,17 16,17	28,99 326,07	0,48 14,57	0,25 3,99		970,32	266.074,90
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,43 -0,89	4,67 -0,30	10,83 -0,83	-7,56 0,74		-312.749,16	3.950.628,18
Artigo 9º II % do CDI	-6,52 -608,28	-25,73 -289,38	-3,27 -98,86	-14,19 -224,70	-19,08 -175,07	-169.346,86	-840.936,06
Artigo 9º III % do CDI	-7,72 -720,14	-30,97 -348,32	-4,35 -131,36	-14,12 -223,69	-22,81 -209,38	-2.723.143,24	-14.602.350,24
Artigo 10º I % do CDI	-8,62 -804,01	-19,75 -222,16	-2,62 -79,28	-17,18 -272,06		-3.744.765,71	-9.772.156,87
CARAGUATATUBA (Total)						-4.881.656,50	6.610.339,69

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%)	20.287.084,97	0,00	0,00	0,00	20.312.269,76	25.184,79	901.435,61
NTN-B 150523 (5,900000%)	40.386.672,69	0,00	0,00	0,00	40.438.987,08	52.314,39	3.495.320,69
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.000.859,06	0,00	0,00	0,00	10.014.404,84	13.545,78	16.876,78
NTN-B 150535 (5,560000%)	16.358.291,71	0,00	0,00	0,00	16.375.103,80	16.812,09	1.151.835,32
NTN-B 150535 (5,821000%)	19.105.047,23	0,00	0,00	0,00	19.128.616,95	23.569,72	1.176.277,96
NTN-B 150545 (5,710000%)	31.209.107,07	0,00	0,00	0,00	31.244.879,29	35.772,22	2.105.796,02
NTN-B 150545 (5,760000%)	10.375.450,87	0,00	0,00	0,00	10.387.750,25	12.299,38	681.603,11
NTN-B 150545 (5,781000%)	10.357.680,16	0,00	0,00	0,00	10.370.129,39	12.449,23	665.160,32
NTN-B 150555 (5,815000%)	10.331.844,19	0,00	0,00	0,00	10.344.542,17	12.697,98	635.662,97

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,850000%)	9.989.799,86	0,00	0,00	0,00	10.002.367,99	12.568,13	286.128,09
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.239.386,59	0,00	0,00	0,00	5.246.140,31	6.753,72	323.736,57
NTN-B 150824 (6,480000%)	20.007.079,08	0,00	0,00	0,00	20.042.043,70	34.964,62	44.240,65
NTN-B 150830 (5,708000%)	10.352.065,66	0,00	0,00	0,00	10.363.913,43	11.847,77	666.416,01
NTN-B 150840 (5,650000%)	880.572,01	0,00	0,00	0,00	881.539,90	967,89	62.208,55
NTN-B 150840 (5,770000%)	10.358.119,07	0,00	0,00	0,00	10.370.479,74	12.360,67	670.151,24
NTN-B 150850 (5,713000%)	10.406.972,73	0,00	0,00	0,00	10.418.924,74	11.952,01	715.455,77
NTN-B 150850 (5,780000%)	10.055.557,89	0,00	0,00	0,00	10.067.641,55	12.083,66	356.074,24
NTN-B 150850 (5,815000%)	10.331.316,27	0,00	0,00	0,00	10.344.017,42	12.701,15	641.209,83
NTN-B 150850 (5,916000%)	3.706.806,72	0,00	0,00	0,00	3.711.657,39	4.850,67	221.372,21
NTN-B 150850 (5,920000%)	9.927.974,79	0,00	0,00	0,00	9.941.013,81	13.039,02	231.692,86
					270.006.423,51	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	11.142.776,47	0,00	0,00	0,00	11.263.766,93	120.990,46	888.337,74
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.021.359,35	0,00	0,00	0,00	2.031.669,26	10.309,91	1.293.086,65
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1.324.006,94	0,00	0,00	0,00	1.340.444,51	16.437,57	726.069,17
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2.615.051,29	0,00	0,00	0,00	2.655.120,48	40.069,19	205.810,02
ITAU SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	392.519,79	894,90	0,00	0,00	397.801,69	4.387,00	30.818,40
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	559.153,30	0,00	0,00	0,00	561.397,04	2.243,74	531.915,83
					18.250.199,91	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\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	13.028.467,90	1.500.167,34	0,00	0,00	14.679.023,85	150.388,61	685.539,25
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	94.284.371,17	4.799.774,48	-3.495.777,77	0,00	96.648.375,12	1.060.007,24	3.048.197,18
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	666.497,54	14.001.907,55	0,00	0,00	14.817.852,10	149.447,01	237.444,27
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	688.927,53	0,00	0,00	0,00	699.082,22	10.154,69	978.432,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	14.660.332,54	0,00	0,00	0,00	14.824.540,38	164.207,84	324.540,38
					141.668.873,67	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	559.890,23	0,00	0,00	0,00	560.860,55	970,32	266.074,90
					560.860,55	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	1.466.956,62	0,00	0,00	0,00	1.466.494,28	-462,34	114.916,35
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	23.458.890,87	0,00	0,00	0,00	23.428.058,53	-30.832,34	810.709,66
BRADESCO F I A SELECTION	5.428.076,95	0,00	0,00	0,00	5.354.557,10	-73.519,85	404.381,40
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	5.974.590,17	0,00	0,00	0,00	5.894.786,80	-79.803,37	-167.453,91
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	7.303.094,36	0,00	0,00	0,00	7.396.376,04	93.281,68	632.951,30
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	13.476.420,79	0,00	0,00	0,00	13.464.296,02	-12.124,77	1.038.590,57
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	5.968.388,05	0,00	0,00	0,00	5.908.659,35	-59.728,70	121.559,60
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	743.698,43	0,00	0,00	0,00	749.619,60	5.921,17	767.347,85
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	9.719.078,60	0,00	0,00	0,00	9.563.597,96	-155.480,64	227.625,36
					73.226.445,68	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	1.160.171,80	0,00	0,00	0,00	1.096.186,99	-63.984,81	-503.243,08
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	1.436.924,32	0,00	0,00	0,00	1.331.562,27	-105.362,05	-337.692,98
					2.427.749,26	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	35.274.697,89	0,00	0,00	0,00	32.551.554,65	-2.723.143,24	-14.602.350,24
					32.551.554,65	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	43.448.618,80	0,00	0,00	0,00	39.703.853,09	-3.744.765,71	-9.772.156,87
					39.703.853,09	0,00	0,00

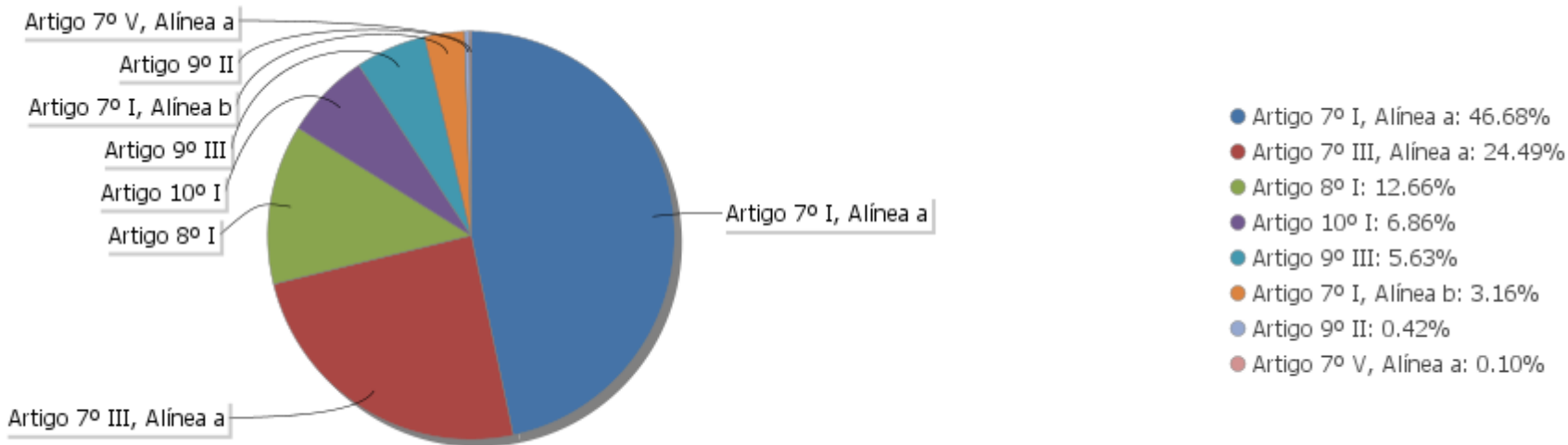
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

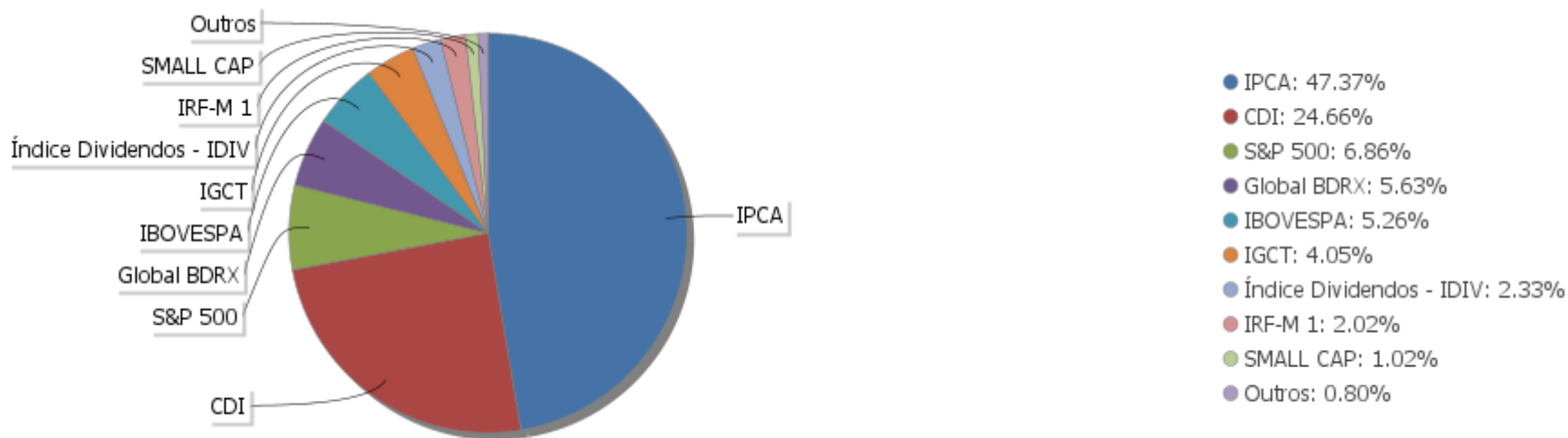
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	271.495.746,89	46,94	271.495.746,89	46,94
de 31 a 365 dias	97.645.046,76	16,88	369.140.793,65	63,82
acima de 365 dias	209.255.166,67	36,18	578.395.960,32	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

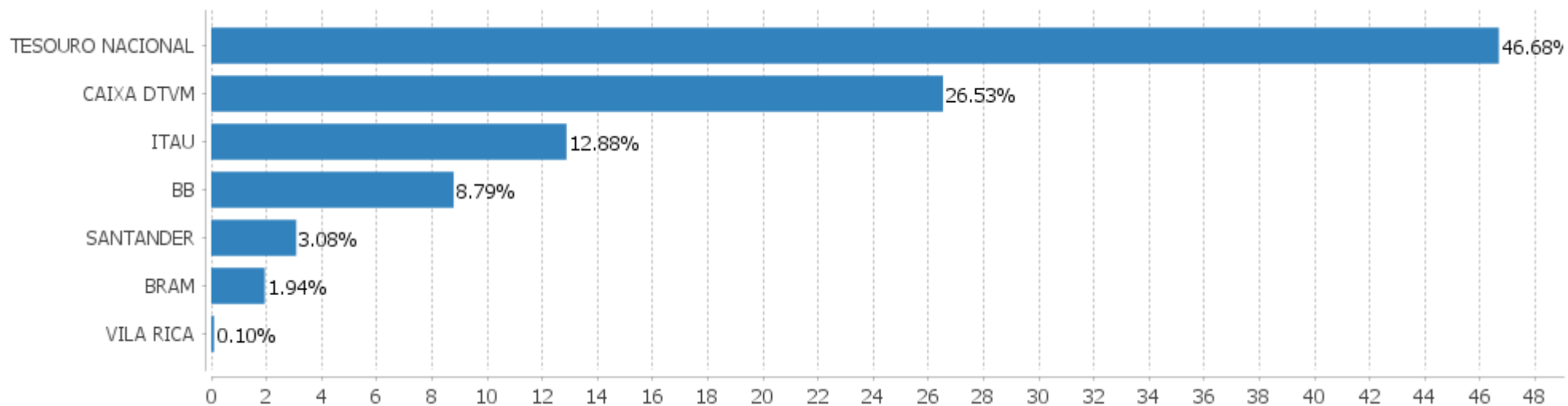


Alocação Por Estratégia



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	0,51	-0,83				0,98
IPCA + 4,99%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,90	1,08	-0,28	0,08	0,12				7,96
p.p. indexador	-1,48	-1,65	0,30	-3,13	0,11	-2,81	2,54	0,42	-0,95				-6,98
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

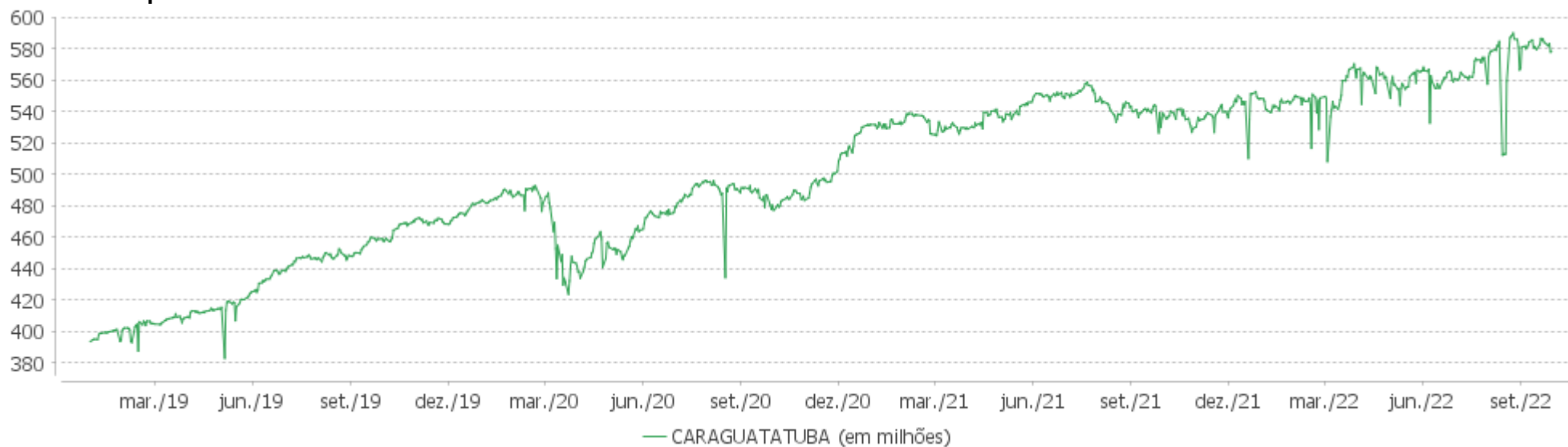
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	20	44,44	03 meses	1,93	-0,08	2,01	4,56
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	55,56	06 meses	-0,54	3,37	-3,91	5,29
			12 meses	2,11	12,64	-10,53	5,71
			24 meses	7,27	31,07	-23,80	5,69
Maior rentabilidade da Carteira	4,43	2020-12	36 meses	8,27	43,18	-34,91	8,73
Menor rentabilidade da Carteira	-8,82	2020-03	Desde 31/12/2018	20,64	53,31	-32,66	7,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

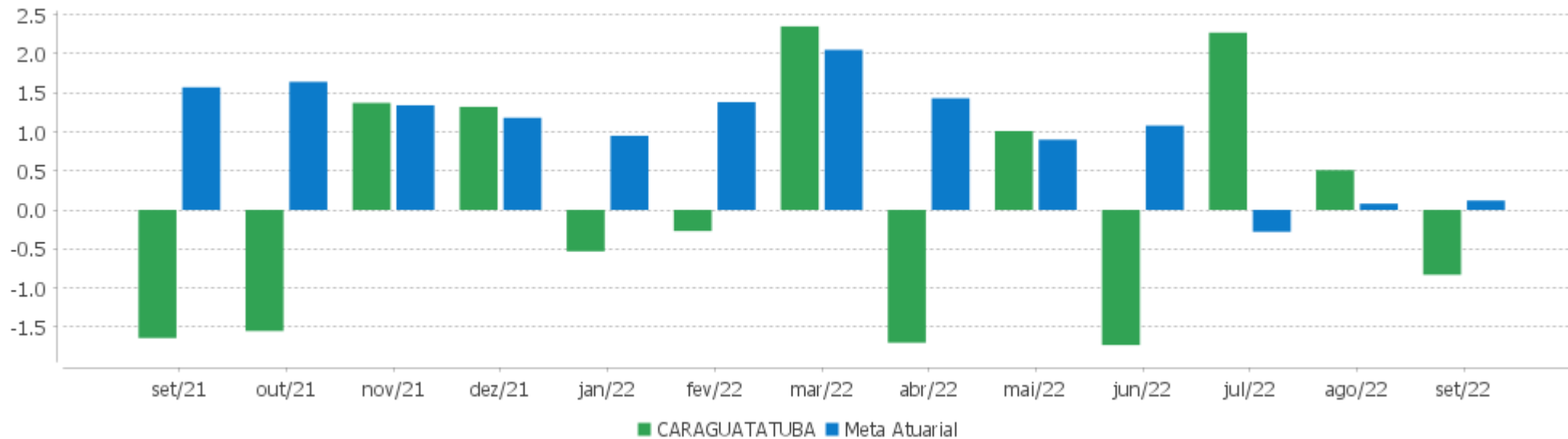


Patrimônio Líquido



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.	0,12 0,41	9,18 5,09	0,57 1,90	4,90 4,03	10,87 3,70	21,88 3,73	25,00 3,15
NTN-B 150545 (5,781000%) Var. IPCA p.p.	0,12 0,41	9,15 5,06	0,56 1,89	4,87 4,01	10,90 3,73	22,03 3,88	25,27 3,42
NTN-B 150535 (5,560000%) Var. IPCA p.p.	0,10 0,39	8,97 4,88	0,51 1,83	4,76 3,90	10,71 3,54	21,65 3,50	24,72 2,86
NTN-B 150824 (5,892000%) Var. IPCA p.p.	0,13 0,42	6,10 2,01	0,59 1,91	4,93 4,07	10,94 3,77	22,02 3,87	25,21 3,35
NTN-B 150840 (5,650000%) Var. IPCA p.p.	0,11 0,40	9,04 4,95	0,53 1,85	4,81 3,94	13,95 6,78	25,30 7,15	28,55 6,70
NTN-B 150555 (5,850000%) Var. IPCA p.p.	0,13 0,42	9,17 5,08	0,58 1,90	4,88 4,02	10,93 3,76	22,10 3,95	25,38 3,53
NTN-B 150523 (5,900000%) Var. IPCA p.p.	0,13 0,42	9,24 5,15	0,59 1,92	4,93 4,07	10,94 3,77	22,03 3,88	25,22 3,36
NTN-B 150850 (5,713000%) Var. IPCA p.p.	0,11 0,40	6,08 1,99	0,55 1,87	4,84 3,98	10,87 3,70	22,00 3,85	25,23 3,38
NTN-B 150850 (5,916000%) Var. IPCA p.p.	0,13 0,42	6,15 2,07	0,59 1,92	4,94 4,08	11,00 3,83	22,18 4,03	25,47 3,61
NTN-B 150850 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	0,12 0,41	6,12 2,03	0,57 1,89	4,89 4,03	10,93 3,76	22,09 3,94	25,35 3,50
NTN-B 150545 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	0,12 0,41	9,13 5,04	0,56 1,88	4,86 4,00	10,89 3,72	22,01 3,86	25,24 3,39
NTN-B 150525 (5,980000%) Var. IPCA p.p.	0,14 0,43	6,18 2,09	0,62 1,95	1,97 1,11	7,85 0,68	18,71 0,56	21,89 0,04
NTN-B 150830 (5,708000%) Var. IPCA p.p.	0,11 0,40	6,02 1,93	0,54 1,87	4,83 3,97	10,80 3,63	21,78 3,63	24,87 3,02
NTN-B 150555 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	0,12 0,41	9,17 5,08	0,57 1,89	4,89 4,03	10,94 3,77	22,11 3,96	25,38 3,52
NTN-B 150824 (6,480000%) Var. IPCA p.p.	0,17 0,46	3,43 -0,66	-2,17 -0,85	2,18 1,32	8,29 1,12	19,66 1,51	23,31 1,46
NTN-B 150840 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	0,12 0,41	6,08 2,00	0,56 1,88	4,87 4,00	10,89 3,72	21,99 3,84	25,19 3,34
NTN-B 150535 (5,821000%)	0,12	9,18	0,57	4,89	10,91	22,01	25,21

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.	0,41	5,09	1,90	4,03	3,74	3,86	3,36
NTN-B 150850 (5,920000%) Var. IPCA p.p.	0,13 0,42	6,13 2,04	0,60 1,92	4,91 4,05	10,97 3,80	22,15 4,00	25,44 3,59
NTN-B 150850 (5,780000%) Var. IPCA p.p.	0,12 0,41	6,11 2,02	0,56 1,89	4,87 4,01	10,91 3,74	22,06 3,91	25,31 3,46
NTN-B 150545 (5,710000%) Var. IPCA p.p.	0,11 0,40	9,09 5,00	0,54 1,87	4,84 3,97	10,86 3,69	21,96 3,81	25,17 3,32
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,12 0,00	8,47 -0,12	3,38 -0,05	6,08 -0,09	9,65 -0,17	12,23 -0,33	16,91 -0,75
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,40 -0,02	6,91 -0,16	0,39 -0,05	3,03 -0,10	9,03 -0,22	15,26 -0,48	23,38 -0,75
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,24 1,53	8,29 4,20	3,54 4,86	5,84 4,98	9,44 2,28	10,38 -7,77	17,45 -4,40
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,09 -0,03	8,39 -0,21	3,37 -0,06	6,02 -0,16	9,57 -0,24	11,94 -0,61	16,61 -1,05
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,51 -0,11	6,53 -0,41	0,11 0,02	2,60 -0,34	8,47 -0,45	14,89 -0,79	23,34 -1,60
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	1,53 1,82	8,40 4,31	2,97 4,30	5,62 4,76	10,74 3,57	13,75 -4,40	17,95 -3,91
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	0,17 16,17	28,99 326,07	0,48 14,57	0,25 3,99	30,05 275,82	71,71 504,53	2.259,29 12.362,70
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	1,12 104,34	9,49 106,76	3,40 102,64	6,56 103,95	11,70 107,37	15,57 109,57	19,27 105,42
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,47 -0,01	5,45 -0,67	1,22 -0,48	2,24 -0,92	5,84 -1,40	11,30 -1,00	14,84 0,17
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,09 101,93	9,08 102,10	3,35 101,16	6,35 100,55	11,18 102,63	14,77 103,93	18,19 99,53
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,11 103,09	9,12 102,57	3,34 100,77	6,40 101,38	11,18 102,63	14,86 104,57	18,19 99,54
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	1,12 104,49	9,30 104,59	3,41 103,01	6,53 103,43	11,54 105,92	15,48 108,94	18,47 101,05
BRANCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-1,35 -1,82	8,17 3,19	13,87 2,21	-3,35 4,96	-1,15 -0,30	7,51 -8,80	-6,16 -11,22
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	1,28 0,81	9,36 4,38	11,86 0,20	-6,48 1,82	2,62 3,47	12,21 -4,11	12,18 7,13
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	-1,00	2,10	11,81	-3,37	-6,05	12,04	0,24

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.	-1,47	-2,87	0,14	4,93	-5,21	-4,27	-4,81
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-1,60 -2,07	2,44 -2,54	11,81 0,14	-8,69 -0,39			
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,09 1,71	8,36 -0,85	6,94 2,52	-6,33 -0,90	4,58 -2,63	21,26 -6,94	12,79 -2,84
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	0,80 0,33	6,29 1,31	12,66 1,00	-5,60 2,70	-3,26 -2,42	7,77 -8,55	2,10 -2,96
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	-0,03 -0,50	8,50 3,53	8,61 -3,05	-5,84 2,46	3,03 3,88	10,63 -5,68	-7,57 -12,62
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	-0,13 0,05	3,58 -0,68	11,14 -0,19	-9,22 -0,26	-3,03 -0,83	14,00 -2,06	4,65 -2,93
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	-1,34 0,50	-2,76 5,30	11,58 -2,90	-13,01 0,81	-14,44 3,99	0,72 6,30	-0,96 6,31
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-7,72 0,66	-30,97 -0,19	-4,35 0,03	-14,12 0,08	-22,81 -0,54	-8,72 -2,81	47,15 -3,67
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	-5,52 -514,48	-31,46 -353,90	-2,27 -68,59	-11,11 -175,94	-26,92 -247,07	-11,68 -82,19	42,97 235,12
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI Var. MSCI ACWI p.p.	-7,33 -1,56	-20,23 8,74	-4,08 0,21	-16,56 -5,31	-11,23 11,25	13,71 19,86	
ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI Var. S&P 500 p.p.	-8,62 -3,26	-19,75 7,36	-2,62 -0,40	-17,18 -7,49	-9,30 7,96	18,63 16,43	30,97 -25,41
CARAGUATATUBA Var. IPCA + 4,99% p.p.	-0,83 -0,95	0,98 -6,98	1,93 2,01	-0,54 -3,91	2,11 -10,40	7,27 -22,94	8,27 -32,73
CDI	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28
IBOVESPA	0,47	4,97	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05
INPC + 6,00%	0,17	8,98	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90
IPCA + 6,00%	0,20	8,74	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10

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
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 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
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	D+1 du	D+0	D+2 du	D+4 du		1,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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 RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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	1,11	8,59	3,43	6,17	9,81	12,55	17,67	26,42	34,96
IRF-M 1+	1,58	6,25	5,47	5,41	7,24	3,87	11,78	35,04	42,24
IRF-M TOTAL	1,40	6,96	4,66	5,53	8,01	6,91	13,92	33,10	40,74
IMA-B 5	0,42	7,07	0,43	3,14	9,25	15,75	24,13	43,24	52,60
IMA-B 5+	2,39	5,10	3,01	3,14	5,19	8,56	6,75	54,62	53,36
IMA-B TOTAL	1,48	6,12	1,70	3,16	7,25	12,30	14,67	50,64	54,48
IMA-GERAL TOTAL	1,26	7,80	3,17	5,13	9,24	11,95	16,81	36,41	43,76
IDKA 2	0,62	6,94	0,09	2,94	8,91	15,68	24,94	40,99	52,99
IDKA 20	5,00	3,97	6,75	3,59	0,98	3,03	-6,12	61,55	50,87
CDI	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,07

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,47	4,97	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05	38,69	48,11
IBRX 100	-0,05	4,43	10,77	-9,10	-1,33	16,26	6,28	43,30	51,68
IBRX 50	0,48	5,31	11,70	-8,80	0,58	19,15	7,21	38,32	48,42
SMALL CAP	-1,84	-8,06	14,47	-13,82	-18,43	-5,58	-7,27	45,86	34,71
IFIX	0,49	6,63	6,98	7,58	10,13	7,01	11,42	40,10	34,66
Índice Consumo - ICON	-1,18		15,08	-17,92	-27,77	-28,97	-29,71	8,70	-9,15
Índice Dividendos - IDIV	-1,80	9,21	4,42	-5,43	7,21	28,20	15,63	76,72	67,29

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	-0,29	4,09	-1,32	0,86	7,17	18,15	21,85	25,38	31,05
INPC	-0,32	4,32	-1,23	0,87	7,19	18,75	23,37	26,97	32,02
IGPM	-0,95	6,61	-1,43	1,07	8,25	35,16	59,40	64,77	81,31
SELIC	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,08

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-5,36	-27,11	-2,23	-9,68	-17,26	2,19	56,39	66,16	142,89
MSCI ACWI	-5,78	-28,97	-4,29	-11,25	-22,48	-6,15	37,99	42,53	93,97

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,04	7,20	-0,32	2,87	11,46	27,77	37,05	46,63	59,32
IPCA + 5,00%	0,12	7,97	-0,07	3,37	12,53	30,23	41,03	52,34	67,10
IPCA + 5,50%	0,16	8,35	0,05	3,62	13,06	31,48	43,06	55,26	71,10
IPCA + 5,89%	0,19	8,65	0,14	3,81	13,48	32,45	44,65	57,56	74,27
IPCA + 6,00%	0,20	8,74	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10	58,22	75,18
INPC + 4,00%	0,01	7,43	-0,22	2,89	11,48	28,42	38,75	48,49	60,50
INPC + 6,00%	0,17	8,98	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90	60,23	76,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
220	02/09/2022	ITAU SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	894,90	0,00	24,00344000	37,2821610000
221	02/09/2022	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	14.000.000,00	0,00	3.853,60058840	3.632,9660220000
222	08/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	234.993,50	0,00	90.205,74944000	2,6050833950
223	08/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.784,78	0,00	3.372,16843600	2,6050833950
224	08/09/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	31.348,98	0,00	7.407,31107200	4,2321673400
225	09/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.379,03	0,00	3.214,76334100	2,6064220320
226	09/09/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	22.677,98	5.355,74167100	4,2343304400
227	09/09/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	62.000,00	14.642,22049600	4,2343304400
228	19/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.201.288,58	0,00	459.504,10150400	2,6143152500
229	19/09/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	366.718,81	0,00	86.336,40295600	4,2475572000
230	20/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	46.721,45	0,00	17.862,05835400	2,6156811870
231	20/09/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.998.843,20	0,00	940.955,37955100	4,2497692100
232	20/09/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	280.561,30	0,00	66.018,00854000	4,2497692100
233	27/09/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	93.706,81	0,00	21.993,80293900	4,2606006000
234	29/09/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	28.595,38	0,00	6.703,55895100	4,2657012800
235	29/09/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.231.723,51	757.606,63284400	4,2657011830
236	29/09/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	179.376,28	42.050,83013400	4,2657012800
237	30/09/2022	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1.907,55	0,00	0,51979492	3.669,8127340000
Total			20.302.744,27	3.495.777,77		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 13.315.132,92

Value-At-Risk: 2,30%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARAGUATATUBA		2,30	2,30			578.395.960,32	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,11%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150523 (5,831000%)		0,19	-0,00	0,17			20.312.269,76	3,51
NTN-B 150523 (5,900000%)		0,19	-0,00	0,17			40.438.987,08	6,99
NTN-B 150525 (5,980000%)		0,29	-0,00	0,34			10.014.404,84	1,73
NTN-B 150535 (5,560000%)		0,19	-0,00	0,17			16.375.103,80	2,83
NTN-B 150535 (5,821000%)		0,19	-0,00	0,17			19.128.616,95	3,31
NTN-B 150545 (5,710000%)		0,19	-0,00	0,17			31.244.879,29	5,40
NTN-B 150545 (5,760000%)		0,19	-0,00	0,17			10.387.750,25	1,80
NTN-B 150545 (5,781000%)		0,19	-0,00	0,17			10.370.129,39	1,79
NTN-B 150555 (5,815000%)		0,19	-0,00	0,17			10.344.542,17	1,79
NTN-B 150555 (5,850000%)		0,25	-0,00	0,22			10.002.367,99	1,73
NTN-B 150824 (5,892000%)		0,19	-0,00	0,17			5.246.140,31	0,91
NTN-B 150824 (6,480000%)		0,29	-0,00	0,32			20.042.043,70	3,47
NTN-B 150830 (5,708000%)		0,19	-0,00	0,17			10.363.913,43	1,79
NTN-B 150840 (5,650000%)		0,19	-0,00	0,17			881.539,90	0,15
NTN-B 150840 (5,770000%)		0,19	-0,00	0,17			10.370.479,74	1,79
NTN-B 150850 (5,713000%)		0,19	-0,00	0,17			10.418.924,74	1,80
NTN-B 150850 (5,780000%)		0,19	-0,00	0,17			10.067.641,55	1,74
NTN-B 150850 (5,815000%)		0,19	-0,00	0,17			10.344.017,42	1,79
NTN-B 150850 (5,916000%)		0,19	-0,00	0,17			3.711.657,39	0,64
NTN-B 150850 (5,920000%)		0,24	-0,00	0,21			9.941.013,81	1,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,30	0,17	-0,00		-3,16	0,13	270.006.423,51	46,68

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		0,18	-0,00	0,26			397.801,69	0,07
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,18	0,00	0,01			11.263.766,93	1,95
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,17	0,00	0,01			561.397,04	0,10
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,54	0,00	0,42			2.031.669,26	0,35
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,42	0,00	1,43			2.655.120,48	0,46
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,25	0,00	1,27			1.340.444,51	0,23
Sub-total	1,29	0,51	0,00		0,00	1,08	18.250.199,91	3,16

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		2,69	0,00	0,36			699.082,22	0,12
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,03	-0,00	0,03			96.648.375,12	16,71
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,02	0,00	0,02			14.817.852,10	2,56
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	-0,00	0,01			14.679.023,85	2,54
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,01	-0,00	0,01			14.824.540,38	2,56
Sub-total	0,05	0,02	0,00		0,83	1,11	141.668.873,67	24,49

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR		0,01	-0,00	0,01			560.860,55	0,10
Sub-total	0,60	0,01	-0,00		-1,50	0,17	560.860,55	0,10

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,57%

Artigo 8º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS		8,33	0,02	3,58			1.466.494,28	0,25
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		12,40	0,10	3,35			5.894.786,80	1,02
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		10,02	0,01	1,85			749.619,60	0,13
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		10,63	0,35	0,15			23.428.058,53	4,05
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS		9,87	0,10	1,92			7.396.376,04	1,28
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		8,42	0,15	1,93			13.464.296,02	2,33
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		8,65	0,07	4,41			5.908.659,35	1,02
BRADESCO F I A SELECTION		10,97	0,08	3,33			5.354.557,10	0,93
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		9,01	0,12	4,55			9.563.597,96	1,65
Sub-total	22,27	9,57	1,00		-0,07	-0,43	73.226.445,68	12,66

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 13,39%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI		13,39	0,86	7,87			39.703.853,09	6,86
Sub-total	24,74	13,39	0,86		-0,39	-8,62	39.703.853,09	6,86

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,78%

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		10,05	0,01	10,05			1.096.186,99	0,19
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI		11,16	0,02	8,71			1.331.562,27	0,23
Sub-total	16,00	9,31	0,03		-0,47	-6,52	2.427.749,26	0,42

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		11,01	0,41	2,09			32.551.554,65	5,63

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	20,19	11,01	0,41		-0,44	-7,72	32.551.554,65	5,63