



LDB
EMPRESAS

CARAGUATATUBA
OUTUBRO 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 31.10.2022.

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

73,57%

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%)	2,94	0,55	5,14	20.423.635,03	3,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,900000%)	2,95	0,55	9,84	40.662.827,02	6,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,980000%)	4,11	0,56	0,73	10.070.397,11	1,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,560000%)	2,84	0,53	7,97	16.461.522,14	2,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,821000%)	2,90	0,55	7,00	19.233.349,05	3,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,710000%)	2,85	0,54	7,65	31.413.325,29	5,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	2,86	0,54	7,46	10.444.145,24	1,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,781000%)	2,87	0,54	7,30	10.426.593,78	1,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,815000%)	2,87	0,55	7,00	10.401.136,02	1,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	2,89	0,55	3,49	10.057.359,30	1,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,892000%)	2,98	0,55	6,97	5.275.141,85	0,89
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,480000%)	4,24	0,60	0,82	20.161.618,32	3,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,708000%)	2,93	0,54	7,25	10.419.771,47	1,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,650000%)	0,65	0,53	7,94	886.252,31	0,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,770000%)	2,91	0,54	7,29	10.426.862,29	1,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,713000%)	2,87	0,54	7,74	10.475.115,03	1,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,780000%)	2,90	0,54	4,13	10.122.452,55	1,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,815000%)	2,91	0,55	7,00	10.400.598,42	1,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,916000%)	2,95	0,55	6,75	3.732.245,84	0,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,920000%)	2,95	0,56	2,89	9.996.201,94	1,69
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,64	0,55	9,89	271.490.550,00	45,76

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	0,51	1,00	9,56	402.578,53	0,07	165.400.002,25	0,24
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,51	0,98	9,45	11.374.581,07	1,92	6.033.726.634,06	0,19
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,44	1,89	8,94	572.030,26	0,10	902.156.349,01	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,70	1,83	8,48	2.068.849,83	0,35	8.108.886.938,29	0,03
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,80	0,88	9,36	2.678.470,23	0,45	2.434.245.468,97	0,11
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,59	0,99	9,36	1.353.660,25	0,23	5.839.461.409,01	0,02
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,38	1,09	7,57	18.450.170,17	3,11		

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	5,59	1,25	6,77	707.805,26	0,12	447.224.453,96	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,14	1,03	10,25	98.920.597,59	16,67	14.020.474.735,38	0,71
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,16	1,09	10,68	14.980.925,11	2,53	3.279.050.946,44	0,46
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,12	1,04	7,27	16.330.632,12	2,75	12.427.649.222,70	0,13
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC	0,12	1,05	3,31	14.980.109,57	2,53	2.800.691.599,83	0,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
		FI							
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	1,58	1,04	10,23	145.920.069,65	24,60		
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	0,72	29,91	564.874,81	0,10	22.202.742,12	2,54
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea a	25,30	0,72	29,91	564.874,81	0,10		
		Renda Fixa	2,31	0,74	8,18	436.425.664,63	73,57		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

13,15%

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	18,26	5,17	14,11	1.542.244,91	0,26	651.510.998,09	0,24
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	25,18	8,43	5,44	6.391.747,07	1,08	1.071.937.315,26	0,60
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	20,06	6,12	12,79	795.528,74	0,13	519.673.528,79	0,15
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,68	5,63	9,42	24.747.579,06	4,17	907.112.837,29	2,73
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	20,05	5,78	15,68	7.824.224,82	1,32	726.235.442,52	1,08
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,09	6,04	14,91	14.278.107,46	2,41	998.009.273,18	1,43
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19,29	10,60	12,92	6.534.833,03	1,10	2.150.027.623,87	0,30
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	21,43	5,78	14,43	5.664.301,39	0,95	520.825.145,72	1,09
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	22,10	6,81	9,42	10.215.194,61	1,72	270.031.745,38	3,78
Sub-total Artigo 8º I			19,74	6,51	11,49	77.993.761,09	13,15		
Renda Variável			19,23	6,51	11,49	77.993.761,09	13,15		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,01%

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	19,91	3,61	-28,99	1.135.707,49	0,19	1.037.465.638,26	0,11
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	22,64	5,38	-15,94	1.403.158,01	0,24	424.939.275,41	0,33
Sub-total Artigo 9º II			18,84	4,58	-22,33	2.538.865,50	0,43		

Artigo 9º III (Fundos de 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	24,16	1,70	-29,79	33.105.909,36	5,58	2.030.078.847,62	1,63
Sub-total Artigo 9º III			24,16	1,70	-29,79	33.105.909,36	5,58		

Investimentos no Exterior			23,53	1,90	-29,31	35.644.774,86	6,01		
----------------------------------	--	--	--------------	-------------	---------------	----------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,28%

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	23,02	8,72	-12,75	43.166.001,49	7,28	1.273.842.064,19	3,39
Sub-total Artigo 10º I			23,02	8,72	-12,75	43.166.001,49	7,28		
Investimentos Estruturados			24,24	8,72	-12,75	43.166.001,49	7,28		
Total			5,60	2,08	3,08	593.230.202,07	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	271.490.550,00	45,76	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	18.450.170,17	3,11	0,00	10,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	145.920.069,65	24,60	0,00	14,25	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	564.874,81	0,10	0,00	0,25	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	436.425.664,63	73,57					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	77.993.761,09	13,15	0,00	5,50	35,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	77.993.761,09	13,15					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	2.538.865,50	0,43	0,00	1,96	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	33.105.909,36	5,58	0,00	7,04	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	35.644.774,86	6,01					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	43.166.001,49	7,28	0,00	9,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	43.166.001,49	7,28					15,00
Total		593.230.202,07	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	0,55 53,85	9,89 98,89	0,67 20,24	3,71 57,06		1.484.126,49	19.077.330,16
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,09 106,92	7,57 75,65	3,15 95,59	4,12 63,36	11,19 97,33	199.169,10	4.940.891,81
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,04 102,03	10,23 102,33	3,38 102,46	6,47 99,37		1.496.191,99	6.770.345,39
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,72 70,12	29,91 299,06	1,31 39,80	1,01 15,52		4.014,26	270.089,16
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	6,51 1,06	11,49 0,79	12,54 0,06	7,68 0,11		4.767.315,41	8.717.943,59
Artigo 9º II % do CDI	4,58 448,42	-22,33 -223,23	-5,84 -177,06	-4,68 -71,85	-21,46 -186,76	111.116,24	-729.819,82
Artigo 9º III % do CDI	1,70 166,85	-29,79 -297,86	-9,82 -298,04	-6,27 -96,27	-29,23 -254,37	554.354,71	-14.047.995,53
Artigo 10º I % do CDI	8,72 854,33	-12,75 -127,51	-3,84 -116,41	-1,45 -22,34		3.462.148,40	-6.310.008,47
CARAGUATATUBA (Total)						12.078.436,60	18.688.776,29

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%)	20.312.269,76	0,00	0,00	0,00	20.423.635,03	111.365,27	1.012.800,88
NTN-B 150523 (5,900000%)	40.438.987,08	0,00	0,00	0,00	40.662.827,02	223.839,94	3.719.160,63
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.014.404,84	0,00	0,00	0,00	10.070.397,11	55.992,27	72.869,05
NTN-B 150535 (5,560000%)	16.375.103,80	0,00	0,00	0,00	16.461.522,14	86.418,34	1.238.253,66
NTN-B 150535 (5,821000%)	19.128.616,95	0,00	0,00	0,00	19.233.349,05	104.732,10	1.281.010,06
NTN-B 150545 (5,710000%)	31.244.879,29	0,00	0,00	0,00	31.413.325,29	168.446,00	2.274.242,02
NTN-B 150545 (5,760000%)	10.387.750,25	0,00	0,00	0,00	10.444.145,24	56.394,99	737.998,10
NTN-B 150545 (5,781000%)	10.370.129,39	0,00	0,00	0,00	10.426.593,78	56.464,39	721.624,71
NTN-B 150555 (5,815000%)	10.344.542,17	0,00	0,00	0,00	10.401.136,02	56.593,85	692.256,82

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.002.367,99	0,00	0,00	0,00	10.057.359,30	54.991,31	341.119,40
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.246.140,31	0,00	0,00	0,00	5.275.141,85	29.001,54	352.738,11
NTN-B 150824 (6,480000%)	20.042.043,70	0,00	0,00	0,00	20.161.618,32	119.574,62	163.815,27
NTN-B 150830 (5,708000%)	10.363.913,43	0,00	0,00	0,00	10.419.771,47	55.858,04	722.274,05
NTN-B 150840 (5,650000%)	881.539,90	0,00	0,00	0,00	886.252,31	4.712,41	66.920,96
NTN-B 150840 (5,770000%)	10.370.479,74	0,00	0,00	0,00	10.426.862,29	56.382,55	726.533,79
NTN-B 150850 (5,713000%)	10.418.924,74	0,00	0,00	0,00	10.475.115,03	56.190,29	771.646,06
NTN-B 150850 (5,780000%)	10.067.641,55	0,00	0,00	0,00	10.122.452,55	54.811,00	410.885,24
NTN-B 150850 (5,815000%)	10.344.017,42	0,00	0,00	0,00	10.400.598,42	56.581,00	697.790,83
NTN-B 150850 (5,916000%)	3.711.657,39	0,00	0,00	0,00	3.732.245,84	20.588,45	241.960,66
NTN-B 150850 (5,920000%)	9.941.013,81	0,00	0,00	0,00	9.996.201,94	55.188,13	286.880,99
					271.490.550,00	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	11.263.766,93	0,00	0,00	0,00	11.374.581,07	110.814,14	999.151,88
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.031.669,26	0,00	0,00	0,00	2.068.849,83	37.180,57	1.330.267,22
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1.340.444,51	0,00	0,00	0,00	1.353.660,25	13.215,74	739.284,91
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2.655.120,48	0,00	0,00	0,00	2.678.470,23	23.349,75	229.159,77
ITAU SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	397.801,69	801,16	0,00	0,00	402.578,53	3.975,68	34.794,08
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	561.397,04	0,00	0,00	0,00	572.030,26	10.633,22	542.549,05
					18.450.170,17	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	14.679.023,85	1.492.012,80	0,00	0,00	16.330.632,12	159.595,47	845.134,72
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	96.648.375,12	4.873.803,25	-3.612.719,61	0,00	98.920.597,59	1.011.138,83	4.059.336,01
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	14.817.852,10	1.907,55	0,00	0,00	14.980.925,11	161.165,46	398.609,73
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	699.082,22	0,00	0,00	0,00	707.805,26	8.723,04	987.155,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	14.824.540,38	0,00	0,00	0,00	14.980.109,57	155.569,19	480.109,57
					145.920.069,65	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	560.860,55	0,00	0,00	0,00	564.874,81	4.014,26	270.089,16
					564.874,81	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	1.466.494,28	0,00	0,00	0,00	1.542.244,91	75.750,63	190.666,98
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	23.428.058,53	0,00	0,00	0,00	24.747.579,06	1.319.520,53	2.130.230,19
BRADESCO F I A SELECTION	5.354.557,10	0,00	0,00	0,00	5.664.301,39	309.744,29	714.125,69
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	5.894.786,80	0,00	0,00	0,00	6.391.747,07	496.960,27	329.506,36
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	7.396.376,04	0,00	0,00	0,00	7.824.224,82	427.848,78	1.060.800,08
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	13.464.296,02	0,00	0,00	0,00	14.278.107,46	813.811,44	1.852.402,01
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	5.908.659,35	0,00	0,00	0,00	6.534.833,03	626.173,68	747.733,28
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	749.619,60	0,00	0,00	0,00	795.528,74	45.909,14	813.256,99
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	9.563.597,96	0,00	0,00	0,00	10.215.194,61	651.596,65	879.222,01
					77.993.761,09	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	1.096.186,99	0,00	0,00	0,00	1.135.707,49	39.520,50	-463.722,58
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	1.331.562,27	0,00	0,00	0,00	1.403.158,01	71.595,74	-266.097,24
					2.538.865,50	0,00	0,00

Artigo 9º III (Fundos de 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	32.551.554,65	0,00	0,00	0,00	33.105.909,36	554.354,71	-14.047.995,53
					33.105.909,36	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	39.703.853,09	0,00	0,00	0,00	43.166.001,49	3.462.148,40	-6.310.008,47
					43.166.001,49	0,00	0,00

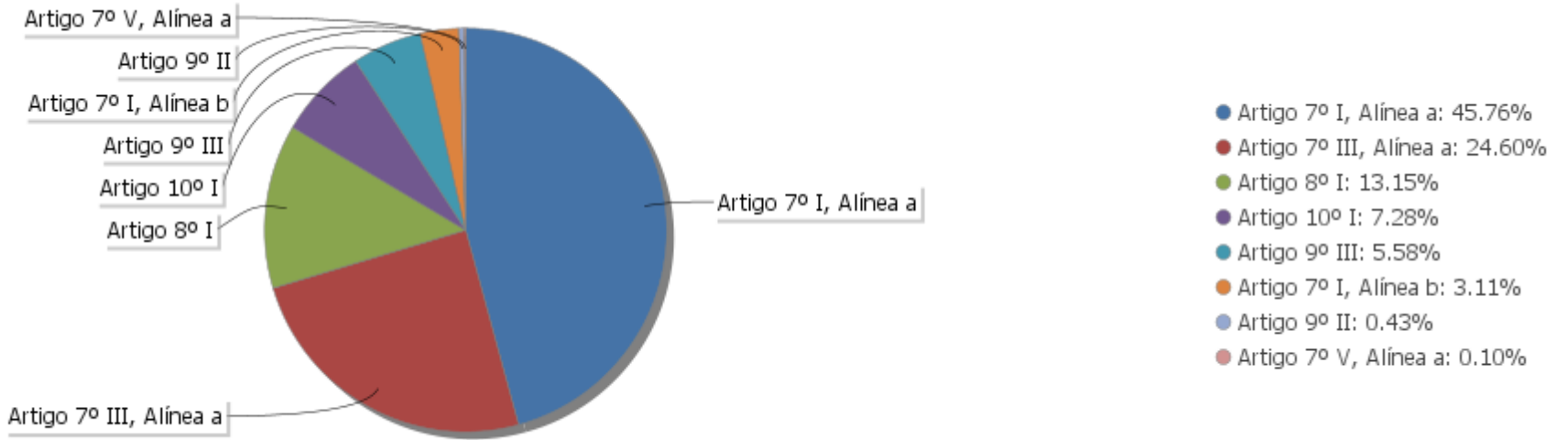
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

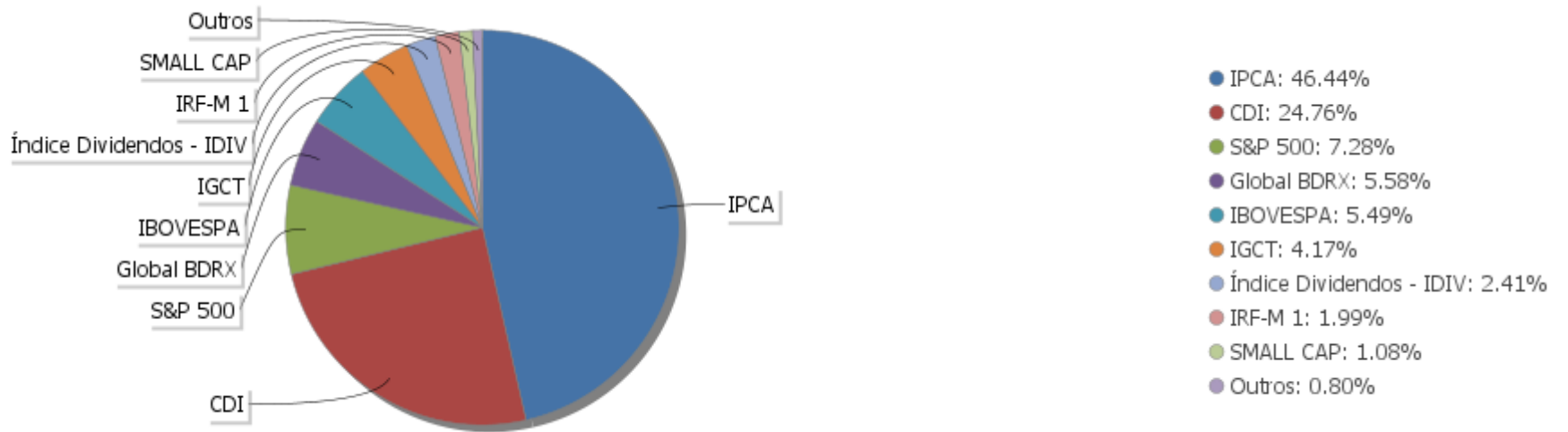
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	282.322.417,34	47,59	282.322.417,34	47,59
de 31 a 365 dias	100.503.696,78	16,94	382.826.114,12	64,53
acima de 365 dias	210.404.087,95	35,47	593.230.202,07	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

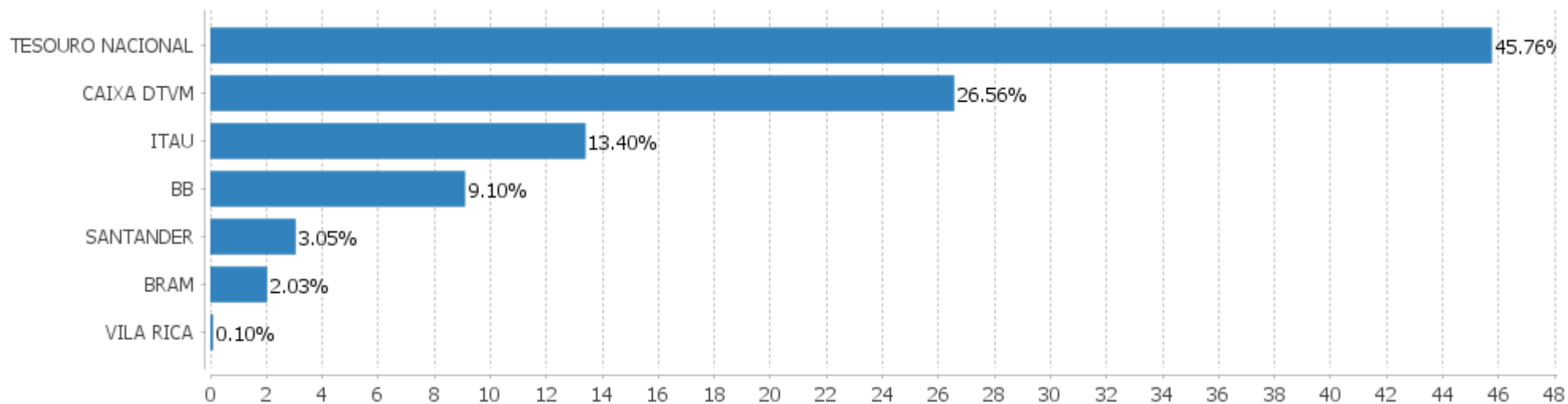


Alocação Por Estratégia



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	2,08			3,08
IPCA + 4,99%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,90	1,08	-0,28	0,08	0,12	0,98			9,02
p.p. indexador	-1,48	-1,65	0,30	-3,13	0,11	-2,81	2,54	0,42	-0,95	1,10			-5,93
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

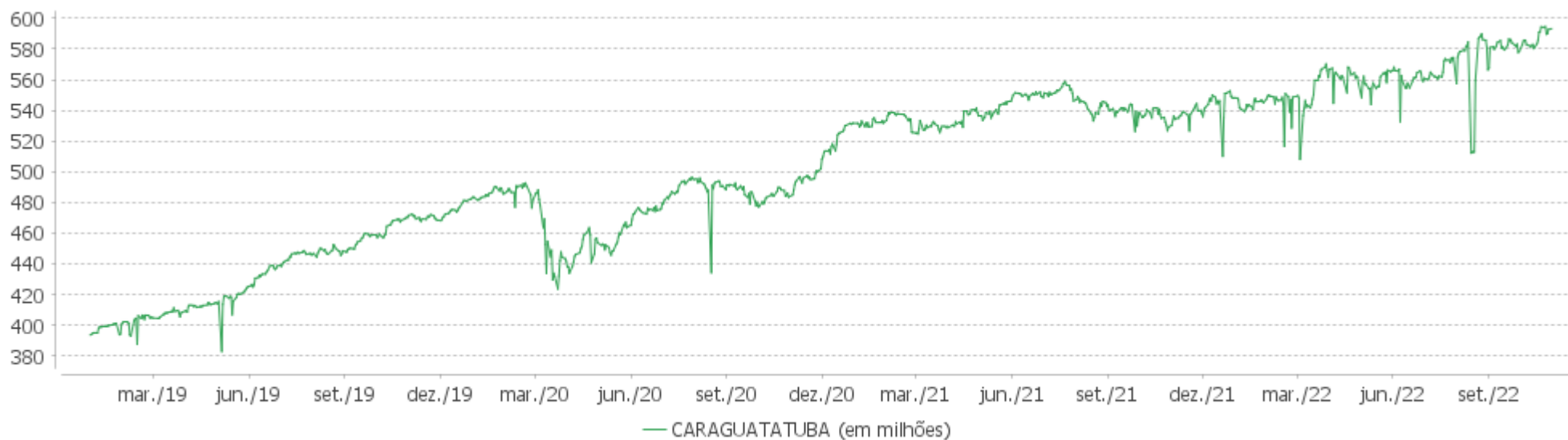
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	21	45,65	03 meses	1,75	1,18	0,57	4,81
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	54,35	06 meses	3,28	2,91	0,38	5,18
			12 meses	5,88	11,87	-5,98	5,60
			24 meses	9,56	30,60	-21,04	5,66
Maior rentabilidade da Carteira	4,43	2020-12	36 meses	8,24	43,67	-35,43	8,77
Menor rentabilidade da Carteira	-8,82	2020-03	Desde 31/12/2018	23,15	54,81	-31,65	7,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

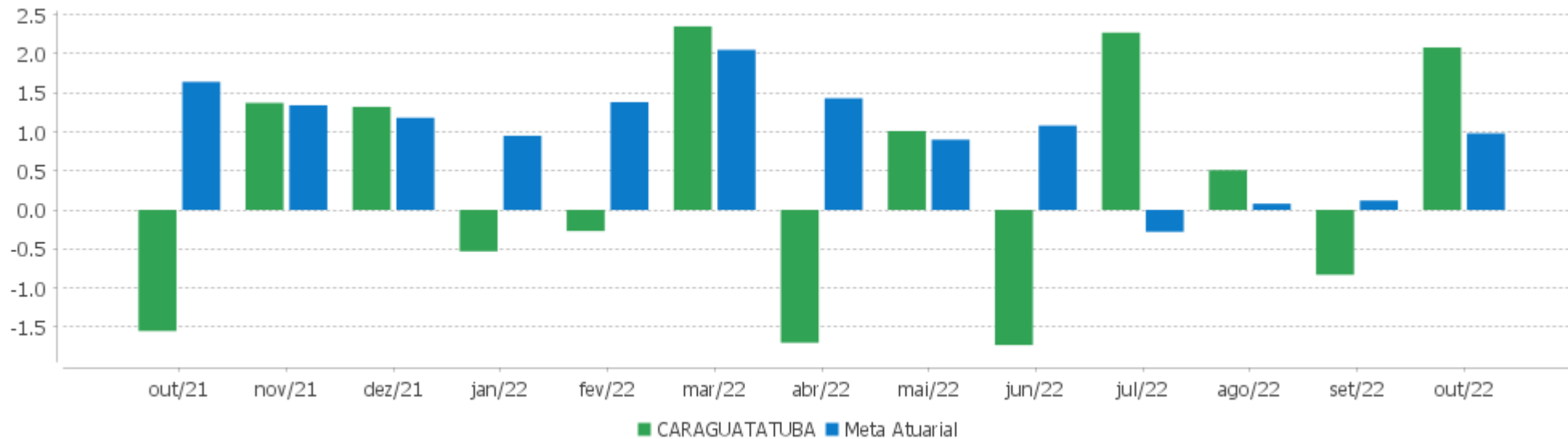


Patrimônio Líquido



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.	0,55 -0,04	9,78 5,08	0,64 0,71	3,63 3,23	9,85 3,38	20,99 3,16	25,05 2,60
NTN-B 150545 (5,781000%) Var. IPCA p.p.	0,54 -0,05	9,74 5,04	0,63 0,69	3,60 3,21	9,88 3,41	21,15 3,31	25,32 2,87
NTN-B 150535 (5,560000%) Var. IPCA p.p.	0,53 -0,06	9,55 4,85	0,58 0,64	3,49 3,10	9,69 3,22	20,77 2,94	24,77 2,32
NTN-B 150840 (5,650000%) Var. IPCA p.p.	0,53 -0,06	9,63 4,92	0,60 0,66	3,54 3,14	12,89 6,42	24,39 6,56	28,61 6,16
NTN-B 150824 (5,892000%) Var. IPCA p.p.	0,55 -0,04	6,69 1,99	0,66 0,72	3,66 3,26	9,91 3,44	21,13 3,30	25,26 2,81
NTN-B 150555 (5,850000%) Var. IPCA p.p.	0,55 -0,04	9,77 5,06	0,65 0,71	3,61 3,21	9,90 3,43	21,21 3,38	25,43 2,98
NTN-B 150523 (5,900000%) Var. IPCA p.p.	0,55 -0,04	9,84 5,14	0,66 0,72	3,66 3,27	9,92 3,45	21,14 3,31	25,27 2,82
NTN-B 150850 (5,916000%) Var. IPCA p.p.	0,55 -0,04	6,74 2,04	0,66 0,73	3,67 3,28	9,97 3,50	21,29 3,46	25,52 3,07
NTN-B 150850 (5,713000%) Var. IPCA p.p.	0,54 -0,05	6,66 1,95	0,61 0,68	3,57 3,18	9,84 3,37	21,11 3,28	25,29 2,84
NTN-B 150850 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	0,55 -0,04	6,70 2,00	0,64 0,70	3,62 3,23	9,91 3,44	21,20 3,37	25,40 2,95
NTN-B 150545 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	0,54 -0,05	9,72 5,02	0,63 0,69	3,59 3,20	9,86 3,39	21,12 3,29	25,29 2,84
NTN-B 150525 (5,980000%) Var. IPCA p.p.	0,56 -0,03	6,77 2,07	0,69 0,75	0,74 0,34	6,85 0,38	17,84 0,01	21,94 -0,51
NTN-B 150830 (5,708000%) Var. IPCA p.p.	0,54 -0,05	6,59 1,89	0,61 0,68	3,57 3,17	9,78 3,31	20,89 3,06	24,93 2,48
NTN-B 150555 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	0,55 -0,04	9,77 5,06	0,64 0,70	3,62 3,23	9,91 3,44	21,22 3,38	25,43 2,98
NTN-B 150824 (6,480000%) Var. IPCA p.p.	0,60 0,01	4,05 -0,65	-2,11 -2,05	0,95 0,56	7,29 0,82	18,78 0,95	23,35 0,90
NTN-B 150840 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	0,54 -0,05	6,66 1,96	0,63 0,69	3,60 3,20	9,86 3,39	21,10 3,27	25,25 2,80
NTN-B 150850 (5,920000%)	0,56	6,72	0,66	3,64	9,94	21,26	25,49

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.	-0,03	2,01	0,73	3,25	3,47	3,43	3,04
NTN-B 150535 (5,821000%) Var. IPCA p.p.	0,55 -0,04	9,77 5,07	0,64 0,70	3,62 3,23	9,88 3,41	21,12 3,29	25,27 2,82
NTN-B 150850 (5,780000%) Var. IPCA p.p.	0,54 -0,05	6,68 1,98	0,63 0,69	3,60 3,21	9,89 3,42	21,17 3,34	25,36 2,91
NTN-B 150545 (5,710000%) Var. IPCA p.p.	0,54 -0,05	9,68 4,97	0,61 0,68	3,57 3,17	9,83 3,36	21,07 3,24	25,23 2,78
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,00 -0,01	9,56 -0,12	3,38 -0,00	6,37 -0,07	11,43 -0,09	13,21 -0,28	17,31 -0,80
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,89 -0,02	8,94 -0,19	2,30 -0,05	3,40 -0,11	12,50 -0,23	17,23 -0,49	23,70 -0,75
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,99 0,40	9,36 4,65	3,75 3,81	5,92 5,53	11,26 4,79	11,59 -6,24	16,62 -5,83
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,98 -0,02	9,45 -0,23	3,31 -0,08	6,32 -0,13	11,23 -0,29	12,92 -0,58	17,06 -1,05
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,83 0,05	8,48 -0,37	2,24 0,19	3,04 -0,18	11,90 -0,60	16,82 -0,88	24,01 -1,60
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,88 0,29	9,36 4,65	3,05 3,11	5,73 5,33	12,11 5,64	14,66 -3,17	18,40 -4,05
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	0,72 70,12	29,91 299,06	1,31 39,80	1,01 15,52	30,91 269,00	25,44 167,38	3.041,81 16.085,63
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	1,09 106,56	10,68 106,81	3,44 104,24	6,88 105,69	12,27 106,78	16,66 109,60	20,01 105,79
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,25 0,02	6,77 -0,66	3,63 -0,24	2,75 -0,82	11,01 -0,39	12,69 -0,76	12,22 -0,08
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,04 101,81	10,21 102,09	3,35 101,70	6,62 101,68	11,79 102,61	15,78 103,83	18,90 99,93
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,03 101,13	10,25 102,43	3,36 101,99	6,65 102,09	11,77 102,40	15,91 104,68	18,88 99,83
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	1,05 102,81	10,45 104,43	3,41 103,62	6,76 103,88	12,04 104,79	16,48 108,43	19,21 101,60
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	5,78 0,33	14,43 3,73	13,32 0,85	10,57 3,00	14,43 2,32	10,06 -13,44	-4,06 -12,28
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	5,78 0,33	15,68 4,99	12,82 0,35	8,67 1,11	16,48 4,37	20,86 -2,65	15,16 6,94
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	10,60	12,92	16,65	14,07	12,37	23,30	8,29

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.	5,14	2,22	4,17	6,51	0,26	-0,21	0,06
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	6,81 1,36	9,42 -1,28	12,29 -0,19	5,43 -2,14	3,93 -8,18		
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	6,04 2,01	14,91 1,30	9,71 3,20	6,36 2,60	15,89 -0,57	28,52 -3,98	15,62 -2,87
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	6,12 0,67	12,79 2,10	13,77 1,29	10,74 3,18	12,55 0,43	15,91 -7,60	5,34 -2,88
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	5,63 -0,21	9,42 -0,93	12,43 -0,31	6,59 -0,48	11,18 -1,03	21,41 -2,32	7,54 -3,13
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	5,17 -0,29	14,11 3,41	11,05 -1,43	5,56 -2,00	13,83 1,72	18,07 -5,44	-3,74 -11,96
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	8,43 1,13	5,44 6,78	14,34 -2,47	4,13 3,22	6,07 6,01	11,97 8,29	6,07 8,78
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	1,70 0,37	-29,79 0,07	-9,82 0,16	-6,27 0,29	-29,23 -0,10	-5,49 -2,53	51,74 -3,28
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	3,61 353,22	-28,99 -289,87	-5,17 -157,01	-4,14 -63,66	-29,80 -259,33	-7,93 -52,21	49,11 259,71
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI Var. MSCI ACWI p.p.	5,38 2,34	-15,94 10,88	-6,36 0,47	-5,10 -0,97	-13,11 13,59	23,74 26,81	
ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI Var. S&P 500 p.p.	8,72 3,72	-12,75 10,72	-3,84 1,18	-1,45 -1,60	-8,38 13,29	32,25 24,40	39,41 -27,94
CARAGUATATUBA Var. IPCA + 4,99% p.p.	2,08 1,10	3,08 -5,93	1,75 0,57	3,28 0,38	5,88 -5,90	9,56 -20,27	8,24 -33,36
CDI	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91
IBOVESPA	5,45	10,70	12,48	7,57	12,11	23,51	8,22
INPC + 6,00%	0,94	10,00	1,33	3,32	12,85	32,81	47,43
IPCA + 6,00%	1,06	9,89	1,43	3,41	12,86	32,34	45,71

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 RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,10
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

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	1,00	9,68	3,38	6,44	11,52	13,50	18,11	26,53	35,47
IRF-M 1+	0,92	7,22	5,18	6,95	12,08	5,46	10,35	30,15	43,64
IRF-M TOTAL	0,93	7,95	4,44	6,64	11,95	8,26	13,06	29,67	41,90
IMA-B 5	1,91	9,12	2,35	3,50	12,73	17,73	24,45	41,60	54,77
IMA-B 5+	0,65	5,79	5,62	3,73	10,15	9,03	2,65	40,63	55,93
IMA-B TOTAL	1,23	7,43	3,86	3,57	11,40	13,44	12,30	42,33	56,98
IMA-GERAL TOTAL	1,01	8,88	3,72	5,61	11,80	12,98	15,99	33,17	45,02
IDKA 2	1,78	8,84	2,04	3,22	12,50	17,69	25,62	40,76	54,48
IDKA 20	-0,33	3,63	10,36	4,51	7,43	2,00	-11,54	37,24	53,99
CDI	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91	26,30	34,57

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,45	10,70	12,48	7,57	12,11	23,51	8,22	32,73	56,16
IBRX 100	5,57	10,25	12,01	6,76	11,78	23,41	9,78	37,01	60,34
IBRX 50	5,32	10,92	12,53	7,34	13,01	26,17	10,50	32,80	56,33
SMALL CAP	7,30	-1,35	16,81	0,91	0,06	3,68	-2,72	39,01	46,73
IFIX	0,02	6,66	6,30	6,34	11,80	8,12	7,14	33,40	34,37
Índice Consumo - ICON	6,28		12,02	1,65	-14,96	-22,29	-23,79	10,51	-0,91
Índice Dividendos - IDIV	4,03	13,61	6,51	3,76	16,46	32,51	18,49	64,97	73,53

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	0,59	4,70	-0,06	0,39	6,47	17,83	22,45	25,55	31,28
INPC	0,47	4,81	-0,16	0,30	6,46	18,26	23,90	27,06	32,15
IGPM	-0,97	5,58	-2,59	-1,31	6,52	29,66	56,80	61,74	79,20
SELIC	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91	26,30	34,58

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	5,00	-23,47	-5,01	0,15	-21,68	7,85	67,36	101,91	141,21
MSCI ACWI	3,03	-26,82	-6,84	-4,13	-26,70	-3,07	44,06	71,11	89,42

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,90	8,17	0,94	2,41	10,73	27,41	37,65	46,79	59,57
IPCA + 5,00%	0,98	9,03	1,18	2,91	11,79	29,86	41,64	52,49	67,35
IPCA + 5,50%	1,02	9,46	1,31	3,16	12,33	31,10	43,66	55,41	71,35
IPCA + 5,89%	1,05	9,79	1,40	3,35	12,74	32,06	45,25	57,71	74,53
IPCA + 6,00%	1,06	9,89	1,43	3,41	12,86	32,34	45,71	58,36	75,43
INPC + 4,00%	0,78	8,27	0,84	2,32	10,72	27,87	39,28	48,55	60,63
INPC + 6,00%	0,94	10,00	1,33	3,32	12,85	32,81	47,43	60,26	76,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
238	04/10/2022	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	801,16	0,00	21,25677935	37,6896230000
239	06/10/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	2.679,65	626,65932900	4,2760870200
240	07/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	226.838,96	0,00	86.133,18161000	2,6335838960
241	10/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.379,03	0,00	3.179,93580900	2,6349682830
242	10/10/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	56.000,00	13.082,48762600	4,2805314700
243	11/10/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.598,06	373,14002300	4,2827348700
244	13/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.784,78	0,00	3.330,48306300	2,6376894380
245	13/10/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	27.371,39	0,00	6.387,72189900	4,2850002600
246	17/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	46.721,45	0,00	17.694,27884800	2,6404834240
247	18/10/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	9.341,48	0,00	2.176,62963500	4,2917177300
248	19/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.201.288,58	0,00	454.479,17657600	2,6432202880
249	19/10/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	93.578,99	0,00	21.792,25744400	4,2941393400
250	19/10/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.998.957,94	0,00	931.259,47328900	4,2941393400
251	19/10/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	93.578,99	21.792,25744454	4,2941393400
252	19/10/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	280.561,30	0,00	65.335,86308800	4,2941393400
253	20/10/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	341.336,66	0,00	79.448,10052790	4,2963476500
254	20/10/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	2.000,00	465,51166800	4,2963476500
255	26/10/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.259.247,10	757.030,67134300	4,3053039100
256	26/10/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	28.658,93	0,00	6.656,65667200	4,3053039100
257	26/10/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	195.615,81	45.436,00504300	4,3053039100
258	27/10/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	93.996,56	0,00	21.821,49743959	4,3075210700
259	27/10/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	2.000,00	464,30414700	4,3075210700
260	27/10/2022	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1.907,55	0,00	0,51482353	3.705,2502440000
Total			6.368.524,76	3.612.719,61		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 14.013.536,28

Value-At-Risk: 2,36%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARAGUATATUBA		2,36	2,36			593.230.202,07	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%)		0,18	-0,00	0,19			20.423.635,03	3,44
NTN-B 150523 (5,900000%)		0,18	-0,00	0,19			40.662.827,02	6,85
NTN-B 150525 (5,980000%)		0,18	-0,00	0,19			10.070.397,11	1,70
NTN-B 150535 (5,560000%)		0,18	-0,00	0,19			16.461.522,14	2,77
NTN-B 150535 (5,821000%)		0,18	-0,00	0,19			19.233.349,05	3,24
NTN-B 150545 (5,710000%)		0,18	-0,00	0,19			31.413.325,29	5,30
NTN-B 150545 (5,760000%)		0,18	-0,00	0,19			10.444.145,24	1,76
NTN-B 150545 (5,781000%)		0,18	-0,00	0,19			10.426.593,78	1,76
NTN-B 150555 (5,815000%)		0,18	-0,00	0,19			10.401.136,02	1,75
NTN-B 150555 (5,850000%)		0,18	-0,00	0,19			10.057.359,30	1,70
NTN-B 150824 (5,892000%)		0,18	-0,00	0,19			5.275.141,85	0,89
NTN-B 150824 (6,480000%)		0,31	-0,00	0,34			20.161.618,32	3,40
NTN-B 150830 (5,708000%)		0,18	-0,00	0,19			10.419.771,47	1,76
NTN-B 150840 (5,650000%)		0,18	-0,00	0,19			886.252,31	0,15
NTN-B 150840 (5,770000%)		0,18	-0,00	0,19			10.426.862,29	1,76
NTN-B 150850 (5,713000%)		0,18	-0,00	0,19			10.475.115,03	1,77
NTN-B 150850 (5,780000%)		0,18	-0,00	0,19			10.122.452,55	1,71
NTN-B 150850 (5,815000%)		0,18	-0,00	0,19			10.400.598,42	1,75
NTN-B 150850 (5,916000%)		0,18	-0,00	0,19			3.732.245,84	0,63
NTN-B 150850 (5,920000%)		0,18	-0,00	0,19			9.996.201,94	1,69

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,32	0,17	-0,01		-1,48	0,55	271.490.550,00	45,76

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		0,17	-0,00	0,24			402.578,53	0,07
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,17	0,00	0,01			11.374.581,07	1,92
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,16	0,00	0,01			572.030,26	0,10
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,48	0,00	0,49			2.068.849,83	0,35
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,49	0,00	1,50			2.678.470,23	0,45
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,01	0,00	1,02			1.353.660,25	0,23
Sub-total	0,60	0,50	0,00		0,12	1,09	18.450.170,17	3,11

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		2,78	0,00	0,41			707.805,26	0,12
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,03	0,00	0,03			98.920.597,59	16,67
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,02	0,00	0,02			14.980.925,11	2,53
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	-0,00	0,01			16.330.632,12	2,75
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,01	-0,00	0,01			14.980.109,57	2,53
Sub-total	0,04	0,02	0,00		0,56	1,04	145.920.069,65	24,60

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR		0,07	-0,00	0,07			564.874,81	0,10
Sub-total	2,53	0,07	-0,00		-0,12	0,72	564.874,81	0,10

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,15%

Artigo 8º I

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS		9,31	0,02	3,08			1.542.244,91	0,26
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		12,92	0,11	3,19			6.391.747,07	1,08
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		10,50	0,01	1,64			795.528,74	0,13
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		10,81	0,34	0,16			24.747.579,06	4,17
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS		10,27	0,10	1,77			7.824.224,82	1,32
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		8,97	0,15	1,82			14.278.107,46	2,41
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		9,20	0,08	4,93			6.534.833,03	1,10
BRADESCO F I A SELECTION		11,19	0,08	2,91			5.664.301,39	0,95
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		10,89	0,14	4,54			10.215.194,61	1,72
Sub-total	28,89	10,15	1,02		0,19	6,51	77.993.761,09	13,15

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 12,56%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI		12,56	0,85	7,60			43.166.001,49	7,28
Sub-total	27,62	12,56	0,85		0,28	8,72	43.166.001,49	7,28

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 13,33%

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		10,26	0,01	10,26			1.135.707,49	0,19
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI		11,12	0,02	8,19			1.403.158,01	0,24
Sub-total	24,09	9,40	0,03		0,15	4,58	2.538.865,50	0,43

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		13,73	0,46	2,44			33.105.909,36	5,58
Sub-total	35,00	13,73	0,46		0,02	1,70	33.105.909,36	5,58

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS