



**LDB**  
EMPRESAS

**SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO**  
ABRIL 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 29.04.2022.

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

82,04%

## 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 150535 (5,600000%)	4,01	1,76	4,08	78.795.607,07	8,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,890000%)	4,10	1,78	2,55	109.303.967,45	11,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,530000%)	2,87	1,76	4,06	48.405.978,41	5,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,620000%)	2,84	1,77	4,08	90.837.831,50	9,61
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,70</b>	<b>1,77</b>	<b>4,09</b>	<b>327.343.384,43</b>	<b>34,63</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
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,64	1,54	5,35	92.404.145,86	9,78	11.887.667.806,21	0,78
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,64	1,54	5,36	67.993.269,94	7,19	1.213.440.846,98	5,60
BB	BB	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,59	0,48	2,81	28.280.691,98	2,99	210.810.927,62	13,42
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,15	0,71	2,77	1.365.379,62	0,14	956.356.979,66	0,14
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	1,55	2,05	6,16	4.374.638,77	0,46	490.881.908,79	0,89
BB	BB	BB PREV RF VII	1,55	2,05	6,16	733.034,75	0,08	255.836.372,37	0,29
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,16	0,78	3,43	65.041.668,40	6,88	2.728.342.512,21	2,38
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	6,05	0,67	3,16	23.216.212,22	2,46	955.132.457,33	2,43
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>3,42</b>	<b>1,18</b>	<b>3,87</b>	<b>283.409.041,54</b>	<b>29,98</b>		

## 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
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,17	0,73	2,89	290,10	0,00	3.457.499.653,78	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,18	0,86	3,45	74.665.501,29	7,90	5.669.332.770,36	1,32
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,71	0,95	3,55	40.951.911,24	4,33	955.504.680,82	4,29
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,15</b>	<b>0,89</b>	<b>3,48</b>	<b>115.617.702,63</b>	<b>12,23</b>		

## Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRADESCO	BRADESCO	LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a	0,89	1,89	2,71	9.712.616,39	1,03	0,00	
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a	0,92	1,87	2,67	9.702.520,56	1,03	0,00	
XP	XP	LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	2,66	0,41	0,41	7.932.499,32	0,84	0,00	
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	3,59	0,55	0,55	7.943.836,60	0,84	0,00	
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	1,03	2,24	4,57	13.803.338,16	1,46	0,00	
<b>Sub-total Artigo 7º IV</b>			<b>0,89</b>	<b>1,98</b>	<b>4,40</b>	<b>49.094.811,03</b>	<b>5,19</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	-0,04	28,61	86.734,28	0,01	40.395.435,01	0,21
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>			<b>26,03</b>	<b>-0,04</b>	<b>28,61</b>	<b>86.734,28</b>	<b>0,01</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>2,76</b>	<b>1,43</b>	<b>4,05</b>	<b>775.551.673,91</b>	<b>82,04</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

11,27%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	24,42	-10,96	-2,16	29.979.143,79	3,17	1.685.141.632,83	1,78
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	17,82	-6,31	-1,01	18.500.517,39	1,96	2.248.085.818,53	0,82
BRAM	BEM	BRAPRES F I A SELECTION	20,34	-7,53	3,49	17.007.719,00	1,80	468.444.914,78	3,63
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	27,64	-11,23	-11,59	16.994.336,13	1,80	725.956.775,63	2,34
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	28,66	-8,36	-0,03	2.745.281,35	0,29	322.957.053,86	0,85
TRUXT	INTRAG	TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	24,52	-8,75	1,55	21.288.344,73	2,25	1.028.483.761,73	2,07
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>23,01</b>	<b>-9,18</b>	<b>-2,01</b>	<b>106.515.342,39</b>	<b>11,27</b>		
Renda Variável			20,95	-9,18	-2,01	106.515.342,39	11,27		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,54%

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
XP	BNP PARIBAS	ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	19,58	-8,00	-14,41	3.182.006,78	0,34	95.263.682,29	3,34
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	22,37	-10,91	-22,24	14.067.419,41	1,49	339.687.078,57	4,14
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	27,45	-8,96	-38,03	15.341.365,18	1,62	731.072.061,43	2,10
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16,22	-3,92	-25,92	19.804.631,29	2,10	1.295.887.061,82	1,53
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>17,49</b>	<b>-7,62</b>	<b>-28,55</b>	<b>52.395.422,66</b>	<b>5,54</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>17,49</b>	<b>-7,62</b>	<b>-28,55</b>	<b>52.395.422,66</b>	<b>5,54</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,15%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	0,48	0,43	3,67	0,00	0,00	836.061.315,16	0,00
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	16,76	-8,77	-11,40	8.141.170,96	0,86	431.935.926,69	1,88
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI	0,36	0,79	3,64	2.703.010,70	0,29	48.002.648,71	5,63
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>12,27</b>	<b>-5,43</b>	<b>-4,69</b>	<b>10.844.181,66</b>	<b>1,15</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>12,27</b>	<b>-5,43</b>	<b>-4,69</b>	<b>10.844.181,66</b>	<b>1,15</b>		
<b>Total</b>			<b>4,44</b>	<b>-0,52</b>	<b>0,72</b>	<b>945.306.620,62</b>	<b>100,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	327.343.384,43	34,63	0,00	11,50	100,00	30,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	283.409.041,54	29,98	50,00	56,00	100,00	25,07	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	115.617.702,63	12,23	0,00	11,00	60,00	11,36	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	49.094.811,03	5,19	0,00	0,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	86.734,28	0,01	0,00	0,50	5,00	0,01	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>775.551.673,91</b>	<b>82,04</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	106.515.342,39	11,27	3,00	5,00	20,00	1,29	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>106.515.342,39</b>	<b>11,27</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	52.395.422,66	5,54	0,00	9,00	10,00	8,59	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>52.395.422,66</b>	<b>5,54</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	10.844.181,66	1,15	1,00	5,00	10,00	10,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>10.844.181,66</b>	<b>1,15</b>					15,00



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,77 212,19	4,09 199,08				5.694.197,20	11.250.139,42
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,18 141,20	3,87 117,95	3,96 156,78	7,09 151,64	5,25 74,16	3.363.657,97	12.900.821,05
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,89 107,25	3,48 106,10	2,67 105,60			1.025.624,24	3.927.593,27
Artigo 7º IV % do CDI	1,98 237,73	4,40 210,00				736.791,90	1.188.734,03
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,04 -4,90	28,61 872,58	28,27 1.117,98			-35,48	19.295,94
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	0,64 19,58	0,37 14,50			0,00	59.539,75
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-9,18 0,93	-2,01 -4,92	-6,14 -2,34			-10.762.539,41	-2.181.605,43
Artigo 9º II % do CDI	-7,62 -912,72	-28,55 -870,60	-17,99 -711,58	-30,61 -654,28	-26,30 -371,56	-4.318.842,54	-20.986.418,36
Artigo 10º I % do CDI	-5,43 -650,26	-4,69 -143,09	-3,28 -129,60			-718.045,93	-534.058,58
<b>SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>-4.979.192,05</b>	<b>5.644.041,09</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 150535 (5,600000%)	77.430.016,39	0,00	0,00	0,00	78.795.607,07	1.365.590,68	3.085.597,69
NTN-B 150545 (5,890000%)	107.387.475,22	0,00	0,00	0,00	109.303.967,45	1.916.492,23	2.714.601,53
NTN-B 150830 (5,530000%)	47.569.434,98	0,00	0,00	0,00	48.405.978,41	836.543,43	1.889.658,95
NTN-B 150840 (5,620000%)	89.262.260,64	0,00	0,00	0,00	90.837.831,50	1.575.570,86	3.560.281,25
					327.343.384,43	0,00	0,00

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	28.144.799,36	0,00	0,00	0,00	28.280.691,98	135.892,62	806.823,45
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4.286.876,96	0,00	0,00	0,00	4.374.638,77	87.761,81	255.215,63
BB PREV RF VII	718.338,05	0,00	0,00	0,00	733.034,75	14.696,70	42.739,09
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.228.220,20	17.780.942,14	-17.687.223,38	0,00	1.365.379,62	43.440,66	331.405,21
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	91.006.468,23	0,00	0,00	0,00	92.404.145,86	1.397.677,63	4.693.942,72
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	64.540.688,15	0,00	0,00	0,00	65.041.668,40	500.980,25	2.158.537,55
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	23.062.501,41	0,00	0,00	0,00	23.216.212,22	153.710,81	710.211,99
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	66.963.772,45	0,00	0,00	0,00	67.993.269,94	1.029.497,49	3.463.751,16
					283.409.041,54	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 FLUXO FIC	49.932,18	9.566,46	-59.440,35	0,00	290,10	231,81	37.548,10
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	74.025.662,55	0,00	0,00	0,00	74.665.501,29	639.838,74	2.487.387,96
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	40.566.357,55	0,00	0,00	0,00	40.951.911,24	385.553,69	1.402.657,21
					115.617.702,63	0,00	0,00

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a	9.532.516,14	0,00	0,00	0,00	9.712.616,39	180.100,25	256.539,39
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	0,00	7.900.000,00	0,00	0,00	7.932.499,32	32.499,32	32.499,32
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a	9.524.842,13	0,00	0,00	0,00	9.702.520,56	177.678,43	252.520,56
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	13.500.660,86	0,00	0,00	0,00	13.803.338,16	302.677,30	603.338,16
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	0,00	7.900.000,00	0,00	0,00	7.943.836,60	43.836,60	43.836,60
					49.094.811,03	0,00	0,00

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

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC ITALIA SENIOR	86.769,76	0,00	0,00	0,00	86.734,28	-35,48	19.295,94
					86.734,28	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\$)
BRADESCO F I A SELECTION	18.392.046,46	0,00	0,00	0,00	17.007.719,00	-1.384.327,46	573.649,49
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	33.669.290,49	0,00	0,00	0,00	29.979.143,79	-3.690.146,70	-661.354,69
INDIE FIC FIA	19.143.224,30	0,00	0,00	0,00	16.994.336,13	-2.148.888,17	-2.228.618,36
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19.747.492,70	0,00	0,00	0,00	18.500.517,39	-1.246.975,31	-188.694,91
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	2.995.640,71	0,00	0,00	0,00	2.745.281,35	-250.359,36	-860,51
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	23.330.187,14	0,00	0,00	0,00	21.288.344,73	-2.041.842,41	324.273,55
					106.515.342,39	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\$)
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	3.458.868,85	0,00	0,00	0,00	3.182.006,78	-276.862,07	-535.813,51
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	15.790.911,55	0,00	0,00	0,00	14.067.419,41	-1.723.492,14	-4.022.764,80
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16.851.727,31	0,00	0,00	0,00	15.341.365,18	-1.510.362,13	-9.497.245,73
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20.612.757,49	0,00	0,00	0,00	19.804.631,29	-808.126,20	-6.930.594,32
					52.395.422,66	0,00	0,00
Artigo 10º I (Fundos Multimercados)							
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	8.923.465,52	0,00	0,00	0,00	8.141.170,96	-782.294,56	-982.277,18
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	9.931.446,66	0,00	-9.974.487,35	0,00	0,00	43.040,69	353.219,51
ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI	2.681.802,76	0,00	0,00	0,00	2.703.010,70	21.207,94	94.999,09
					10.844.181,66	0,00	0,00

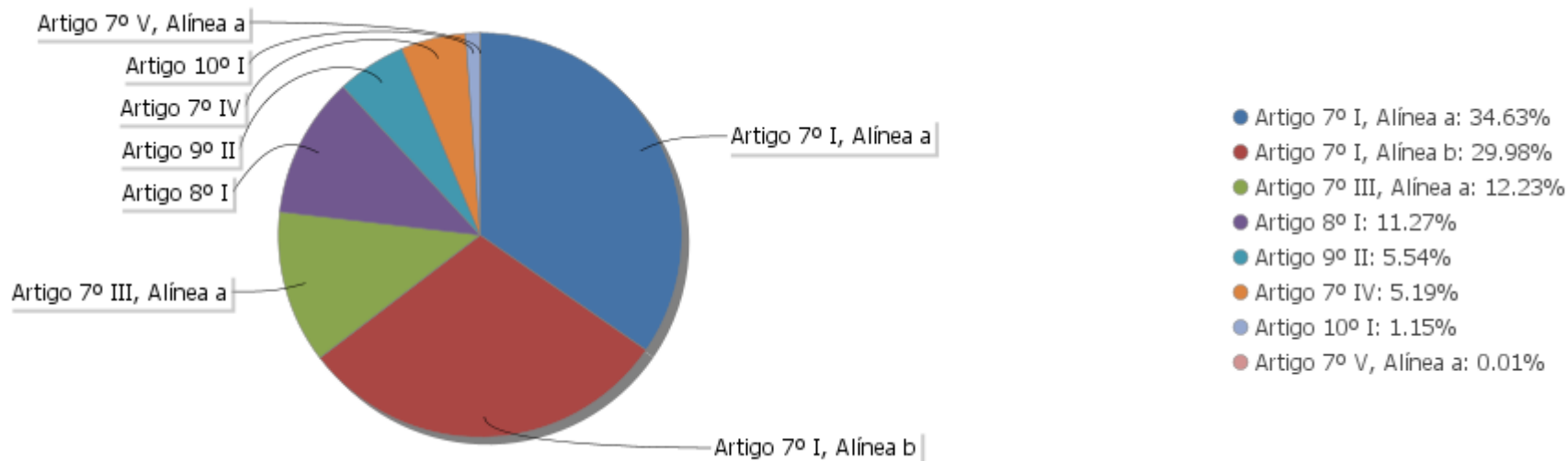
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

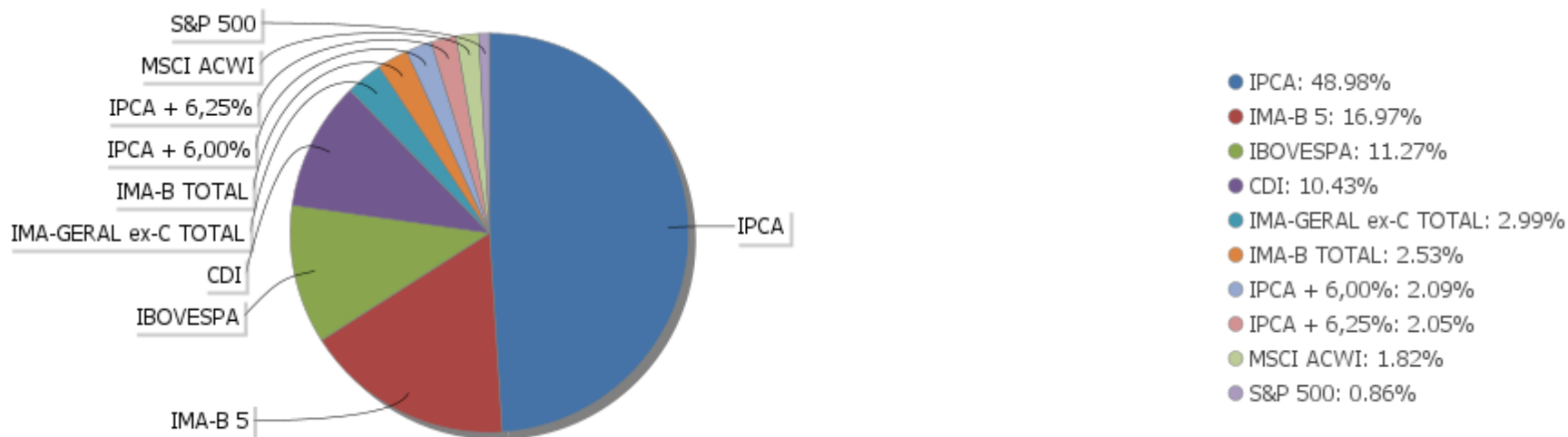
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	474.166.393,97	50,16	474.166.393,97	50,16
de 31 a 365 dias	94.702.031,19	10,02	568.868.425,16	60,18
acima de 365 dias	376.438.195,46	39,82	945.306.620,62	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

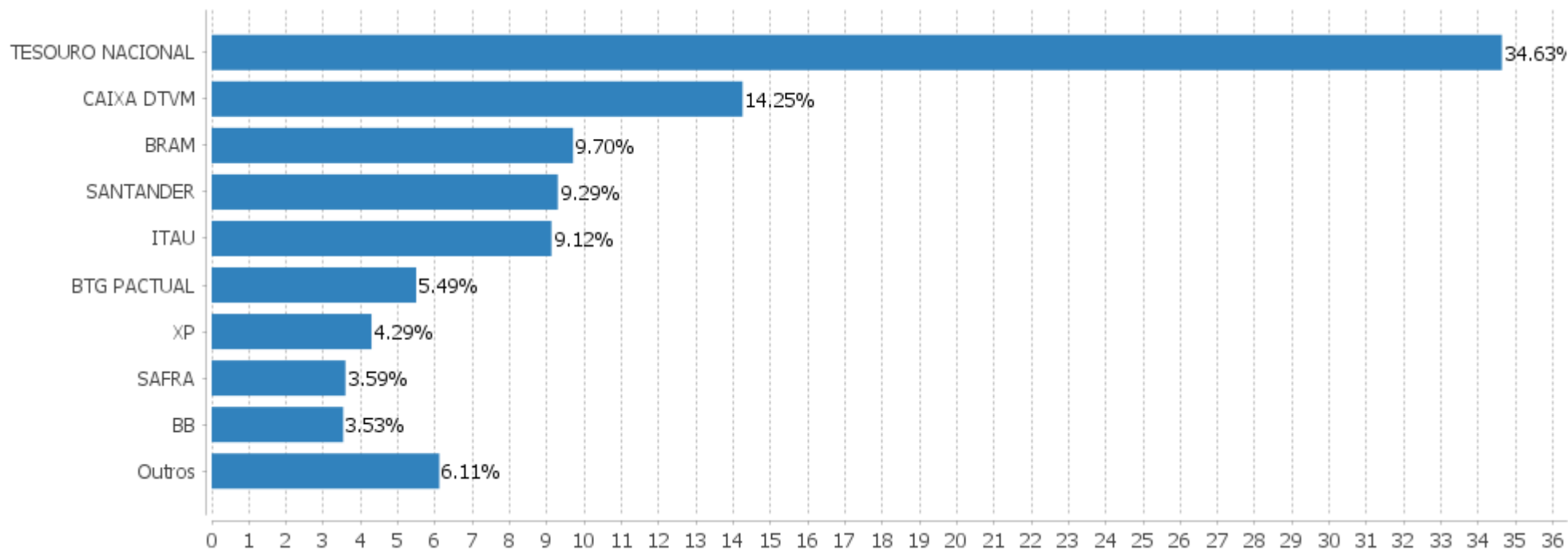


Alocação Por Estratégia



## 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	-0,50	-0,02	1,78	-0,52									0,72
INPC + 4,94%	1,08	1,37	2,14	1,41									6,12
p.p. indexador	-1,58	-1,39	-0,36	-1,93									-5,40
2021	-0,25	-0,80	0,07	1,08	0,98	0,37	-0,62	-1,00	-0,86	-2,11	0,81	0,67	-1,69
INPC + 5,43%	0,69	1,20	1,35	0,80	1,41	1,04	1,49	1,35	1,65	1,59	1,26	1,22	16,12
p.p. indexador	-0,94	-2,00	-1,28	0,27	-0,43	-0,67	-2,11	-2,35	-2,51	-3,70	-0,45	-0,54	-17,81
2020	0,39	-1,01	-7,26	1,95	2,14	2,21	3,07	-0,76	-1,08	0,12	2,29	3,11	4,80
INPC + 5,87%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,96	0,84	1,35	1,37	1,41	1,97	11,61
p.p. indexador	-0,30	-1,59	-7,94	1,72	1,94	1,43	2,10	-1,60	-2,44	-1,25	0,88	1,15	-6,81

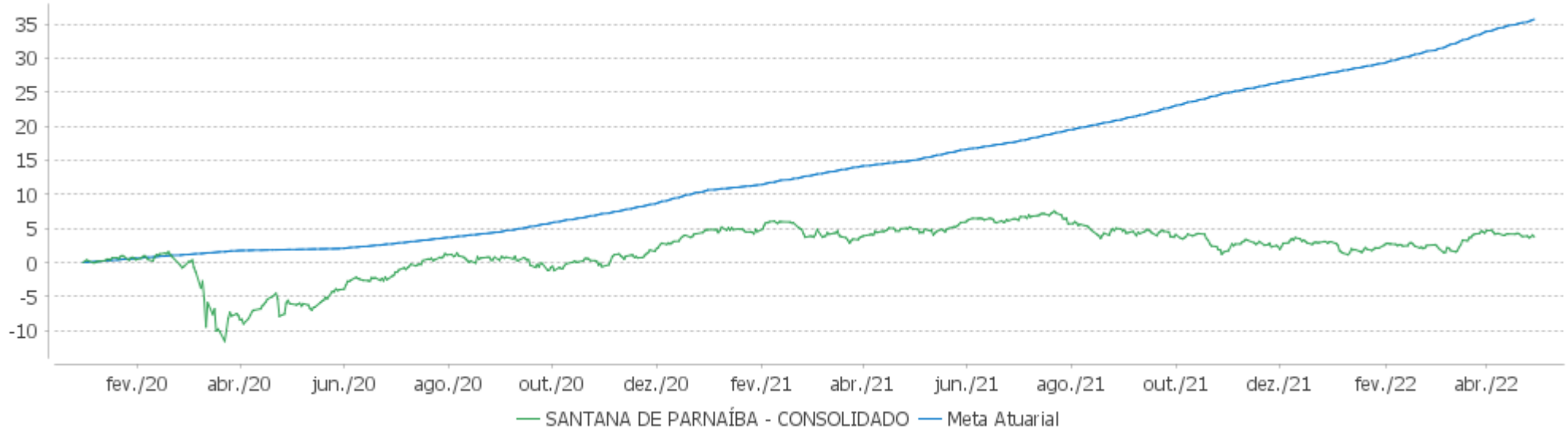
## Performance Sobre a Meta Atuarial

## Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	7	25,00	03 meses	1,23	4,99	-3,77	4,02
Meses abaixo - Meta Atuarial	21	75,00	06 meses	2,22	8,77	-6,55	4,32
			12 meses	-1,07	18,37	-19,44	4,44
			24 meses	10,44	34,59	-24,15	4,73
Maior rentabilidade da Carteira	3,11	2020-12	Desde 31/12/2019	3,77	37,54	-33,76	7,84
Menor rentabilidade da Carteira	-7,26	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



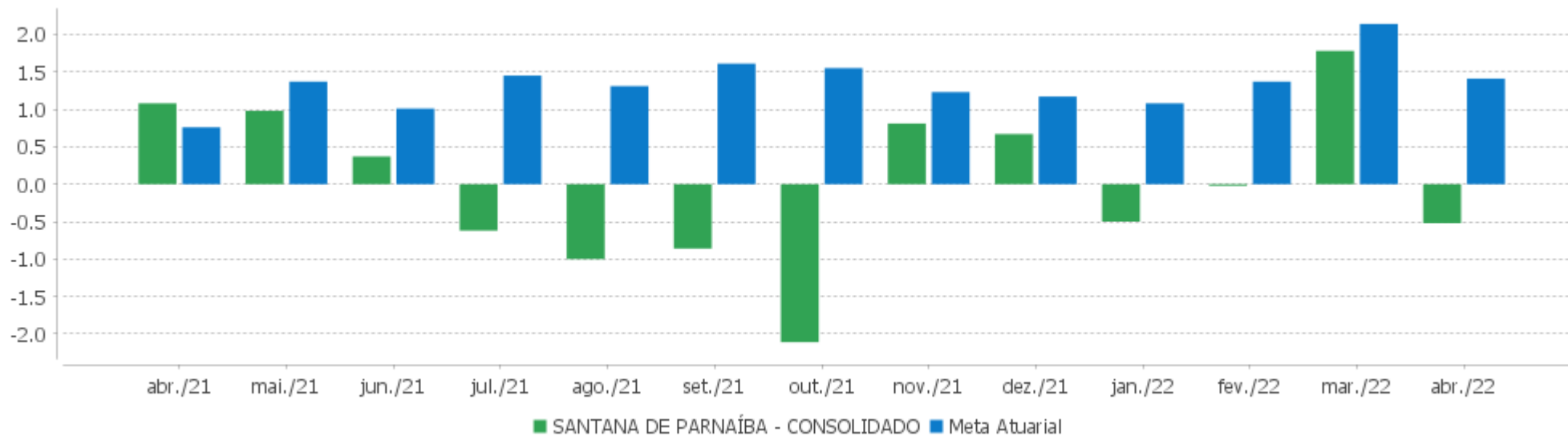
Patrimônio Líquido





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 150840 (5,620000%) Var. IPCA p.p.	1,77 0,71	5,87 1,58	4,69 0,96	9,02 2,97	14,59 2,46	21,69 1,98	25,10 2,52
NTN-B 150535 (5,600000%) Var. IPCA p.p.	1,76 0,70	5,87 1,57	4,69 0,95	5,99 -0,06	11,38 -0,75	18,23 -1,48	21,49 -1,10
NTN-B 150545 (5,890000%) Var. IPCA p.p.	1,78 0,72	5,96 1,67	4,76 1,02	6,07 0,02	11,54 -0,59	18,57 -1,14	22,00 -0,58
NTN-B 150830 (5,530000%) Var. IPCA p.p.	1,76 0,70	5,84 1,55	4,67 0,94	8,98 2,92	14,46 2,33	21,38 1,67	24,62 2,04
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,86 103,60	3,45 105,27	2,66 105,04	4,96 105,95	7,71 108,97	10,24 109,25	15,03 99,72
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,73 87,17	2,92 89,09	2,25 89,17	4,13 88,36	5,92 83,70	7,01 74,75	11,36 75,41
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,95 -0,11	3,55 -0,75	2,71 -1,02	5,06 -0,99	3,84 -8,29	8,13 -11,58	
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	-0,04 -4,90	28,61 872,58	28,27 1.117,98	29,60 632,80	37,17 525,23	2.042,65 21.782,56	2.583,91 17.147,69
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a Var. IPCA + 6,25% p.p.	1,89 0,37	2,71 0,20					
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a Var. IPCA + 6,25% p.p.	1,87 0,34	2,67 0,26					
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a Var. IPCA p.p.	0,41 0,08	0,41 0,08					
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a Var. IPCA p.p.	0,55 0,22	0,55 0,22					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a Var. IPCA p.p.	2,24 1,18	4,57 1,44					
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,67 -0,16	3,16 -0,57	4,20 -0,29	6,38 -1,18	1,92 -2,77	10,11 -4,70	21,27 -3,80
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,54 -0,02	5,35 -0,08	5,26 -0,05	8,78 -0,14	9,20 -0,25	18,62 -0,59	28,55 -1,00
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,54 -0,02	5,36 -0,07	5,26 -0,06	8,80 -0,11	9,22 -0,23	18,69 -0,52	28,75 -0,80
BB PREV RF VII	2,05	6,16	5,56	8,63	11,92	20,19	27,38

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,21	2,43	1,07	1,06	7,24	5,39	2,31
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	2,05 0,54	6,16 -0,11	5,56 0,38	8,64 -0,50	11,95 -6,89	22,02 -12,40	32,44 -13,49
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,48	2,81	2,73	5,63	4,37	8,06	16,72
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,78 -0,28	3,43 -0,86	2,90 -0,84	6,04 -0,01	7,64 -4,49	9,81 -9,90	19,90 -2,68
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,71 85,68	2,77 84,52	2,15 85,04	3,91 83,56	5,71 80,64	7,08 75,47	11,69 77,59
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-10,96 -0,86	-2,16 -5,07	-6,82 -3,02	-9,35 -13,57	-32,94 -23,67	-4,49 -38,49	-7,44 -19,40
BRANCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-7,53 2,58	3,49 0,58	-3,08 0,73	3,49 -0,73	-12,74 -3,47	27,90 -6,10	-1,37 -13,33
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-8,36 1,75	-0,03 -2,94	-4,96 -1,16	-4,13 -8,36	-25,86 -16,59	11,66 -22,34	
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-11,23 -1,12	-11,59 -14,51	-14,96 -11,15	-13,70 -17,93	-32,28 -23,01	0,69 -33,30	3,58 -8,38
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-8,75 1,35	1,55 -1,37	-3,03 0,78	-3,70 -7,93	-17,81 -8,54	34,11 0,11	33,01 21,05
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	-6,31 3,79	-1,01 -3,92	-2,32 1,48	-1,49 -5,72	-13,29 -4,02	27,57 -6,42	15,42 3,46
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-10,91 -6,29	-22,24 1,43	-14,44 1,89	-24,03 -0,50	-17,16 -1,95	28,19 7,07	
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-8,00 -3,38	-14,41 9,25	-14,81 1,52	-14,67 8,86	-21,19 -5,98		
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	-3,92 -469,90	-25,92 -790,56	-15,29 -604,60	-26,77 -572,18	-20,02 -282,85	17,96 191,51	61,85 410,49
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-8,96 -10,47	-38,03 -44,29	-24,55 -29,74	-41,35 -50,49	-39,19 -58,02	-4,82 -39,24	
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP % do CDI	0,96 115,01	4,21 128,52	3,15 124,66	5,59 119,47	7,96 112,43	10,23 109,11	16,78 111,36
ITAU INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI % do CDI	0,79 94,78	3,64 111,09	2,89 114,17	5,23 111,83	7,66 108,17	10,15 108,24	17,23 114,33
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	-8,77 -3,46	-11,40 12,18	-6,54 9,44	-6,94 14,85	4,95 14,99	51,63 23,03	
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO	-0,52	0,72	1,23	2,22	-1,07	10,44	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. INPC + 4,94% p.p.	-1,93	-5,40	-3,77	-6,46	-19,07	-22,73	
CDI	0,83	3,28	2,53	4,68	7,08	9,38	15,07
IBOVESPA	-10,10	2,91	-3,81	4,23	-9,27	34,00	11,96
INPC + 6,00%	1,48	6,47	5,25	9,23	19,19	35,86	47,59
IPCA + 6,00%	1,50	6,27	5,18	9,14	18,83	34,41	45,93

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		0,80
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREV RF VII	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)		3,00
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+0	D+2 du		
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+0	A taxa de performance será apurada e provisionada diariamente, devendo ser paga à ADMINISTRADORA semestralmente, por período vencido, no primeiro dia útil do mês subsequente a cada semestre civil	0,70
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	D+0	D+0		D +1		
FIDC ITALIA SENIOR	Não se aplica	Não se aplica				
INDIE FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32	O fundo cobrará 20.00 % do que	1,34

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					exceder 100.00 % o índice IBX_FEC. A taxa de performance sera paga no(s) mes(es) de Janeiro e Julho	
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 INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
ITAU INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI			D+0	D+1 du		0,35
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32	Método Passivo.	0,00
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	D+0	D+0	D+3 du	D+4 du		0,15
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+8 du		1,00
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,10
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)		2,90

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**
**Indexadores**
**Renda Fixa**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,75	3,04	2,40	4,76	5,63	8,09	15,23	22,93	33,92
IRF-M 1+	-0,53	0,26	0,76	4,79	-1,08	0,34	14,30	26,22	44,13
IRF-M TOTAL	-0,12	1,23	1,31	4,98	1,22	3,18	15,24	25,96	42,07
IMA-B 5	1,56	5,43	5,31	8,92	9,45	19,21	29,55	42,42	59,01
IMA-B 5+	0,08	1,99	3,65	6,19	-0,03	10,27	19,61	43,70	58,71
IMA-B TOTAL	0,83	3,73	4,49	7,56	4,69	14,81	25,06	44,56	60,36
IMA-GERAL TOTAL	0,54	3,09	2,88	5,86	4,95	9,79	19,09	31,12	45,31
IDKA 2	1,51	5,45	5,39	8,99	9,27	19,55	29,85	42,08	59,55
IDKA 20	-1,21	-0,85	2,14	2,79	-8,97	3,42	9,22	42,00	53,49
CDI	0,83	3,28	2,53	4,68	7,08	9,38	15,07	22,37	32,30

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-10,10	2,91	-3,81	4,23	-9,27	34,00	11,96	25,27	64,94
IBRX 100	-10,11	3,27	-3,37	4,71	-10,15	35,89	15,35	30,27	70,90
IBRX 50	-10,51	3,33	-4,01	5,29	-9,44	38,94	13,39	25,43	65,73
SMALL CAP	-8,36	-2,23	-5,46	-0,84	-20,81	23,46	17,79	30,74	73,22
IFIX	1,19	0,29	1,30	5,13	-1,68	8,04	12,14	20,36	38,18
Índice Consumo - ICON	-14,19		-11,54	-16,34	-30,65	-10,38	-9,46	-1,52	13,09
Índice Dividendos - IDIV	-5,19	9,49	1,87	12,24	3,76	42,18	31,97	56,94	85,91

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	1,06	4,29	3,73	6,05	12,13	19,71	22,58	28,64	32,19
INPC	1,04	4,49	3,80	6,14	12,47	21,00	23,98	30,27	32,47
IGPM	1,41	6,98	5,07	7,93	14,66	51,37	61,49	75,44	78,75
SELIC	0,83	3,28	2,53	4,68	7,08	9,38	15,07	22,37	32,32

**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	-5,31	-23,58	-15,98	-21,79	-10,04	28,59	74,88	120,49	166,54
MSCI ACWI	-4,62	-23,67	-16,34	-23,54	-15,21	21,12	55,29	81,22	120,87

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,36	5,62	4,71	8,12	16,60	29,42	37,85	50,40	60,68
IPCA + 5,00%	1,43	5,94	4,95	8,63	17,72	31,90	41,85	56,24	68,52
IPCA + 5,50%	1,47	6,10	5,07	8,89	18,27	33,16	43,88	59,23	72,55
IPCA + 5,89%	1,50	6,23	5,16	9,08	18,71	34,14	45,48	61,58	75,75
IPCA + 6,00%	1,50	6,27	5,18	9,14	18,83	34,41	45,93	62,25	76,66
INPC + 4,00%	1,34	5,82	4,77	8,21	16,95	30,82	39,42	52,30	61,02
INPC + 6,00%	1,48	6,47	5,25	9,23	19,19	35,86	47,59	64,31	77,03



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
678	01/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	107.610,22	0,00	54.241,23666339	1,9839190000
668	05/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	600,00	302,20579300	1,9854020000
679	05/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.099,00	1.057,21658900	1,9854020000
680	07/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	53.071,23	26.710,77013300	1,9868850000
681	08/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	7.563.789,62	0,00	3.805.433,31778700	1,9876290000
669	11/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	41.597,12	20.920,15839400	1,9883750000
682	11/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	112.212,07	56.434,05911200	1,9883750000
665	12/04/2022	FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	0,00	9.974.487,35	4.383.409,31815100	2,2755090000
670	12/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	449.890,01	0,00	226.175,39917100	1,9891200000
683	12/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	8.003.831,23	0,00	4.023.805,11482400	1,9891200000
684	12/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.496.310,97	0,00	752.247,71255600	1,9891200000
671	19/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	14.651,11	7.354,59822200	1,9921020000
676	19/04/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	50.000,00	22.311,03318300	2,2410436840
685	19/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	15.750.000,00	7.906.221,66677600	1,9921020000
666	20/04/2022	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	7.900.000,00	0,00	158,00000000	50.000,0000000000
667	20/04/2022	LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	7.900.000,00	0,00	158,00000000	50.000,0000000000
672	25/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	49,00	24,56897100	1,9943460000
686	25/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	45.552,59	22.840,86560200	1,9943460000
673	26/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	79.862,99	40.029,62726300	1,9950970000
687	26/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.425.141,80	714.322,06460100	1,9950970000
675	27/04/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	9.566,46	0,00	4.260,60820500	2,2453273190
688	27/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	159.510,09	0,00	79.921,00095800	1,9958470000
689	27/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.046,05	524,11322800	1,9958470000
677	28/04/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.440,35	4.202,83565900	2,2461858530
690	28/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	158.464,04	79.366,98341600	1,9965990000
674	29/04/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.876,38	1.440,09738400	1,9973510000
<b>Total</b>			<b>33.590.508,60</b>	<b>27.721.151,08</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 15.714.104,97

Value-At-Risk: 1,66%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO		1,66	1,66			945.306.620,62	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,33%

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 150535 (5,600000%)		0,12	-0,00	0,14			78.795.607,07	8,34
NTN-B 150545 (5,890000%)		0,12	-0,00	0,14			109.303.967,45	11,56
NTN-B 150830 (5,530000%)		0,12	-0,00	0,14			48.405.978,41	5,12
NTN-B 150840 (5,620000%)		0,12	-0,00	0,14			90.837.831,50	9,61
<b>Sub-total</b>	0,99	0,12	-0,00		0,95	1,77	327.343.384,43	34,63

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
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,04	0,04	0,01			92.404.145,86	9,78
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,02	0,03	0,02			67.993.269,94	7,19
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,08	0,02	1,81			28.280.691,98	2,99
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,02	0,00	0,02			1.365.379,62	0,14
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI		0,63	0,00	0,60			4.374.638,77	0,46
BB PREV RF VII		0,63	0,00	2,00			733.034,75	0,08
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI		0,29	0,01	0,28			65.041.668,40	6,88
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF		2,35	0,03	0,41			23.216.212,22	2,46
<b>Sub-total</b>	1,78	0,90	0,12		0,19	1,18	283.409.041,54	29,98

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
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

**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
BB PREV RF FLUXO FIC		0,02	0,00	0,02			290,10	0,00
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	0,00	0,03			74.665.501,29	7,90
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,16	0,00	0,19			40.951.911,24	4,33
<b>Sub-total</b>	0,24	0,07	0,00		0,25	0,89	115.617.702,63	12,23

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a		0,37	-0,00	0,41			9.712.616,39	1,03
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a		0,41	-0,00	0,43			9.702.520,56	1,03
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a		1,13	-0,01	1,16			7.932.499,32	0,84
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a		1,52	-0,01	1,55			7.943.836,60	0,84
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a		0,55	-0,00	0,58			13.803.338,16	1,46
<b>Sub-total</b>	1,31	0,63	-0,01		0,88	1,98	49.094.811,03	5,19

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		1,17	-0,00	1,17			86.734,28	0,01
<b>Sub-total</b>	0,15	1,17	-0,00		-5,88	-0,04	86.734,28	0,01

**Renda Variável**

**Value-At-Risk: 10,47%**

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
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		11,49	0,34	5,97			29.979.143,79	3,17
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		8,99	0,16	5,65			18.500.517,39	1,96
BRADESCO F I A SELECTION		9,24	0,14	3,29			17.007.719,00	1,80
INDIE FIC FIA		13,56	0,22	8,30			16.994.336,13	1,80
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		15,21	0,04	10,32			2.745.281,35	0,29
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		10,40	0,20	6,06			21.288.344,73	2,25

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>	17,29	10,47	1,09		-0,58	-9,18	106.515.342,39	11,27

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,69%

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
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE		11,26	0,03	11,33			3.182.006,78	0,34
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		15,57	0,17	11,13			14.067.419,41	1,49
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		16,48	0,13	16,48			15.341.365,18	1,62
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,13	0,06	9,13			19.804.631,29	2,10
<b>Sub-total</b>	15,50	10,69	0,40		-0,55	-7,62	52.395.422,66	5,54

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,53%

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
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		10,03	0,06	7,96			8.141.170,96	0,86
ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI		0,12	0,00	0,12			2.703.010,70	0,29
<b>Sub-total</b>	20,24	7,53	0,06		-0,31	-5,43	10.844.181,66	1,15