



LDB
EMPRESAS

SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO
2º TRIMESTRE 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 30.06.2022.

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 84,21%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,600000%)	2,84	0,98	4,24	78.477.509,81	8,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,890000%)	2,90	1,00	4,31	108.849.233,66	11,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,530000%)	2,87	0,97	4,22	49.578.920,83	5,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,620000%)	2,84	0,98	4,25	93.052.392,26	9,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,761000%)	4,02	0,99	1,36	42.639.413,70	4,46
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,62	0,99	4,26	372.597.470,26	38,99

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,58	0,33	2,65	93.421.303,96	9,78	11.084.704.335,99	0,84
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,58	0,32	2,64	68.729.100,04	7,19	1.328.159.744,16	5,17
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,16	0,88	2,50	1.952.653,08	0,20	794.285.280,96	0,25
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	1,69	0,31	3,03	4.416.793,75	0,46	495.612.154,77	0,89
BB	BB	BB PREV RF VII	1,69	0,31	3,03	740.080,91	0,08	258.295.551,92	0,29
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,18	0,79	2,57	66.200.281,20	6,93	2.668.371.249,57	2,48
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	5,87	-0,44	1,24	23.348.752,47	2,44	691.358.921,53	3,38
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,23	0,38	2,41	258.808.965,41	27,09		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,18	0,95	2,39	64,31	0,00	3.467.595.820,39	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,18	1,08	3,07	76.297.472,03	7,98	4.894.755.710,10	1,56
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,96	0,09	2,32	41.505.891,10	4,34	855.763.788,80	4,85
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,60	0,73	2,80	117.803.427,44	12,33		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
XP	XP	LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a	0,60	0,52	0,52	5.076.354,14	0,53		
BRADESCO	BRADESCO	LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a	0,73	1,03	4,46	9.958.045,56	1,04		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a	0,76	1,03	4,44	9.947.377,96	1,04		
XP	XP	LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	0,95	1,03	2,96	8.134.070,97	0,85		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	1,30	1,05	3,04	8.140.108,84	0,85		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	1,13	0,67	4,42	14.097.125,93	1,48		
Sub-total Artigo 7º IV			0,79	0,92	4,43	55.353.083,40	5,79		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	25,98	0,42	-0,23	86.570,44	0,01	40.395.435,01	0,21
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			25,98	0,42	-0,23	86.570,44	0,01		
Renda Fixa			2,54	0,75	3,40	804.649.516,95	84,21		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

10,07%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	24,94	-10,74	-21,02	26.592.213,55	2,78	1.325.317.998,19	2,01
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,63	-11,11	-13,57	17.066.932,36	1,79	1.911.192.204,59	0,89
BRAM	BEM	BRANCO F I A SELECTION	21,14	-11,17	-15,12	15.611.149,74	1,63	424.182.243,03	3,68
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	28,73	-13,65	-22,97	14.746.561,98	1,54	542.075.424,35	2,72
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	29,80	-13,03	-21,23	2.359.808,58	0,25	240.852.459,81	0,98
TRUXT	INTRAG	TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	24,54	-8,67	-14,92	19.850.175,55	2,08	949.416.016,76	2,09
Sub-total Artigo 8º I			22,11	-10,98	-17,95	96.226.841,76	10,07		
Renda Variável			21,78	-10,98	-17,95	96.226.841,76	10,07		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,93%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
XP	BNP PARIBAS	ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	21,53	-4,77	-11,19	3.071.944,83	0,32	78.311.240,78	3,92
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	27,59	-7,83	-23,03	12.153.970,56	1,27	255.779.879,69	4,75
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	31,97	-2,83	-22,26	13.101.370,67	1,37	568.267.517,75	2,31
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	17,83	-0,53	-9,04	18.748.982,86	1,96	1.171.391.227,04	1,60
Sub-total Artigo 9º II			20,29	-3,42	-16,99	47.076.268,92	4,93		
Investimentos no Exterior			20,29	-3,42	-16,99	47.076.268,92	4,93		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,79%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	20,08	-7,82	-15,04	7.581.527,86	0,79	393.628.937,87	1,93
Sub-total Artigo 10º I			20,08	-7,82	-11,68	7.581.527,86	0,79		
Investimentos Estruturados			18,98	-7,82	-11,68	7.581.527,86	0,79		
Total			4,37	-0,85	-0,62	955.534.155,49	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	372.597.470,26	38,99	0,00	11,50	100,00	30,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	258.808.965,41	27,09	50,00	56,00	100,00	25,07	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	117.803.427,44	12,33	0,00	11,00	60,00	11,36	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	55.353.083,40	5,79	0,00	0,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	86.570,44	0,01	0,00	0,50	5,00	0,01	5,00
	Total Renda Fixa	804.649.516,95	84,21					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	96.226.841,76	10,07	3,00	5,00	20,00	1,29	30,00
	Total Renda Variável	96.226.841,76	10,07					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	47.076.268,92	4,93	0,00	9,00	10,00	8,59	10,00
	Total Investimentos no Exterior	47.076.268,92	4,93					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	7.581.527,86	0,79	1,00	5,00	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	7.581.527,86	0,79					15,00
Total		955.534.155,49	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,99 97,47	4,26 146,72	4,26 146,72			3.644.742,10	14.205.369,69
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,38 37,43	2,41 82,91	2,41 82,91	5,13 95,01	5,55 64,12	989.592,15	6.738.758,56
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,73 71,65	2,80 96,40	2,80 96,40	5,44 100,62		849.342,65	3.212.019,06
Artigo 7º IV % do CDI	0,92 91,17	4,43 152,43	4,43 152,43			490.639,37	1.945.064,27
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,42 41,85	-0,23 -7,90	-0,23 -7,90	28,37 525,22		365,64	-199,32
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,64 11,89		0,00	0,00
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-10,98 0,53	-17,95 -0,07	-17,95 -0,07	-11,47 -5,48		-11.864.535,52	-21.051.040,04
Artigo 9º II % do CDI	-3,42 -337,50	-16,99 -584,69	-16,99 -584,69	-35,80 -662,81	-31,37 -362,40	-1.667.395,93	-9.637.996,28
Artigo 10º I % do CDI	-7,82 -771,72	-11,68 -401,70	-11,68 -401,70	-10,99 -203,47		-643.330,88	-1.261.440,32
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO (Total)						-8.200.580,42	-5.849.464,38

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150535 (5,600000%)	77.715.930,41	0,00	0,00	0,00	78.477.509,81	761.579,40	3.250.568,97
NTN-B 150545 (5,890000%)	107.768.210,77	0,00	0,00	0,00	108.849.233,66	1.081.022,89	4.581.662,16
NTN-B 150830 (5,530000%)	49.100.463,67	0,00	0,00	0,00	49.578.920,83	478.457,16	2.009.485,85
NTN-B 150840 (5,620000%)	92.147.887,05	0,00	0,00	0,00	93.052.392,26	904.505,21	3.790.131,62
NTN-B 150850 (5,761000%)	42.220.236,26	0,00	0,00	0,00	42.639.413,70	419.177,44	573.521,08
					372.597.470,26	3.644.742,10	0,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4.403.032,48	0,00	0,00	0,00	4.416.793,75	13.761,27	129.916,79
BB PREV RF VII	737.784,49	0,00	0,00	0,00	740.080,91	2.296,42	21.742,86
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.849.134,46	8.547.786,83	-8.475.710,43	0,00	1.952.653,08	31.442,22	152.466,53
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	93.110.706,02	0,00	0,00	0,00	93.421.303,96	310.597,94	2.414.835,73
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	65.684.470,06	0,00	0,00	0,00	66.200.281,20	515.811,14	1.659.593,05
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	23.453.092,56	0,00	0,00	0,00	23.348.752,47	-104.340,09	286.251,06
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	68.509.076,79	0,00	0,00	0,00	68.729.100,04	220.023,25	1.765.327,59
					258.808.965,41	989.592,15	0,10

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	57,19	14.526,88	-14.526,88	0,00	64,31	7,12	676,03
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	75.483.639,73	0,00	0,00	0,00	76.297.472,03	813.832,30	2.271.809,48
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	41.470.387,87	0,00	0,00	0,00	41.505.891,10	35.503,23	939.533,55
					117.803.427,44	849.342,65	0,09

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a	9.856.790,15	0,00	0,00	0,00	9.958.045,56	101.255,41	425.529,42
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	8.051.269,76	0,00	0,00	0,00	8.134.070,97	82.801,21	234.070,97
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a	0,00	5.050.000,00	0,00	0,00	5.076.354,14	26.354,14	26.354,14
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a	9.845.997,58	0,00	0,00	0,00	9.947.377,96	101.380,38	422.535,83
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	14.002.855,80	0,00	0,00	0,00	14.097.125,93	94.270,13	596.465,07
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	8.055.530,74	0,00	0,00	0,00	8.140.108,84	84.578,10	240.108,84
					55.353.083,40	490.639,37	0,05

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIDC ITALIA SENIOR	86.204,80	0,00	0,00	0,00	86.570,44	365,64	-199,32
					86.570,44	365,64	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BRADESCO F I A SELECTION	17.574.813,04	0,00	0,00	0,00	15.611.149,74	-1.963.663,30	-2.780.896,72
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	29.790.795,11	0,00	0,00	0,00	26.592.213,55	-3.198.581,56	-7.077.076,94
INDIE FIC FIA	17.078.562,33	0,00	0,00	0,00	14.746.561,98	-2.332.000,35	-4.396.662,32
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19.199.319,16	0,00	0,00	0,00	17.066.932,36	-2.132.386,80	-2.680.560,34
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	2.713.339,54	0,00	0,00	0,00	2.359.808,58	-353.530,96	-635.832,13
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	21.734.548,10	0,00	0,00	0,00	19.850.175,55	-1.884.372,55	-3.480.011,59
					96.226.841,76	-11.864.535,52	-1,23

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	3.225.691,66	0,00	0,00	0,00	3.071.944,83	-153.746,83	-386.924,02
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	13.186.858,98	0,00	0,00	0,00	12.153.970,56	-1.032.888,42	-3.636.940,99
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	13.482.485,24	0,00	0,00	0,00	13.101.370,67	-381.114,57	-3.750.356,64
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18.848.628,97	0,00	0,00	0,00	18.748.982,86	-99.646,11	-1.863.774,63
					47.076.268,92	-1.667.395,93	-0,17

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	8.224.858,74	0,00	0,00	0,00	7.581.527,86	-643.330,88	-1.341.937,66
					7.581.527,86	-643.330,88	-0,07

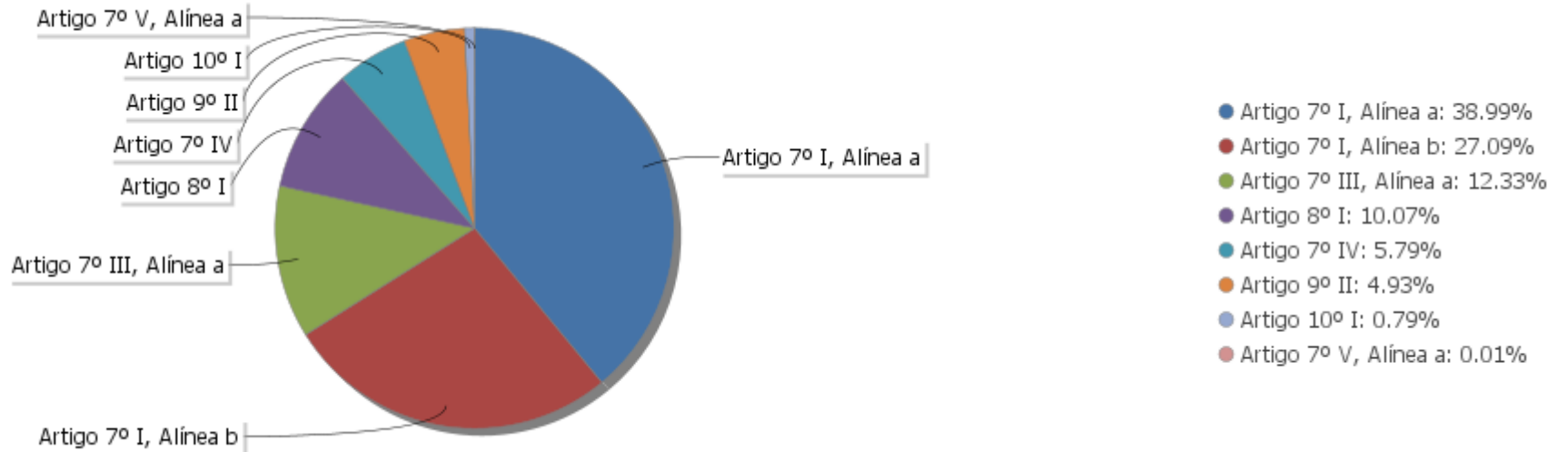
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

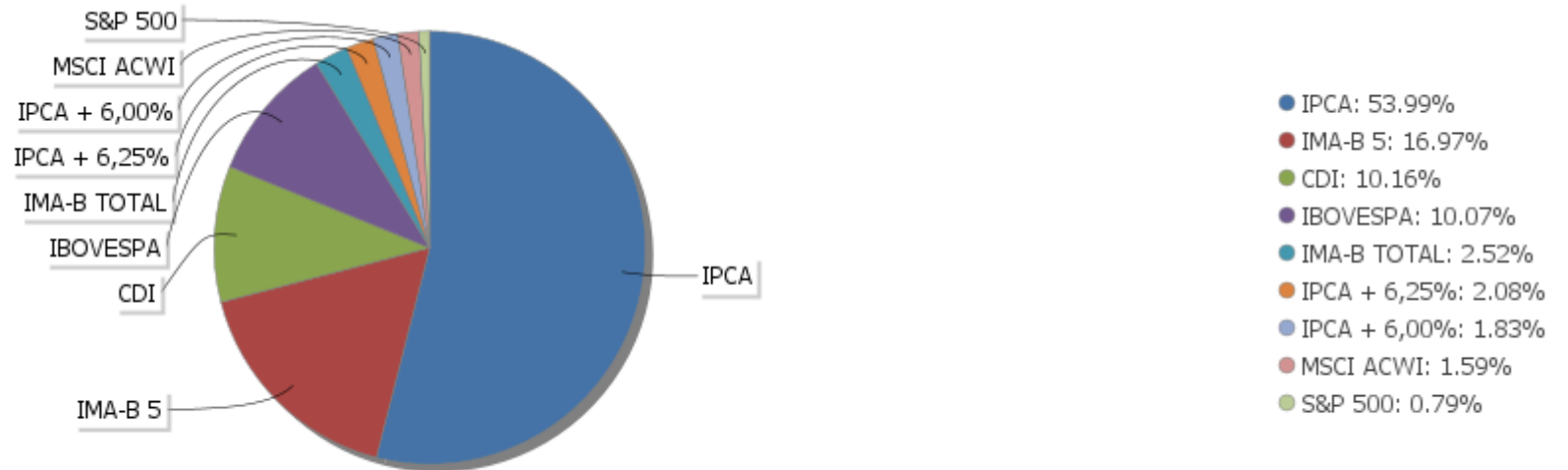
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	441.724.464,71	46,23	441.724.464,71	46,23
de 31 a 365 dias	85.859.137,12	8,99	527.583.601,83	55,21
acima de 365 dias	427.950.553,66	44,79	955.534.155,49	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

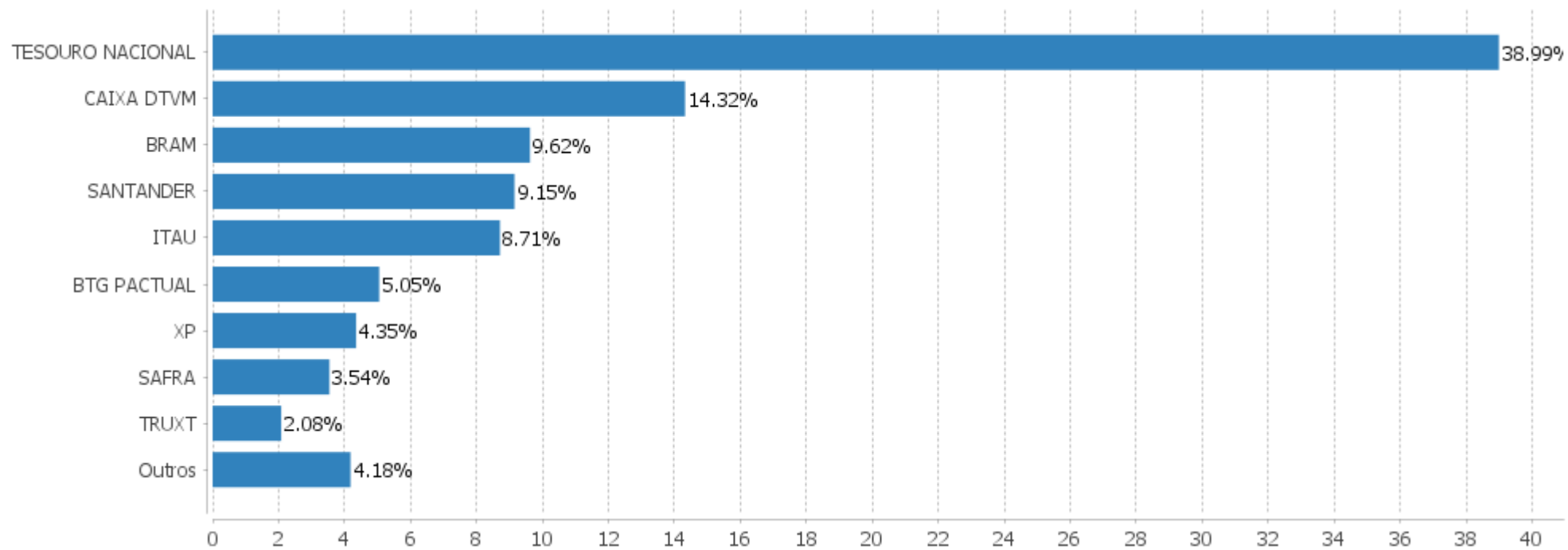


Alocação Por Estratégia



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	0,76	-0,85							0,62
INPC + 4,94%	1,08	1,37	2,14	1,41	0,87	1,03							8,15
p.p. indexador	-1,58	-1,39	-0,36	-1,93	-0,11	-1,88							-7,52
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

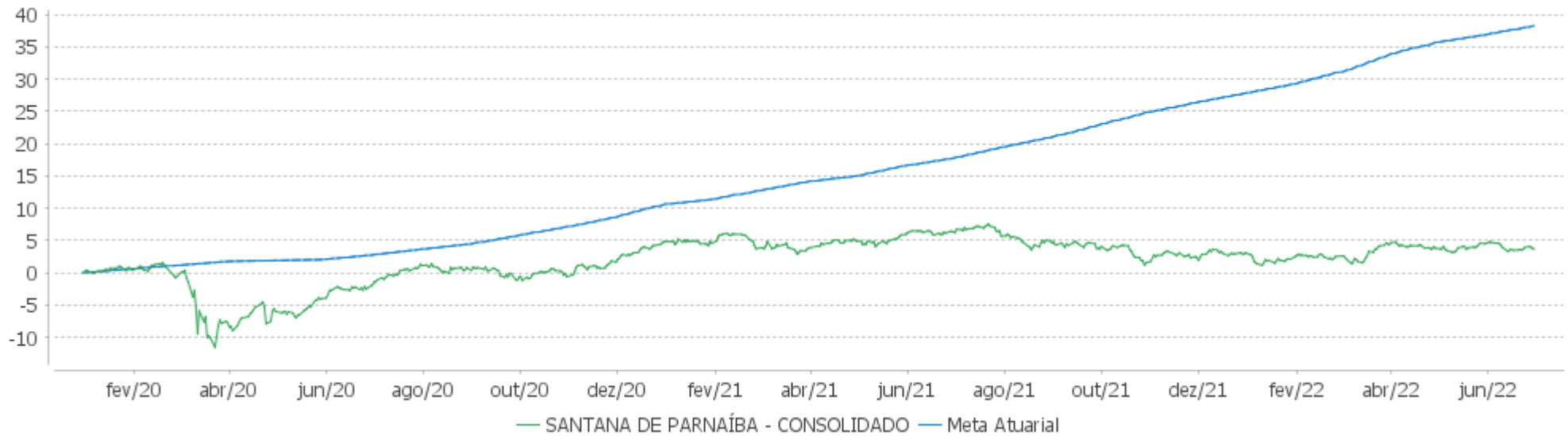
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	7	23,33	03 meses	-0,62	3,34	-3,96	3,27
Meses abaixo - Meta Atuarial	23	76,67	06 meses	0,62	8,15	-7,52	3,93
			12 meses	-2,49	17,73	-20,21	4,37
			24 meses	5,69	35,82	-30,14	4,53
Maior rentabilidade da Carteira	3,11	2020-12	Desde 31/12/2019	3,67	40,16	-36,49	7,61
Menor rentabilidade da Carteira	-7,26	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

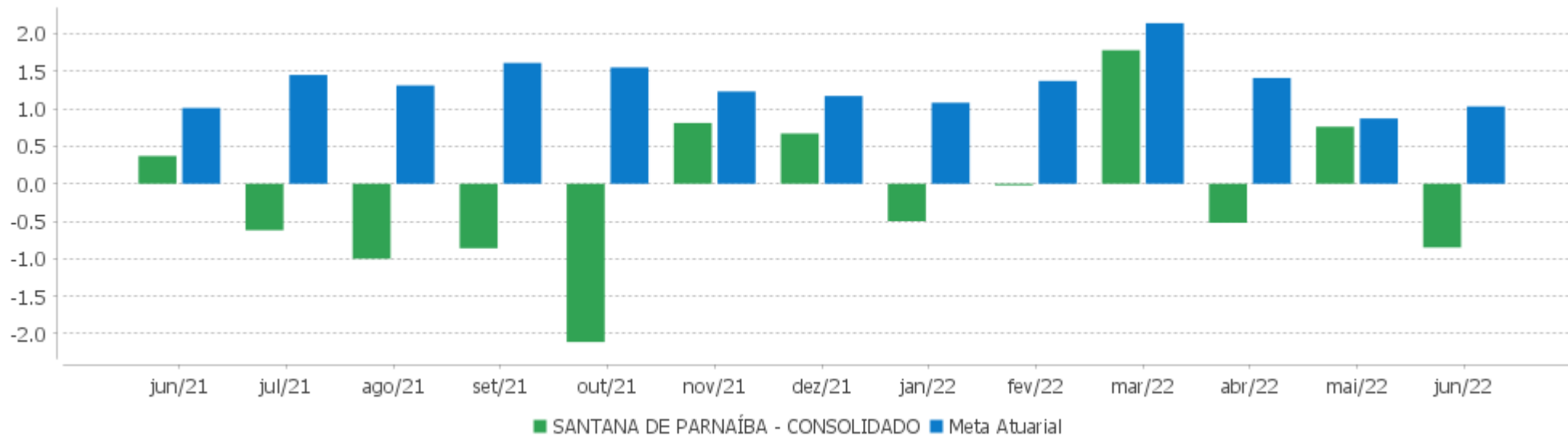


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a Var. IPCA p.p.	0,52 0,17	0,52 0,17					
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a Var. IPCA + 6,25% p.p.	1,03 -0,15	4,46 0,71	4,46 0,71				
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a Var. IPCA + 6,25% p.p.	1,03 -0,15	4,44 0,68	4,44 0,68				
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a Var. IPCA p.p.	1,03 0,36	2,96 1,48					
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a Var. IPCA p.p.	1,05 0,38	3,04 1,56					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a Var. IPCA p.p.	0,67 0,00	4,42 2,20	4,42 2,20				
NTN-B 150850 (5,761000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,32	4,28 2,07	4,28 2,07	5,51 0,03	11,76 -0,12	20,89 -0,33	23,34 -0,47
NTN-B 150840 (5,620000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,31	4,25 2,03	4,25 2,03	8,45 2,97	14,83 2,94	24,11 2,89	26,53 2,72
NTN-B 150535 (5,600000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,31	4,24 2,03	4,24 2,03	8,44 2,96	14,79 2,90	24,00 2,78	26,36 2,55
NTN-B 150545 (5,890000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,33	4,31 2,10	4,31 2,10	8,59 3,10	15,03 3,15	24,45 3,22	26,99 3,18
NTN-B 150830 (5,530000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,30	4,22 2,01	4,22 2,01	8,41 2,92	14,70 2,81	23,80 2,57	26,04 2,23
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,44 -0,08	1,24 -0,19	1,24 -0,19	3,74 -0,60	0,72 -3,05	6,74 -4,74	13,64 -3,35
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,33 -0,00	2,65 -0,04	2,65 -0,04	6,51 -0,10	9,84 -0,22	16,18 -0,56	26,06 -0,96
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,32 -0,01	2,64 -0,06	2,64 -0,06	6,50 -0,11	9,82 -0,24	16,23 -0,51	26,25 -0,78
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,31 0,68	3,03 1,59	3,03 1,59	7,18 2,83	11,77 8,00	18,68 7,19	26,13 9,13
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,31 -0,85	3,03 -0,66	3,03 -0,66	7,18 -1,37	11,79 -6,81	19,50 -16,68	29,55 -17,91
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	0,79	2,57	2,57	5,28	8,95	10,68	16,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,12	0,36	0,36	-0,21	-2,94	-10,54	-6,91
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,88 86,38	2,50 85,98	2,50 85,98	4,59 85,01	7,12 82,22	8,63 77,61	12,68 78,03
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	0,42 41,85	-0,23 -7,90	-0,23 -7,90	28,37 525,22	38,02 439,26	1.603,86 14.422,91	2.255,38 13.875,85
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,08 106,37	3,07 105,59	3,07 105,59	5,71 105,77	9,36 108,10	12,01 107,96	16,36 100,67
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,93 91,99	2,63 90,64	2,63 90,64	4,87 90,16	7,48 86,44	8,72 78,45	12,53 77,09
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,09 -0,58	2,32 0,10	2,32 0,10	4,95 -0,54	4,93 -6,96	7,33 -13,90	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-10,74 0,77	-21,02 -3,14	-21,02 -3,14	-13,21 -7,22	-43,33 -21,05	-30,33 -34,00	-24,19 -21,79
BRADERCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-11,17 0,33	-15,12 2,76	-15,12 2,76	-5,01 0,98	-25,98 -3,69	-0,10 -3,77	-13,56 -11,16
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-13,03 -1,53	-21,23 -3,34	-21,23 -3,34	-14,07 -8,08	-41,23 -18,94	-19,95 -23,62	-10,12 -7,72
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-13,65 -2,15	-22,97 -5,09	-22,97 -5,09	-23,29 -17,30	-45,39 -23,11	-28,40 -32,07	-16,73 -14,33
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-8,67 2,83	-14,92 2,96	-14,92 2,96	-5,31 0,68	-28,52 -6,24	2,02 -1,65	15,83 18,24
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	-11,11 0,40	-13,57 4,31	-13,57 4,31	-8,68 -2,69	-25,55 -3,26	2,22 -1,45	-2,29 0,12
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-7,83 -9,09	-23,03 -15,76	-23,03 -15,76	-32,81 -7,02	-31,28 -18,07	-3,82 -12,57	
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-4,77 -6,02	-11,19 -3,91	-11,19 -3,91	-17,37 8,42	-24,15 -10,94		
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	-0,53 -52,16	-9,04 -311,09	-9,04 -311,09	-29,87 -553,03	-19,25 -222,35	4,28 38,48	56,44 347,24
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-2,83 -3,99	-22,26 -25,95	-22,26 -25,95	-47,08 -55,63	-44,47 -63,07	-28,51 -64,68	
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	-7,82 -9,29	-15,04 -7,41	-15,04 -7,41	-17,49 7,96	-5,39 2,37	33,16 16,37	
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO Var. INPC + 4,94% p.p.	-0,85 -1,88	-0,62 -3,96	-0,62 -3,96	0,62 -7,52	-2,49 -19,93	5,69 -28,90	
CDI	1,01	2,91	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	-11,50	-17,88	-17,88	-5,99	-22,29	3,67	-2,40
INPC + 6,00%	1,11	3,60	3,60	8,68	18,63	37,32	49,01
IPCA + 6,00%	1,16	3,69	3,69	8,56	18,60	36,18	47,46

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 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
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 exceder 100.00 % o índice IBX_FEC. A taxa de performance será paga no(s) mes(es) de Janeiro e Julho	1,34
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	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVÉSPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
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 Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,93	2,65	2,65	4,99	7,19	9,37	15,94	24,32	34,03
IRF-M 1+	0,09	-0,06	-0,06	0,73	-1,02	-2,10	9,44	30,43	42,54
IRF-M TOTAL	0,37	0,83	0,83	2,19	1,76	1,90	11,90	29,50	41,08
IMA-B 5	0,33	2,69	2,69	6,61	10,06	16,74	27,03	45,64	59,81
IMA-B 5+	-1,10	0,12	0,12	2,03	-2,16	6,18	8,27	52,42	61,74
IMA-B TOTAL	-0,36	1,43	1,43	4,35	3,78	11,48	17,00	50,64	62,99
IMA-GERAL TOTAL	0,43	1,90	1,90	4,49	5,34	9,08	16,19	34,66	46,06
IDKA 2	0,47	2,86	2,86	6,85	10,11	17,88	28,22	45,20	59,68
IDKA 20	-2,95	-2,97	-2,97	-2,61	-13,58	-2,92	-7,47	53,52	57,70
CDI	1,01	2,91	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25	23,60	32,71

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-11,50	-17,88	-17,88	-5,99	-22,29	3,67	-2,40	35,43	56,67
IBRX 100	-11,56	-17,94	-17,94	-5,72	-23,04	4,91	0,02	40,80	61,46
IBRX 50	-11,67	-18,35	-18,35	-5,71	-22,70	6,28	-1,09	35,60	56,73
SMALL CAP	-16,33	-24,72	-24,72	-19,69	-39,59	-15,65	-11,30	25,69	43,26
IFIX	-0,88	0,56	0,56	-0,33	1,48	-0,38	6,46	31,54	34,78
Índice Consumo - ICON	-14,29	-28,67	-28,67		-46,23	-37,15	-28,35	-3,87	-2,44
Índice Dividendos - IDIV	-8,38	-9,43	-9,43	4,58	-4,10	18,72	18,53	75,13	90,63

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,67	2,22	2,22	5,49	11,89	21,23	23,81	27,98	33,60
INPC	0,62	2,12	2,12	5,61	11,92	22,24	25,11	29,26	33,82
IGPM	0,59	2,54	2,54	8,16	10,70	50,28	61,27	71,77	83,66
SELIC	1,01	2,91	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25	23,60	32,72

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	1,47	-7,62	-7,62	-25,45	-7,76	16,79	75,88	89,17	147,32
MSCI ACWI	1,26	-7,28	-7,28	-25,79	-13,20	8,75	55,83	60,47	103,16

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,00	3,21	3,21	7,54	16,36	31,10	39,27	49,65	62,39
IPCA + 5,00%	1,08	3,45	3,45	8,05	17,48	33,63	43,33	55,47	70,31
IPCA + 5,50%	1,12	3,57	3,57	8,30	18,04	34,90	45,38	58,44	74,39
IPCA + 5,89%	1,15	3,66	3,66	8,50	18,48	35,90	47,00	60,79	77,62
IPCA + 6,00%	1,16	3,69	3,69	8,56	18,60	36,18	47,46	61,46	78,54
INPC + 4,00%	0,95	3,11	3,11	7,67	16,40	32,20	40,73	51,14	62,66
INPC + 6,00%	1,11	3,60	3,60	8,68	18,63	37,32	49,01	63,07	78,83

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
700	06/05/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.709,52	1.353,97603800	2,0011580000
708	06/05/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	545,74	0,00	272,71209900	2,0011580000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
709	09/05/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	7.626.731,84	0,00	3.809.600,13027100	2,0019770000
701	10/05/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	423.824,30	0,00	211.616,94436200	2,0027900000
710	10/05/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	577.359,20	288.277,44995000	2,0027900000
711	12/05/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	921,50	0,00	459,73352900	2,0044220000
702	16/05/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	12.532,99	6.247,56793100	2,0060590000
712	16/05/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	5.371.699,45	0,00	2.677.737,51918500	2,0060590000
707	17/05/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	126,11	0,00	62,83892800	2,0068770000
713	17/05/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.063,63	529,99241300	2,0068770000
696	17/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	126,11	55,83465500	2,2586330980
692	17/05/2022	ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI	0,00	2.719.259,41	7.627,02629000	356,5294410000
714	18/05/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	30.310.393,62	0,00	15.097.110,67667100	2,0076950000
694	18/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	862.290,10	0,00	381.608,18388300	2,2596216130
691	18/05/2022	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	28.453.424,31	11.878.118,22216900	2,3954488220
715	19/05/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	862.833,94	0,00	429.587,57132700	2,0085170000
697	19/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	862.833,94	381.681,45120000	2,2606127120
703	20/05/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	14.565,22	7.248,75835900	2,0093400000
716	20/05/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	42.065.892,62	20.935.179,02070200	2,0093400000
693	20/05/2022	NTN-B 150850 (5,761000%)	42.065.892,61	0,00	10.123,00000000	4.155,4768960000
704	25/05/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	49,00	24,35612700	2,0117980000
705	26/05/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	64.161,62	31.879,64965200	2,0126200000
717	26/05/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.441.249,51	716.106,12413000	2,0126200000
718	27/05/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	163.100,45	0,00	81.005,78511800	2,0134420000
695	27/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	124.922,20	0,00	55.115,93520300	2,2665350690
698	30/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	115.481,85	50.929,18738900	2,2674983820
706	31/05/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	9.702,43	4.814,88909500	2,0150890000
719	31/05/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	164.720,02	81.743,29892800	2,0150890000
699	31/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.440,41	4.161,53513400	2,2684922020
721	01/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	49,00	0,00	24,30661600	2,0159120000
732	01/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	315,00	156,25677900	2,0159120000
733	02/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	315,00	156,19305800	2,0167320000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
722	06/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.176,30	582,79700900	2,0183700000
734	06/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.063,63	526,97476200	2,0183700000
735	07/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	54.809,81	27.144,45504200	2,0191900000
723	08/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	897,26	444,18569600	2,0200110000
736	08/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	897,26	0,00	444,18569900	2,0200110000
737	09/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	7.682.391,83	0,00	3.801.592,82177900	2,0208350000
724	10/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	38.604,51	19.095,46984900	2,0216580000
738	10/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	67.995,48	33.633,52498900	2,0216580000
725	13/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	462.784,79	0,00	228.820,22683000	2,0224820000
739	13/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	5.561.239,25	2.749.710,13244200	2,0224820000
740	14/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	81.555,74	0,00	40.308,55746500	2,0232860000
720	14/06/2022	LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a	5.050.000,00	0,00	101,00000000	50.000,0000000000
726	15/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	170.372,16	84.171,31159100	2,0241120000
741	15/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	15.755,82	7.784,06522300	2,0241120000
728	27/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	49,00	24,13631500	2,0301220000
727	27/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	47.515,99	0,00	23.405,48499000	2,0301220000
742	27/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.278.230,32	1.122.213,50431300	2,0301220000
730	28/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	14.526,88	0,00	6.350,26567100	2,2876019290
743	28/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	272.592,22	0,00	134.216,42647100	2,0309900000
731	29/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.526,88	6.347,39017000	2,2886382610
744	29/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	272.592,22	134.158,95843300	2,0318600000
729	30/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	10.123,68	4.980,33436400	2,0327310000
745	30/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.170,99	1.068,01641100	2,0327310000
Total			135.016.104,17	112.725.960,18		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 15.193.283,24

Value-At-Risk: 1,59%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO		1,59	1,59			955.534.155,49	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,35%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,600000%)		0,12	0,00	0,15			78.477.509,81	8,21
NTN-B 150545 (5,890000%)		0,12	0,00	0,15			108.849.233,66	11,39
NTN-B 150830 (5,530000%)		0,12	0,00	0,15			49.578.920,83	5,19
NTN-B 150840 (5,620000%)		0,12	0,00	0,15			93.052.392,26	9,74
NTN-B 150850 (5,761000%)		0,24	-0,00	0,27			42.639.413,70	4,46
Sub-total	0,37	0,11	0,00		-0,07	0,99	372.597.470,26	38,99

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,11	0,05	0,02			93.421.303,96	9,78
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,12	0,04	0,01			68.729.100,04	7,19
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,02	-0,00	0,00			1.952.653,08	0,20
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI		0,81	0,00	0,78			4.416.793,75	0,46
BB PREV RF VII		0,81	0,00	2,13			740.080,91	0,08
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI		0,25	0,01	0,27			66.200.281,20	6,93
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF		2,31	0,03	0,22			23.348.752,47	2,44
Sub-total	2,21	0,94	0,12		-0,29	0,38	258.808.965,41	27,09

Artigo 7º III, Alínea a

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 PREV RF FLUXO FIC		0,02	-0,00	0,01			64,31	0,00
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	0,00	0,02			76.297.472,03	7,98
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		1,34	0,01	1,35			41.505.891,10	4,34
Sub-total	1,15	0,47	0,01		-0,25	0,73	117.803.427,44	12,33

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a		0,26	0,00	0,29			5.076.354,14	0,53
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a		0,28	0,00	0,27			9.958.045,56	1,04
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a		0,33	0,00	0,32			9.947.377,96	1,04
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a		0,28	-0,00	0,30			8.134.070,97	0,85
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a		0,39	-0,00	0,39			8.140.108,84	0,85
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a		0,52	0,00	0,51			14.097.125,93	1,48
Sub-total	0,45	0,30	0,00		-0,20	0,92	55.353.083,40	5,79

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR		1,13	-0,00	1,13			86.570,44	0,01
Sub-total	1,47	1,13	-0,00		-0,40	0,42	86.570,44	0,01

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,40%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		10,13	0,26	5,84			26.592.213,55	2,78
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		9,53	0,15	5,34			17.066.932,36	1,79
BRADESCO F I A SELECTION		10,18	0,14	3,23			15.611.149,74	1,63
INDIE FIC FIA		15,30	0,21	9,39			14.746.561,98	1,54
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		13,32	0,03	9,06			2.359.808,58	0,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		10,22	0,19	5,74			19.850.175,55	2,08
Sub-total	17,85	10,40	0,97		-0,67	-10,98	96.226.841,76	10,07

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 11,77%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE		12,55	0,03	11,76			3.071.944,83	0,32
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		17,30	0,18	12,18			12.153.970,56	1,27
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		17,58	0,10	17,58			13.101.370,67	1,37
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		10,29	0,09	10,28			18.748.982,86	1,96
Sub-total	29,39	11,77	0,39		-0,15	-3,42	47.076.268,92	4,93

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 14,21%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		14,21	0,09	8,36			7.581.527,86	0,79
Sub-total	29,25	14,21	0,09		-0,30	-7,82	7.581.527,86	0,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de junho de 2022, vale observar que:

- O Instituto está com 27,09% dos recursos garantidores alocados no Artigo 7º I, Alínea b, Fundos 100% Títulos Públicos, limite este, inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos;
- O Instituto está com 0,79% dos recursos garantidores alocados no Artigo 10º I, Fundos Multimercados, limite este, inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos.