



**LDB**  
EMPRESAS

**SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO**  
JULHO 2022



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 29.07.2022.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Posição de Ativos e Enquadramento

## RENDA FIXA

83,43%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,600000%)	2,85	0,46	7,10	78.839.449,08	8,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,890000%)	2,91	0,48	5,60	109.376.233,97	11,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,530000%)	2,88	0,46	7,07	49.804.832,27	5,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,620000%)	2,85	0,46	7,11	93.483.093,97	9,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,761000%)	4,03	0,47	1,84	42.841.512,33	4,39
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,67</b>	<b>0,47</b>	<b>7,14</b>	<b>374.345.121,62</b>	<b>38,35</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	2,61	0,02	6,53	93.440.623,93	9,57	10.426.166.067,57	0,90
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,62	-0,01	6,49	68.724.084,87	7,04	1.121.658.731,38	6,13
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,16	0,90	5,54	2.301.976,13	0,24	756.882.858,12	0,30
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	1,73	0,83	8,07	4.453.250,24	0,46	499.702.968,06	0,89
BB	BB	BB PREV RF VII	1,73	0,82	8,06	746.176,93	0,08	260.423.123,57	0,29
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,17	0,80	6,12	66.731.253,66	6,84	2.528.329.321,31	2,64
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	5,89	-0,98	2,73	23.120.819,61	2,37	569.575.734,81	4,06
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>3,15</b>	<b>0,15</b>	<b>5,29</b>	<b>259.518.185,37</b>	<b>26,58</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	0,95	5,58	69,19	0,00	3.157.315.937,43	0,00

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,17	1,08	6,85	80.030.059,53	8,20	5.194.423.550,27	1,54
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,82	0,62	5,60	41.763.634,98	4,28	846.202.155,15	4,94
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,68</b>	<b>0,92</b>	<b>6,40</b>	<b>121.793.763,70</b>	<b>12,48</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
XP	XP	LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a	1,26	1,08	1,61	5.131.177,17	0,53		
BRDESCO	BRDESCO	LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a	0,76	0,60	5,94	10.017.969,78	1,03		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a	0,80	0,62	5,92	10.009.540,79	1,03		
XP	XP	LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	0,89	0,66	3,65	8.188.072,09	0,84		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	1,16	0,72	3,78	8.198.827,37	0,84		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	1,38	1,28	8,16	14.277.091,94	1,46		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a. a	2,94	0,64	0,64	2.910.412,74	0,30		
<b>Sub-total Artigo 7º IV</b>			<b>0,88</b>	<b>0,87</b>	<b>7,83</b>	<b>58.733.091,88</b>	<b>6,02</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	26,03	-0,11	28,23	40.395,29	0,00	40.395.435,01	0,10
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>			<b>26,03</b>	<b>-0,11</b>	<b>28,23</b>	<b>40.395,29</b>	<b>0,00</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>2,41</b>	<b>0,46</b>	<b>6,56</b>	<b>814.430.557,86</b>	<b>83,43</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

10,48%

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	25,04	8,51	-5,83	28.854.916,51	2,96	1.409.031.482,53	2,05
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,86	6,01	-3,20	18.091.813,76	1,85	1.957.830.490,61	0,92
BRAM	BEM	BRABESCO F I A SELECTION	21,19	6,30	0,97	16.594.056,40	1,70	466.800.295,62	3,55
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	28,79	4,18	-20,08	15.363.170,25	1,57	520.071.396,76	2,95
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	30,25	4,66	-10,06	2.469.842,21	0,25	236.714.154,00	1,04
TRUXT	INTRAG	TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	24,41	5,69	0,08	20.980.289,32	2,15	983.075.301,57	2,13
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>21,42</b>	<b>6,37</b>	<b>-5,84</b>	<b>102.354.088,45</b>	<b>10,48</b>		
Renda Variável			21,90	6,37	-5,84	102.354.088,45	10,48		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,23%

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	21,30	-0,75	-17,99	3.048.978,91	0,31	71.903.641,63	4,24
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	28,44	10,07	-26,05	13.377.518,75	1,37	268.632.822,66	4,98
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	33,83	11,73	-40,87	14.637.932,83	1,50	622.030.531,24	2,35
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,13	6,78	-25,12	20.019.824,68	2,05	1.161.561.395,32	1,72
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>21,04</b>	<b>8,51</b>	<b>-30,34</b>	<b>51.084.255,17</b>	<b>5,23</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>21,04</b>	<b>8,51</b>	<b>-30,34</b>	<b>51.084.255,17</b>	<b>5,23</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,86%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	20,63	10,21	-9,07	8.355.477,65	0,86	430.901.170,93	1,94
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>20,63</b>	<b>10,21</b>	<b>-1,90</b>	<b>8.355.477,65</b>	<b>0,86</b>		
Investimentos Estruturados			19,14	10,21	-1,90	8.355.477,65	0,86		
<b>Total</b>			<b>4,26</b>	<b>1,52</b>	<b>2,16</b>	<b>976.224.379,13</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	374.345.121,62	38,35	0,00	11,50	100,00	30,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	259.518.185,37	26,58	50,00	56,00	100,00	25,07	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	121.793.763,70	12,48	0,00	11,00	60,00	11,36	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	58.733.091,88	6,02	0,00	0,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	40.395,29	0,00	0,00	0,50	5,00	0,01	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>814.430.557,86</b>	<b>83,43</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	102.354.088,45	10,48	3,00	5,00	20,00	1,29	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>102.354.088,45</b>	<b>10,48</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	51.084.255,17	5,23	0,00	9,00	10,00	8,59	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>51.084.255,17</b>	<b>5,23</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	8.355.477,65	0,86	1,00	5,00	10,00	10,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>8.355.477,65</b>	<b>0,86</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>976.224.379,13</b>	<b>100,00</b>					



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,47 45,32	7,14 136,52	2,93 94,21			1.747.651,36	21.508.963,27
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,15 14,75	5,29 81,52	1,37 44,09	5,39 94,26	6,04 64,37	397.085,52	16.673.007,16
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,92 88,51	6,40 98,59	2,82 90,76	5,57 97,39		1.097.576,63	7.211.564,72
Artigo 7º IV % do CDI	0,87 83,69	7,83 148,52	3,29 105,63			488.008,48	2.885.014,88
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,11 -10,49	28,23 434,83	-0,30 -9,55	27,88 487,65		-93,99	19.038,11
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	0,64 9,89	0,00 0,00	0,37 6,41		0,00	59.539,75
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	6,37 1,68	-5,84 -4,25	-3,91 0,46	-9,81 -1,80		6.127.246,69	-6.342.859,37
Artigo 9º II % do CDI	8,51 822,71	-30,34 -467,26	-2,50 -80,44	-20,04 -350,52	-27,13 -288,91	4.007.986,25	-22.297.585,85
Artigo 10º I % do CDI	10,21 986,46	-1,90 -29,33	2,93 94,02	-0,45 -7,82		773.949,79	-303.503,18
<b>SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>14.639.410,73</b>	<b>19.413.179,49</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%)	78.477.509,81	0,00	0,00	0,00	78.839.449,08	361.939,27	5.332.515,25
NTN-B 150545 (5,890000%)	108.849.233,66	0,00	0,00	0,00	109.376.233,97	527.000,31	5.906.771,77
NTN-B 150830 (5,530000%)	49.578.920,83	0,00	0,00	0,00	49.804.832,27	225.911,44	3.288.512,81
NTN-B 150840 (5,620000%)	93.052.392,26	0,00	0,00	0,00	93.483.093,97	430.701,71	6.205.543,72
NTN-B 150850 (5,761000%)	42.639.413,70	0,00	0,00	0,00	42.841.512,33	202.098,63	775.619,71
					374.345.121,62	1.747.651,36	0,18

## 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 Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4.416.793,75	0,00	0,00	0,00	4.453.250,24	36.456,49	333.827,10
BB PREV RF VII	740.080,91	0,00	0,00	0,00	746.176,93	6.096,02	55.881,27
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.952.653,08	8.328.757,56	-8.016.623,12	0,00	2.301.976,13	37.188,61	477.619,69
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	93.421.303,96	0,00	0,00	0,00	93.440.623,93	19.319,97	5.730.420,79
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	66.200.281,20	0,00	0,00	0,00	66.731.253,66	530.972,46	3.848.122,81
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	23.348.752,47	0,00	0,00	0,00	23.120.819,61	-227.932,86	614.819,38
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	68.729.100,04	0,00	0,00	0,00	68.724.084,87	-5.015,17	4.194.566,09
					259.518.185,37	397.085,52	0,04

## 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	64,31	9.440,35	-9.440,35	0,00	69,19	4,88	37.997,20
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	76.297.472,03	2.892.759,63	0,00	0,00	80.030.059,53	839.827,87	4.959.186,57
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	41.505.891,10	0,00	0,00	0,00	41.763.634,98	257.743,88	2.214.380,95
					121.793.763,70	1.097.576,63	0,11

## 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	9.958.045,56	0,00	0,00	0,00	10.017.969,78	59.924,22	561.892,78
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	8.134.070,97	0,00	0,00	0,00	8.188.072,09	54.001,12	288.072,09
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a	5.076.354,14	0,00	0,00	0,00	5.131.177,17	54.823,03	81.177,17
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a	9.947.377,96	0,00	0,00	0,00	10.009.540,79	62.162,83	559.540,79
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	14.097.125,93	0,00	0,00	0,00	14.277.091,94	179.966,01	1.077.091,94
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	8.140.108,84	0,00	0,00	0,00	8.198.827,37	58.718,53	298.827,37
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	0,00	2.892.000,00	0,00	0,00	2.910.412,74	18.412,74	18.412,74
					58.733.091,88	488.008,48	0,05

## 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	86.570,44	0,00	0,00	46.081,16	40.395,29	-93,99	19.038,11
					40.395,29	-93,99	-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	15.611.149,74	0,00	0,00	0,00	16.594.056,40	982.906,66	159.986,89
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	26.592.213,55	0,00	0,00	0,00	28.854.916,51	2.262.702,96	-1.785.581,97
INDIE FIC FIA	14.746.561,98	0,00	0,00	0,00	15.363.170,25	616.608,27	-3.859.784,24
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	17.066.932,36	0,00	0,00	0,00	18.091.813,76	1.024.881,40	-597.398,54
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	2.359.808,58	0,00	0,00	0,00	2.469.842,21	110.033,63	-276.299,65
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	19.850.175,55	0,00	0,00	0,00	20.980.289,32	1.130.113,77	16.218,14
					102.354.088,45	6.127.246,69	0,64

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	3.071.944,83	0,00	0,00	0,00	3.048.978,91	-22.965,92	-668.841,38
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	12.153.970,56	0,00	0,00	0,00	13.377.518,75	1.223.548,19	-4.712.665,46
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	13.101.370,67	0,00	0,00	0,00	14.637.932,83	1.536.562,16	-10.200.678,08
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18.748.982,86	0,00	0,00	0,00	20.019.824,68	1.270.841,82	-6.715.400,93
					51.084.255,17	4.007.986,25	0,42

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	7.581.527,86	0,00	0,00	0,00	8.355.477,65	773.949,79	-767.970,49
					8.355.477,65	773.949,79	0,08

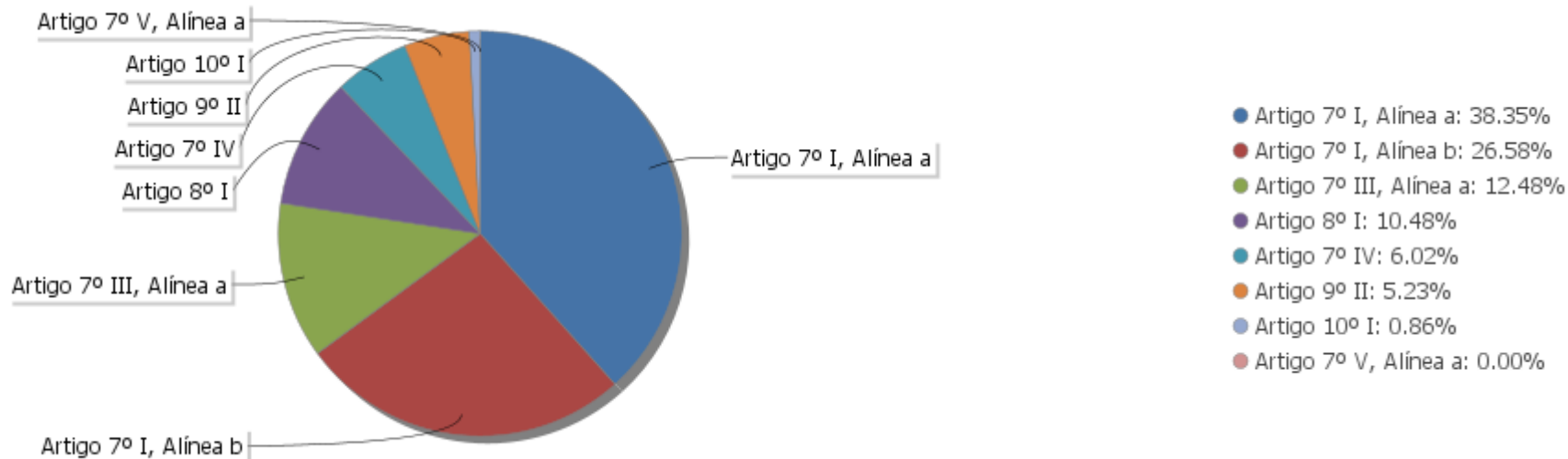
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

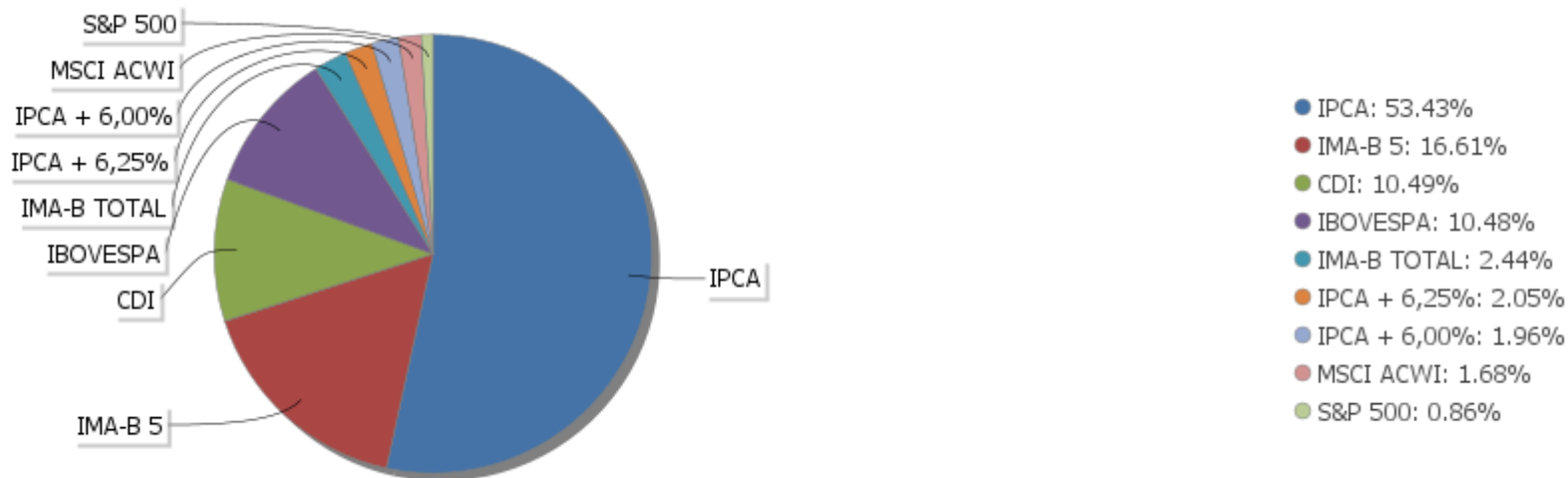
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	457.345.738,29	46,85	457.345.738,29	46,85
de 31 a 365 dias	85.800.427,34	8,79	543.146.165,63	55,64
acima de 365 dias	433.078.213,50	44,36	976.224.379,13	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

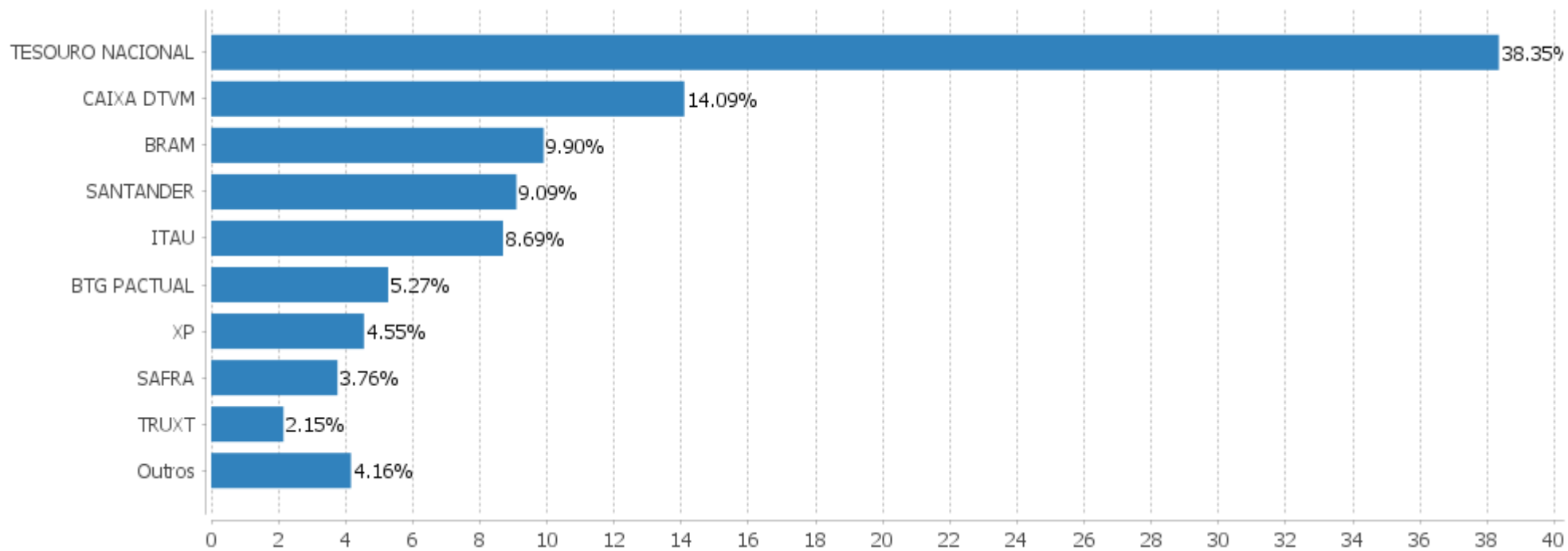


Alocação Por Estratégia



## 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	1,52						2,16
INPC + 4,94%	1,08	1,37	2,14	1,41	0,87	1,03	-0,20						7,93
p.p. indexador	-1,58	-1,39	-0,36	-1,93	-0,11	-1,88	1,72						-5,77
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

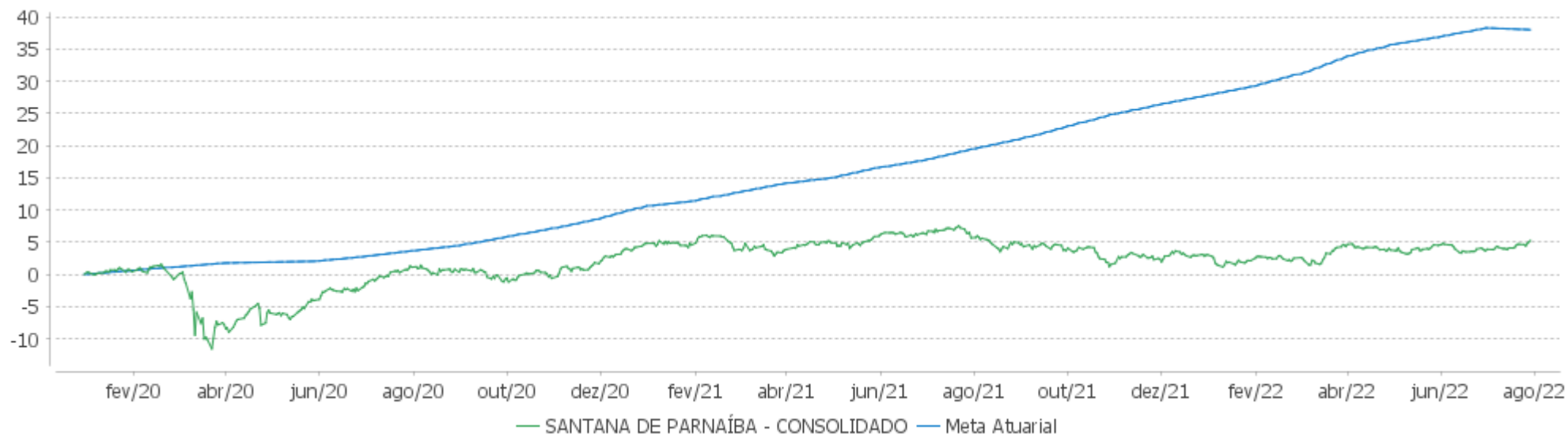
## Performance Sobre a Meta Atuarial

## Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	8	25,81	03 meses	1,43	1,70	-0,27	3,19
Meses abaixo - Meta Atuarial	23	74,19	06 meses	2,67	6,78	-4,11	3,60
			12 meses	-0,38	15,77	-16,15	4,26
			24 meses	4,11	34,26	-30,15	4,48
Maior rentabilidade da Carteira	3,11	2020-12	Desde 31/12/2019	5,25	39,88	-34,63	7,50
Menor rentabilidade da Carteira	-7,26	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



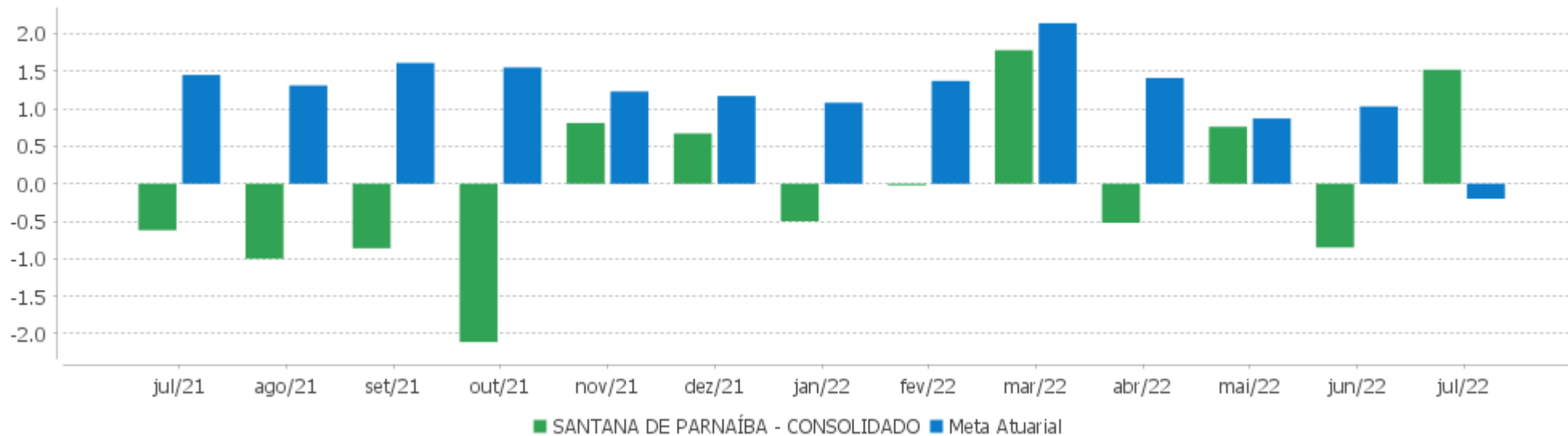
Patrimônio Líquido





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
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a Var. IPCA p.p.	1,08 1,76	1,61 1,94					
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a Var. IPCA + 6,25% p.p.	0,60 0,78	5,94 1,36	3,14 1,13				
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a Var. IPCA + 6,25% p.p.	0,62 0,80	5,92 1,44	3,16 1,15				
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a Var. IPCA p.p.	0,66 1,34	3,65 2,86	3,22 2,77				
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a Var. IPCA p.p.	0,72 1,40	3,78 2,99	3,21 2,75				
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a Var. IPCA p.p.	0,64 0,99	0,64 0,99					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a Var. IPCA p.p.	1,28 1,96	8,16 4,56	3,43 2,98				
NTN-B 150850 (5,761000%) Var. IPCA p.p.	0,47 1,15	6,01 1,24	2,95 2,49	4,82 0,61	10,96 0,89	20,46 0,49	23,13 0,39
NTN-B 150840 (5,620000%) Var. IPCA p.p.	0,46 1,14	8,96 4,19	2,91 2,46	7,74 3,53	14,01 3,94	23,67 3,71	26,31 3,58
NTN-B 150535 (5,600000%) Var. IPCA p.p.	0,46 1,14	8,94 4,17	2,91 2,45	7,73 3,52	13,97 3,90	23,57 3,60	26,14 3,41
NTN-B 150545 (5,890000%) Var. IPCA p.p.	0,48 1,16	9,12 4,35	2,98 2,52	7,88 3,67	14,21 4,14	24,01 4,04	26,77 4,03
NTN-B 150830 (5,530000%) Var. IPCA p.p.	0,46 1,14	8,90 4,13	2,89 2,43	7,70 3,49	13,88 3,81	23,36 3,39	25,83 3,09
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,98 -0,10	2,73 -0,70	-0,41 -0,13	3,77 -0,43	0,33 -2,93	0,85 -5,01	11,21 -3,28
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-0,01 -0,02	6,49 -0,13	1,07 -0,05	6,39 -0,11	9,81 -0,23	15,10 -0,50	25,05 -0,77
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,02 0,01	6,53 -0,09	1,12 -0,01	6,44 -0,06	9,84 -0,20	15,08 -0,53	24,91 -0,91
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,82 1,70	8,06 4,63	1,79 2,08	7,45 3,26	11,96 8,71	19,27 13,41	26,12 11,63
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	0,83	8,07	1,80	7,46	11,98	19,66	29,36

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,02	-0,27	-0,16	0,22	-4,67	-15,04	-16,75
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,80 1,48	6,12 1,35	2,60 2,14	5,57 1,36	9,65 -0,42	10,96 -9,01	16,73 -6,00
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,90 87,35	5,54 85,29	2,69 86,50	4,90 85,68	7,81 83,15	9,48 78,70	13,15 78,29
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	-0,11 -10,49	28,23 434,83	-0,30 -9,55	27,88 487,65	37,19 396,07	1.603,63 13.305,51	2.139,49 12.739,70
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,08 104,11	6,85 105,54	3,29 105,64	6,03 105,45	10,11 107,64	12,91 107,14	16,96 100,99
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,95 91,86	5,87 90,37	2,86 91,99	5,18 90,61	8,24 87,71	9,65 80,03	13,07 77,84
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,62 1,30	5,60 0,83	1,98 1,53	4,75 0,54	6,22 -3,84	6,99 -12,98	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,51 3,82	-5,83 -4,25	-3,75 0,62	-10,31 -2,31	-35,56 -20,26	-30,25 -30,49	-21,35 -22,68
BRADERCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	6,30 1,61	0,97 2,55	-2,43 1,94	-5,43 2,57	-17,29 -1,99	-3,51 -3,75	-9,68 -11,01
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,66 -0,03	-10,06 -8,48	-10,03 -5,67	-14,50 -6,49	-36,92 -21,61	-22,25 -22,49	-8,36 -9,68
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,18 -0,51	-20,08 -18,50	-9,60 -5,23	-23,12 -15,11	-41,88 -26,58	-31,02 -31,26	-17,26 -18,59
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	6,01 1,31	-3,20 -1,62	-2,21 2,16	-4,48 3,53	-18,57 -3,27	0,76 0,51	-0,16 -1,49
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,69 1,00	0,08 1,66	-1,45 2,92	-4,43 3,58	-21,04 -5,74	-3,85 -4,09	17,56 16,23
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	10,07 4,22	-26,05 -4,60	-4,90 -7,81	-18,64 -4,73	-25,56 -14,77	-0,38 -15,60	
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-0,75 -6,60	-17,99 3,46	-4,18 -7,08	-18,37 -4,46	-19,87 -9,07		
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	6,78 654,99	-25,12 -386,90	1,09 34,93	-14,37 -251,23	-18,03 -192,02	8,51 70,62	70,20 418,02
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	11,73 11,92	-40,87 -49,21	-4,59 -6,54	-28,01 -35,25	-38,67 -55,31	-22,68 -57,38	
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	10,21 2,13	-9,07 10,36	2,63 -2,80	-4,08 7,34	1,48 6,29	38,77 12,86	
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO	1,52	2,16	1,43	2,67	-0,38	4,11	

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.	1,72	-5,77	-0,27	-4,11	-15,93	-29,04	
CDI	1,03	6,49	3,11	5,72	9,39	12,05	16,79
IBOVESPA	4,69	-1,58	-4,37	-8,01	-15,30	0,25	1,33
INPC + 6,00%	-0,12	8,56	1,96	7,31	16,71	35,83	47,90
IPCA + 6,00%	-0,20	8,34	1,95	7,24	16,65	34,70	46,11

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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,05	6,09	2,96	5,43	8,11	10,26	16,33	24,81	34,03
IRF-M 1+	1,20	1,94	1,68	2,45	1,01	-2,37	9,37	29,67	40,37
IRF-M TOTAL	1,15	3,36	2,11	3,45	3,42	1,97	11,97	29,08	39,48
IMA-B 5	0,01	6,62	1,13	6,50	10,04	15,61	25,82	43,53	55,41
IMA-B 5+	-1,84	0,16	-1,79	1,79	-3,22	-2,89	4,70	45,06	51,68
IMA-B TOTAL	-0,88	3,43	-0,28	4,20	3,25	5,86	14,50	45,94	55,35
IMA-GERAL TOTAL	0,47	4,98	1,83	4,76	5,95	7,72	15,62	33,41	43,39
IDKA 2	-0,17	6,66	1,15	6,61	10,11	16,59	26,71	42,67	55,48
IDKA 20	-3,59	-6,10	-5,30	-3,27	-15,47	-16,49	-12,36	41,45	43,04
CDI	1,03	6,49	3,11	5,72	9,39	12,05	16,79	24,21	33,01

## Renda Variável

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

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,68	4,77	0,46	4,21	10,07	19,97	22,74	26,69	32,37
INPC	-0,60	4,98	0,47	4,28	10,12	20,98	24,23	28,16	32,79
IGPM	0,21	8,39	1,32	6,45	10,08	47,31	60,97	71,26	85,37
SELIC	1,03	6,49	3,11	5,72	9,39	12,05	16,79	24,21	33,03

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	8,08	-19,43	5,43	-11,42	-4,80	25,90	90,98	102,65	177,09
MSCI ACWI	5,85	-21,45	2,90	-13,91	-10,79	15,22	67,60	69,52	121,29

**Meta Atuarial**

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



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
759	01/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.729,39	850,40736100	2,0336020000
751	01/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	3.679,98	1.809,58710800	2,0336020000
760	05/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	47.002,66	0,00	23.093,38534700	2,0353300000
761	07/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.813,04	0,00	890,02079400	2,0370760000
762	08/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	7.698.012,60	0,00	3.777.331,43600100	2,0379500000
763	11/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	537.015,01	263.394,23491600	2,0388260000
752	11/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	409.815,35	0,00	201.005,55417600	2,0388260000
764	12/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	307,51	150,76233200	2,0397000000
753	12/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	234,11	114,77668800	2,0397000000
765	13/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.846.632,59	1.395.015,61268200	2,0405740000
747	13/07/2022	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	2.892.759,63	0,00	211.277,74306179	13,6917386000
766	14/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.892.000,00	1.416.640,13271000	2,0414500000
748	14/07/2022	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	2.892.000,00	0,00	57,00000000	50.736,8421050000
767	20/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	24.138,89	11.804,11790400	2,0449550000
754	20/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	11.271,92	5.512,06236600	2,0449550000
755	21/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	600,00	293,27904600	2,0458330000
756	25/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	49,00	23,93041500	2,0475870000
768	27/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.460.565,47	712.699,02302800	2,0493440000
757	27/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	64.696,94	31.569,58114600	2,0493440000
749	28/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	9.440,35	0,00	4.086,08899700	2,3103632850
769	28/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	172.113,91	0,00	83.948,83193200	2,0502240000
750	29/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.440,35	4.084,24393300	2,3114069960
770	29/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	172.391,32	84.048,03641600	2,0511046700
758	29/07/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.310,99	639,16280800	2,0511049200
<b>Total</b>			<b>14.122.957,54</b>	<b>8.026.063,47</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 16.183.768,85

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			976.224.379,13	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,41%

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%)		0,31	0,00	0,30			78.839.449,08	8,08
NTN-B 150545 (5,890000%)		0,31	0,00	0,30			109.376.233,97	11,20
NTN-B 150830 (5,530000%)		0,31	0,00	0,30			49.804.832,27	5,10
NTN-B 150840 (5,620000%)		0,31	0,00	0,30			93.483.093,97	9,58
NTN-B 150850 (5,761000%)		0,31	0,00	0,30			42.841.512,33	4,39
<b>Sub-total</b>	0,52	0,31	0,00		-1,09	0,47	374.345.121,62	38,35

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		1,19	0,05	0,02			93.440.623,93	9,57
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,19	0,04	0,01			68.724.084,87	7,04
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,03	-0,00	0,00			2.301.976,13	0,24
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI		0,98	0,00	0,97			4.453.250,24	0,46
BB PREV RF VII		0,98	0,00	2,14			746.176,93	0,08
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI		0,24	0,01	0,35			66.731.253,66	6,84
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF		2,29	0,03	0,21			23.120.819,61	2,37
<b>Sub-total</b>	2,22	0,98	0,12		-0,40	0,15	259.518.185,37	26,58

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		0,03	-0,00	0,01			69,19	0,00
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,02			80.030.059,53	8,20
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		1,42	0,01	1,44			41.763.634,98	4,28
<b>Sub-total</b>	1,04	0,49	0,01		-0,11	0,92	121.793.763,70	12,48

## 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 - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a		0,38	0,00	0,48			5.131.177,17	0,53
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a		0,32	0,00	0,31			10.017.969,78	1,03
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a		0,37	0,00	0,35			10.009.540,79	1,03
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a		0,27	-0,00	0,33			8.188.072,09	0,84
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a		0,34	-0,00	0,39			8.198.827,37	0,84
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a		0,59	0,00	0,62			14.277.091,94	1,46
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a		1,28	0,00	1,29			2.910.412,74	0,30
<b>Sub-total</b>	1,10	0,40	0,00		-0,15	0,87	58.733.091,88	6,02

## Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR		1,14	-0,00	1,15			40.395,29	0,00
<b>Sub-total</b>	0,38	1,14	-0,00		-3,04	-0,11	40.395,29	0,00

## Renda Variável

Value-At-Risk: 10,13%

## 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		10,08	0,27	5,68			28.854.916,51	2,96
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		9,82	0,16	4,56			18.091.813,76	1,85
BRADESCO F I A SELECTION		10,40	0,15	3,10			16.594.056,40	1,70
INDIE FIC FIA		12,73	0,17	7,48			15.363.170,25	1,57

## 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
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		12,49	0,03	7,79			2.469.842,21	0,25
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		10,39	0,19	5,22			20.980.289,32	2,15
<b>Sub-total</b>	16,19	10,13	0,97		0,33	6,37	102.354.088,45	10,48

## Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,54%

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		12,42	0,03	12,01			3.048.978,91	0,31
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		18,09	0,20	13,25			13.377.518,75	1,37
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		21,70	0,14	21,72			14.637.932,83	1,50
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,18	0,07	9,18			20.019.824,68	2,05
<b>Sub-total</b>	22,47	12,54	0,44		0,33	8,51	51.084.255,17	5,23

## Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 14,96%

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
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		14,96	0,11	8,76			8.355.477,65	0,86
<b>Sub-total</b>	18,80	14,96	0,11		0,49	10,21	8.355.477,65	0,86

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

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

- O Instituto está com 26,58% 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 0,86% dos recursos garantidores alocados no Artigo 10º I, Fundos Multimercados, limite este, inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos.