



LDB
EMPRESAS

SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO
3º 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 30.09.2022.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 83,73%

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%)	2,85	0,11	0,52	78.883.572,55	7,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,890000%)	2,91	0,13	0,59	109.489.881,12	10,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,530000%)	0,66	0,10	0,50	48.437.495,23	4,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,620000%)	0,66	0,11	0,52	90.961.610,75	9,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,761000%)	2,90	0,13	0,57	41.691.527,23	4,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,860000%)	2,93	0,13	0,19	41.585.773,83	4,18
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,73	0,12	0,55	411.049.860,71	41,27

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	2,68	0,43	0,50	93.884.421,66	9,43	8.885.835.879,64	1,06
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,69	0,40	0,39	39.007.103,04	3,92	889.444.204,66	4,39
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,13	0,93	2,89	3.064.123,32	0,31	772.946.064,25	0,40
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,84	1,53	2,97	68.167.058,23	6,84	2.451.788.610,47	2,78
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	5,85	1,36	1,78	23.765.211,36	2,39	510.345.410,43	4,66
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,98	0,85	1,40	227.887.917,61	22,88		

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	0,14	0,99	3,05	5.312.538,40	0,53	3.459.949.589,95	0,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,14	1,12	3,44	87.961.622,89	8,83	7.044.059.635,23	1,25
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,68	1,28	3,51	42.963.071,07	4,31	801.217.889,04	5,36
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,66	1,17	3,46	136.237.232,36	13,68		

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	2,02	0,03	1,60	5.157.588,14	0,52		
BRABESCO	BRABESCO	LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRABESCO SA 6,23% a.a	0,82	0,15	0,73	10.030.980,35	1,01		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a	0,88	0,14	0,76	10.022.610,05	1,01		
XP	XP	LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	0,87	0,14	0,76	8.196.292,28	0,82		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	1,02	0,15	0,84	8.208.644,28	0,82		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	1,58	0,35	0,80	14.210.337,57	1,43		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a. a	3,07	0,08	1,29	2.929.348,85	0,29		
Sub-total Artigo 7º IV			1,00	0,18	0,91	58.755.801,52	5,90		

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	25,30	0,17	0,48	40.634,29	0,00	22.044.959,18	0,18
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			25,30	0,17	0,48	40.634,29	0,00		
Renda Fixa			2,04	0,49	1,26	833.971.446,49	83,73		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

10,91%

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	24,68	-0,31	14,37	30.414.729,35	3,05	1.434.568.432,69	2,12
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,75	-1,00	11,81	19.081.784,30	1,92	1.961.836.267,82	0,97
BRAM	BEM	BRABESCO F I A SELECTION	21,23	-1,35	13,87	17.776.573,79	1,78	493.369.883,54	3,60
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	28,70	-1,67	13,16	16.687.326,94	1,68	536.979.527,43	3,11
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	30,69	0,73	16,08	2.739.234,98	0,28	237.020.075,64	1,16
TRUXT	INTRAG	TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	23,68	-0,91	10,86	22.005.443,68	2,21	999.608.333,73	2,20
Sub-total Artigo 8º I			21,26	-0,91	12,97	108.705.093,04	10,91		
Renda Variável			21,96	-0,91	12,97	108.705.093,04	10,91		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,59%

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	20,92	-10,42	-11,41	2.721.306,48	0,27	59.811.858,67	4,55
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	29,72	-12,25	-6,77	11.331.545,29	1,14	216.834.041,61	5,23
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	36,27	-9,46	1,59	13.310.220,24	1,34	551.200.355,41	2,41
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,94	-5,52	-2,27	18.323.281,00	1,84	1.006.692.313,90	1,82
Sub-total Artigo 9º II			22,18	-8,71	-2,95	45.686.353,01	4,59		
Investimentos no Exterior			22,18	-8,71	-2,95	45.686.353,01	4,59		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,77%

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	21,80	-5,01	1,41	7.688.373,33	0,77	391.146.244,88	1,97
Sub-total Artigo 10º I			21,80	-5,01	1,41	7.688.373,33	0,77		
Investimentos Estruturados			19,38	-5,01	1,41	7.688.373,33	0,77		
Total			3,97	-0,17	2,25	996.051.265,87	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	411.049.860,71	41,27	0,00	11,50	100,00	50,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	227.887.917,61	22,88	50,00	56,00	100,00	8,48	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	136.237.232,36	13,68	0,00	11,00	60,00	14,99	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	58.755.801,52	5,90	0,00	0,00	20,00	6,03	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	40.634,29	0,00	0,00	0,50	5,00	0,01	5,00
	Total Renda Fixa	833.971.446,49	83,73					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	108.705.093,04	10,91	3,00	5,00	20,00	0,49	30,00
	Total Renda Variável	108.705.093,04	10,91					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	45.686.353,01	4,59	0,00	9,00	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	45.686.353,01	4,59					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	7.688.373,33	0,77	1,00	5,00	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	7.688.373,33	0,77					15,00
Total		996.051.265,87	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	0,12 10,86	0,55 16,46	0,55 16,46	4,83 76,55		478.035,99	2.094.181,85
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,85 79,16	1,40 42,23	1,40 42,23	3,84 60,85	7,96 73,05	1.946.932,95	3.376.198,76
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,17 108,83	3,46 104,38	3,46 104,38	6,35 100,65		1.547.140,70	4.297.878,34
Artigo 7º IV % do CDI	0,18 16,91	0,91 27,34	0,91 27,34	5,38 85,15		106.303,62	510.718,12
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,17 16,17	0,48 14,57	0,48 14,57	0,25 3,99		70,30	145,00
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00		0,00	0,00
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,91 -1,38	12,97 1,30	12,97 1,30	-7,31 0,99		-998.567,30	12.478.251,28
Artigo 9º II % do CDI	-8,71 -812,58	-2,95 -89,19	-2,95 -89,19	-19,44 -308,01	-35,36 -324,52	-4.359.343,72	-1.389.915,91
Artigo 10º I % do CDI	-5,01 -466,97	1,41 42,57	1,41 42,57	-10,43 -165,22		-405.150,68	106.845,47
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO (Total)						-1.684.578,14	21.474.302,91

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%)	78.800.108,31	0,00	0,00	0,00	78.883.572,55	83.464,24	406.062,74
NTN-B 150545 (5,890000%)	109.349.011,95	0,00	0,00	0,00	109.489.881,12	140.869,17	640.647,46
NTN-B 150830 (5,530000%)	48.388.914,73	0,00	0,00	0,00	48.437.495,23	48.580,50	245.539,12
NTN-B 150840 (5,620000%)	90.863.943,89	0,00	0,00	0,00	90.961.610,75	97.666,86	481.219,77
NTN-B 150850 (5,761000%)	41.636.588,58	0,00	0,00	0,00	41.691.527,23	54.938,65	240.554,69
NTN-B 150850 (5,860000%)	41.533.257,26	0,00	0,00	0,00	41.585.773,83	52.516,57	80.158,06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
					411.049.860,71	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	2.749.254,19	8.550.545,64	-8.279.012,48	0,00	3.064.123,32	43.335,97	178.133,35
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	93.485.111,52	0,00	0,00	0,00	93.884.421,66	399.310,14	463.117,70
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	67.138.329,35	0,00	0,00	0,00	68.167.058,23	1.028.728,88	1.966.777,03
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	23.445.553,60	0,00	0,00	0,00	23.765.211,36	319.657,76	416.458,89
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	38.851.202,84	0,00	0,00	0,00	39.007.103,04	155.900,20	278.003,00
					227.887.917,61	0,00	0,00

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	5.260.165,03	149.188,62	-149.188,62	0,00	5.312.538,40	52.373,37	81.890,64
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	80.998.096,96	6.012.583,50	0,00	0,00	87.961.622,89	950.942,43	2.758.807,73
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	42.419.246,17	0,00	0,00	0,00	42.963.071,07	543.824,90	1.457.179,97
					136.237.232,36	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 Financeiro Trimestre (R\$)
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a	10.015.598,94	0,00	0,00	0,00	10.030.980,35	15.381,41	72.934,79
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	8.185.190,94	0,00	0,00	0,00	8.196.292,28	11.101,34	62.221,31
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a	5.156.111,80	0,00	0,00	0,00	5.157.588,14	1.476,34	81.234,00
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a	10.008.384,60	0,00	0,00	0,00	10.022.610,05	14.225,45	75.232,09
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	14.160.734,09	0,00	0,00	0,00	14.210.337,57	49.603,48	113.211,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	8.196.344,62	0,00	0,00	0,00	8.208.644,28	12.299,66	68.535,44
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	2.927.132,91	0,00	0,00	0,00	2.929.348,85	2.215,94	37.348,85
					58.755.801,52	0,00	0,00

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	40.563,99	0,00	0,00	0,00	40.634,29	70,30	145,00
					40.634,29	0,00	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	18.020.652,03	0,00	0,00	0,00	17.776.573,79	-244.078,24	2.165.424,05
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	30.510.571,04	0,00	0,00	0,00	30.414.729,35	-95.841,69	3.822.515,80
INDIE FIC FIA	16.971.176,49	0,00	0,00	0,00	16.687.326,94	-283.849,55	1.940.764,96
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19.274.675,78	0,00	0,00	0,00	19.081.784,30	-192.891,48	2.014.851,94
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	2.719.253,41	0,00	0,00	0,00	2.739.234,98	19.981,57	379.426,40
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	22.207.331,59	0,00	0,00	0,00	22.005.443,68	-201.887,91	2.155.268,13
					108.705.093,04	0,00	0,00

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	3.037.918,45	0,00	0,00	0,00	2.721.306,48	-316.611,97	-350.638,35
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	12.913.966,45	0,00	0,00	0,00	11.331.545,29	-1.582.421,16	-822.425,27
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	14.700.994,80	0,00	0,00	0,00	13.310.220,24	-1.390.774,56	208.849,57
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO	19.392.817,03	0,00	0,00	0,00	18.323.281,00	-1.069.536,03	-425.701,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
EXTERIOR							
					45.686.353,01	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	8.093.524,01	0,00	0,00	0,00	7.688.373,33	-405.150,68	106.845,47
					7.688.373,33	0,00	0,00

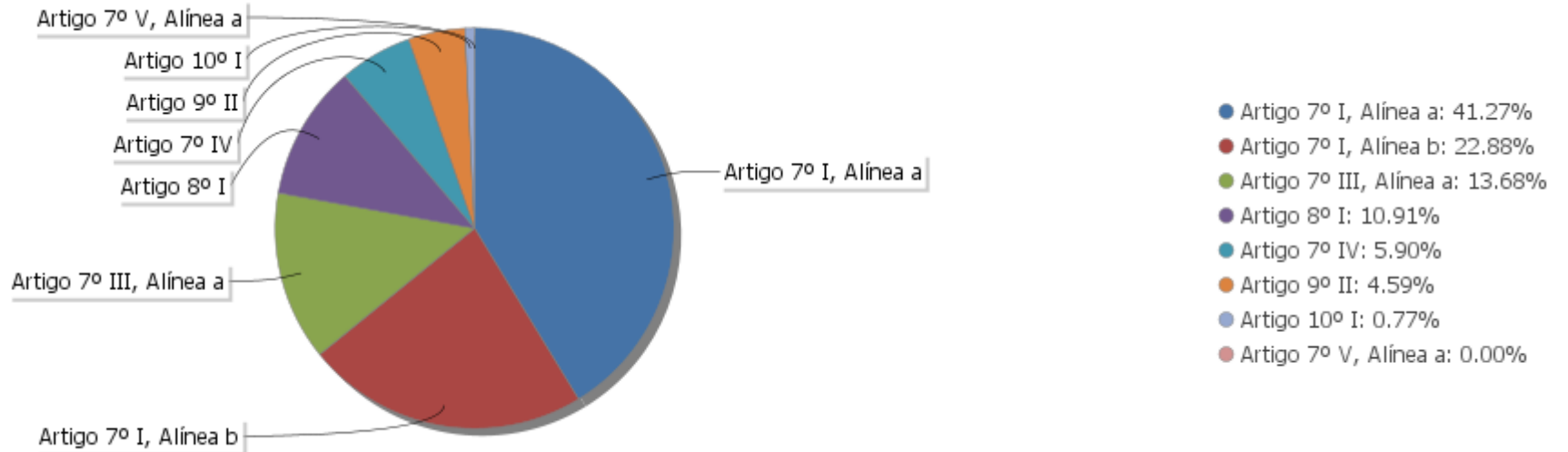
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

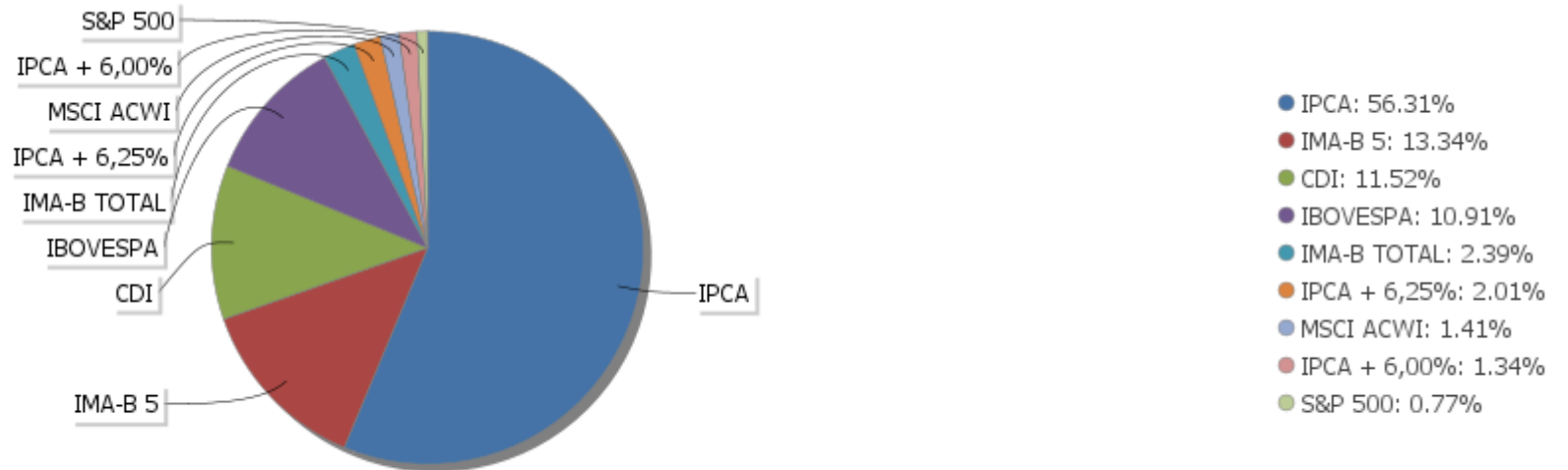
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	435.276.450,10	43,70	435.276.450,10	43,70
de 31 a 365 dias	90.969.153,54	9,13	526.245.603,64	52,83
acima de 365 dias	469.805.662,23	47,17	996.051.265,87	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

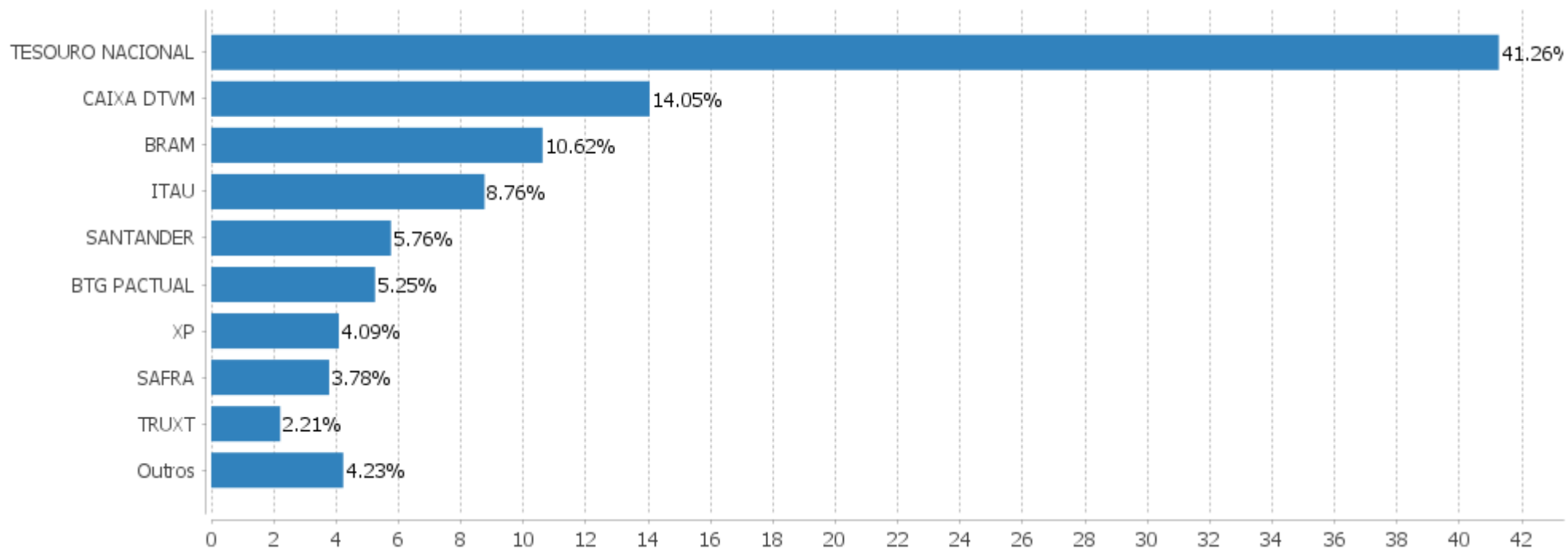


Alocação Por Estratégia



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	0,88	-0,17				2,88
INPC + 4,94%	1,08	1,37	2,14	1,41	0,87	1,03	-0,20	0,13	0,08				8,16
p.p. indexador	-1,58	-1,39	-0,36	-1,93	-0,11	-1,88	1,72	0,75	-0,25				-5,27
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

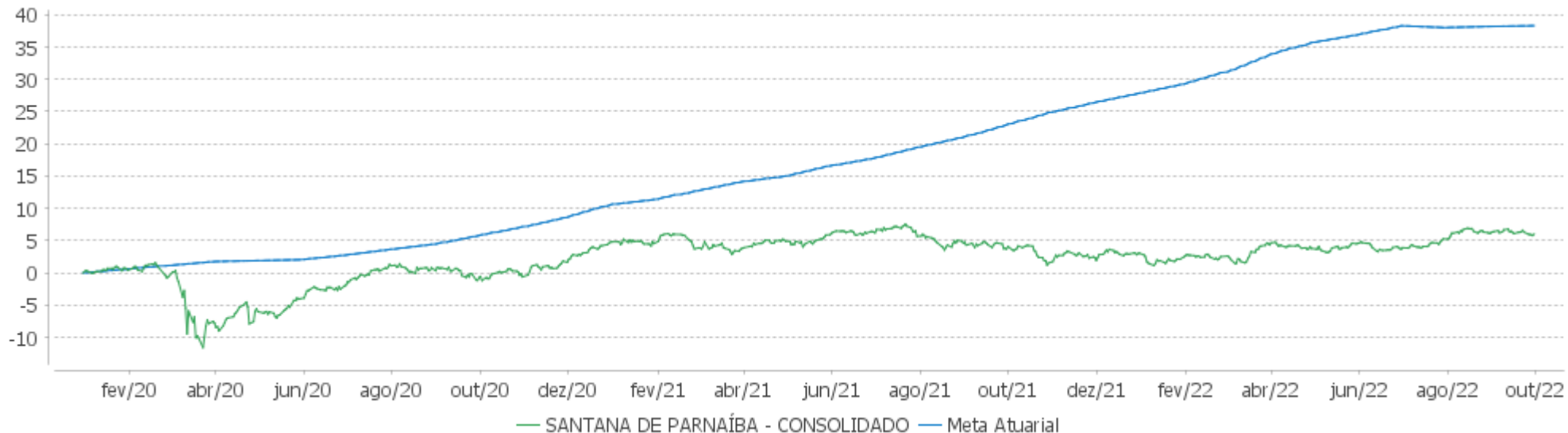
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

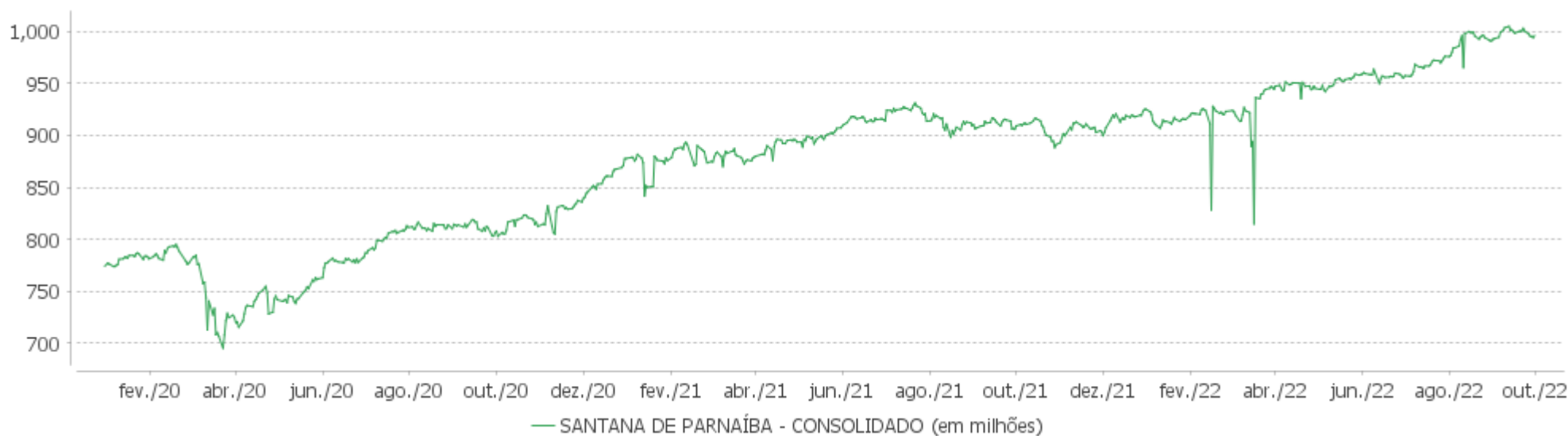
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	9	27,27	03 meses	2,25	0,01	2,24	3,01
Meses abaixo - Meta Atuarial	24	72,73	06 meses	1,62	3,35	-1,74	3,15
			12 meses	2,22	12,62	-10,40	3,97
			24 meses	6,81	31,65	-24,84	4,24
Maior rentabilidade da Carteira	3,11	2020-12	Desde 31/12/2019	6,00	40,18	-34,17	7,30
Menor rentabilidade da Carteira	-7,26	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

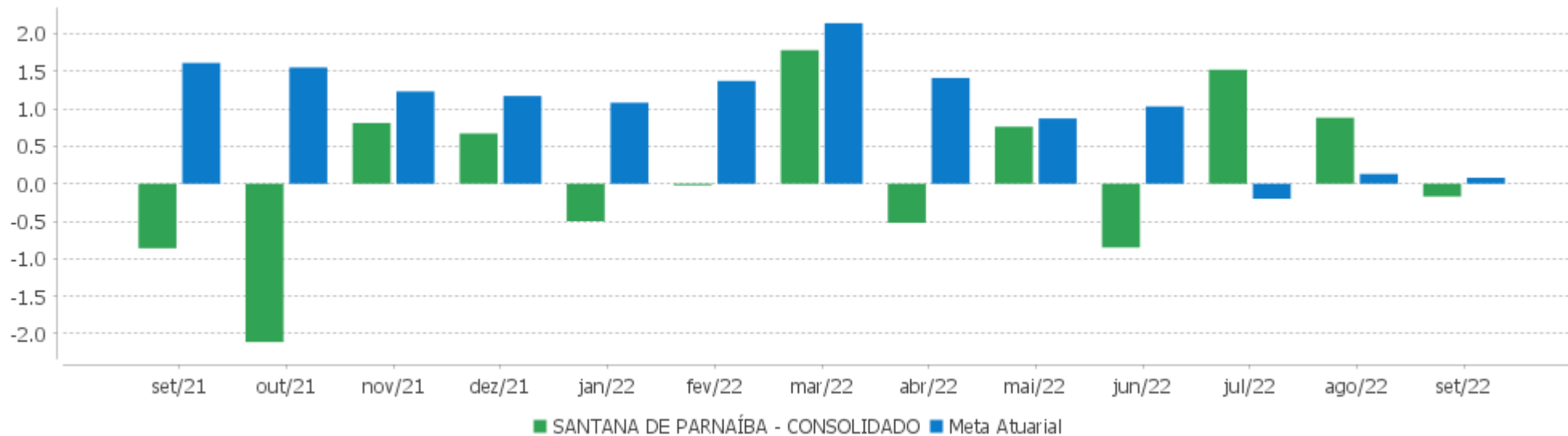


Patrimônio Líquido



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.	0,03 0,32	1,60 2,92	1,60 2,92				
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a Var. IPCA + 6,25% p.p.	0,15 -0,06	0,73 0,50	0,73 0,50	5,23 1,24			
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a Var. IPCA + 6,25% p.p.	0,14 -0,07	0,76 0,53	0,76 0,53	5,23 1,24			
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a Var. IPCA p.p.	0,14 0,43	0,76 2,09	0,76 2,09				
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a Var. IPCA p.p.	0,08 0,37	1,29 2,29					
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a Var. IPCA p.p.	0,15 0,44	0,84 2,17	0,84 2,17				
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a Var. IPCA p.p.	0,35 0,64	0,80 2,13	0,80 2,13	5,26 4,40			
NTN-B 150850 (5,761000%) Var. IPCA p.p.	0,13 0,42	0,57 1,89	0,57 1,89	4,87 4,01	10,91 3,75	22,06 3,91	25,31 3,45
NTN-B 150840 (5,620000%) Var. IPCA p.p.	0,11 0,40	0,52 1,85	0,52 1,85	4,79 3,93	13,91 6,74	25,26 7,11	28,49 6,64
NTN-B 150535 (5,600000%) Var. IPCA p.p.	0,11 0,40	0,52 1,84	0,52 1,84	4,78 3,92	10,74 3,57	21,71 3,56	24,79 2,94
NTN-B 150850 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	0,13 0,42	0,58 1,91	0,58 1,91	4,91 4,05	10,96 3,79	22,13 3,98	25,40 3,55
NTN-B 150545 (5,890000%) Var. IPCA p.p.	0,13 0,42	0,59 1,91	0,59 1,91	4,93 4,06	10,98 3,81	22,14 3,99	25,41 3,56
NTN-B 150830 (5,530000%) Var. IPCA p.p.	0,10 0,39	0,50 1,82	0,50 1,82	4,75 3,88	13,82 6,65	24,97 6,82	28,02 6,17
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,36 -0,12	1,78 0,08	1,78 0,08	3,05 -0,11	5,38 -1,86	8,06 -4,24	11,55 -3,12
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,40 -0,02	0,39 -0,05	0,39 -0,05	3,03 -0,10	9,03 -0,22	15,26 -0,48	23,38 -0,75
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,43 0,00	0,50 0,06	0,50 0,06	3,16 0,02	9,15 -0,10	15,36 -0,39	23,34 -0,79
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,53	2,97	2,97	5,62	10,74	13,75	17,95

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.	1,82	4,30	4,30	4,76	3,57	-4,40	-3,91
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,93 87,16	2,89 87,17	2,89 87,17	5,46 86,43	9,21 84,54	11,44 80,47	14,42 78,93
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	0,17 16,17	0,48 14,57	0,48 14,57	0,25 3,99	30,05 275,82	71,71 504,53	2.259,29 12.362,70
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,12 104,02	3,44 103,94	3,44 103,94	6,62 104,79	11,58 106,31	15,22 107,12	18,56 101,56
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,99 92,75	3,06 92,31	3,06 92,31	5,77 91,41	9,78 89,79	11,85 83,36	14,54 79,54
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	1,28 1,57	3,51 4,84	3,51 4,84	5,91 5,05	10,29 3,12	11,11 -7,04	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,31 -0,78	14,37 2,71	14,37 2,71	-9,67 -1,36	-20,04 -19,19	-23,90 -40,21	-19,68 -24,73
BRADERCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-1,35 -1,82	13,87 2,21	13,87 2,21	-3,35 4,96	-1,15 -0,30	7,51 -8,80	-6,16 -11,22
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,73 0,27	16,08 4,41	16,08 4,41	-8,56 -0,26	-19,74 -18,89	-9,26 -25,57	-2,23 -7,28
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,67 -2,14	13,16 1,50	13,16 1,50	-12,83 -4,53	-27,44 -26,59	-20,74 -37,05	-14,50 -19,56
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,91 -1,38	10,86 -0,81	10,86 -0,81	-5,68 2,62	-12,46 -11,61	5,21 -11,10	17,10 12,04
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	-1,00 -1,47	11,81 0,14	11,81 0,14	-3,37 4,93	-6,05 -5,21	12,04 -4,27	0,24 -4,81
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-12,25 -6,48	-6,77 -2,48	-6,77 -2,48	-28,24 -16,99	-35,43 -12,95	-19,15 -13,01	
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	-5,52 -514,48	-2,27 -68,59	-2,27 -68,59	-11,11 -175,94	-26,92 -247,07	-11,68 -82,19	42,97 235,12
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-10,42 -4,65	-11,41 -7,13	-11,41 -7,13	-21,32 -10,07	-25,37 -2,89	-14,81 -8,66	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-9,46 -9,66	1,59 1,42	1,59 1,42	-21,02 -24,88	-45,36 -58,96	-40,77 -73,50	
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	-5,01 0,35	1,41 3,64	1,41 3,64	-13,84 -4,16	-5,35 11,91	24,97 22,78	
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO Var. INPC + 4,94% p.p.	-0,17 -0,25	2,25 2,24	2,25 2,24	1,62 -1,74	2,22 -10,27	6,81 -23,94	
CDI	1,07	3,31	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	0,47	11,66	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05
INPC + 6,00%	0,17	0,27	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90
IPCA + 6,00%	0,20	0,17	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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
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 DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Renda Variável

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

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

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	-5,36	-2,23	-2,23	-9,68	-17,26	2,19	56,39	66,16	142,89
MSCI ACWI	-5,78	-4,29	-4,29	-11,25	-22,48	-6,15	37,99	42,53	93,97

Meta Atuarial

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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	BRASESCO 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
779	05/08/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	710,00	345,40987700	2,0555288900
788	05/08/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	142,13	69,14522000	2,0555288900
780	08/08/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	295,22	0,00	143,55865900	2,0564416100
789	08/08/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	49.574,78	24.107,06903100	2,0564416100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
790	09/08/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	7.788.306,19	0,00	3.785.593,58977000	2,0573540200
781	10/08/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	420.926,79	0,00	204.505,54716400	2,0582658800
791	10/08/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	261.469,66	0,00	127.033,95734200	2,0582658800
771	11/08/2022	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	0,00	30.000.000,00	981.761,60564200	30,5573163868
792	12/08/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	30.000.000,00	0,00	14.562.468,52170700	2,0600902900
782	15/08/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	68.632,87	33.300,69300400	2,0610042500
772	15/08/2022	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	0,00	4.479.634,45	1.680.535,07962000	2,6656000830
774	15/08/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	4.479.634,45	0,00	1.928.291,16941055	2,3231110120
793	15/08/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	5.147.407,16	0,00	2.497.523,79695400	2,0610042500
773	16/08/2022	BB PREV RF VII	0,00	750.949,00	352.315,32689800	2,1314684280
775	16/08/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	750.949,00	0,00	323.093,91625000	2,3242437020
776	17/08/2022	NTN-B 150850 (5,860000%)	41.505.615,76	0,00	10.232,00000000	4,056,4518930000
794	17/08/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	41.505.622,18	20.120.764,06759302	2,0628253500
783	19/08/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	14.986,09	7.258,34689600	2,0646698300
785	25/08/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	49,00	23,69032400	2,0683427300
784	25/08/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	870,65	420,94087100	2,0683427300
795	25/08/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	16.415,14	7.936,37323500	2,0683427300
786	26/08/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	3.401,55	1.643,84604600	2,0692631100
796	29/08/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.431.027,74	691.257,07275300	2,0701817000
777	29/08/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	9.440,35	0,00	4.044,35953400	2,3342014770
797	30/08/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	172.852,60	83.459,20818500	2,0711027700
778	30/08/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.440,35	4.042,46921200	2,3352929870
787	31/08/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	67.143,16	32.404,63541200	2,0720232900
798	31/08/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	62.692,16	0,00	30.256,49388300	2,0720232900
811	06/09/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	57.429,05	27.667,33932600	2,0756983300
821	06/09/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	7.911.659,36	0,00	3.811.565,12276000	2,0756983300
812	08/09/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	462.784,79	0,00	222.855,81819800	2,0766107600
822	08/09/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	247.160,81	119.021,28826300	2,0766101057
813	09/09/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	43.260,45	20.823,02386100	2,0775296400
807	09/09/2022	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	6.012.583,50	0,00	429.874,83300000	13,9868237000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
823	09/09/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	6.112.444,63	2.942.169,63942000	2,0775296400
824	13/09/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	216,31	0,00	104,02665200	2,0793709600
814	14/09/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	25.860,74	12.431,30074400	2,0802923400
825	14/09/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	17.584,96	8.453,11962700	2,0802923400
816	15/09/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	500,00	240,24445000	2,0812134400
815	15/09/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	500,00	0,00	240,24446000	2,0812134400
817	16/09/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.900,00	1.392,80083600	2,0821354300
818	26/09/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	49,00	23,47038200	2,0876814800
819	27/09/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	63.875,46	30.582,82578100	2,0886055300
826	27/09/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.515.903,52	725.796,94907300	2,0886055300
808	28/09/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	149.188,62	0,00	63.284,95754800	2,3574104460
827	28/09/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	175.385,18	0,00	83.935,19812100	2,0895307800
809	29/09/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	139.748,27	59.252,89764700	2,3585052470
820	30/09/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	12.341,43	5.901,08224700	2,0913841200
810	30/09/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.440,35	4.000,81034900	2,3596094730
828	30/09/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	179.702,43	85.925,11767900	2,0913841200
Total			119.262.012,04	95.025.716,26		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 14.689.950,42

Value-At-Risk: 1,47%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO	3,64	1,47	1,47	-1,65	2,88	996.051.265,87	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,41%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,600000%)	0,67	0,19	-0,00	0,17	0,17	9,01	78.883.572,55	7,92
NTN-B 150545 (5,890000%)	0,67	0,19	-0,00	0,17	0,50	9,23	109.489.881,12	10,99
NTN-B 150830 (5,530000%)	0,67	0,19	-0,00	0,17	0,09	8,95	48.437.495,23	4,86
NTN-B 150840 (5,620000%)	0,67	0,19	-0,00	0,17	0,19	9,02	90.961.610,75	9,13
NTN-B 150850 (5,761000%)	3,32	0,19	-0,00	0,17	-0,84	6,11	41.691.527,23	4,19
NTN-B 150850 (5,860000%)	3,36	0,19	-0,00	0,17	-0,82	6,14	41.585.773,83	4,18
Sub-total	0,30	0,19	-0,00		-3,19	0,12	411.049.860,71	41,27

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	2,49	1,14	0,05	0,04	-0,74	7,04	93.884.421,66	9,43
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,50	1,17	0,02	0,01	-0,79	6,91	39.007.103,04	3,92
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,08	0,01	-0,00	0,00	-15,74	7,61	3.064.123,32	0,31
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,87	1,42	0,04	1,43	-0,26	8,40	68.167.058,23	6,84
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	5,24	2,58	0,03	0,30	-0,63	5,60	23.765.211,36	2,39
Sub-total	3,26	1,24	0,15		-0,07	0,85	227.887.917,61	22,88

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,09	0,01	-0,00	0,00	-9,42	8,07	5.312.538,40	0,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,01	-0,00	0,01	5,06	9,35	87.961.622,89	8,83
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,90	1,46	0,02	1,48	-0,14	8,63	42.963.071,07	4,31
Sub-total	0,67	0,46	0,02		0,14	1,17	136.237.232,36	13,68

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	2,02	0,29	0,00	0,33	-0,86	2,13	5.157.588,14	0,52
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a	0,82	0,27	0,00	0,25	-0,85	6,08	10.030.980,35	1,01
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a	0,88	0,27	0,00	0,26	-0,77	6,06	10.022.610,05	1,01
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	0,87	0,25	0,00	0,24	-2,25	3,75	8.196.292,28	0,82
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	1,02	0,25	0,00	0,25	-1,77	3,91	8.208.644,28	0,82
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	1,58	0,33	0,00	0,36	0,01	7,65	14.210.337,57	1,43
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	3,07	0,27	0,00	0,33	-0,49	1,29	2.929.348,85	0,29
Sub-total	0,31	0,24	0,00		-2,90	0,18	58.755.801,52	5,90

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR	29,21	0,01	-0,00	0,01	0,69	28,99	40.634,29	0,00
Sub-total	0,60	0,01	-0,00		-1,50	0,17	40.634,29	0,00

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,42%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	22,56	9,50	0,26	6,02	-0,43	-0,74	30.414.729,35	3,05
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,80	8,65	0,15	4,41	-0,36	2,10	19.081.784,30	1,92
BRADESCO F I A SELECTION	19,97	10,97	0,17	3,33	-0,04	8,17	17.776.573,79	1,78
INDIE FIC FIA	27,11	10,93	0,17	5,97	-0,81	-13,19	16.687.326,94	1,68
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	28,31	12,49	0,03	7,37	-0,32	-0,25	2.739.234,98	0,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	21,60	9,40	0,18	4,97	-0,18	4,97	22.005.443,68	2,21
Sub-total	22,33	9,42	0,94		-0,09	-0,91	108.705.093,04	10,91

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 11,82%

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	22,14	9,98	0,02	9,59	-1,61	-26,80	2.721.306,48	0,27
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	32,50	14,68	0,12	10,21	-1,42	-37,36	11.331.545,29	1,14
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	39,56	20,12	0,10	20,13	-1,39	-46,23	13.310.220,24	1,34
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,55	10,05	0,05	10,05	-2,06	-31,46	18.323.281,00	1,84
Sub-total	19,54	11,82	0,28		-0,50	-8,71	45.686.353,01	4,59

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 13,61%

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	23,58	13,61	0,08	8,44	-1,07	-16,33	7.688.373,33	0,77
Sub-total	21,91	13,61	0,08		-0,28	-5,01	7.688.373,33	0,77