



**LDB**  
EMPRESAS

**SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO**  
OUTUBRO 2022



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.10.2022.

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

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

Equipe LDB Empresas.

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 83,04%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,600000%)	2,85	0,53	7,73	79.302.291,58	7,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,890000%)	2,91	0,55	6,30	110.094.948,90	10,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,530000%)	0,65	0,53	7,68	48.692.025,44	4,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,620000%)	0,65	0,53	7,74	91.445.806,66	8,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,761000%)	2,89	0,54	2,49	41.917.892,20	4,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,860000%)	2,93	0,55	0,74	41.814.685,53	4,10
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,70</b>	<b>0,54</b>	<b>7,80</b>	<b>413.267.650,31</b>	<b>40,50</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	2,43	1,88	9,05	95.645.132,49	9,37	8.449.071.998,91	1,13
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,44	1,89	8,94	39.745.922,39	3,89	902.156.349,01	4,41
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,11	0,89	8,56	3.306.566,75	0,32	818.815.798,11	0,40
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,80	0,88	9,36	68.766.535,17	6,74	2.434.245.468,97	2,82
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	5,39	1,27	6,94	24.067.031,14	2,36	476.367.259,74	5,05
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,60</b>	<b>1,51</b>	<b>8,21</b>	<b>231.531.187,94</b>	<b>22,69</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	0,12	0,95	8,80	5.363.093,83	0,53	3.859.205.707,52	0,14

**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	0,12	1,07	10,52	94.808.185,36	9,29	7.181.883.753,28	1,32
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,69	0,96	9,68	43.376.656,25	4,25	839.190.192,11	5,17
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,64</b>	<b>1,03</b>	<b>10,21</b>	<b>143.547.935,44</b>	<b>14,07</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	1,91	0,20	2,33	5.167.730,37	0,51		
BRDESCO	BRDESCO	LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a	0,78	0,53	6,64	10.083.915,90	0,99		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a	0,83	0,52	6,62	10.075.173,54	0,99		
XP	XP	LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	0,82	0,49	4,26	8.236.681,92	0,81		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	0,96	0,48	4,40	8.247.946,65	0,81		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	1,49	0,58	8,28	14.292.831,62	1,40		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a. a	2,73	0,23	1,53	2.936.168,17	0,29		
<b>Sub-total Artigo 7º IV</b>			<b>0,96</b>	<b>0,48</b>	<b>8,39</b>	<b>59.040.448,17</b>	<b>5,79</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	25,30	0,72	29,91	40.925,12	0,00	22.202.742,12	0,18
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>			<b>25,30</b>	<b>0,72</b>	<b>29,91</b>	<b>40.925,12</b>	<b>0,00</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,60</b>	<b>0,88</b>	<b>8,36</b>	<b>847.428.146,98</b>	<b>83,04</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

11,58%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	24,46	7,78	6,99	32.781.968,18	3,21	1.534.573.593,33	2,14
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19,29	10,60	12,92	21.103.987,70	2,07	2.150.027.623,87	0,98
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	21,43	5,78	14,43	18.804.892,65	1,84	520.825.145,72	3,61
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	28,19	8,89	-5,47	18.171.299,90	1,78	572.961.650,38	3,17
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	29,85	4,79	4,53	2.870.439,13	0,28	242.814.961,57	1,18
TRUXT	INTRAG	TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	24,07	11,27	16,79	24.484.899,17	2,40	1.065.269.130,28	2,30
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>22,11</b>	<b>8,75</b>	<b>8,76</b>	<b>118.217.486,73</b>	<b>11,58</b>		
Renda Variável			22,26	8,75	8,76	118.217.486,73	11,58		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,56%

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	21,43	-3,42	-29,31	2.628.232,91	0,26	55.539.253,68	4,73
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	30,83	4,27	-34,69	11.815.324,23	1,16	218.636.584,93	5,40
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	38,26	-1,68	-47,14	13.086.430,99	1,28	529.565.364,86	2,47
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,91	3,61	-28,99	18.983.884,62	1,86	1.037.465.638,26	1,83
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>23,17</b>	<b>1,81</b>	<b>-36,57</b>	<b>46.513.872,75</b>	<b>4,56</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>23,17</b>	<b>1,81</b>	<b>-36,57</b>	<b>46.513.872,75</b>	<b>4,56</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,82%

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	22,87	8,84	-8,93	8.368.296,28	0,82	403.547.884,46	2,07
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>22,87</b>	<b>8,84</b>	<b>-1,75</b>	<b>8.368.296,28</b>	<b>0,82</b>		
Investimentos Estruturados			20,37	8,84	-1,75	8.368.296,28	0,82		
<b>Total</b>			<b>3,80</b>	<b>1,84</b>	<b>4,78</b>	<b>1.020.527.802,74</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	413.267.650,31	40,50	0,00	11,50	100,00	50,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	231.531.187,94	22,69	50,00	56,00	100,00	8,48	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	143.547.935,44	14,07	0,00	11,00	60,00	14,99	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	59.040.448,17	5,79	0,00	0,00	20,00	6,03	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	40.925,12	0,00	0,00	0,50	5,00	0,01	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>847.428.146,98</b>	<b>83,04</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	118.217.486,73	11,58	3,00	5,00	20,00	0,49	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>118.217.486,73</b>	<b>11,58</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	46.513.872,75	4,56	0,00	9,00	10,00	10,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>46.513.872,75</b>	<b>4,56</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	8.368.296,28	0,82	1,00	5,00	10,00	10,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>8.368.296,28</b>	<b>0,82</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>1.020.527.802,74</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	0,54 52,86	7,80 89,65	0,62 18,68	3,56 54,76		2.217.789,60	24.073.283,36
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,51 147,59	8,21 82,06	2,77 84,00	4,18 64,19	11,57 100,67	3.448.231,25	23.100.351,65
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,03 101,29	10,21 102,04	3,58 108,50	6,50 99,86		1.443.696,44	11.855.562,87
Artigo 7º IV % do CDI	0,48 47,46	8,39 96,01	0,52 15,88	3,83 58,79		284.646,65	3.192.371,17
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,72 70,12	29,91 299,06	1,31 39,80	1,01 15,52		290,83	19.567,93
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	0,64 6,42	0,00 0,00	0,00 0,00		0,00	59.539,75
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	8,75 3,30	8,76 -1,94	15,50 3,02	10,99 3,42		9.512.393,69	9.520.538,91
Artigo 9º II % do CDI	1,81 177,46	-36,57 -365,61	-8,95 -271,46	-11,23 -172,45	-38,40 -334,13	827.519,74	-26.867.968,27
Artigo 10º I % do CDI	8,84 866,44	-1,75 -17,53	0,15 4,65	3,08 47,36		679.922,95	-290.684,55
<b>SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>18.414.491,15</b>	<b>44.662.562,82</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%)	78.883.572,55	0,00	0,00	0,00	79.302.291,58	418.719,03	5.795.357,75
NTN-B 150545 (5,890000%)	109.489.881,12	0,00	0,00	0,00	110.094.948,90	605.067,78	6.625.486,70
NTN-B 150830 (5,530000%)	48.437.495,23	0,00	0,00	0,00	48.692.025,44	254.530,21	3.562.670,70
NTN-B 150840 (5,620000%)	90.961.610,75	0,00	0,00	0,00	91.445.806,66	484.195,91	6.740.257,69
NTN-B 150850 (5,761000%)	41.691.527,23	0,00	0,00	0,00	41.917.892,20	226.364,97	1.040.440,74
NTN-B 150850 (5,860000%)	41.585.773,83	0,00	0,00	0,00	41.814.685,53	228.911,70	309.069,76
					413.267.650,31	0,00	0,00

**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\$)
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	3.064.123,32	8.309.907,85	-8.114.868,77	0,00	3.306.566,75	47.404,35	665.968,78
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	93.884.421,66	0,00	0,00	0,00	95.645.132,49	1.760.710,83	7.934.929,35
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	68.167.058,23	0,00	0,00	0,00	68.766.535,17	599.476,94	5.883.404,32
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	23.765.211,36	0,00	0,00	0,00	24.067.031,14	301.819,78	1.561.030,91
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	39.007.103,04	0,00	0,00	0,00	39.745.922,39	738.819,35	5.216.403,61
					231.531.187,94	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	5.312.538,40	141.636,03	-141.636,03	0,00	5.363.093,83	50.555,43	170.438,39
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	87.961.622,89	5.867.006,64	0,00	0,00	94.808.185,36	979.555,83	7.857.722,26
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	42.963.071,07	0,00	0,00	0,00	43.376.656,25	413.585,18	3.827.402,22
					143.547.935,44	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a	10.030.980,35	0,00	0,00	0,00	10.083.915,90	52.935,55	627.838,90
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	8.196.292,28	0,00	0,00	0,00	8.236.681,92	40.389,64	336.681,92
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a	5.157.588,14	0,00	0,00	0,00	5.167.730,37	10.142,23	117.730,37
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a	10.022.610,05	0,00	0,00	0,00	10.075.173,54	52.563,49	625.173,54
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	14.210.337,57	0,00	0,00	0,00	14.292.831,62	82.494,05	1.092.831,62
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	8.208.644,28	0,00	0,00	0,00	8.247.946,65	39.302,37	347.946,65
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	2.929.348,85	0,00	0,00	0,00	2.936.168,17	6.819,32	44.168,17
					59.040.448,17	0,00	0,00

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

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC ITALIA SENIOR	40.634,29	0,00	0,00	0,00	40.925,12	290,83	19.567,93
					40.925,12	0,00	0,00

## Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO F I A SELECTION	17.776.573,79	0,00	0,00	0,00	18.804.892,65	1.028.318,86	2.370.823,14
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	30.414.729,35	0,00	0,00	0,00	32.781.968,18	2.367.238,83	2.141.469,70
INDIE FIC FIA	16.687.326,94	0,00	0,00	0,00	18.171.299,90	1.483.972,96	-1.051.654,59
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19.081.784,30	0,00	0,00	0,00	21.103.987,70	2.022.203,40	2.414.775,40
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	2.739.234,98	0,00	0,00	0,00	2.870.439,13	131.204,15	124.297,27
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	22.005.443,68	0,00	0,00	0,00	24.484.899,17	2.479.455,49	3.520.827,99
					118.217.486,73	0,00	0,00

## Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	2.721.306,48	0,00	0,00	0,00	2.628.232,91	-93.073,57	-1.089.587,38
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	11.331.545,29	0,00	0,00	0,00	11.815.324,23	483.778,94	-6.274.859,98
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	13.310.220,24	0,00	0,00	0,00	13.086.430,99	-223.789,25	-11.752.179,92
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18.323.281,00	0,00	0,00	0,00	18.983.884,62	660.603,62	-7.751.340,99
					46.513.872,75	0,00	0,00

## Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	7.688.373,33	0,00	0,00	0,00	8.368.296,28	679.922,95	-755.151,86
					8.368.296,28	0,00	0,00

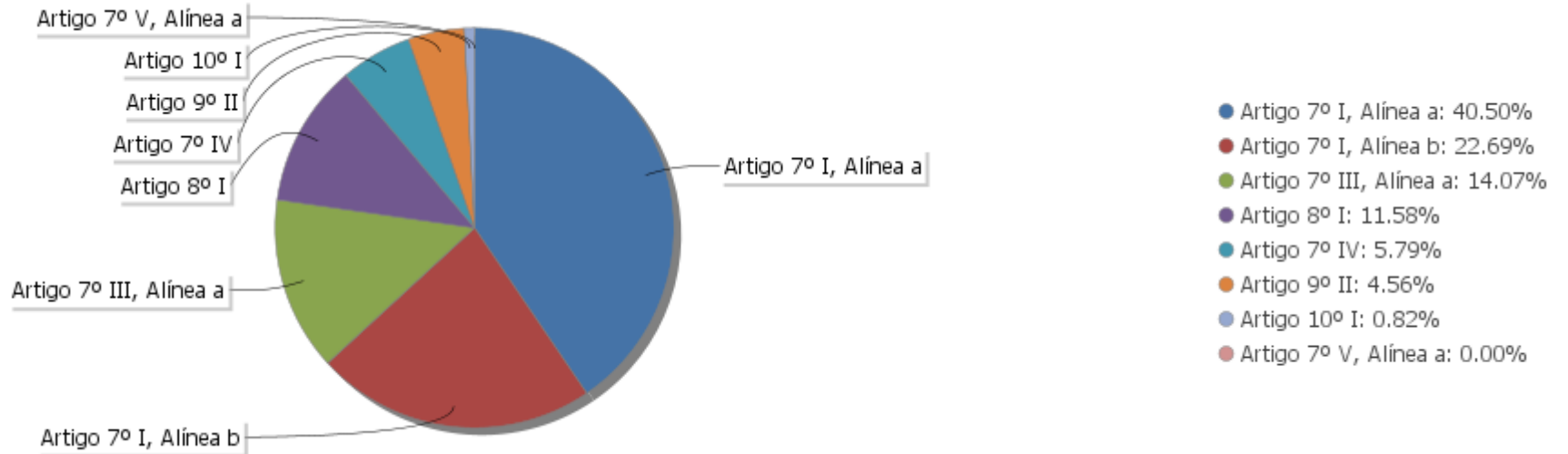
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

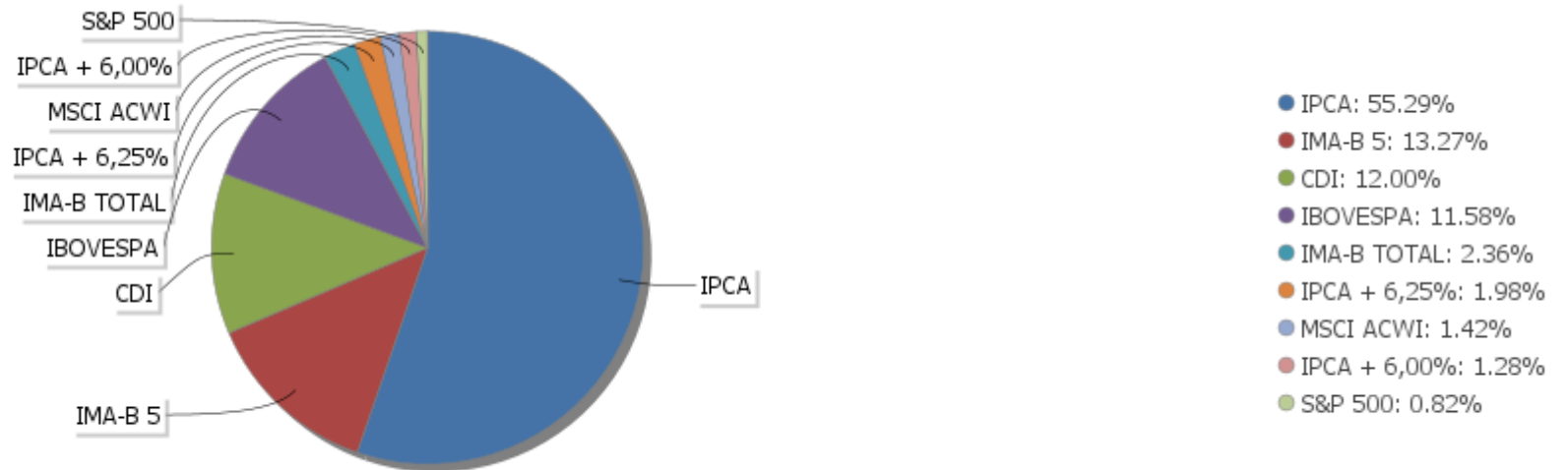
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	448.766.185,06	43,97	448.766.185,06	43,97
de 31 a 365 dias	99.453.519,20	9,75	548.219.704,26	53,72
acima de 365 dias	472.308.098,48	46,28	1.020.527.802,74	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

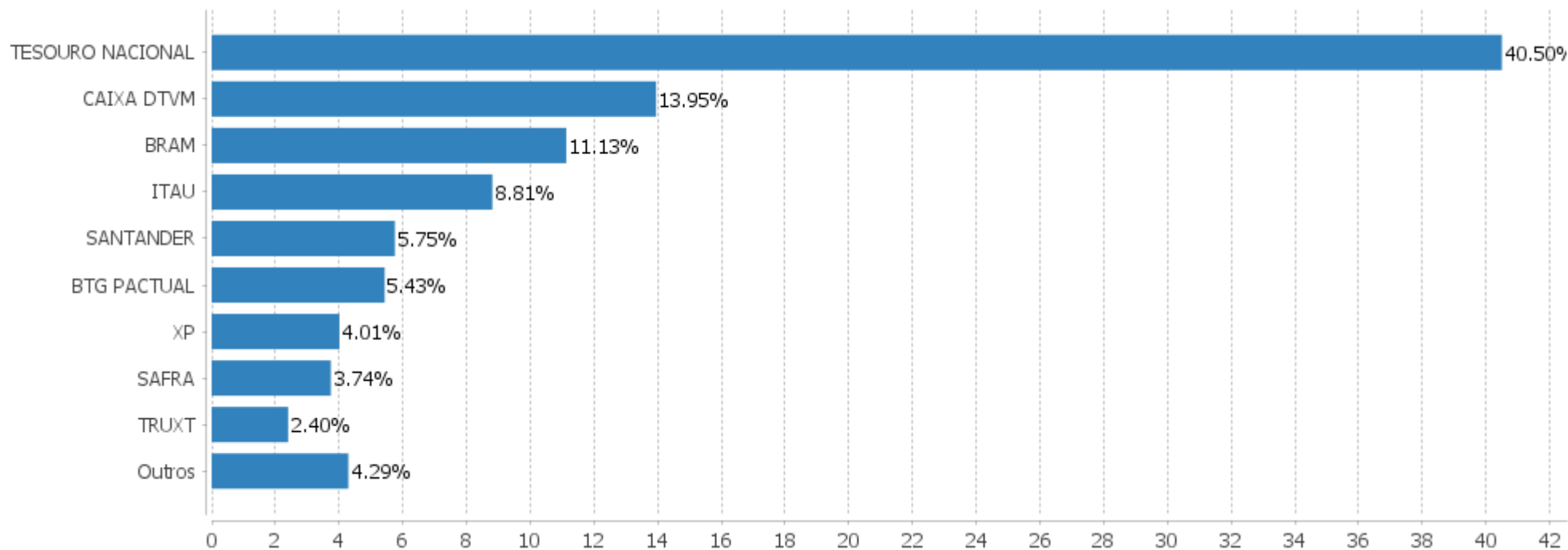


Alocação Por Estratégia



## 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	1,84			4,78
INPC + 4,94%	1,08	1,37	2,14	1,41	0,87	1,03	-0,20	0,13	0,08	0,86			9,08
p.p. indexador	-1,58	-1,39	-0,36	-1,93	-0,11	-1,88	1,72	0,75	-0,25	0,99			-4,31
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

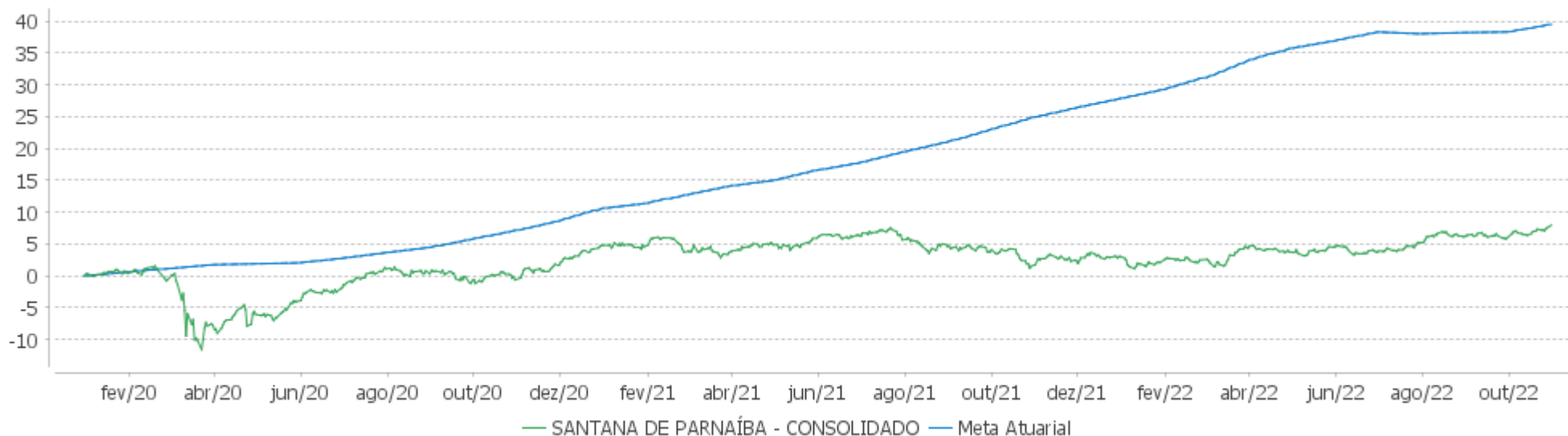
**Performance Sobre a Meta Atuarial**

**Relatório**

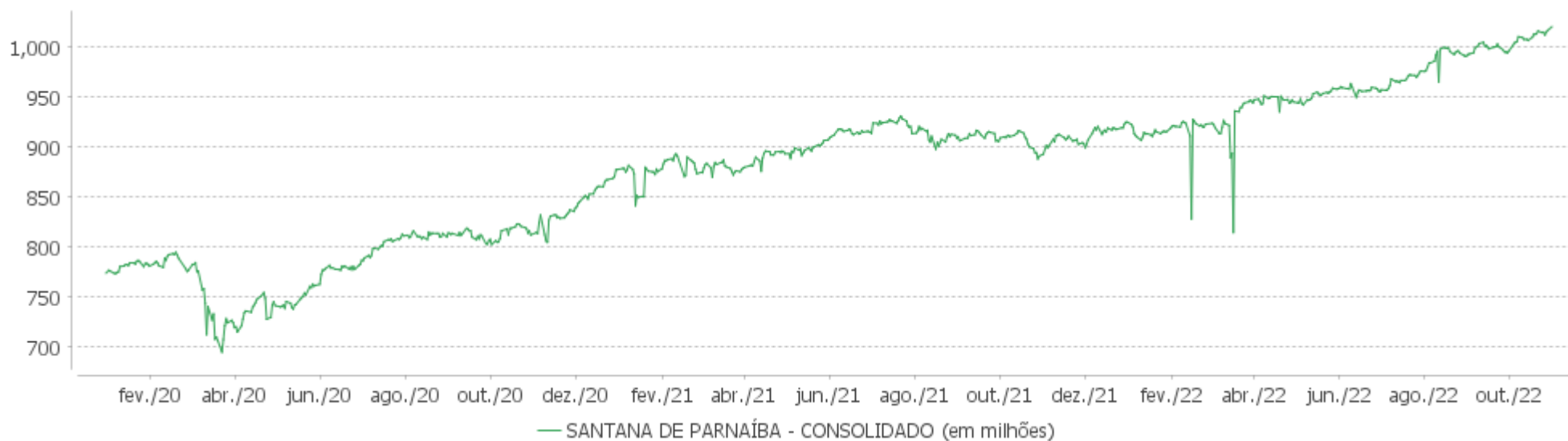
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	10	29,41	03 meses	2,57	1,07	1,50	3,28
Meses abaixo - Meta Atuarial	24	70,59	06 meses	4,03	2,79	1,24	3,23
			12 meses	6,35	11,81	-5,46	3,80
			24 meses	8,64	30,98	-22,33	4,20
Maior rentabilidade da Carteira	3,11	2020-12	Desde 31/12/2019	7,95	41,37	-33,42	7,23
Menor rentabilidade da Carteira	-7,26	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



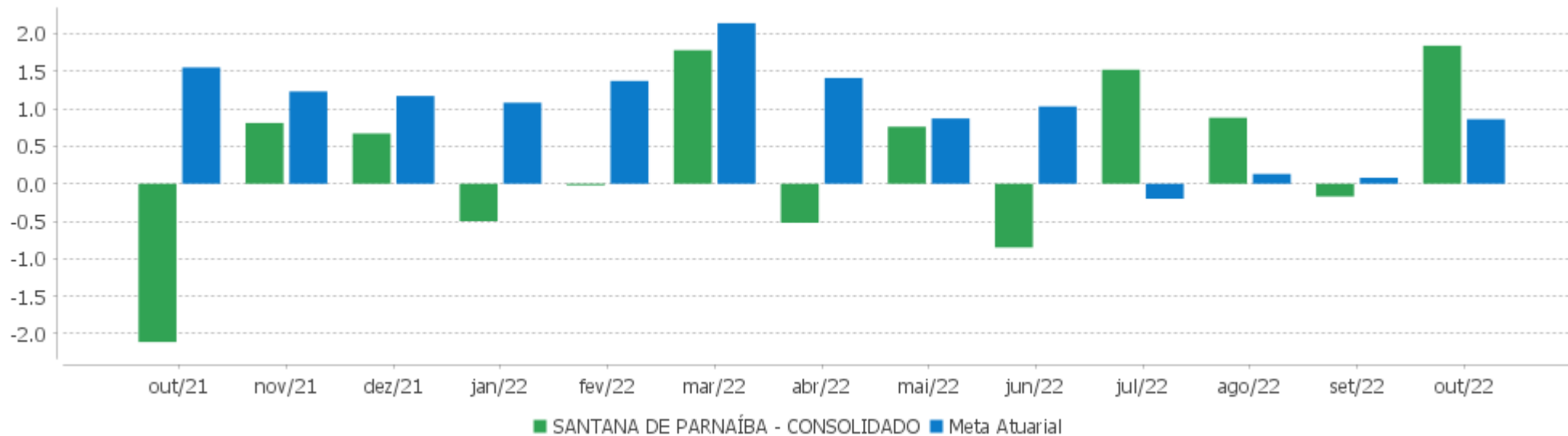
Patrimônio Líquido





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.	0,20 -0,39	2,33 2,73	0,71 0,78				
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a Var. IPCA + 6,25% p.p.	0,53 -0,55	6,64 0,51	0,66 -0,83	3,82 0,29			
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a Var. IPCA + 6,25% p.p.	0,52 -0,55	6,62 0,58	0,66 -0,83	3,84 0,31			
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a Var. IPCA p.p.	0,49 -0,10	4,26 3,53	0,59 0,66	3,83 3,44			
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a Var. IPCA p.p.	0,48 -0,11	4,40 3,68	0,60 0,66	3,83 3,44			
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a Var. IPCA p.p.	0,23 -0,36	1,53 1,95	0,88 0,95				
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a Var. IPCA p.p.	0,58 -0,01	8,28 4,74	0,11 0,17	3,55 3,15			
NTN-B 150850 (5,761000%) Var. IPCA p.p.	0,54 -0,05	6,69 1,99	0,64 0,70	3,61 3,21	9,89 3,42	21,17 3,34	25,36 2,91
NTN-B 150840 (5,620000%) Var. IPCA p.p.	0,53 -0,06	9,60 4,90	0,59 0,65	3,52 3,13	12,86 6,39	24,35 6,51	28,55 6,10
NTN-B 150535 (5,600000%) Var. IPCA p.p.	0,53 -0,06	9,58 4,88	0,59 0,65	3,51 3,12	9,72 3,25	20,82 2,99	24,85 2,40
NTN-B 150850 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	0,55 -0,04	6,72 2,02	0,65 0,71	3,64 3,25	9,94 3,47	21,24 3,41	25,46 3,01
NTN-B 150545 (5,890000%) Var. IPCA p.p.	0,55 -0,04	9,83 5,13	0,66 0,72	3,66 3,26	9,95 3,48	21,26 3,42	25,47 3,02
NTN-B 150830 (5,530000%) Var. IPCA p.p.	0,53 -0,06	9,52 4,82	0,57 0,63	3,48 3,08	12,76 6,29	24,06 6,23	28,08 5,63
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,27 0,04	6,94 -0,49	4,09 0,23	3,66 0,10	10,28 -1,12	9,72 -3,72	9,12 -3,18
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,88 -0,04	9,05 -0,08	2,36 0,01	3,51 0,00	12,60 -0,14	17,31 -0,41	23,62 -0,83
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,89 -0,02	8,94 -0,19	2,30 -0,05	3,40 -0,11	12,50 -0,23	17,23 -0,49	23,70 -0,75
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,88	9,36	3,05	5,73	12,11	14,66	18,40

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,29	4,65	3,11	5,33	5,64	-3,17	-4,05
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,89 86,82	8,56 85,62	2,87 87,00	5,64 86,58	9,77 84,97	12,33 81,11	14,97 79,19
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	0,72 70,12	29,91 299,06	1,31 39,80	1,01 15,52	30,91 269,00	25,44 167,38	3.041,81 16.085,63
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,07 105,22	10,52 105,23	3,44 104,29	6,84 105,03	12,13 105,57	16,28 107,15	19,29 102,00
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,95 93,10	9,10 91,00	3,06 92,71	6,00 92,25	10,39 90,38	12,85 84,54	15,18 80,28
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,96 0,37	9,68 4,97	3,86 3,93	5,92 5,53	11,28 4,81	12,31 -5,53	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,78 2,33	6,99 -3,71	13,61 1,13	9,35 1,78	-0,87 -12,98	-16,53 -40,04	-15,40 -23,63
BRADERCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	5,78 0,33	14,43 3,73	13,32 0,85	10,57 3,00	14,43 2,32	10,06 -13,44	-4,06 -12,28
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,79 -0,66	4,53 -6,17	16,22 3,74	4,56 -3,01	0,24 -11,87	-4,38 -27,88	0,60 -7,62
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,89 3,44	-5,47 -16,17	18,28 5,80	6,93 -0,64	-7,73 -19,84	-14,00 -37,50	-10,45 -18,68
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	10,60 5,14	12,92 2,22	16,65 4,17	14,07 6,51	12,37 0,26	23,30 -0,21	8,29 0,06
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	11,27 5,81	16,79 6,10	16,70 4,23	15,02 7,45	10,76 -1,35	17,13 -6,37	27,58 19,36
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	4,27 1,24	-34,69 -7,87	-11,68 -4,84	-16,01 -11,88	-36,20 -9,50	-14,35 -11,28	
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	3,61 353,22	-28,99 -289,87	-5,17 -157,01	-4,14 -63,66	-29,80 -259,33	-7,93 -52,21	49,11 259,71
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-3,42 -6,45	-29,31 -2,49	-13,80 -6,96	-17,40 -13,27	-29,52 -2,82	-19,81 -16,74	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,68 -2,74	-47,14 -57,02	-10,60 -12,03	-14,70 -18,11	-49,97 -62,83	-41,16 -73,50	
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	8,84 3,85	-8,93 14,54	0,15 5,17	2,79 2,64	-4,35 17,33	39,24 31,39	
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO Var. INPC + 4,94% p.p.	1,84 0,99	4,78 -4,31	2,57 1,50	4,03 1,24	6,35 -5,37	8,64 -21,53	
CDI	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	5,45	10,70	12,48	7,57	12,11	23,51	8,22
INPC + 6,00%	0,94	10,00	1,33	3,32	12,85	32,81	47,43
IPCA + 6,00%	1,06	9,89	1,43	3,41	12,86	32,34	45,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

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

**Renda Variável**

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,59	4,70	-0,06	0,39	6,47	17,83	22,45	25,55	31,28
INPC	0,47	4,81	-0,16	0,30	6,46	18,26	23,90	27,06	32,15
IGPM	-0,97	5,58	-2,59	-1,31	6,52	29,66	56,80	61,74	79,20
SELIC	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91	26,30	34,58

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	5,00	-23,47	-5,01	0,15	-21,68	7,85	67,36	101,91	141,21
MSCI ACWI	3,03	-26,82	-6,84	-4,13	-26,70	-3,07	44,06	71,11	89,42

**Meta Atuarial**

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



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
833	03/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	5.337,84	2.551,17680800	2,0923048600
844	03/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	89,48	0,00	42,76623400	2,0923048600
834	06/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	73.808,48	35.229,58131200	2,0950711661
845	06/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	80.728,93	38.532,78626400	2,0950711803
835	07/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	295,22	0,00	140,84937700	2,0959979000
846	07/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	7.847.479,06	0,00	3.744.030,02025900	2,0959979000
836	10/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	25.000,00	11.922,23464400	2,0969223259
837	13/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	462.044,09	0,00	220.149,60873600	2,0987731600
847	13/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	505.448,89	240.830,64462300	2,0987731600
829	14/10/2022	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	5.867.006,64	0,00	414.186,88500000	14,1651193000
838	14/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	12.534,70	5.969,75702300	2,0997001800
848	14/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	5.812.561,37	2.768.281,59716800	2,0997001800
839	20/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	15.508,25	7.372,87885200	2,1034185400
849	20/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	17.156,60	8.156,53165200	2,1034185400
840	25/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	55,00	26,11290900	2,1062087300
841	26/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	65.136,16	30.912,12105300	2,1071397900
830	26/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	141.636,03	0,00	59.543,72420100	2,3786894740
850	26/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.295.822,00	614.967,26663800	2,1071397900
842	27/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	4.681,15	2.220,58923700	2,1080666000
831	27/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	132.195,68	55.549,09630300	2,3797989310
851	27/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	15.633,84	7.416,19831500	2,1080666000
843	28/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	3.500,00	1.659,56411100	2,1089875300
832	28/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.440,35	3.965,00899300	2,3809151550
852	28/10/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	181.955,56	86.276,26107900	2,1089875300
<b>Total</b>			<b>14.318.550,52</b>	<b>8.256.504,80</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 15.817.966,60

Value-At-Risk: 1,55%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO		1,55	1,55			1.020.527.802,74	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%)		0,18	-0,00	0,19			79.302.291,58	7,77
NTN-B 150545 (5,890000%)		0,18	-0,00	0,19			110.094.948,90	10,79
NTN-B 150830 (5,530000%)		0,18	-0,00	0,19			48.692.025,44	4,77
NTN-B 150840 (5,620000%)		0,18	-0,00	0,19			91.445.806,66	8,96
NTN-B 150850 (5,761000%)		0,18	-0,00	0,19			41.917.892,20	4,11
NTN-B 150850 (5,860000%)		0,18	-0,00	0,19			41.814.685,53	4,10
<b>Sub-total</b>	0,32	0,18	-0,01		-1,50	0,54	413.267.650,31	40,50

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		1,16	0,06	0,03			95.645.132,49	9,37
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,16	0,02	0,01			39.745.922,39	3,89
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,01	0,00	0,00			3.306.566,75	0,32
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,49	0,05	1,50			68.766.535,17	6,74
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF		2,76	0,03	0,43			24.067.031,14	2,36
<b>Sub-total</b>	1,74	1,28	0,17		0,28	1,51	231.531.187,94	22,69

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
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	0,00	0,01			5.363.093,83	0,53

## 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
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,01	0,00	0,01			94.808.185,36	9,29
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		1,15	0,02	1,17			43.376.656,25	4,25
<b>Sub-total</b>	0,40	0,35	0,02		0,03	1,03	143.547.935,44	14,07

## 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		0,27	-0,00	0,32			5.167.730,37	0,51
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a		0,18	-0,00	0,21			10.083.915,90	0,99
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a		0,18	-0,00	0,21			10.075.173,54	0,99
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a		0,20	-0,00	0,23			8.236.681,92	0,81
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a		0,20	-0,00	0,23			8.247.946,65	0,81
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a		0,20	0,00	0,25			14.292.831,62	1,40
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a		0,25	-0,00	0,31			2.936.168,17	0,29
<b>Sub-total</b>	0,43	0,18	-0,00		-1,25	0,48	59.040.448,17	5,79

## 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		0,07	0,00	0,07			40.925,12	0,00
<b>Sub-total</b>	2,53	0,07	0,00		-0,12	0,72	40.925,12	0,00

## Renda Variável

Value-At-Risk: 10,09%

## 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		10,92	0,32	5,83			32.781.968,18	3,21
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		9,20	0,17	4,93			21.103.987,70	2,07
BRADESCO F I A SELECTION		11,19	0,17	2,91			18.804.892,65	1,84
INDIE FIC FIA		11,24	0,18	5,51			18.171.299,90	1,78
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		12,88	0,03	6,54			2.870.439,13	0,28

**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
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		9,64	0,20	4,81			24.484.899,17	2,40
<b>Sub-total</b>	28,87	10,09	1,08		0,27	8,75	118.217.486,73	11,58

**Investimentos no Exterior**

Value-At-Risk: 11,85%

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		9,00	0,02	9,95			2.628.232,91	0,26
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		14,70	0,12	10,55			11.815.324,23	1,16
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		20,55	0,06	20,56			13.086.430,99	1,28
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		10,26	0,02	10,26			18.983.884,62	1,86
<b>Sub-total</b>	30,46	11,85	0,22		0,03	1,81	46.513.872,75	4,56

**Investimentos Estruturados**

Value-At-Risk: 12,78%

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		12,78	0,07	8,10			8.368.296,28	0,82
<b>Sub-total</b>	27,76	12,78	0,07		0,28	8,84	8.368.296,28	0,82