



LDB
EMPRESAS

SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO
4º 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 30.12.2022.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 84,03%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,600000%)	0,62	0,04	0,84	2,46	78.582.896,55	7,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,890000%)	0,62	0,04	0,87	2,53	109.084.089,64	10,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,530000%)	0,62	0,04	0,84	2,44	49.620.851,02	4,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,620000%)	0,62	0,04	0,84	2,46	93.203.418,62	8,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,761000%)	2,89	0,05	0,86	2,50	42.732.981,26	4,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,860000%)	2,92	0,04	0,86	2,52	42.634.490,78	4,10
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,65	0,04	0,85	2,49	415.858.727,87	39,96

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,60	0,04	0,92	2,46	96.190.409,31	9,24	7.960.289.495,76	1,21
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,61	0,04	0,92	2,48	39.975.680,70	3,84	827.149.677,31	4,83
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,08	0,04	0,96	2,76	1.375.572,91	0,13	918.894.770,10	0,15
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,08	0,05	-0,37	-0,53	67.806.290,76	6,51	2.189.575.950,42	3,10
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	5,41	0,04	-0,08	0,41	20.618.886,97	1,98	431.891.104,87	4,77
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,74	0,04	0,47	1,44	225.966.840,65	21,71		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,08	0,05	1,03	2,95	20.568.493,06	1,98	3.841.990.026,28	0,54
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,05	1,17	3,34	96.930.008,54	9,31	7.627.582.136,16	1,27
BB	BB	BB INSTITUCIONAL FI RF	0,11	0,05	1,13	1,62	11.210.346,24	1,08	2.433.411.615,94	0,46
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,03	0,05	1,20	1,97	43.810.268,66	4,21	759.362.625,02	5,77
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,67	0,05	1,16	2,89	172.519.116,50	16,58		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
XP	XP	LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a. a	1,72	0,18	1,05	1,96	5.258.682,07	0,51		
BRADESCO	BRADESCO	LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a	0,72	0,03	0,88	2,54	10.286.227,40	0,99		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S. A. 6,25% a.a	0,77	0,06	0,91	2,55	10.278.217,62	0,99		
XP	XP	LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a. a	0,75	0,07	0,91	2,52	8.403.131,14	0,81		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a. a	0,87	0,06	0,92	2,54	8.416.836,16	0,81		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	1,35	0,04	0,90	2,62	14.582.217,38	1,40		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	2,30	0,18	1,10	2,07	2.990.078,04	0,29		
Sub-total Artigo 7º IV			0,89	0,07	0,93	2,48	60.215.389,81	5,79		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	25,35	0,30	0,30	1,16	41.105,95	0,00	56.027.774,26	0,07
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			25,35	0,30	0,30	1,16	41.105,95	0,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

1,18

0,05

0,80

2,26

874.601.180,78

84,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

10,23%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	23,56	-0,00	-3,06	-3,97	29.208.286,12	2,81	1.373.628.350,10	2,13
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	20,59	-0,01	1,80	3,00	19.654.171,56	1,89	1.879.797.625,43	1,05
BRAM	BEM	BRDESCO F I A SELECTION	21,43	-0,00	-2,58	-0,93	17.611.476,57	1,69	465.783.812,97	3,78
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	27,49	-0,01	-4,35	-4,96	15.859.531,29	1,52	476.369.536,44	3,33
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	28,36	-0,01	-2,14	-7,43	2.535.726,34	0,24	205.166.844,97	1,24
TRUXT	INTRAG	TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	24,03	-0,01	-2,89	-1,92	21.582.599,25	2,07	922.729.640,47	2,34
Sub-total Artigo 8º I			22,67	-0,01	-2,26	-2,07	106.451.791,13	10,23		
Renda Variável			22,67	-0,01	-2,26	-2,07	106.451.791,13	10,23		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,62%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
XP	BNP PARIBAS	ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	21,94	-0,96	-2,81	9,63	2.983.408,48	0,29	58.710.729,94	5,08
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	33,12	-0,37	-5,45	2,49	11.614.001,72	1,12	209.850.376,32	5,53
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	40,20	-0,57	-3,21	1,80	13.550.297,56	1,30	538.528.356,62	2,52
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	22,11	-0,14	-2,14	8,62	19.903.190,88	1,91	996.043.275,47	2,00
Sub-total Artigo 9º II			25,23	-0,37	-3,30	5,18	48.050.898,64	4,62		
Investimentos no Exterior			25,23	-0,37	-3,30	5,18	48.050.898,64	4,62		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,12%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
SAFRA	SAFRA	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	1,14	0,05	1,05	1,42	3.226.514,10	0,31	1.140.100.976,41	0,28
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	24,01	0,05	-4,87	9,97	8.454.663,84	0,81	435.575.393,61	1,94
Sub-total Artigo 10º I			20,69	0,05	-4,13	10,38	11.681.177,94	1,12		
Investimentos Estruturados			20,69	0,05	-4,13	10,38	11.681.177,94	1,12		
Total			3,52	0,02	0,23	1,99	1.040.785.048,49	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	415.858.727,87	39,96	0,00	11,50	100,00	50,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	225.966.840,65	21,71	50,00	56,00	100,00	8,48	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	172.519.116,50	16,58	0,00	11,00	60,00	14,99	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	60.215.389,81	5,79	0,00	0,00	20,00	6,03	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	41.105,95	0,00	0,00	0,50	5,00	0,01	5,00
	Total Renda Fixa	874.601.180,78	84,03					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	106.451.791,13	10,23	3,00	5,00	20,00	0,49	30,00
	Total Renda Variável	106.451.791,13	10,23					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	48.050.898,64	4,62	0,00	9,00	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	48.050.898,64	4,62					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	11.681.177,94	1,12	1,00	5,00	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	11.681.177,94	1,12					15,00
Total		1.040.785.048,49	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,85 75,78	2,49 77,78	2,49 77,78	3,05 46,05		3.510.247,07	10.152.736,79
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,47 41,61	1,44 45,12	1,44 45,12	2,86 43,25	8,14 65,79	987.520,92	3.120.015,22
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,16 103,02	2,89 90,34	2,89 90,34	6,44 97,43	12,23 98,84	1.884.700,66	4.350.774,98
Artigo 7º IV % do CDI	0,93 82,43	2,48 77,68	2,48 77,68	3,41 51,58		552.446,15	1.459.588,29
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,30 26,92	1,16 36,29	1,16 36,29	1,65 24,93	30,49 246,39	123,92	471,66
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,64 5,19	0,00	0,00
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-2,26 0,19	-2,07 -1,80	-2,07 -1,80	10,63 -0,73	-2,07 -6,75	-2.460.824,18	-2.253.301,91
Artigo 9º II % do CDI	-3,30 -293,88	5,18 161,83	5,18 161,83	2,07 31,30	-34,47 -278,61	-1.640.421,35	2.364.545,63
Artigo 10º I % do CDI	-4,13 -367,69	10,38 324,60	10,38 324,60	11,94 180,47	-0,37 -2,96	-410.283,16	792.804,61
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO (Total)						2.423.510,03	19.987.635,27

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150535 (5,600000%)	77.927.047,13	0,00	0,00	0,00	78.582.896,55	655.849,42	1.911.045,66
NTN-B 150545 (5,890000%)	108.147.654,21	0,00	0,00	0,00	109.084.089,64	936.435,43	2.726.356,49
NTN-B 150830 (5,530000%)	49.209.560,44	0,00	0,00	0,00	49.620.851,02	411.290,58	1.183.355,79
NTN-B 150840 (5,620000%)	92.423.960,22	0,00	0,00	0,00	93.203.418,62	779.458,40	2.241.807,87
NTN-B 150850 (5,761000%)	42.370.681,01	0,00	0,00	0,00	42.732.981,26	362.300,25	1.041.454,03
NTN-B 150850 (5,860000%)	42.269.577,79	0,00	0,00	0,00	42.634.490,78	364.912,99	1.048.716,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
					415.858.727,87	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	3.574.975,61	16.062.434,38	-18.305.407,58	0,00	1.375.572,91	43.570,50	152.541,77
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	95.311.584,12	0,00	0,00	0,00	96.190.409,31	878.825,19	2.305.987,65
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	68.057.958,95	0,00	0,00	0,00	67.806.290,76	-251.668,19	-360.767,47
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	22.668.043,57	0,00	-2.000.000,00	0,00	20.618.886,97	-49.156,60	53.675,61
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	39.609.730,68	0,00	0,00	0,00	39.975.680,70	365.950,02	968.577,66
					225.966.840,65	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 INSTITUCIONAL FI RF	11.084.589,64	0,00	0,00	0,00	11.210.346,24	125.756,60	178.304,56
BB PREV RF FLUXO FIC	5.413.238,99	15.182.317,72	-150.256,88	0,00	20.568.493,06	123.193,23	223.893,82
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	95.812.962,71	0,00	0,00	0,00	96.930.008,54	1.117.045,83	3.101.379,01
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	43.291.563,66	0,00	0,00	0,00	43.810.268,66	518.705,00	847.197,59
					172.519.116,50	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	10.196.203,49	0,00	0,00	0,00	10.286.227,40	90.023,91	255.247,05
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	8.326.992,63	0,00	0,00	0,00	8.403.131,14	76.138,51	206.838,86
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a	5.203.974,48	0,00	0,00	0,00	5.258.682,07	54.707,59	101.093,93
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a	10.185.622,66	0,00	0,00	0,00	10.278.217,62	92.594,96	255.607,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	14.452.641,61	0,00	0,00	0,00	14.582.217,38	129.575,77	371.879,81
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	8.339.997,00	0,00	0,00	0,00	8.416.836,16	76.839,16	208.191,88
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	2.957.511,79	0,00	0,00	0,00	2.990.078,04	32.566,25	60.729,19
					60.215.389,81	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	40.982,03	0,00	0,00	0,00	41.105,95	123,92	471,66
					41.105,95	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	18.077.813,64	0,00	0,00	0,00	17.611.476,57	-466.337,07	-165.097,22
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	30.131.402,94	0,00	0,00	0,00	29.208.286,12	-923.116,82	-1.206.443,23
INDIE FIC FIA	16.580.272,56	0,00	0,00	0,00	15.859.531,29	-720.741,27	-827.795,65
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19.306.866,71	0,00	0,00	0,00	19.654.171,56	347.304,85	572.387,26
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	2.591.174,01	0,00	0,00	0,00	2.535.726,34	-55.447,67	-203.508,64
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	22.225.085,45	0,00	0,00	0,00	21.582.599,25	-642.486,20	-422.844,43
					106.451.791,13	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	3.069.681,50	0,00	0,00	0,00	2.983.408,48	-86.273,02	262.102,00
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	12.283.035,85	0,00	0,00	0,00	11.614.001,72	-669.034,13	282.456,43
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	13.999.240,29	0,00	0,00	0,00	13.550.297,56	-448.942,73	240.077,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20.339.362,35	0,00	0,00	0,00	19.903.190,88	-436.171,47	1.579.909,88
					48.050.898,64	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	8.887.065,59	0,00	0,00	0,00	8.454.663,84	-432.401,75	766.290,51
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	1.204.395,51	2.000.000,00	0,00	0,00	3.226.514,10	22.118,59	26.514,10
					11.681.177,94	0,00	0,00

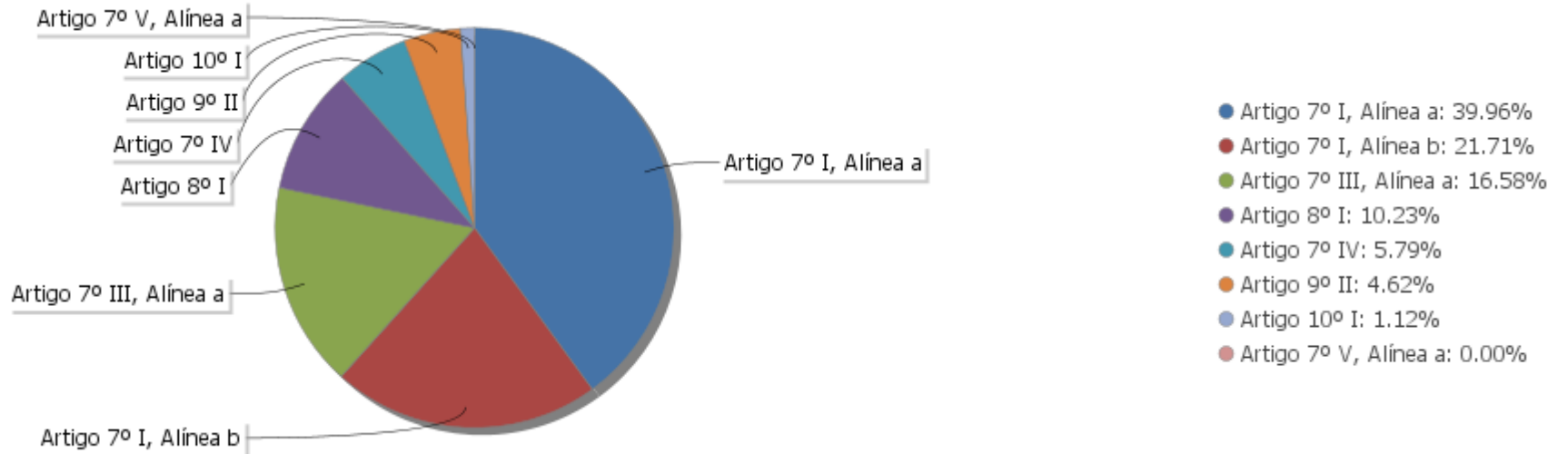
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

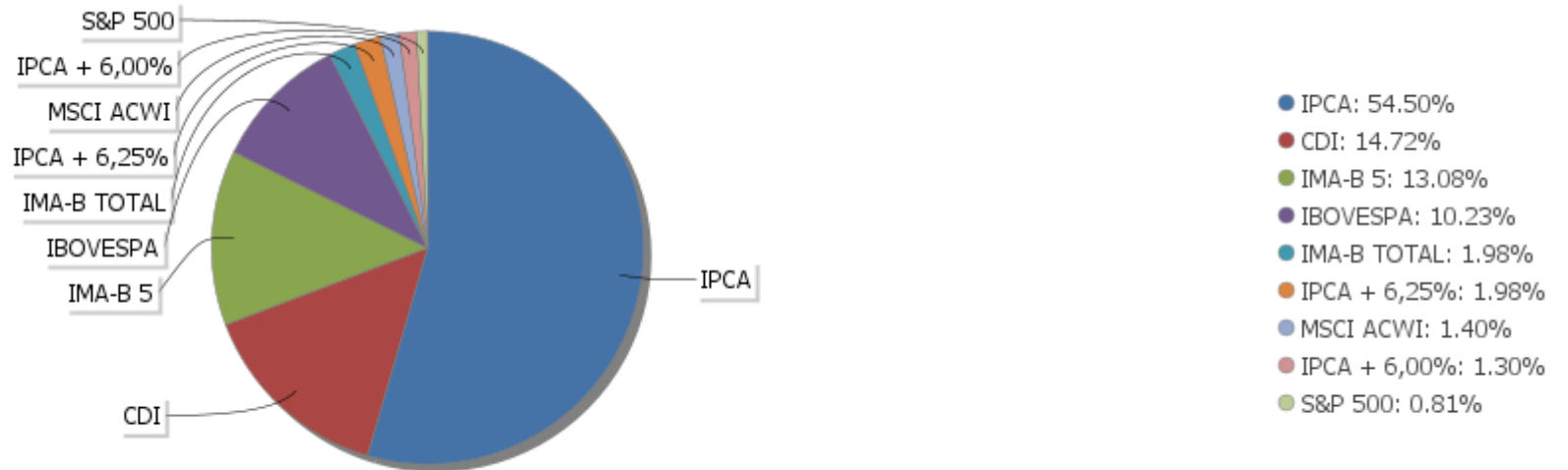
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	475.870.616,25	45,72	475.870.616,25	45,72
de 31 a 365 dias	88.840.314,56	8,54	564.710.930,81	54,26
acima de 365 dias	476.074.117,68	45,74	1.040.785.048,49	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

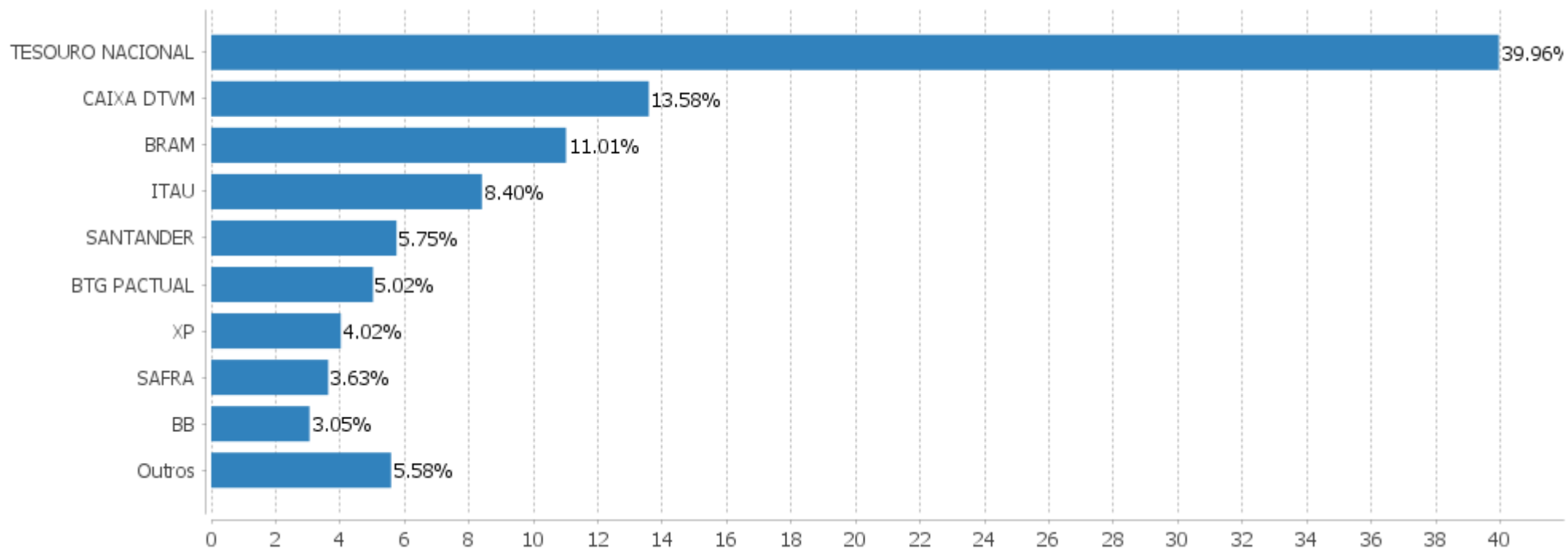


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2022	-0,50	-0,02	1,78	-0,52	0,76	-0,85	1,52	0,88	-0,17	1,84	-0,08	0,23	4,93
INPC + 4,94%	1,08	1,37	2,14	1,41	0,87	1,03	-0,20	0,13	0,08	0,86	0,76	1,11	11,14
p.p. indexador	-1,58	-1,39	-0,36	-1,93	-0,11	-1,88	1,72	0,75	-0,25	0,99	-0,85	-0,89	-6,21
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

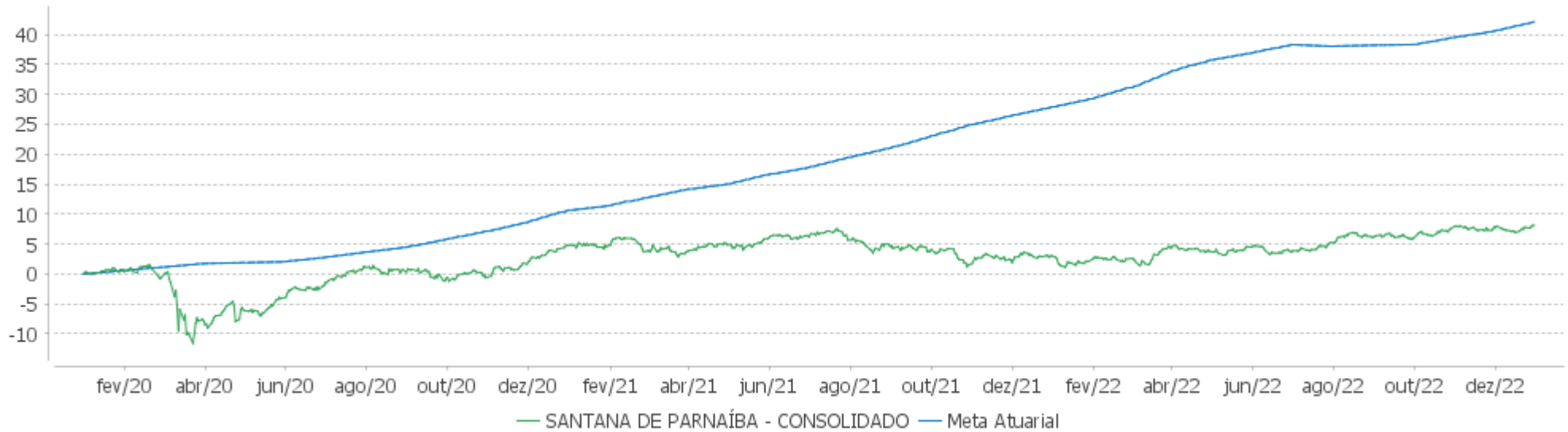
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

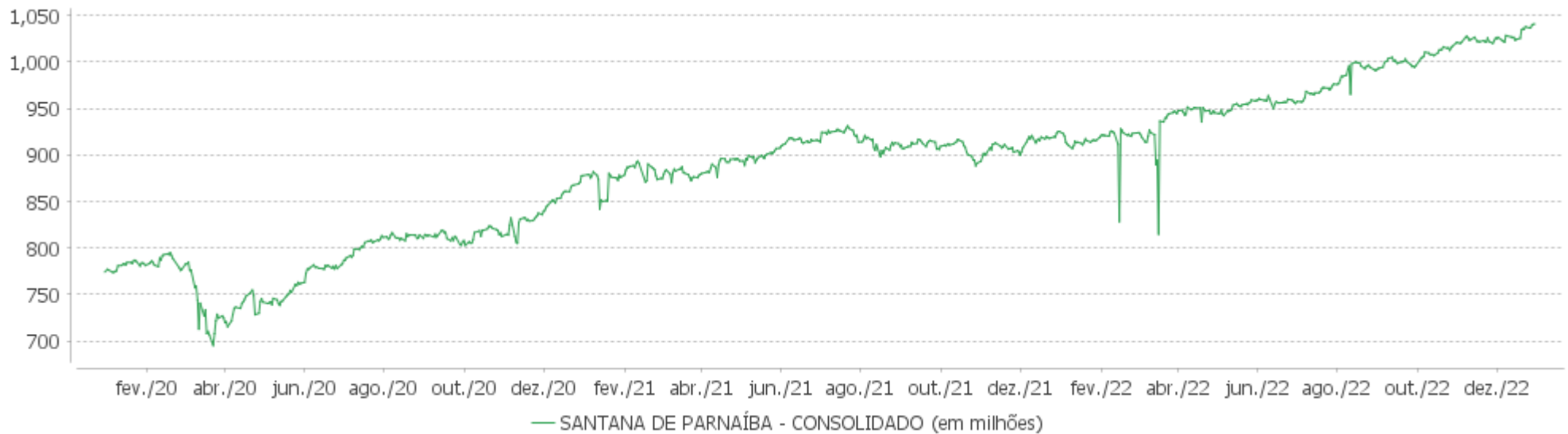
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	10	27,78	03 meses	1,99	2,76	-0,77	3,14
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	72,22	06 meses	4,28	2,77	1,51	3,06
			12 meses	4,93	11,14	-6,21	3,52
			24 meses	3,16	29,06	-25,90	4,11
			36 meses	8,11	44,04	-35,93	7,05
Maior rentabilidade da Carteira	3,11	2020-12	Desde 31/12/2019	8,11	44,04	-35,93	7,05
Menor rentabilidade da Carteira	-7,26	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

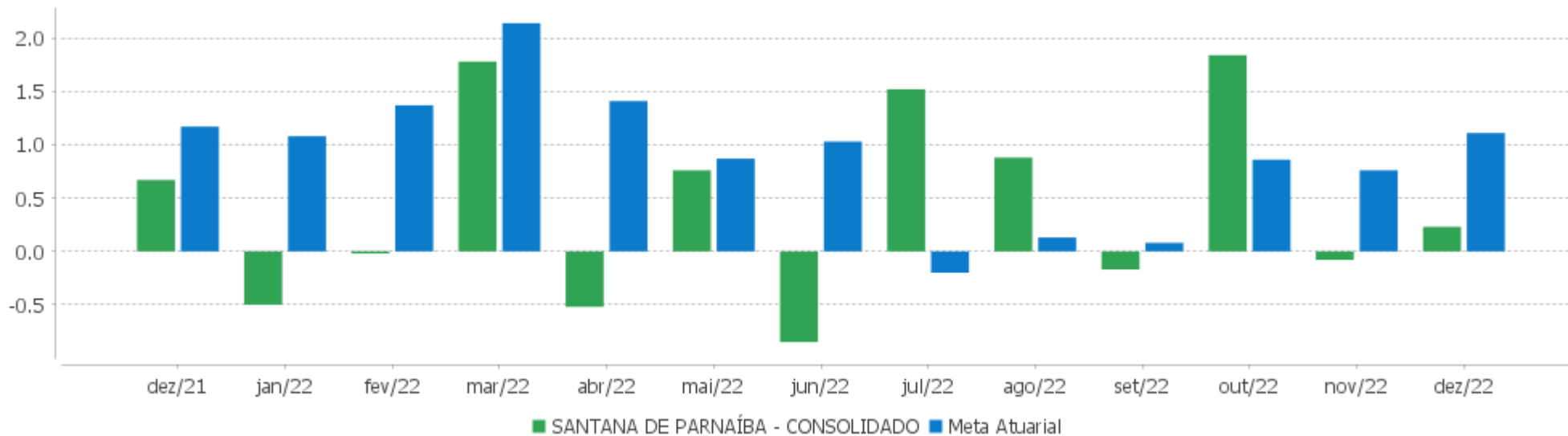


Patrimônio Líquido



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.	1,05 0,43	1,96 0,33	1,96 0,33	3,59 3,31			
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a Var. IPCA + 6,25% p.p.	0,88 -0,27	2,54 -0,61	2,54 -0,61	3,30 -0,10			
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a Var. IPCA + 6,25% p.p.	0,91 -0,24	2,55 -0,61	2,55 -0,61	3,33 -0,07			
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a Var. IPCA p.p.	0,91 0,29	2,52 0,89	2,52 0,89	3,31 3,03			
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a Var. IPCA p.p.	0,92 0,30	2,54 0,91	2,54 0,91	3,40 3,12			
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a Var. IPCA p.p.	1,10 0,48	2,07 0,44	2,07 0,44				
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a Var. IPCA p.p.	0,90 0,28	2,62 0,99	2,62 0,99	3,44 3,16			
NTN-B 150850 (5,761000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,24	2,50 0,87	2,50 0,87	3,08 2,80	8,77 2,98	20,01 3,59	25,27 3,58
NTN-B 150840 (5,620000%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,22	2,46 0,84	2,46 0,84	3,00 2,72	11,71 5,92	23,16 6,73	28,45 6,77
NTN-B 150535 (5,600000%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,22	2,46 0,83	2,46 0,83	2,99 2,71	11,69 5,90	23,07 6,64	28,29 6,61
NTN-B 150850 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,24	2,52 0,89	2,52 0,89	3,12 2,84	8,81 3,03	20,09 3,66	25,36 3,68
NTN-B 150545 (5,890000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,25	2,53 0,90	2,53 0,90	3,13 2,85	11,99 6,21	23,59 7,16	29,02 7,33
NTN-B 150830 (5,530000%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,22	2,44 0,81	2,44 0,81	2,96 2,67	11,61 5,83	22,88 6,45	27,99 6,30
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,08 0,12	0,41 0,17	0,41 0,17	2,20 0,26	6,03 -0,34	0,87 -4,15	8,53 -3,22
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,92 -0,02	2,48 -0,05	2,48 -0,05	2,88 -0,10	9,57 -0,22	14,33 -0,46	23,29 -0,74
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,92 -0,02	2,46 -0,07	2,46 -0,07	2,96 -0,01	9,67 -0,11	14,40 -0,40	23,26 -0,76
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	-0,37	-0,53	-0,53	2,43	7,83	12,71	15,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	-0,99	-2,16	-2,16	2,14	2,04	-3,71	-5,75
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,96 85,76	2,76 86,23	2,76 86,23	5,72 86,52	10,58 85,49	14,21 82,10	16,39 79,70
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	0,30 26,92	1,16 36,29	1,16 36,29	1,65 24,93	30,49 246,39	25,96 149,98	1.817,48 8.840,40
BB INSTITUCIONAL FI RF % do CDI	1,13 101,00	3,24 101,32	3,24 101,32	6,78 102,50	12,71 102,69	18,19 105,05	21,07 102,46
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,17 103,79	3,34 104,31	3,34 104,31	6,89 104,19	13,00 105,05	18,58 107,34	21,11 102,67
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	1,03 92,01	2,95 92,16	2,95 92,16	6,09 92,12	11,26 91,00	14,89 86,04	16,78 81,63
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	1,20 0,58	1,97 0,34	1,97 0,34	5,55 5,27	10,77 4,99	11,55 -4,88	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,06 -0,62	-3,97 -3,69	-3,97 -3,69	9,84 -1,52	-4,67 -9,36	-34,98 -27,18	-29,85 -24,74
BRADERCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-2,58 -0,13	-0,93 -0,65	-0,93 -0,65	12,81 1,46	7,16 2,48	-11,71 -3,91	-14,95 -9,84
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,14 0,31	-7,43 -7,15	-7,43 -7,15	7,45 -3,90	-7,66 -12,35	-28,75 -20,95	-18,91 -13,80
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,35 -1,90	-4,96 -4,69	-4,96 -4,69	7,55 -3,81	-17,50 -22,18	-36,83 -29,03	-32,12 -27,01
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	1,80 4,24	3,00 3,27	3,00 3,27	15,16 3,80	5,16 0,48	-3,78 4,02	-8,47 -3,36
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,89 -0,44	-1,92 -1,65	-1,92 -1,65	8,73 -2,63	2,95 -1,74	-13,22 -5,42	1,22 6,33
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-5,45 -0,01	2,49 -3,08	2,49 -3,08	-4,44 -5,49	-35,80 -10,79	-26,35 -20,41	5,15 -33,49
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	-2,14 -190,91	8,62 269,61	8,62 269,61	6,16 93,07	-25,55 -206,53	-7,94 -45,89	48,52 236,02
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-2,81 2,62	9,63 4,05	9,63 4,05	-2,88 -3,93	-19,75 5,26	-22,27 -16,32	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-3,21 -4,34	1,80 -1,29	1,80 -1,29	3,43 0,16	-45,26 -57,37	-41,29 -72,05	12,31 -32,52
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO % do CDI	1,05 93,88	2,73 85,50	2,73 85,50	6,51 98,41	14,01 113,24	16,99 98,15	20,59 100,15
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	-4,87	9,97	9,97	11,52	-7,99	23,07	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. S&P 500 p.p.	2,39	6,63	6,63	10,48	16,69	20,43	
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO	0,23	1,99	1,99	4,28	4,93	3,16	8,11
Var. INPC + 4,94% p.p.	-0,89	-0,77	-0,77	1,51	-6,21	-25,30	-34,01
CDI	1,12	3,20	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56
IBOVESPA	-2,45	-0,27	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11
INPC + 6,00%	1,20	3,01	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46
IPCA + 6,00%	1,13	3,10	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83

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 INSTITUCIONAL FI RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					EXCEDER A 100% DA VARIÇÃO DO IBOVESPA, 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 CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
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	1,18	3,16	3,16	6,70	12,02	15,30	19,73	27,82	36,73
IRF-M 1+	1,62	1,10	1,10	6,63	7,41	2,06	10,68	26,44	41,95
IRF-M TOTAL	1,48	1,74	1,74	6,49	8,82	6,66	13,80	27,49	41,17
IMA-B 5	0,94	2,53	2,53	2,98	9,78	14,79	24,02	40,34	54,18
IMA-B 5+	-1,19	-1,72	-1,72	1,24	3,30	-3,47	1,84	32,76	53,22
IMA-B TOTAL	-0,19	0,23	0,23	1,94	6,37	5,02	11,75	37,40	55,34
IMA-GERAL TOTAL	0,77	1,73	1,73	4,95	9,66	10,71	16,62	31,57	44,78
IDKA 2	1,24	2,25	2,25	2,34	9,34	14,78	24,67	39,41	53,01
IDKA 20	-3,32	-5,66	-5,66	0,71	-1,92	-16,13	-14,29	23,65	48,88
CDI	1,12	3,20	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,96

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,45	-0,27	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11	24,86	43,63
IBRX 100	-2,63	-0,39	-0,39	10,33	4,02	-7,61	-4,37	27,56	47,23
IBRX 50	-2,55	0,38	0,38	12,12	5,72	-5,43	-2,00	26,57	44,96
SMALL CAP	-3,01	-7,61	-7,61	5,76	-15,06	-28,82	-29,28	11,87	20,97
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	-1,61	3,15	3,15	7,71	12,65	5,43	4,37	51,51	75,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-7,26	3,34	3,34	1,04	-24,68	2,63	53,84	106,24	126,51

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,00	-4,14	-4,14	2,56	2,22	-0,11	-10,33	21,92	28,78

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-5,43	5,58	5,58	1,05	-25,01	-5,95	38,64	78,90	86,12

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,62	1,63	1,63	0,28	5,78	16,43	21,69	26,93	31,68
INPC	0,69	1,55	1,55	0,30	5,93	16,70	23,05	28,57	32,98
IGPM	0,45	-1,09	-1,09	-2,51	5,45	24,20	52,94	64,11	76,48
SELIC	1,12	3,20	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,97

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,97	2,61	2,61	2,28	10,00	25,89	36,82	48,44	60,11
IPCA + 5,00%	1,05	2,86	2,86	2,78	11,05	28,31	40,79	54,22	67,93
IPCA + 5,50%	1,09	2,98	2,98	3,03	11,58	29,53	42,80	57,17	71,96
IPCA + 5,89%	1,12	3,07	3,07	3,22	11,99	30,49	44,38	59,51	75,15
IPCA + 6,00%	1,13	3,10	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83	60,17	76,06
INPC + 4,00%	1,04	2,53	2,53	2,31	10,15	26,18	38,35	50,36	61,69
INPC + 6,00%	1,20	3,01	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46	62,24	77,79

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	BRADESCO 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
871	01/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	921,50	0,00	436,55564900	2,1108420000
861	04/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	693,63	328,31027600	2,1127270000
877	04/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	53.996,09	25.557,53279700	2,1127270000
872	07/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	7.894.882,80	0,00	3.735.166,29661300	2,1136630000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
878	08/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	54.689,24	25.862,79730800	2,1145910000
862	09/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	379,99	179,62022200	2,1155190000
879	09/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	683,64	323,15472900	2,1155190000
863	10/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	30.668,66	14.490,62750500	2,1164480000
873	10/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	2.292,06	0,00	1.082,97487100	2,1164480000
864	11/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	146.342,75	69.115,08092600	2,1173780000
874	11/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	16.490,01	0,00	7.787,93866700	2,1173780000
858	16/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	8.332,86	0,00	3.932,00578100	2,1192390000
875	16/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	5.335.322,03	0,00	2.517.565,04575400	2,1192390000
855	16/11/2022	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	0,00	1.200.000,00	8.688,49122000	138,1137380000
860	17/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	17.448,48	0,00	8.229,76680600	2,1201670000
859	17/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	434.964,30	0,00	205.155,67877400	2,1201670000
880	17/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	11.484.454,46	5.416.768,80238900	2,1201670000
853	17/11/2022	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	1.200.000,00	0,00	5.186,41924800	231,3735050000
854	17/11/2022	BB INSTITUCIONAL FI RF	11.032.041,68	0,00	1.038.812,35629400	10,6198598940
865	18/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	23.192,98	10.934,41657600	2,1210990000
866	21/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	72,15	34,00045900	2,1220300000
881	21/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.117,66	526,69373900	2,1220300000
882	22/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.897,73	893,90711800	2,1229610000
867	23/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	500,00	235,41675700	2,1238930000
869	25/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	55,00	25,87303100	2,1257640000
868	25/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	4.796,81	2.256,51104700	2,1257640000
870	28/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	66.677,69	31.352,74219400	2,1266940000
883	28/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.603.897,04	754.173,86724300	2,1266940000
856	29/11/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	9.440,35	0,00	3.928,25415100	2,4031922670
876	29/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	169.371,42	0,00	79.606,19773400	2,1276160000
857	30/11/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.440,35	3.926,43949600	2,4043029340
885	30/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	17.295,73	8.125,59217400	2,1285500000
884	30/11/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	181.772,27	85.397,22708200	2,1285500000
905	01/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	6.709,56	3.150,79570600	2,1294810000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
894	02/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	6.469,86	3.036,90396700	2,1304130000
906	02/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	11.405,00	5.353,42232800	2,1304130000
907	05/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	210,00	98,52928800	2,1313460000
895	07/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.063,63	498,60749300	2,1332010000
897	08/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.543,43	723,20996900	2,1341380000
896	08/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	7.787.936,86	0,00	3.649.218,96334700	2,1341380000
908	08/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	44.452,74	20.829,36393400	2,1341380000
898	09/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	419.546,77	196.502,67771300	2,1350690000
909	09/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	462.729,29	0,00	216.728,02611900	2,1350690000
886	13/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	7.517.468,61	0,00	3.113.568,61917100	2,4144220120
899	13/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	7.517.468,61	3.517.872,60266200	2,1369360000
900	14/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	74.478,88	34.837,90621100	2,1378690000
910	14/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	31.972,18	14.955,16511000	2,1378690000
889	15/12/2022	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	0,00	2.000.000,00	14.563,60895784	137,3285980000
901	15/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	921,50	0,00	430,84867100	2,1388020000
887	16/12/2022	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	2.000.000,00	0,00	8.562,74540935	233,5699480000
890	19/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1,00	0,00	0,41340600	2,4189247470
902	19/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	139.298,87	0,00	65.072,55672200	2,1406700000
911	19/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	781.902,27	365.260,53738400	2,1406700000
891	20/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	159.696,23	0,00	65.989,29010200	2,4200325500
903	20/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	7.671.492,86	0,00	3.582.126,50056900	2,1416030000
912	20/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.701.011,33	794.270,14717480	2,1416030000
892	21/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	150.255,88	62.059,78376000	2,4211473340
888	22/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	7.505.151,88	0,00	3.098.370,96240000	2,4222896390
904	22/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	7.707.118,32	3.595.640,28997100	2,1434620000
913	26/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	55,00	0,00	25,63714100	2,1453250000
914	26/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	55,00	25,63658900	2,1453250000
893	29/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1,00	0,41186100	2,4280029600
Total			73.684.810,11	43.594.793,13		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 14.154.963,27

Value-At-Risk: 1,36%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO		1,36	1,36			1.040.785.048,49	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,45%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,600000%)		0,17	-0,00	0,14			78.582.896,55	7,55
NTN-B 150545 (5,890000%)		0,17	-0,00	0,14			109.084.089,64	10,48
NTN-B 150830 (5,530000%)		0,17	-0,00	0,14			49.620.851,02	4,77
NTN-B 150840 (5,620000%)		0,17	-0,00	0,14			93.203.418,62	8,96
NTN-B 150850 (5,761000%)		0,17	-0,00	0,14			42.732.981,26	4,11
NTN-B 150850 (5,860000%)		0,17	-0,00	0,14			42.634.490,78	4,10
Sub-total	0,39	0,17	-0,01		-0,70	0,85	415.858.727,87	39,96

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,41	0,08	0,03			96.190.409,31	9,24
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,43	0,03	0,01			39.975.680,70	3,84
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,00	-0,00	0,00			1.375.572,91	0,13
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,94	0,08	1,96			67.806.290,76	6,51
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF		2,94	0,04	0,35			20.618.886,97	1,98
Sub-total	2,67	1,64	0,23		-0,25	0,47	225.966.840,65	21,71

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			20.568.493,06	1,98

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,01	-0,00	0,01			96.930.008,54	9,31
BB INSTITUCIONAL FI RF		0,03	0,00	0,03			11.210.346,24	1,08
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,82	0,02	0,83			43.810.268,66	4,21
Sub-total	0,32	0,21	0,02		0,11	1,16	172.519.116,50	16,58

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a		0,25	-0,00	0,27			5.258.682,07	0,51
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a		0,17	-0,00	0,16			10.286.227,40	0,99
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a		0,17	-0,00	0,16			10.278.217,62	0,99
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a		0,20	-0,00	0,18			8.403.131,14	0,81
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a		0,20	-0,00	0,18			8.416.836,16	0,81
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a		0,20	-0,00	0,19			14.582.217,38	1,40
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a		0,26	-0,00	0,28			2.990.078,04	0,29
Sub-total	0,40	0,16	-0,00		-0,50	0,93	60.215.389,81	5,79

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR		0,08	0,00	0,08			41.105,95	0,00
Sub-total	1,02	0,08	0,00		-0,80	0,30	41.105,95	0,00

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,45%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		10,76	0,27	5,25			29.208.286,12	2,81
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		11,11	0,18	5,23			19.654.171,56	1,89
BRADESCO F I A SELECTION		11,23	0,16	2,33			17.611.476,57	1,69
INDIE FIC FIA		13,61	0,19	6,13			15.859.531,29	1,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		12,87	0,03	4,75			2.535.726,34	0,24
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		12,79	0,23	5,90			21.582.599,25	2,07
Sub-total	21,77	11,45	1,06		-0,16	-2,26	106.451.791,13	10,23

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 11,65%

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		9,67	0,01	11,74			2.983.408,48	0,29
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		14,37	0,06	10,38			11.614.001,72	1,12
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		18,98	-0,03	18,97			13.550.297,56	1,30
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		10,37	-0,04	10,37			19.903.190,88	1,91
Sub-total	20,60	11,65	0,01		-0,21	-3,30	48.050.898,64	4,62

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 8,22%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO		0,32	-0,00	0,32			3.226.514,10	0,31
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		11,41	0,04	8,02			8.454.663,84	0,81
Sub-total	14,56	8,22	0,04		-0,36	-4,13	11.681.177,94	1,12