



LDB
EMPRESAS

OSASCO - CONSOLIDADO
2º TRIMESTRE 2022



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 30.06.2022.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 82,67%

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 150545	9,46	-1,63	-0,47	15.235.219,30	2,84
TESOURO NACIONAL	LTN 01012024 (6,030000%)	0,00	0,49	1,45	5.524.272,30	1,03
TESOURO NACIONAL	LTN 01012024 (6,100000%)	0,00	0,49	1,47	5.527.057,70	1,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,930000%)	0,53	0,93	4,08	27.556.841,13	5,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,742000%)	3,97	0,99	1,27	41.737.912,66	7,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,200000%)	2,43	0,87	3,90	27.803.064,49	5,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730001%)	4,01	0,99	4,27	43.435.748,56	8,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,740002%)	4,01	0,99	4,28	42.238.018,01	7,88
TESOURO NACIONAL	NTN-F 2029 (12,000000%)	5,24	0,95	2,83	5.403.801,40	1,01
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		1,57	0,75	3,57	214.461.935,55	40,02

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
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,42	-0,35	1,41	17.641.142,26	3,29	5.700.982.768,47	0,31
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,40	-0,39	1,35	7.803.287,86	1,46	561.265.385,95	1,39
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,59	0,27	2,54	13.165.455,04	2,46	9.717.321.383,29	0,14
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,67	0,22	2,50	23.813.945,89	4,44	11.226.926.091,22	0,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,61	0,32	2,63	7.877.871,31	1,47	6.996.220.208,06	0,11
BB	BB	BB PREV RF VII	1,69	0,31	3,03	754.477,06	0,14	258.295.551,92	0,29
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	1,69	0,31	3,03	4.323.567,82	0,81	214.696.158,62	2,01
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,19	0,23	2,22	27.813.859,14	5,19	6.957.180.815,09	0,40
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,17	1,02	2,81	11.230.337,54	2,10	3.689.784.641,04	0,30
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,49	0,18	2,03	114.423.943,92	21,35		

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
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,20	1,06	2,97	28.841.451,62	5,38	12.613.402.228,26	0,23
QUELUZ	RJI	BRA1 FI RENDA FIXA	1,72	0,26	1,84	389.335,60	0,07	7.667.528,48	5,08
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	1,03	2,90	41.367.144,36	7,72	9.838.414.136,64	0,42
VERITAS	RJI	TMJ IMA-B FI RF	32,13	-24,60	-21,23	791.176,41	0,15	47.968.395,99	1,65
GENIAL	RJI	TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	4,38	0,17	1,82	1.152.169,73	0,21	82.776.275,46	1,39
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,61	0,28	2,55	21.797.520,68	4,07	1.352.871.181,17	1,61
VERITAS	RJI	FI BARCELONA RENDA FIXA	25,85	0,27	-11,17	524.842,25	0,10	35.366.727,00	1,48
BRPP	PLANNER	FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	12,86	0,33	1,39	418.738,71	0,08	14.729.621,10	2,84
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,18	1,08	3,07	11.091.150,58	2,07	4.894.755.710,10	0,23
VERITAS	RJI	MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA	22,86	-1,77	-5,40	52.411,73	0,01	1.606.952,56	3,26
RJI	RJI	TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1,27	0,06	1,07	1.076.267,43	0,20	53.596.660,28	2,01
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,60	0,66	2,59	107.502.209,10	20,06		

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
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1,44	0,23	1,20	3.345.644,90	0,62	74.029.557,03	4,52
QUELUZ	PLANNER	ILLUMINATI FIDC	17,89	-0,53	-2,08	2.058.056,65	0,38	110.418.572,95	1,86
BRPP	RJI	INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	15,70	-0,11	-3,29	369.389,67	0,07	7.618.849,75	4,85
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			1,33	-0,07	-0,29	5.773.091,22	1,08		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
PLURAL	INTRADER	PIATÁ FI RF LONGO PRAZO	85,97	-6,94	-56,88	858.713,37	0,16	34.460.454,63	2,49
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			85,97	-6,94	-56,88	858.713,37	0,16		
Renda Fixa			3,54	0,56	2,49	443.019.893,16	82,67		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

4,04%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	18,21	-8,31	-9,45	3.457.309,80	0,65	228.591.211,08	1,51
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	22,51	-10,34	-12,54	4.484.506,20	0,84	232.455.600,75	1,93
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	24,94	-10,74	-21,02	2.594.532,77	0,48	1.325.317.998,19	0,20
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	27,24	-16,29	-24,74	3.257.232,89	0,61	616.162.344,30	0,53
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	19,85	-10,52	-10,56	2.660.445,91	0,50	433.471.840,97	0,61
SAFRA	SAFRA	SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES	25,32	-12,03	-19,34	5.200.569,51	0,97	186.337.490,13	2,79
Sub-total Artigo 8º I			20,61	-11,45	-16,65	21.654.597,08	4,04		
Renda Variável			18,50	-11,45	-16,65	21.654.597,08	4,04		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,47%

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	21,13	0,83	-10,22	6.618.706,38	1,24	2.225.410.384,30	0,30
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	21,84	1,36	-10,21	6.619.006,52	1,24	1.420.707.173,52	0,47
Sub-total Artigo 9º III			22,94	1,09	-10,22	13.237.712,90	2,47		
Investimentos no Exterior			22,22	1,09	-10,22	13.237.712,90	2,47		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,63%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ARENA CAPITAL	REAG	WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP	30,31	1,02	16,01	397.983,50	0,07	44.945.404,61	0,89
SAFRA	SAFRA	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	1,24	-0,04	-0,04	2.498.938,69	0,47	329.200.644,08	0,76
QUELUZ	RJI	FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO	4,35	0,10	1,56	4.074.790,89	0,76	176.742.392,54	2,31
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	19,77	-7,71	-14,89	12.431.337,00	2,32	948.117.020,14	1,31
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA	20,01	-7,86	-15,11	8.665.175,36	1,62	923.445.010,60	0,94
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	19,96	-7,78	-14,98	12.788.076,25	2,39	2.072.988.175,00	0,62
Sub-total Artigo 10º I			22,24	-6,77	-13,11	40.856.301,69	7,62		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
A5	PLANNER	W7 FIP MULTISTRATÉGIA	0,42	-0,12	-0,38	9.608.996,51	1,79	136.133.781,03	7,06
QUELUZ	BNY MELLON	BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	0,29	-0,06	-0,12	1.130.077,59	0,21	27.804.185,53	4,06
Sub-total Artigo 10º II			0,39	-0,11	-0,35	10.739.074,10	2,00		
Investimentos Estruturados			17,62	-5,42	-10,63	51.595.375,79	9,63		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,19%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GRAPHEN	RJI	HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	3,16	3,11	3,15	5.920.762,08	1,10	74.820.991,99	7,91
VERITAS	RJI	SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	12,32	-0,12	1,40	414.260,46	0,08	83.215.784,41	0,50
REDITUS	INDIGO	AQUILLA RENDA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	127,93	4,53	88,25	62.228,37	0,01	74.329.618,05	0,08
Sub-total Artigo 11º			4,21	2,89	3,48	6.397.250,91	1,19		
Fundos Imobiliários			4,21	2,89	3,48	6.397.250,91	1,19		
Total			3,31	-0,52	-0,15	535.904.829,84	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	136.053,25
Sub-total Disponibilidades Financeiras	136.053,25
Total	536.040.883,09

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	214.461.935,55	40,02	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	114.423.943,92	21,35	0,00	18,50	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	107.502.209,10	20,06	0,00	14,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	5.773.091,22	1,08	0,00	1,00	1,40	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	858.713,37	0,16	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	443.019.893,16	82,67					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	21.654.597,08	4,04	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	21.654.597,08	4,04					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	13.237.712,90	2,47	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	13.237.712,90	2,47					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	40.856.301,69	7,62	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	10.739.074,10	2,00	0,00	2,00	2,40	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	51.595.375,79	9,63					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	6.397.250,91	1,19	0,00	1,00	1,45	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	6.397.250,91	1,19					5,00
Total		535.904.829,84	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	0,75 73,94	3,57 122,91	3,57 122,91	6,77 125,34		1.595.219,64	6.418.720,20
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,18 17,60	2,03 69,85	2,03 69,85	4,90 90,68		199.657,42	2.753.519,82
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,66 64,89	2,59 89,03	2,59 89,03	5,19 96,04		733.010,70	2.929.298,08
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,07 -6,42	-0,29 -9,85	-0,29 -9,85	-1,42 -26,24		-3.761,35	-16.567,32
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	-6,94 -684,41	-56,88 -1.957,11	-56,88 -1.957,11	-59,90 -1.109,02		-2.632,86	-1.347.185,11
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-11,45 0,05	-16,65 1,23	-16,65 1,23	-7,99 -2,00		-2.800.323,26	-4.326.606,09
Artigo 9º III % do CDI	1,09 107,98	-10,22 -351,48	-10,22 -351,48	-28,85 -534,06		143.314,30	-1.506.202,78
Artigo 10º I % do CDI	-6,77 -668,44	-13,11 -451,05	-13,11 -451,05	-15,61 -289,00		-2.850.029,71	-5.854.236,11
Artigo 10º II % do CDI	-0,11 -11,27	-0,35 -12,01	-0,35 -12,01	-0,68 -12,68		-12.279,44	-37.664,74
Artigo 11º % do CDI	2,89 285,10	3,48 119,71	3,48 119,71	3,32 61,52		180.504,74	216.185,18
Disponibilidades Financeiras	0,00	0,00	0,00	-11,95		0,00	0,00
OSASCO - CONSOLIDADO (Total)						-2.817.319,82	-770.738,87

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\$)
LTN 01012024 (6,030000%)	5.497.383,24	0,00	0,00	0,00	5.524.272,30	26.889,06	79.010,12
LTN 01012024 (6,100000%)	5.499.852,59	0,00	0,00	0,00	5.527.057,70	27.205,11	79.934,51
NTN-B 150545	15.487.128,19	0,00	0,00	0,00	15.235.219,30	-251.908,89	-66.590,31
NTN-B 150545 (4,930000%)	27.303.893,29	0,00	0,00	0,00	27.556.841,13	252.947,84	1.097.559,27

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150555 (5,742000%)	41.328.239,86	0,00	0,00	0,00	41.737.912,66	409.672,80	525.121,43
NTN-B 150840 (4,200000%)	27.563.877,81	0,00	0,00	0,00	27.803.064,49	239.186,68	1.043.498,13
NTN-B 150850 (5,730001%)	43.009.807,62	0,00	0,00	0,00	43.435.748,56	425.940,94	1.779.872,08
NTN-B 150850 (5,740002%)	41.823.525,49	0,00	0,00	0,00	42.238.018,01	414.492,52	1.731.724,88
NTN-F 2029 (12,000000%)	5.353.007,82	0,00	0,00	0,00	5.403.801,40	50.793,58	148.590,09
					214.461.935,55	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\$)
BB PREV RF IDKA2	13.130.513,95	0,00	0,00	0,00	13.165.455,04	34.941,09	326.435,94
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	17.703.588,98	0,00	0,00	0,00	17.641.142,26	-62.446,72	245.598,64
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	7.852.923,40	0,00	0,00	0,00	7.877.871,31	24.947,91	202.189,28
BB PREV RF VII	752.135,96	0,00	0,00	0,00	754.477,06	2.341,10	22.165,81
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	4.310.181,75	0,00	0,00	0,00	4.323.567,82	13.386,07	126.949,95
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	7.833.955,49	0,00	0,00	0,00	7.803.287,86	-30.667,63	103.599,15
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	23.760.641,82	0,00	0,00	0,00	23.813.945,89	53.304,07	579.699,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	27.749.919,80	0,00	0,00	0,00	27.813.859,14	63.939,34	604.250,51
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	9.130.425,35	2.000.000,00	0,00	0,00	11.230.337,54	99.912,19	221.953,64
					114.423.943,92	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 REF DI LP PERFIL FIC FI	38.125.740,73	29.701.826,22	-26.965.354,69	0,00	41.367.144,36	504.932,10	1.389.924,09
BRA1 FI RENDA FIXA	444.144,25	0,00	0,00	55.854,91	389.335,60	1.046,26	7.921,90
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	10.972.846,05	0,00	0,00	0,00	11.091.150,58	118.304,53	330.246,61
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	21.737.336,69	0,00	0,00	0,00	21.797.520,68	60.183,99	541.216,30
FI BARCELONA RENDA FIXA	523.437,34	0,00	0,00	0,00	524.842,25	1.404,91	-65.994,93

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	28.345.739,34	193.475,79	0,00	0,00	28.841.451,62	302.236,49	808.544,63
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	417.360,43	0,00	0,00	0,00	418.738,71	1.378,28	5.756,44
MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA	53.355,74	0,00	0,00	0,00	52.411,73	-944,01	-2.994,20
TMJ IMA-B FI RF	1.049.248,92	0,00	0,00	0,00	791.176,41	-258.072,51	-212.205,34
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1.075.643,92	0,00	0,00	0,00	1.076.267,43	623,51	11.398,01
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	1.150.252,58	0,00	0,00	0,00	1.152.169,73	1.917,15	20.594,92
					107.502.209,10	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\$)
ILLUMINATI FIDC	2.069.068,95	0,00	0,00	0,00	2.058.056,65	-11.012,30	-43.803,01
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	369.808,54	0,00	0,00	0,00	369.389,67	-418,87	-12.569,53
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	3.337.975,08	0,00	0,00	0,00	3.345.644,90	7.669,82	39.805,22
					5.773.091,22	0,00	0,00

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
PIATÁ FI RF LONGO PRAZO	1.160.695,84	0,00	0,00	299.349,61	858.713,37	-2.632,86	-1.347.185,11
					858.713,37	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\$)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	2.906.610,01	0,00	0,00	0,00	2.594.532,77	-312.077,24	-690.491,90
FIA CAIXA DIVIDENDOS	3.770.632,79	0,00	0,00	0,00	3.457.309,80	-313.322,99	-360.623,71
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	5.001.493,06	0,00	0,00	0,00	4.484.506,20	-516.986,86	-643.023,81
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	3.891.036,01	0,00	0,00	0,00	3.257.232,89	-633.803,12	-1.070.984,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	2.973.375,88	0,00	0,00	0,00	2.660.445,91	-312.929,97	-314.178,15
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES	5.911.772,59	0,00	0,00	0,00	5.200.569,51	-711.203,08	-1.247.303,56
					21.654.597,08	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	6.564.387,82	0,00	0,00	0,00	6.618.706,38	54.318,56	-753.205,34
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	6.530.010,78	0,00	0,00	0,00	6.619.006,52	88.995,74	-752.997,44
					13.237.712,90	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BRADESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA	9.404.712,10	0,00	0,00	0,00	8.665.175,36	-739.536,74	-1.542.874,19
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13.866.949,84	0,00	0,00	0,00	12.788.076,25	-1.078.873,59	-2.252.924,66
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO	4.070.784,96	0,00	0,00	0,00	4.074.790,89	4.005,93	62.518,68
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,00	2.500.000,00	0,00	0,00	2.498.938,69	-1.061,31	-1.061,31
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	13.469.916,60	0,00	0,00	0,00	12.431.337,00	-1.038.579,60	-2.174.812,37
WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP	393.967,90	0,00	0,00	0,00	397.983,50	4.015,60	54.917,74
					40.856.301,69	0,00	0,00

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	1.130.730,14	0,00	0,00	0,00	1.130.077,59	-652,55	-1.310,31
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	9.620.623,40	0,00	0,00	0,00	9.608.996,51	-11.626,89	-36.354,43
					10.739.074,10	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
AQUILLA RENDA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	59.532,17	0,00	0,00	0,00	0,00	62.228,37	2.696,20	29.172,64
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	5.742.398,12	0,00	0,00	0,00	0,00	5.920.762,08	178.363,96	180.746,67
SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	444.684,76	0,00	0,00	0,00	29.868,88	414.260,46	-555,42	6.265,87
						6.397.250,91	0,00	0,00

Disponibilidades Financeiras

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	21.167.976,62	0,00	-21.031.923,37	0,00	136.053,25	0,00	0,00
					136.053,25	0,00	0,00

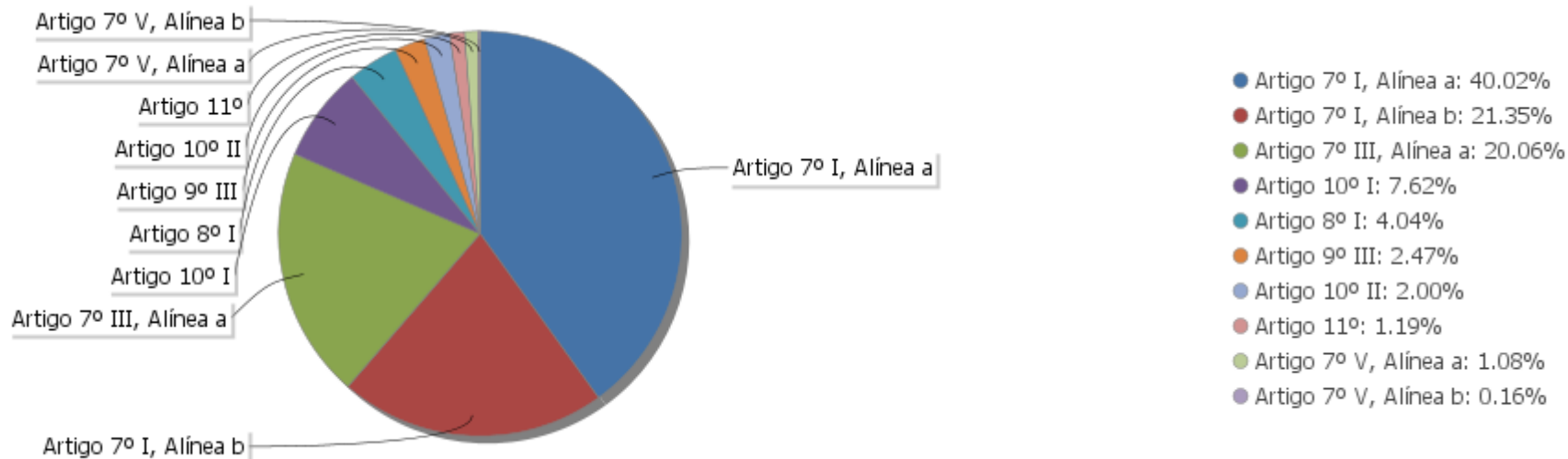
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

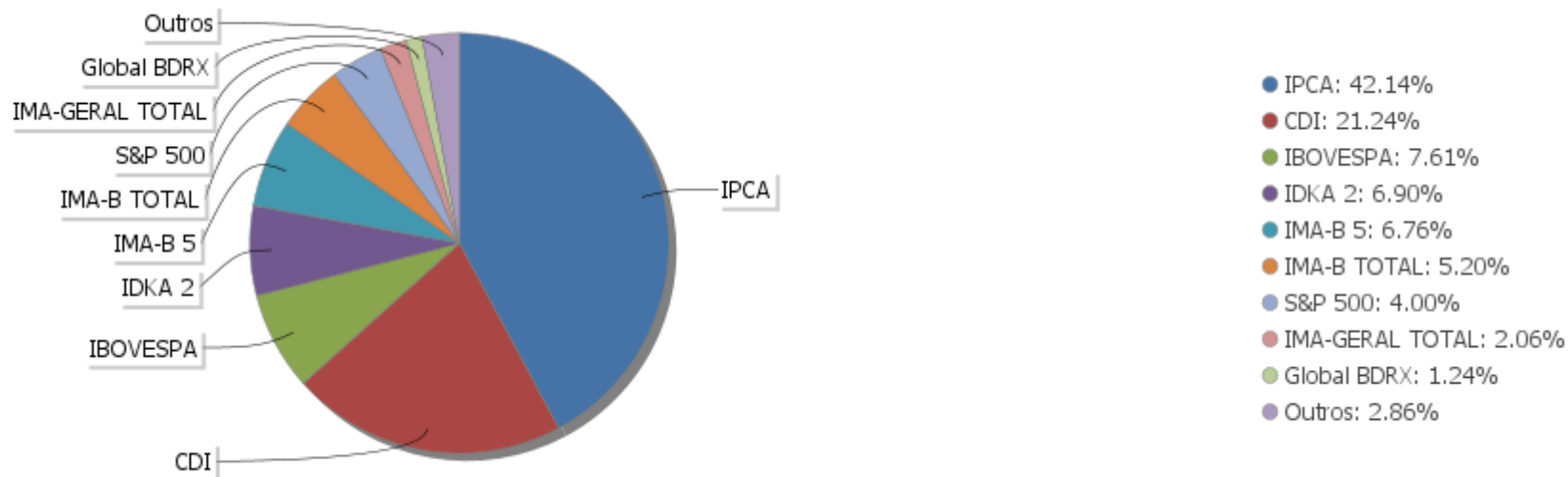
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	301.975.830,37	56,35	301.975.830,37	56,35
de 31 a 365 dias	7.672.577,65	1,43	309.648.408,02	57,78
acima de 365 dias	226.256.421,82	42,22	535.904.829,84	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

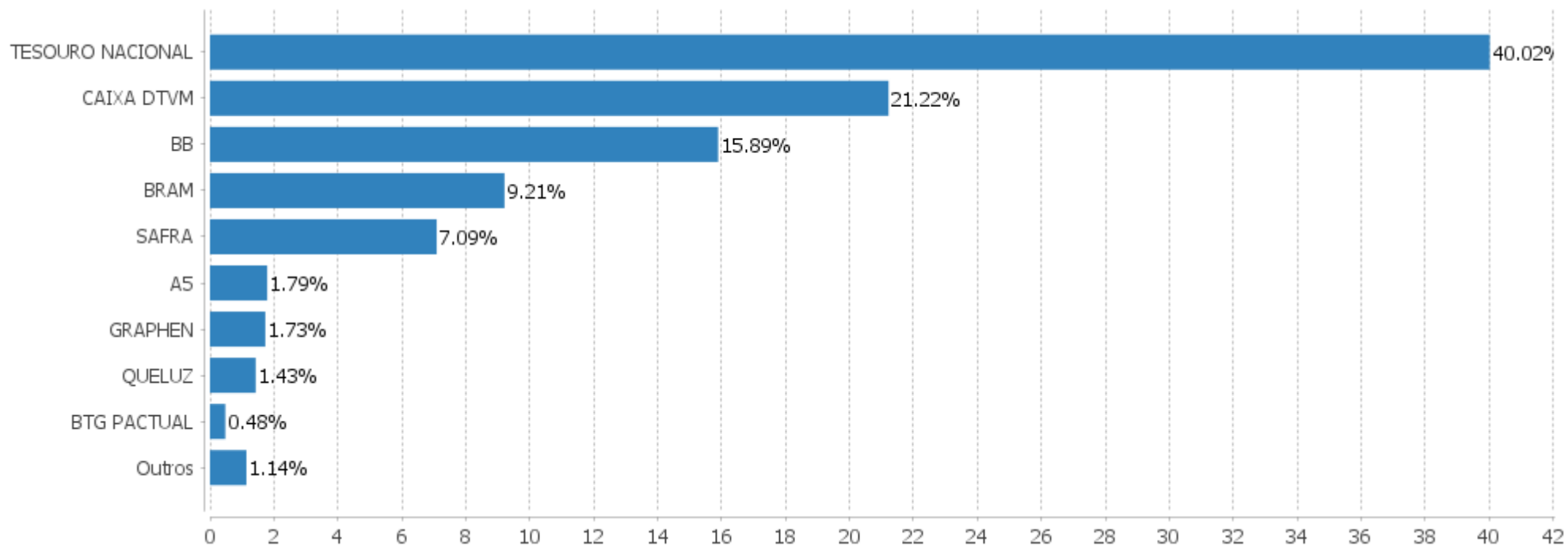


Alocação Por Estratégia



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	-0,24	0,09	1,80	-0,53	0,90	-0,52							1,51
IPCA + 4,95%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,89	1,08							8,02
p.p. indexador	-1,18	-1,28	-0,25	-1,96	0,01	-1,59							-6,52
2021									-0,22	-0,44	1,12	1,14	1,59
IPCA + 5,45%									1,61	1,68	1,38	1,22	6,01
p.p. indexador									-1,83	-2,12	-0,26	-0,08	-4,42

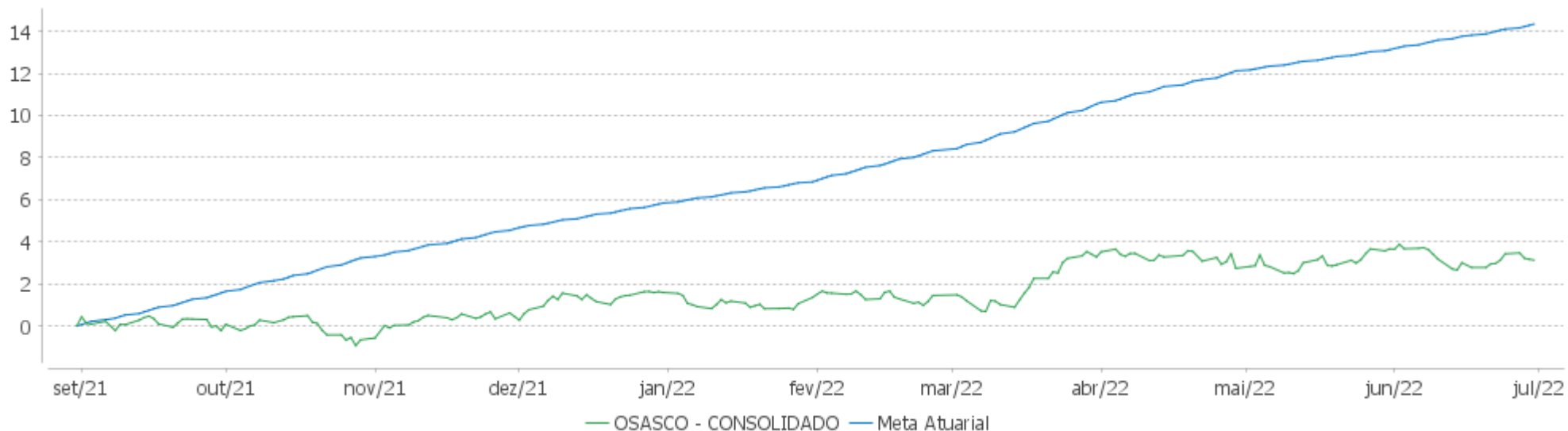
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

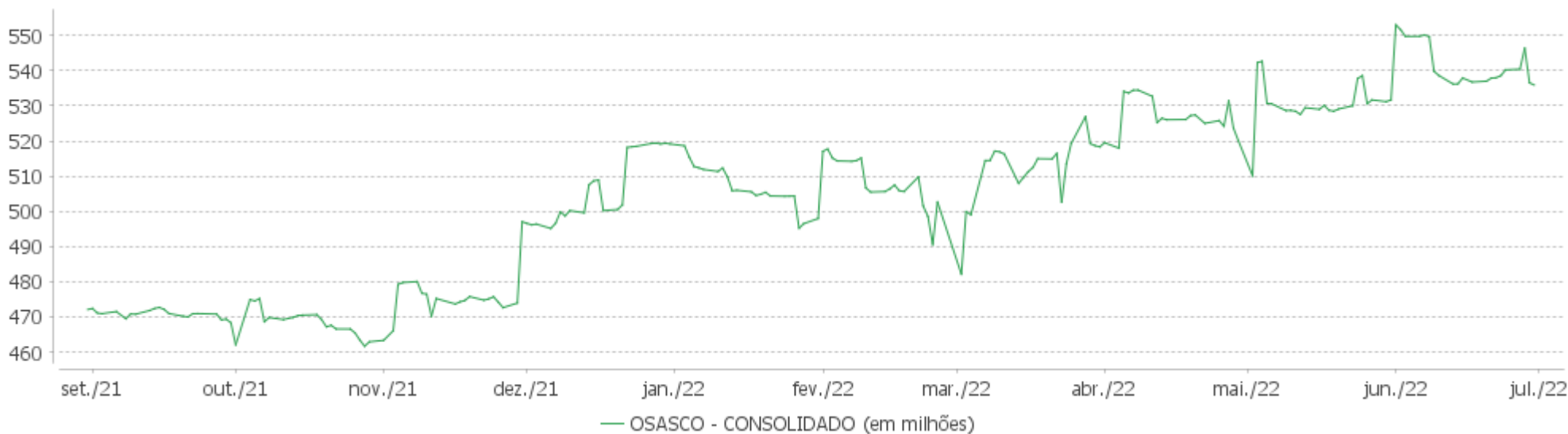
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	1	10,00	03 meses	-0,15	3,44	-3,59	3,65
Meses abaixo - Meta Atuarial	9	90,00	06 meses	1,51	8,02	-6,52	3,43
			12 meses				
			24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,80	2022-03	Desde 31/08/2021	3,13	14,52	-11,39	3,31
Menor rentabilidade da Carteira	-0,53	2022-04					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

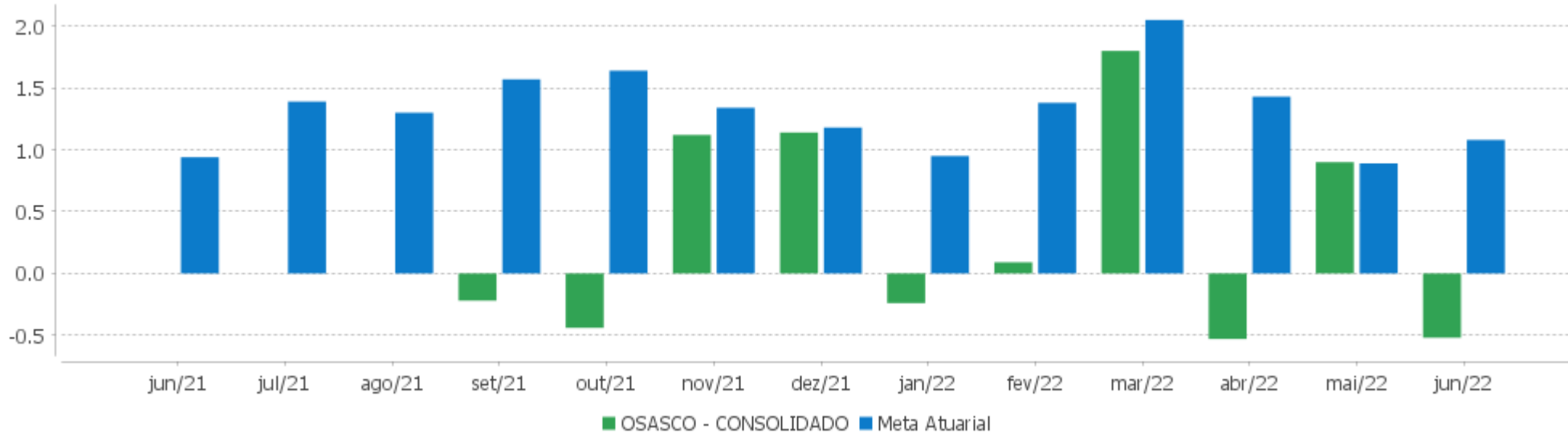


Patrimônio Líquido



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
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO % do CDI	-6,94 -684,41	-56,88 -1.957,11	-56,88 -1.957,11	-59,90 -1.109,02	-60,26 -696,24	-61,09 -549,36	-47,97 -295,14
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	-1,63 -2,30	-0,47 -2,69	-0,47 -2,69	1,53 -3,96	-4,63 -16,51	5,17 -16,05	5,31 -18,50
NTN-B 150555 (5,742000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,32	1,39 -0,82	1,39 -0,82	5,52 0,03	11,77 -0,12	20,91 -0,32	23,37 -0,44
NTN-B 150545 (4,930000%) Var. IPCA p.p.	0,93 0,26	4,08 1,86	4,08 1,86	8,10 2,62	17,31 5,42	26,59 5,37	28,86 5,05
LTN 01012024 (6,030000%) Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,49 0,06	1,45 -0,45	1,45 -0,45	2,92 -1,56	6,03 0,69	12,40 3,32	19,20 3,01
NTN-F 2029 (12,000000%) Var. SELIC p.p.	0,95 -0,06	2,83 -0,08	2,83 -0,08	5,73 0,33	6,29 -2,37	7,10 -4,02	7,93 -8,33
LTN 01012024 (6,100000%) Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,49 0,06	1,47 -0,43	1,47 -0,43	2,96 -1,53	6,10 0,76	12,55 3,46	19,44 3,25
NTN-B 150840 (4,200000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,20	3,90 1,68	3,90 1,68	7,73 2,25	13,76 1,87	22,34 1,12	24,12 0,31
NTN-B 150850 (5,730001%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,32	4,27 2,06	4,27 2,06	5,51 0,02	11,76 -0,13	20,88 -0,35	23,32 -0,49
NTN-B 150850 (5,740002%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,32	4,28 2,06	4,28 2,06	5,51 0,02	11,76 -0,13	20,88 -0,34	23,33 -0,48
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	0,31 -0,02	3,03 0,33	3,03 0,33	7,17 0,56	11,77 1,71	19,65 2,91	30,35 3,32
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,31 0,68	3,03 1,59	3,03 1,59	7,18 2,83	11,77 8,00	18,68 7,19	26,13 9,13
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,27 -0,21	2,54 -0,31	2,54 -0,31	6,46 -0,39	9,84 -0,26	16,85 -1,03	26,41 -1,81
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,23 -0,44	2,22 0,01	2,22 0,01	4,59 -0,90	3,73 -8,16	6,51 -14,72	16,97 -6,84
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,32 -0,02	2,63 -0,06	2,63 -0,06	6,47 -0,14	9,74 -0,33	16,08 -0,66	26,05 -0,98
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,22 -0,25	2,50 -0,36	2,50 -0,36	6,41 -0,43	9,66 -0,45	16,68 -1,21	26,24 -1,99
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,35	1,41	1,41	4,22	3,48	10,88	16,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,01	-0,02	-0,02	-0,13	-0,29	-0,60	-0,86
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI % do CDI	1,02 100,48	2,81 96,78	2,81 96,78	5,35 99,09	8,66 100,00	10,78 96,96	15,66 96,36
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,39 -0,03	1,35 -0,09	1,35 -0,09	4,16 -0,19	3,41 -0,37	10,70 -0,78	15,78 -1,21
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	0,23 22,67	1,20 41,43	1,20 41,43	2,69 49,75	4,04 46,67	0,01 0,06	-7,28 -44,77
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC % do CDI	-0,11 -11,18	-3,29 -113,22	-3,29 -113,22	-4,14 -76,72	-21,18 -244,68		
ILLUMINATI FIDC Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,53 -1,69	-2,08 -5,78	-2,08 -5,78	-6,99 -15,54	-10,74 -29,34	-8,91 -45,09	-19,61 -67,07
MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,77 -1,41	-5,40 -6,84	-5,40 -6,84	-9,70 -14,04	-36,94 -40,72	-96,82 -108,30	-97,28 -114,27
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,90 2,26	2,98 1,54	2,98 1,54	5,06 0,71	10,44 6,67	0,47 -11,01	-22,35 -39,35
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,28 -0,06	2,55 -0,15	2,55 -0,15	6,31 -0,29	9,47 -0,59	15,15 -1,59	25,23 -1,80
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,08 106,37	3,07 105,59	3,07 105,59	5,71 105,77	9,36 108,10	12,01 107,96	16,36 100,67
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,03 101,22	2,90 99,83	2,90 99,83	5,54 102,62	8,98 103,80	11,54 103,80	16,07 98,90
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,17 -0,17	1,82 -0,87	1,82 -0,87	1,22 -5,39	-3,86 -13,92	-65,22 -81,96	-73,97 -100,99
FI BARCELONA RENDA FIXA % do CDI	0,27 26,48	-11,17 -384,30	-11,17 -384,30	-26,79 -495,99	-24,89 -287,52	-25,35 -227,96	-25,74 -158,38
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,06 104,64	2,97 102,04	2,97 102,04	5,60 103,61	9,19 106,13	11,59 104,22	16,08 98,96
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,06 -0,28	1,07 -1,62	1,07 -1,62	2,58 -4,03	1,94 -8,12	-22,32 -39,06	-35,42 -62,45
BRA1 FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,26 0,62	1,84 0,40	1,84 0,40	3,85 -0,49	4,03 0,25	2,00 -9,48	-67,82 -84,82
TMJ IMA-B FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-24,60 -24,23	-21,23 -22,67	-21,23 -22,67	-20,95 -25,29	-29,45 -33,22	-53,52 -65,00	-58,75 -75,75
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-10,74 0,77	-21,02 -3,14	-21,02 -3,14	-13,21 -7,22	-43,33 -21,05	-30,33 -34,00	-24,19 -21,79
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	-10,52	-10,56	-10,56	-3,62	-15,12	21,27	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	0,98	7,32	7,32	2,37	7,16	17,60	
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	-10,34	-12,54	-12,54	-1,37	-11,64	8,62	13,65
Var. IBOVESPA p.p.	1,17	5,34	5,34	4,62	10,65	4,95	16,05
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-16,29	-24,74	-24,74	-19,47	-40,12	-17,78	-14,84
Var. IBOVESPA p.p.	-4,79	-6,86	-6,86	-13,48	-17,83	-21,45	-12,44
FIA CAIXA DIVIDENDOS	-8,31	-9,45	-9,45	4,05	-7,36	11,21	9,52
Var. IBOVESPA p.p.	3,19	8,44	8,44	10,04	14,93	7,54	11,92
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES	-12,03	-19,34	-19,34	-11,42	-37,28	-12,84	
Var. IBOVESPA p.p.	-0,53	-1,46	-1,46	-5,43	-14,99	-16,51	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,83	-10,22	-10,22	-27,83	-13,08	9,72	69,62
Var. Global BDRX p.p.	0,03	0,06	0,06	-0,22	-0,98	-2,78	-4,54
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	1,36	-10,21	-10,21	-29,84	-14,97	9,82	54,22
Var. IBOVESPA p.p.	12,87	7,67	7,67	-23,85	7,32	6,16	56,62
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	1,25	3,77	3,77	7,04	8,79	11,43	16,79
% do CDI	122,87	129,68	129,68	130,41	101,53	102,79	103,27
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO	0,10	1,56	1,56	0,66	-3,86	1,07	-12,40
% do CDI	9,71	53,61	53,61	12,13	-44,54	9,58	-76,26
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-7,78	-14,98	-14,98	-17,57	-5,74	30,65	35,22
Var. S&P 500 p.p.	-9,25	-7,35	-7,35	7,88	2,03	13,86	-40,66
WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP	1,02	16,01	16,01	11,65	-21,13	-19,66	-28,57
Var. IPCA + 7,00% p.p.	-0,22	12,08	12,08	2,59	-40,85	-58,41	-80,24
BRASESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA	-7,86	-15,11	-15,11	-17,86	-6,37	30,10	36,52
Var. S&P 500 p.p.	-9,33	-7,49	-7,49	7,59	1,39	13,31	-39,36
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-7,71	-14,89	-14,89	-17,44	-5,80	30,47	36,44
Var. IBOVESPA p.p.	3,79	2,99	2,99	-11,45	16,48	26,80	38,84
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,12	-0,38	-0,38	-0,73	-1,46	1,46	-0,54
% do CDI	-11,92	-12,95	-12,95	-13,55	-16,85	13,11	-3,32
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	-0,06	-0,12	-0,12	-0,28	-0,93	-2,59	29,18
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,22	-3,81	-3,81	-8,84	-19,53	-38,77	-18,28
SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	-0,12	1,40	1,40	-4,68	-0,81	31,86	-11,37
Var. IFIX p.p.	0,76	0,83	0,83	-4,35	-2,29	32,24	-17,83
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	3,11	3,15	3,15	3,60	3,70	4,83	7,29
Var. IFIX p.p.	3,99	2,59	2,59	3,92	2,22	5,21	0,84
AQUILLA RENDA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	4,53	88,25	88,25	76,34	-44,68		
Var. IBOVESPA p.p.	16,03	106,13	106,13	82,34	-22,39		
OSASCO - CONSOLIDADO	-0,52	-0,15	-0,15	1,51			

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 4,95% p.p.	-1,59	-3,59	-3,59	-6,52			
CDI	1,01	2,91	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25
IBOVESPA	-11,50	-17,88	-17,88	-5,99	-22,29	3,67	-2,40
INPC + 6,00%	1,11	3,60	3,60	8,68	18,63	37,32	49,01
IPCA + 6,00%	1,16	3,69	3,69	8,56	18,60	36,18	47,46

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AQUILLA RENDA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Não se aplica	Não se aplica				
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREV RF VII	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRA1 FI RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1440	D+1445		1,30
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADERCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA			D+0	D+1 du		1,20
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	Não se aplica	Não se aplica				
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
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI BARCELONA RENDA FIXA	D+0	D+0	D+0 ou D+1260 (isento de taxa de resgate)	D+1 du ou D+1261 (isento de taxa de resgate)		0,00
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	D+0	D+0	D+30 ou D+1440 (isento de taxa de resgate)	D+31 ou D+1441 (isento de taxa de resgate)	Adicionalmente à remuneração prevista no caput deste Artigo, o FUNDO, com base em	1,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					seu resultado, pagará a GESTORA, a título de performance ("Prêmio"), o equivalente a 20% (vinte por cento) da valorização da cota do FUNDO que, em cada semestre civil, exceder o índice IMA-B.	
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO	D+1 du	D+0	D+90 ou D+1440 (isento de taxa de resgate)	D+91 ou D+1441 (isento de taxa de resgate)		1,50
FIA CAIXA DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	D+1 du	D+0	D+13 du	D+15 du		2,00
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Não se aplica	Não se aplica				
ILLUMINATI FIDC	D+0	D+0				
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	Não se aplica	Não se aplica				
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	D+0	D+0				
MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1370	D+1371		1,50
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0 ou D+1080 (isento de taxa de resgate)	D+1 du ou D+1081 (isento de taxa de resgate)		1,40
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES			D+1 du	D+3 du		2,00
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+2 du		1,00
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF			D+0	D+0		0,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
REF DI						
SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	Não se aplica	Não se aplica				
TMJ IMA-B FI RF	D+0	D+0	D+30 ou D+1460 du (isento de taxa de resgate)	D+31 ou D+1461 du (isento de taxa de resgate)		0,80
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1 du	D+0	D+1470	D+1471		0,35
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1 du	D+0	D+1470	D+1471		0,70
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se aplica	Não se aplica				
WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP	D+0	D+0	D+1460	D+1520		1,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,93	2,65	2,65	4,99	7,19	9,37	15,94	24,32	34,03
IRF-M 1+	0,09	-0,06	-0,06	0,73	-1,02	-2,10	9,44	30,43	42,54
IRF-M TOTAL	0,37	0,83	0,83	2,19	1,76	1,90	11,90	29,50	41,08
IMA-B 5	0,33	2,69	2,69	6,61	10,06	16,74	27,03	45,64	59,81
IMA-B 5+	-1,10	0,12	0,12	2,03	-2,16	6,18	8,27	52,42	61,74
IMA-B TOTAL	-0,36	1,43	1,43	4,35	3,78	11,48	17,00	50,64	62,99
IMA-GERAL TOTAL	0,43	1,90	1,90	4,49	5,34	9,08	16,19	34,66	46,06
IDKA 2	0,47	2,86	2,86	6,85	10,11	17,88	28,22	45,20	59,68
IDKA 20	-2,95	-2,97	-2,97	-2,61	-13,58	-2,92	-7,47	53,52	57,70
CDI	1,01	2,91	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25	23,60	32,71

Renda Variável

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

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

Investimentos no Exterior

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

Meta Atuarial

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3394	04/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.949.636,92	788.627,93644900	2,4721885060
3395	04/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	141.546,07	57.255,37096200	2,4721885060
3396	04/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	133.333,77	53.933,49644500	2,4721885060
3397	05/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.581.431,88	0,00	3.469.767,34918700	2,4732009430
3398	05/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.637.141,40	0,00	3.087.958,30828600	2,4732009430
3399	05/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.165.049,26	0,00	471.069,39017500	2,4732009430
3400	06/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.000,00	6.062,77718200	2,4741136860
3401	07/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.235,45	6.155,66420700	2,4750294180
3402	07/04/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	191.036,75	0,00	47.524,57057600	4,0197470000
3403	07/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	30.142,68	12.178,71584900	2,4750294180
3404	08/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	18.383,27	0,00	7.424,69481000	2,4759630490
3405	11/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	56.020,64	22.617,09677100	2,4769156080
3406	12/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	13.836,20	0,00	5.583,80742400	2,4779149690
3407	12/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.577.415,33	2.654.415,26940500	2,4779149690
3408	12/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	974.311,10	393.197,95561600	2,4779149690
3409	12/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	171.407,41	0,00	69.174,04840100	2,4779149690
3410	12/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	160.460,70	64.756,33829500	2,4779149690
3411	18/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	28.504,70	11.488,64616200	2,4811191500
3412	18/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	257.872,60	103.933,98479100	2,4811191500
3413	19/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.000.000,00	805.786,53229500	2,4820469440
3414	19/04/2022	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	2.000.000,00	0,00	3.887,72042500	514,4402840000
3415	20/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	301.254,90	0,00	121.329,17542600	2,4829551420
3416	25/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	93.596,34	37.663,30101400	2,4850806350
3417	27/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	6.636.373,05	0,00	2.668.256,64138300	2,4871569500
3418	28/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.369.955,86	550.572,96775900	2,4882366920
3419	28/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	219.550,03	88.235,18707300	2,4882366920
3420	28/04/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	8.083.058,23	3.248.508,57476200	2,4882366920
3421	02/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	18.108,47	7.271,28891300	2,4904071640

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3422	02/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	223.006,43	0,00	89.546,17269900	2,4904071640
3423	02/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	187.508,68	0,00	75.292,37897700	2,4904071640
3424	02/05/2022	SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	10.909.860,66	53.713,50381800	203,1120647000
3425	03/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	11.604.421,88	0,00	4.657.577,96516100	2,4915142520
3426	03/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	9.504.117,55	0,00	3.814.594,89640500	2,4915142520
3427	03/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	10.909.816,86	0,00	4.378.789,66626100	2,4915142520
3428	04/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.099.446,19	0,00	441.076,27731300	2,4926441220
3429	04/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.734.282,10	1.096.940,42397300	2,4926441220
3430	04/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	90.657,50	0,00	36.370,01335200	2,4926441220
3431	04/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	760.395,96	305.055,96578600	2,4926441220
3432	04/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	30.759,22	0,00	12.339,99660300	2,4926441220
3433	05/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	270.263,50	108.378,25452400	2,4937059670
3434	05/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	8.088.437,91	3.243.541,14600400	2,4937059670
3435	05/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.078.279,25	432.400,31674500	2,4937059670
3436	06/05/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	189.213,78	0,00	46.679,37674200	4,0534770000
3437	09/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	21.972,16	8.802,34439300	2,4961713630
3438	09/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	582.333,17	233.290,54192000	2,4961713630
3439	09/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	15.475,66	0,00	6.199,75865000	2,4961713630
3440	09/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	285.469,26	0,00	114.362,84552800	2,4961713630
3441	09/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	85.561,57	34.277,12186300	2,4961713630
3442	11/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	9.956,30	0,00	3.984,60927700	2,4986891580
3443	12/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	235.237,52	94.098,77748400	2,4998998530
3444	12/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	106.411,02	42.566,11314700	2,4998998530
3445	12/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.281.693,26	512.697,84206000	2,4998998530
3446	16/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	49.250,00	19.681,30977000	2,5023741090
3447	17/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	47.405,36	18.934,46870600	2,5036540890
3448	17/05/2022	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	30.722.461,75	19.585.213,91570300	1,5686559200
3449	17/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	29.793.769,82	0,00	11.900.114,29729800	2,5036540890
3450	17/05/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.145.304,78	0,00	281.589,85366100	4,0672800000
3451	18/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	928.691,93	0,00	370.752,18327500	2,5048859370

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3452	19/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	96.013,01	38.310,99806800	2,5061474470
3453	19/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	23.103,78	9.218,84306000	2,5061474470
3454	20/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	305.909,89	0,00	122.004,12897800	2,5073732550
3455	20/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.000.000,00	797.647,49664300	2,5073732550
3456	20/05/2022	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	2.000.000,00	0,00	3.850,06515696	519,4717280000
3457	23/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	71.897,18	28.660,22012900	2,5086052960
3458	23/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	79.168,79	31.558,88657600	2,5086052960
3459	23/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	8.752,32	3.488,91872900	2,5086052960
3460	24/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.392.201,86	0,00	3.343.822,52851300	2,5097629400
3461	24/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	41.212.791,23	16.420.989,63737400	2,5097629400
3462	24/05/2022	NTN-B 150555 (5,742000%)	41.212.791,23	0,00	10.000,00000000	4.121,2791230000
3463	26/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	179.967,69	71.637,27807700	2,5122072590
3464	26/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.972.213,44	3.173.390,01845400	2,5122072590
3465	26/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.351.149,77	537.833,71780300	2,5122072590
3466	27/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	35.958,79	14.306,73801500	2,5134164030
3467	31/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	24.740,55	0,00	9.833,78280300	2,5158731380
3468	01/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	9.150.015,05	0,00	3.635.189,73133200	2,5170667080
3469	01/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	11.111.552,89	0,00	4.414.484,86632600	2,5170667080
3470	01/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.163.792,45	0,00	462.360,59072200	2,5170667080
3471	02/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	172.690,70	68.575,48331200	2,5182571330
3472	02/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.247.758,41	892.584,94716200	2,5182571330
3473	02/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	174.088,03	69.130,36310700	2,5182571330
3474	03/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20.069,80	7.965,83292200	2,5194854320
3475	03/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	798.372,71	316.879,27219600	2,5194854320
3476	06/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	38.791,10	15.388,99154200	2,5207044850
3477	07/06/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	193.475,79	0,00	47.231,87552000	4,0962970000
3478	09/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	948.265,31	375.650,15083000	2,5243309710
3479	09/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.531.258,06	2.983.466,96472100	2,5243309710
3480	09/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	200.556,71	79.449,45108400	2,5243309710
3481	10/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	212.497,85	0,00	84.138,98113700	2,5255576800

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3482	10/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	109.478,53	0,00	43.348,25962000	2,5255576800
3483	14/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	299.349,61	0,00	118.420,01372600	2,5278633280
3484	15/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	83.117,86	32.864,90962800	2,5290761770
3485	20/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	308.822,91	0,00	121.987,41497900	2,5315964770
3486	20/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	100.253,55	39.600,92017500	2,5315964770
3487	21/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.000.000,00	789.616,12877800	2,5328763270
3488	21/06/2022	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	2.000.000,00	0,00	3.811,63593500	524,7090840000
3489	23/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	161.685,36	63.769,69464600	2,5354576480
3490	24/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	55.854,92	0,00	22.018,82142300	2,5366898130
3491	27/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.500.000,00	985.049,09117100	2,5379445780
3492	27/06/2022	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	2.500.000,00	0,00	11.341,90285400	220,4215670000
3493	28/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.260.593,12	0,00	2.859.440,27078200	2,5391658620
3494	29/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.358.634,29	534.808,12150100	2,5404144690
3495	29/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	8.042.550,08	3.165.841,70738300	2,5404144690
3496	29/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	187.262,72	73.713,45199200	2,5404144690
3497	30/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	29.868,89	0,00	11.751,61535200	2,5416837690
3498	30/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	400.000,00	157.375,99023100	2,5416837690
Total			179.064.475,50	159.093.964,77		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 8.664.475,03

Value-At-Risk: 1,62%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
OSASCO - CONSOLIDADO		1,62	1,62			535.904.829,84	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,48%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545		4,05	0,06	4,05			15.235.219,30	2,84
LTN 01012024 (6,030000%)		0,00	-0,00	1,02			5.524.272,30	1,03
LTN 01012024 (6,100000%)		0,00	0,00	1,02			5.527.057,70	1,03
NTN-B 150545 (4,930000%)		0,12	0,00	0,15			27.556.841,13	5,14
NTN-B 150555 (5,742000%)		0,24	-0,00	0,25			41.737.912,66	7,79
NTN-B 150840 (4,200000%)		0,12	0,00	0,15			27.803.064,49	5,19
NTN-B 150850 (5,730001%)		0,24	-0,00	0,27			43.435.748,56	8,11
NTN-B 150850 (5,740002%)		0,24	-0,00	0,27			42.238.018,01	7,88
NTN-F 2029 (12,000000%)		0,00	-0,00	0,02			5.403.801,40	1,01
Sub-total	0,52	0,30	0,06		-0,51	0,75	214.461.935,55	40,02

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,15	0,04	0,03			17.641.142,26	3,29
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		2,15	0,02	0,04			7.803.287,86	1,46
BB PREV RF IDKA2		1,29	0,01	0,28			13.165.455,04	2,46
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,39	0,03	0,37			23.813.945,89	4,44
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,14	0,01	0,03			7.877.871,31	1,47
BB PREV RF VII		0,81	0,00	2,13			754.477,06	0,14
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP		0,81	0,00	0,94			4.323.567,82	0,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,21	0,02	1,22			27.813.859,14	5,19
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI		0,03	0,00	0,02			11.230.337,54	2,10
Sub-total	2,70	1,17	0,13		-0,31	0,18	114.423.943,92	21,35

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,04	0,00	0,04			28.841.451,62	5,38
BRA1 FI RENDA FIXA		0,68	0,00	2,01			389.335,60	0,07
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,03	0,00	0,02			41.367.144,36	7,72
TMJ IMA-B FI RF		1,66	0,00	2,80			791.176,41	0,15
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5		0,34	0,00	1,20			1.152.169,73	0,21
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5		1,16	0,02	0,05			21.797.520,68	4,07
FI BARCELONA RENDA FIXA		1,77	-0,00	1,77			524.842,25	0,10
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B		0,64	0,00	2,11			418.738,71	0,08
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	0,00	0,02			11.091.150,58	2,07
MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA		0,09	0,00	2,14			52.411,73	0,01
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5		0,43	0,00	0,82			1.076.267,43	0,20
Sub-total	0,85	0,24	0,02		-0,42	0,66	107.502.209,10	20,06

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC		0,08	-0,00	0,08			3.345.644,90	0,62
ILLUMINATI FIDC		0,25	0,00	0,29			2.058.056,65	0,38
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC		0,17	0,00	0,17			369.389,67	0,07
Sub-total	0,23	0,07	-0,00		-4,78	-0,07	5.773.091,22	1,08

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PIATÁ FI RF LONGO PRAZO		4,18	0,00	4,18			858.713,37	0,16
Sub-total	134,33	4,18	0,00		-0,06	-6,94	858.713,37	0,16

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 9,25%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP		2,33	0,00	2,33			397.983,50	0,07
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO		0,71	-0,00	0,71			2.498.938,69	0,47
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO		1,10	0,00	1,10			4.074.790,89	0,76
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		14,00	0,31	9,87			12.431.337,00	2,32
BRADESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA		14,18	0,22	8,33			8.665.175,36	1,62
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		14,16	0,32	8,35			12.788.076,25	2,39
Sub-total	25,37	11,68	0,85		-0,31	-6,77	40.856.301,69	7,62

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA		0,03	-0,00	0,04			9.608.996,51	1,79
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP		0,01	0,00	0,12			1.130.077,59	0,21
Sub-total	0,40	0,03	-0,00		-2,85	-0,11	10.739.074,10	2,00

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,39%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA DIVIDENDOS		7,63	0,03	5,33			3.457.309,80	0,65
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA		9,57	0,06	5,41			4.484.506,20	0,84
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		10,13	0,04	5,84			2.594.532,77	0,48
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		12,48	0,06	7,72			3.257.232,89	0,61
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE		8,17	0,03	4,33			2.660.445,91	0,50
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES		10,84	0,09	4,74			5.200.569,51	0,97
Sub-total	17,18	9,39	0,31		-0,73	-11,45	21.654.597,08	4,04

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 13,83%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		12,84	0,11	2,47			6.618.706,38	1,24
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		15,23	0,14	15,09			6.619.006,52	1,24
Sub-total	25,66	13,83	0,25		0,00	1,09	13.237.712,90	2,47

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,15%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO		0,16	-0,00	1,78			5.920.762,08	1,10
SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII		0,22	-0,00	1,88			414.260,46	0,08
AQUILLA RENDA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		2,66	-0,00	11,03			62.228,37	0,01
Sub-total	9,87	0,15	-0,00		0,19	2,89	6.397.250,91	1,19