



LDB
EMPRESAS

OSASCO - CONSOLIDADO
MAIO 2022



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.05.2022.

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 81,99%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	9,52	1,30	3,21	15.487.128,19	2,91
TESOURO NACIONAL	LTN 01012024 (6,030000%)	0,00	0,51	2,42	5.497.383,24	1,03
TESOURO NACIONAL	LTN 01012024 (6,100000%)	0,00	0,52	2,45	5.499.852,59	1,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,930000%)	0,52	1,38	7,11	27.303.893,29	5,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,742000%)	3,97	0,28	0,28	41.328.239,86	7,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,200000%)	2,43	1,32	6,81	27.563.877,81	5,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730001%)	4,01	1,45	4,91	43.009.807,62	8,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,740002%)	4,01	1,45	3,76	41.823.525,49	7,87
TESOURO NACIONAL	NTN-F 2029 (12,000000%)	5,24	0,99	4,74	5.353.007,82	1,01
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		1,66	1,33	5,98	212.866.715,91	40,04

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,48	0,96	4,58	17.703.588,98	3,33	6.293.749.685,70	0,28
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,46	0,90	4,57	7.833.955,49	1,47	562.238.421,06	1,39
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,59	0,77	6,17	13.130.513,95	2,47	9.450.283.491,65	0,14
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,70	0,85	6,17	23.760.641,82	4,47	11.182.665.779,99	0,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,67	0,77	6,14	7.852.923,40	1,48	6.992.058.203,56	0,11
BB	BB	BB PREV RF VII	1,54	0,65	6,84	752.135,96	0,14	257.494.076,66	0,29
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	1,54	0,65	6,84	4.310.181,75	0,81	214.031.444,23	2,01
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,61	0,53	3,08	0,00	0,00	5.396.025.552,32	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,07	1,07	4,35	27.749.919,80	5,22	7.455.971.013,11	0,37
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,17	1,05	1,95	9.130.425,35	1,72	3.429.876.365,58	0,27
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,47	0,83	4,71	112.224.286,50	21,11		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,20	1,08	4,49	28.345.739,34	5,33	12.704.053.440,98	0,22
QUELUZ	RJI	BRA1 FI RENDA FIXA	1,51	0,25	3,58	444.144,25	0,08	8.746.923,24	5,08
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	1,07	4,47	38.125.740,73	7,17	9.967.340.356,95	0,38
VERITAS	RJI	TMJ IMA-B FI RF	14,32	1,33	4,84	1.049.248,92	0,20	63.615.127,80	1,65
GENIAL	RJI	TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	4,57	0,02	1,05	1.150.252,58	0,22	82.638.539,85	1,39
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,67	0,75	6,02	21.737.336,69	4,09	1.346.062.592,73	1,61
VERITAS	RJI	FI BARCELONA RENDA FIXA	25,84	0,89	-26,99	523.437,34	0,10	35.272.056,91	1,48
BRPP	PLANNER	FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	12,93	0,65	3,10	417.360,43	0,08	14.681.138,59	2,84
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,19	0,05	1,85	0,00	0,00	2.097.589.788,62	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,18	1,10	4,59	10.972.846,05	2,06	5.183.790.691,53	0,21
VERITAS	RJI	MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA	22,86	-1,90	-8,07	53.355,74	0,01	1.635.895,91	3,26
RJI	RJI	TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1,28	0,13	2,52	1.075.643,92	0,20	53.565.609,95	2,01
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,54	1,01	4,50	103.895.105,99	19,54		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1,41	0,24	2,38	3.335.640,31	0,63	73.808.184,42	4,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
QUELUZ	PLANNER	ILLUMINATI FIDC	17,89	-0,07	-6,49	2.069.068,95	0,39	110.418.572,95	1,87
BRPP	RJI	INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	15,70	-2,40	-4,04	369.808,54	0,07	7.627.489,10	4,85
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			1,46	-0,05	-1,39	5.774.517,80	1,09		
Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
PLURAL	INTRADER	PIATÁ FI RF LONGO PRAZO	77,17	-0,01	-56,91	1.160.695,84	0,22	46.579.112,20	2,49
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			77,17	-0,01	-56,91	1.160.695,84	0,22		
Renda Fixa			3,73	1,09	4,68	435.921.322,04	81,99		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

4,60%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	18,09	4,03	13,48	3.770.632,79	0,71	246.992.960,33	1,53
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	22,15	3,20	10,00	5.001.493,06	0,94	270.643.773,95	1,85
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	24,56	-0,63	-2,77	2.906.610,01	0,55	1.528.127.935,80	0,19
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	26,52	-1,92	-3,80	3.891.036,01	0,73	748.259.041,27	0,52
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	19,56	3,07	7,71	2.973.375,88	0,56	479.743.885,81	0,62
SAFRA	SAFRA	SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES	24,89	0,36	0,69	5.911.772,59	1,11	222.216.813,28	2,66
Sub-total Artigo 8º I			20,93	1,31	3,91	24.454.920,34	4,60		
Renda Variável			18,44	1,31	3,91	24.454.920,34	4,60		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,46%

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	20,04	-4,44	-28,42	6.564.387,82	1,23	2.266.073.116,40	0,29
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	20,74	-4,24	-30,78	6.530.010,78	1,23	1.571.612.909,63	0,42
Sub-total Artigo 9º III			22,63	-4,34	-29,62	13.094.398,60	2,46		
Investimentos no Exterior			21,85	-4,34	-29,62	13.094.398,60	2,46		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,77%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ARENA CAPITAL	REAG	WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP	29,99	-0,52	10,52	393.967,90	0,07	44.491.911,22	0,89
QUELUZ	RJI	FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO	4,34	-0,10	0,56	4.070.784,96	0,77	176.568.636,80	2,31
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	18,18	0,95	-10,54	13.469.916,60	2,53	1.112.791.358,52	1,21
BRAM	BRADERCO	BRADERCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA	18,40	0,91	-10,85	9.404.712,10	1,77	1.108.488.594,18	0,85
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	18,35	0,97	-10,62	13.866.949,84	2,61	2.423.271.241,40	0,57
Sub-total Artigo 10º I			21,63	0,83	-9,48	41.206.331,40	7,75		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
A5	PLANNER	W7 FIP MULTISTRATÉGIA	0,42	-0,14	-0,61	9.620.623,40	1,81	136.133.781,03	7,07
QUELUZ	BNY MELLON	BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	0,30	-0,01	-0,22	1.130.730,14	0,21	27.882.719,06	4,06
Sub-total Artigo 10º II			0,39	-0,13	-0,57	10.751.353,54	2,02		
Investimentos Estruturados			17,18	0,63	-7,75	51.957.684,94	9,77		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,17%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GRAPHEN	RJI	HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	1,60	-0,04	0,48	5.742.398,12	1,08	72.566.996,88	7,91
VERITAS	RJI	SÃO DOMINGOS FI IMOBILIÁRIO FII	12,32	1,16	-4,56	444.684,76	0,08	89.327.355,71	0,50
REDITUS	INDIGO	AQ3 RENDA FI IMOBILIÁRIO	127,84	80,10	68,70	59.532,17	0,01	43.511.201,93	0,14
Sub-total Artigo 11º			1,20	0,47	0,42	6.246.615,05	1,17		
Fundos Imobiliários			1,20	0,47	0,42	6.246.615,05	1,17		
Total			3,34	0,91	2,03	531.674.940,97	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	21.167.976,62
Sub-total Disponibilidades Financeiras	21.167.976,62
Total	552.842.917,59

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	212.866.715,91	40,04	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	112.224.286,50	21,11	0,00	18,50	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	103.895.105,99	19,54	0,00	14,00	40,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	5.774.517,80	1,09	0,00	1,00	1,40	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	1.160.695,84	0,22	0,00	0,50	0,60	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	435.921.322,04	81,99					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	24.454.920,34	4,60	0,00	5,00	20,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	24.454.920,34	4,60					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	13.094.398,60	2,46	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	13.094.398,60	2,46					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	41.206.331,40	7,75	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	10.751.353,54	2,02	0,00	2,00	2,40	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	51.957.684,94	9,77					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	6.246.615,05	1,17	0,00	1,00	1,45	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	6.246.615,05	1,17					5,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,33 128,92	5,98 137,57	4,61 163,91	6,61 128,59		2.382.143,13	8.264.004,71
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,83 80,53	4,71 108,46	3,69 131,00	5,45 106,05		1.168.949,89	6.867.046,04
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,01 97,96	4,50 103,60	3,06 108,62			1.196.547,78	5.660.909,27
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,05 -4,39	-1,39 -32,07	-0,41 -14,52			-2.612,78	-81.583,41
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	-0,01 -1,31	-56,91 -1.310,21	-53,93 -1.916,03			-156,77	-1.533.239,86
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,31 -1,91	3,91 -2,32	1,11 2,69			315.937,08	919.774,19
Artigo 9º III % do CDI	-4,34 -420,98	-29,62 -681,82	-15,02 -533,77	-27,80 -540,80		-594.131,25	-5.346.830,60
Artigo 10º I % do CDI	0,83 80,50	-9,48 -218,17	-3,00 -106,75			339.183,26	-4.282.519,51
Artigo 10º II % do CDI	-0,13 -12,36	-0,57 -13,15	-0,35 -12,59			-13.721,53	-61.946,20
Artigo 11º % do CDI	0,47 45,60	0,42 9,70	0,73 25,88			29.280,14	26.138,17
Disponibilidades Financeiras	15.195,85	13.368,45	15.195,85	13.368,45		21.029.586,31	21.019.376,76
OSASCO - CONSOLIDADO (Total)						25.851.005,26	31.451.129,56

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LTN 01012024 (6,030000%)	5.469.354,12	0,00	0,00	0,00	5.497.383,24	28.029,12	130.001,16
LTN 01012024 (6,100000%)	5.471.495,62	0,00	0,00	0,00	5.499.852,59	28.356,97	131.507,86
NTN-B 150545	15.726.377,64	0,00	0,00	444.097,77	15.487.128,19	204.848,32	495.849,81
NTN-B 150545 (4,930000%)	27.626.226,79	0,00	0,00	701.207,01	27.303.893,29	378.873,51	1.856.298,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,742000%)	0,00	41.212.791,23	0,00	0,00	41.328.239,86	115.448,63	115.448,63
NTN-B 150840 (4,200000%)	27.204.109,66	0,00	0,00	0,00	27.563.877,81	359.768,15	1.765.962,21
NTN-B 150850 (5,730001%)	42.394.434,83	0,00	0,00	0,00	43.009.807,62	615.372,79	2.011.453,77
NTN-B 150850 (5,740002%)	41.224.780,17	0,00	0,00	0,00	41.823.525,49	598.745,32	1.515.059,05
NTN-F 2029 (12,000000%)	5.300.307,50	0,00	0,00	0,00	5.353.007,82	52.700,32	242.423,65
					212.866.715,91	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 Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	30.559.313,06	0,00	-30.722.461,75	0,00	0,00	163.148,69	918.368,83
BB PREV RF IDKA2	13.029.535,38	0,00	0,00	0,00	13.130.513,95	100.978,57	763.560,12
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	17.535.343,12	0,00	0,00	0,00	17.703.588,98	168.245,86	775.964,98
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	7.792.926,69	0,00	0,00	0,00	7.852.923,40	59.996,71	453.952,99
BB PREV RF VII	747.293,83	0,00	0,00	0,00	752.135,96	4.842,13	48.412,58
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	4.282.456,29	0,00	0,00	0,00	4.310.181,75	27.725,46	277.293,53
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	7.764.184,19	0,00	0,00	0,00	7.833.955,49	69.771,30	342.059,18
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	23.559.636,64	0,00	0,00	0,00	23.760.641,82	201.005,18	1.381.793,58
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	27.457.490,05	0,00	0,00	0,00	27.749.919,80	292.429,75	1.673.065,40
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	7.049.619,11	2.000.000,00	0,00	0,00	9.130.425,35	80.806,24	130.425,35
					112.224.286,50	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	32.516.647,16	73.405.949,58	-68.390.647,25	0,00	38.125.740,73	593.791,24	2.337.142,61
BRA1 FI RENDA FIXA	443.052,10	0,00	0,00	0,00	444.144,25	1.092,15	16.395,66
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	10.853.915,55	0,00	0,00	0,00	10.972.846,05	118.930,50	293.453,41
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	21.576.424,74	0,00	0,00	0,00	21.737.336,69	160.911,95	1.234.544,50
FI BARCELONA RENDA FIXA	518.842,17	0,00	0,00	0,00	523.437,34	4.595,17	-193.472,41
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	26.716.571,67	1.334.518,56	0,00	0,00	28.345.739,34	294.649,11	1.348.151,08

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	414.645,17	0,00	0,00	0,00	417.360,43	2.715,26	17.781,18
MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA	54.391,04	0,00	0,00	0,00	53.355,74	-1.035,30	-4.915,54
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	10.904.662,84	0,00	-10.909.860,66	0,00	0,00	5.197,82	197.731,34
TMJ IMA-B FI RF	1.059.939,03	0,00	0,00	24.740,55	1.049.248,92	14.050,44	49.511,37
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1.074.258,29	0,00	0,00	0,00	1.075.643,92	1.385,63	26.473,50
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	1.149.988,77	0,00	0,00	0,00	1.150.252,58	263,81	11.633,58
					103.895.105,99	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ILLUMINATI FIDC	2.070.455,43	0,00	0,00	0,00	2.069.068,95	-1.386,48	-143.575,20
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	378.892,09	0,00	0,00	0,00	369.808,54	-9.083,55	-15.551,35
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	3.327.783,06	0,00	0,00	0,00	3.335.640,31	7.857,25	77.543,14
					5.774.517,80	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 Financ. Ano (R\$)
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO	1.160.852,61	0,00	0,00	0,00	1.160.695,84	-156,77	-1.533.239,86
					1.160.695,84	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	2.924.986,70	0,00	0,00	0,00	2.906.610,01	-18.376,69	-82.903,35
FIA CAIXA DIVIDENDOS	3.624.729,61	0,00	0,00	0,00	3.770.632,79	145.903,18	447.853,39
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	4.846.624,08	0,00	0,00	0,00	5.001.493,06	154.868,98	454.773,79
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	3.967.169,98	0,00	0,00	0,00	3.891.036,01	-76.133,97	-153.547,78
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	2.884.831,75	0,00	0,00	0,00	2.973.375,88	88.544,13	212.877,31
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES	5.890.641,14	0,00	0,00	0,00	5.911.772,59	21.131,45	40.720,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					24.454.920,34	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	6.869.172,39	0,00	0,00	0,00	6.564.387,82	-304.784,57	-2.554.478,55
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	6.819.357,46	0,00	0,00	0,00	6.530.010,78	-289.346,68	-2.792.352,05
					13.094.398,60	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA	9.320.307,33	0,00	0,00	0,00	9.404.712,10	84.404,77	-1.107.855,53
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13.733.275,32	0,00	0,00	0,00	13.866.949,84	133.674,52	-1.647.202,94
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO	4.074.979,75	0,00	0,00	0,00	4.070.784,96	-4.194,79	22.521,94
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	13.342.540,60	0,00	0,00	0,00	13.469.916,60	127.376,00	-1.587.430,27
WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP	396.045,14	0,00	0,00	0,00	393.967,90	-2.077,24	37.447,29
					41.206.331,40	0,00	0,00

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	1.130.816,24	0,00	0,00	0,00	1.130.730,14	-86,10	-2.539,38
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	9.634.258,83	0,00	0,00	0,00	9.620.623,40	-13.635,43	-59.406,82
					10.751.353,54	0,00	0,00

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AQ3 RENDA FI IMOBILIÁRIO	33.055,73	0,00	0,00	0,00	0,00	59.532,17	26.476,44	24.244,02
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	5.744.801,34	0,00	0,00	0,00	0,00	5.742.398,12	-2.403,22	27.402,11
SÃO DOMINGOS FI IMOBILIÁRIO FII	449.434,13	0,00	0,00	0,00	9.956,29	444.684,76	5.206,92	-25.507,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
						6.246.615,05	0,00	0,00

Disponibilidades Financeiras

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	138.390,31	0,00	0,00	0,00	21.167.976,62	21.029.586,31	21.019.376,76
					21.167.976,62	0,00	0,00

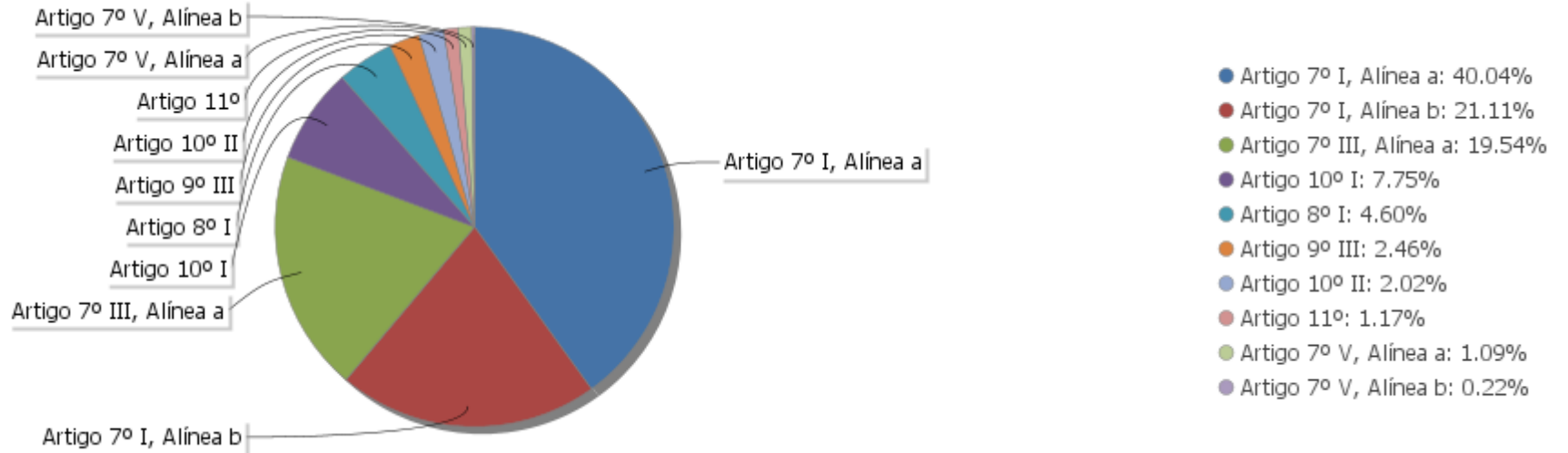
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

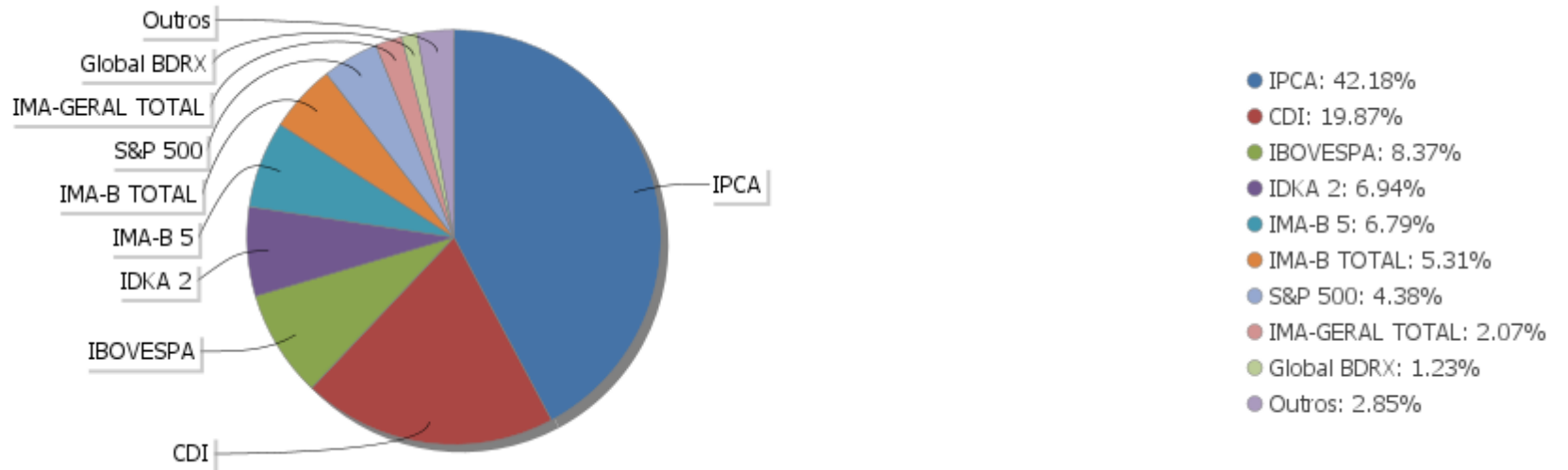
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	288.810.713,11	54,32	288.810.713,11	54,32
de 31 a 365 dias	17.589.551,12	3,31	306.400.264,23	57,63
acima de 365 dias	225.274.676,74	42,37	531.674.940,97	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

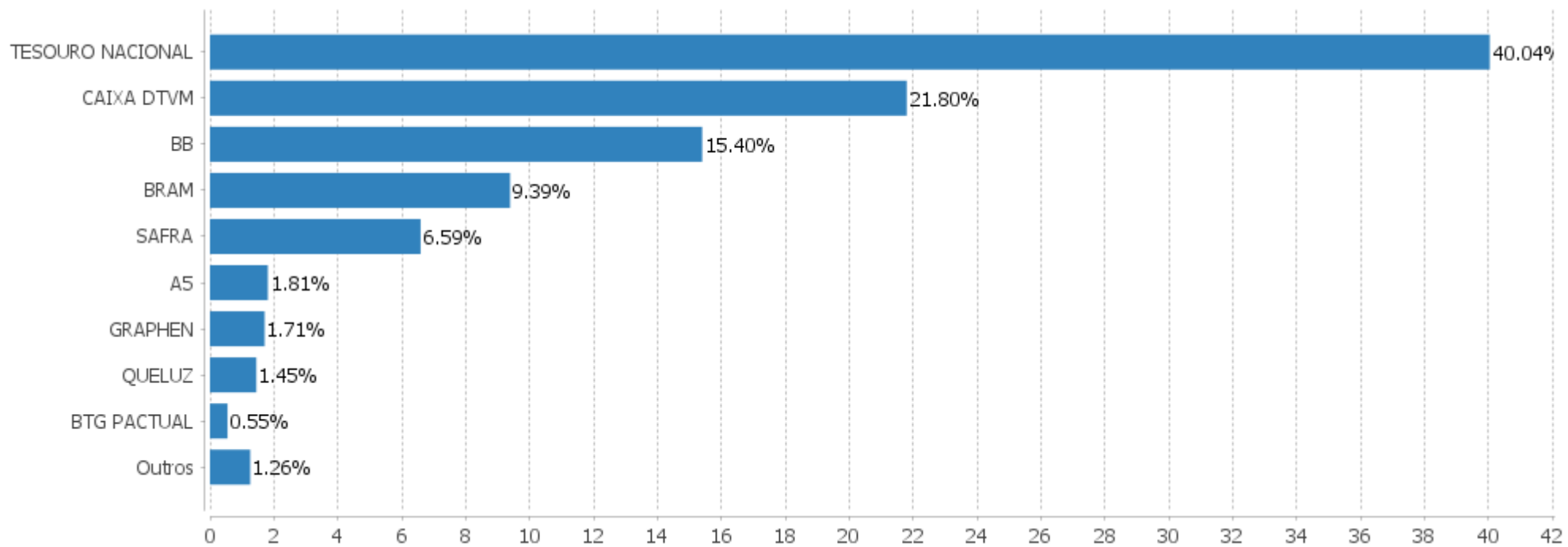


Alocação Por Estratégia



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	0,91								2,03
IPCA + 4,95% p.p. indexador	0,95	1,38	2,05	1,43	0,89								6,87
	-1,18	-1,28	-0,25	-1,96	0,01								-4,84
2021									-0,22	-0,44	1,12	1,14	1,59
IPCA + 5,45% p.p. indexador									1,61	1,68	1,38	1,22	6,01
									-1,83	-2,12	-0,26	-0,08	-4,42

Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

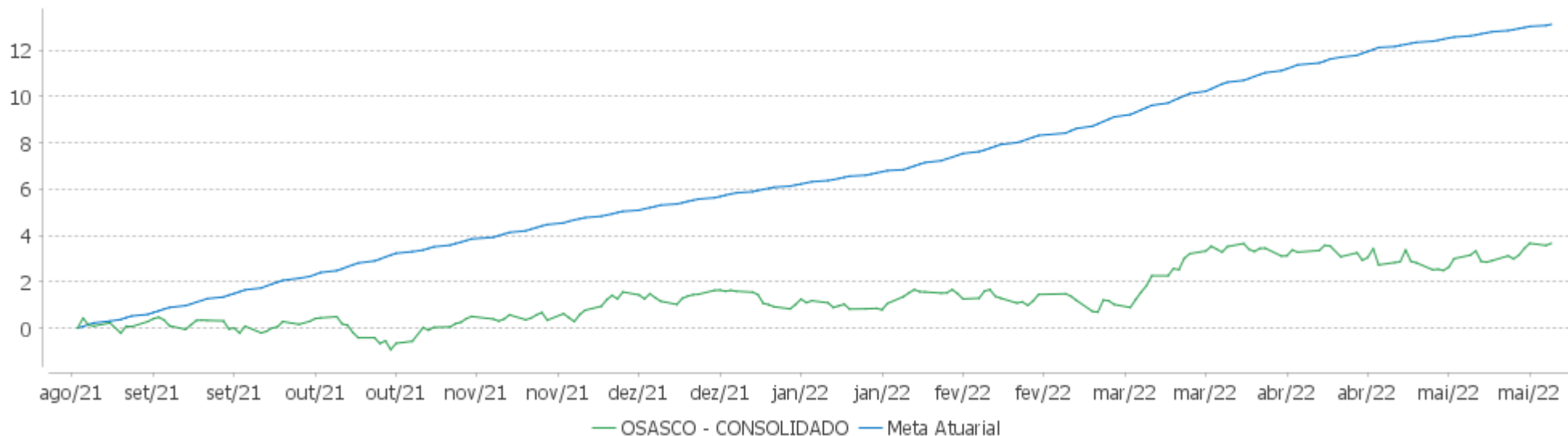
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	1	11,11
Meses abaixo - Meta Atuarial	8	88,89

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,80	2022-03
Menor rentabilidade da Carteira	-0,53	2022-04

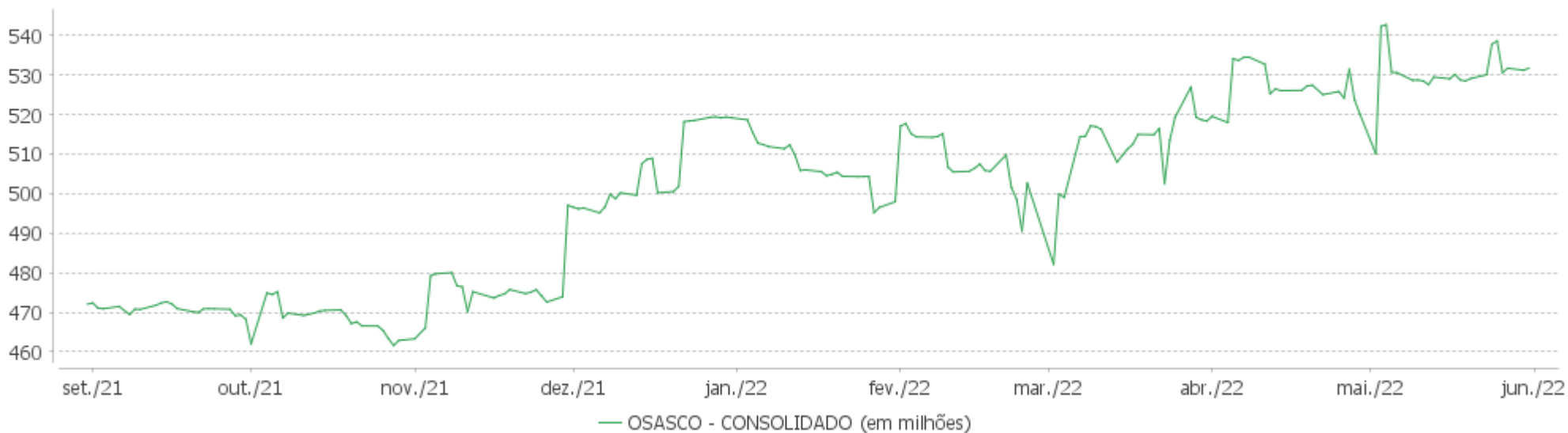
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,18	4,43	-2,25	3,97
06 meses	3,20	8,18	-4,98	3,36
12 meses				
24 meses				
Desde 31/08/2021	3,66	13,30	-9,64	3,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

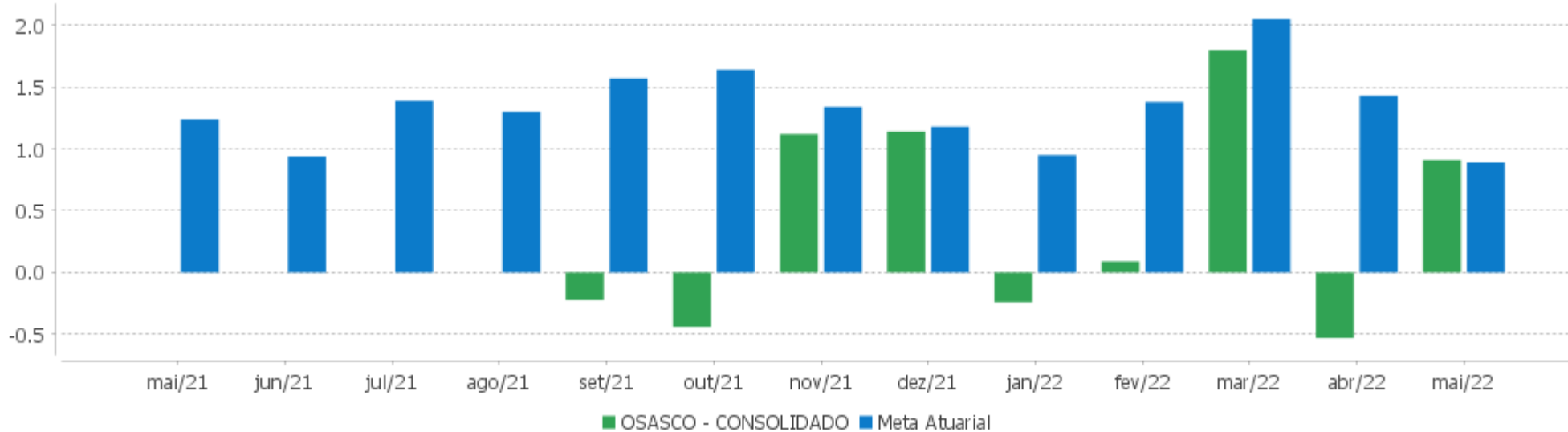


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,90 -2,87	-8,07 -12,80	-5,19 -10,12	-9,42 -14,38	-36,47 -41,07	-96,68 -110,86	-97,19 -119,00
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,65 -0,31	3,10 -1,63	1,89 -3,04	2,39 -2,57	5,82 1,23	-3,90 -18,08	-21,77 -43,58
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,75 -0,04	6,02 -0,23	4,85 -0,17	6,84 -0,25	9,01 -0,54	16,08 -1,57	27,04 -1,74
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,10 106,28	4,59 105,56	2,93 104,02	5,43 105,69	8,57 108,59	11,10 108,36	15,66 100,22
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,07 103,41	4,47 102,93	2,84 100,83	5,31 103,21	8,23 104,30	10,70 104,45	15,42 98,68
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,02 -0,76	1,05 -5,21	1,48 -3,54	0,84 -6,25	-4,17 -13,72	-66,35 -84,00	-74,01 -102,79
FI BARCELONA RENDA FIXA % do CDI	0,89 85,90	-26,99 -621,26	-27,99 -994,52	-26,46 -514,81	-25,20 -319,29	-27,79 -271,33	-25,68 -164,30
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,08 104,41	4,49 103,32	2,83 100,55	5,28 102,65	8,37 106,04	10,69 104,34	15,39 98,47
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,13 -0,65	2,52 -3,73	2,05 -2,97	2,64 -4,45	1,42 -8,13	-24,71 -42,36	-34,93 -63,70
BRA1 FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,25 -0,72	3,58 -1,15	3,14 -1,79	3,90 -1,06	3,17 -1,42	1,93 -12,25	-67,74 -89,55
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	1,10 106,26	4,58 105,52	2,91 103,48	5,43 105,67	8,55 108,32	11,16 108,97	15,62 99,95
TMJ IMA-B FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,33 0,36	4,84 0,11	5,62 0,69	5,61 0,65	-6,15 -10,75	-39,32 -53,50	-44,20 -66,00
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	0,65 -0,13	6,84 0,59	5,06 0,04	7,46 0,37	11,81 2,26	20,69 3,04	32,30 3,52
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,65 -0,32	6,84 2,12	5,06 0,13	7,47 2,50	11,81 7,22	19,48 5,30	27,02 5,21
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,77 -0,08	6,17 -0,17	4,95 -0,02	6,92 -0,30	9,45 0,21	17,95 -0,54	27,46 -1,73
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,82	3,37	2,70	4,32	3,78	7,35	15,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,07	4,35	2,83	5,21	3,49	7,06	19,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,60	-0,44	-0,35	-0,34	-8,24	-13,67	-3,10
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,85	6,17	4,95	6,94	9,11	17,79	27,49
Var. IDKA 2 p.p.	0,00	-0,17	-0,02	-0,29	-0,13	-0,70	-1,70
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,77	6,14	4,95	6,94	9,18	16,95	27,79
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,01	-0,12	-0,07	-0,15	-0,37	-0,70	-0,99
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,96	4,58	4,83	4,80	4,24	13,52	20,88
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,14	-0,10	-0,17	-0,35	-0,66	-0,93
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	1,05	4,29	2,71	5,07	7,89	9,88	15,02
% do CDI	101,92	98,77	96,26	98,58	100,00	96,51	96,09
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	0,90	4,57	4,83	4,78	4,22	13,39	20,55
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,07	-0,16	-0,10	-0,19	-0,37	-0,79	-1,26
NTN-B 150545	1,30	3,21	4,55	1,75	-2,41	9,89	13,00
Var. IPCA p.p.	0,83	-1,58	1,37	-3,80	-14,14	-10,84	-10,00
NTN-B 150555 (5,742000%)	-1,35	4,48	2,16	5,81	12,04	20,26	22,66
Var. IPCA p.p.	-1,82	-0,30	-1,02	0,26	0,31	-0,47	-0,33
NTN-B 150545 (4,930000%)	1,38	7,11	4,86	8,40	17,59	25,91	28,13
Var. IPCA p.p.	0,91	2,33	1,68	2,85	5,86	5,18	5,13
LTN 01012024 (6,030000%)	0,51	2,42	1,47	2,97	6,03	12,40	19,15
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,40	-1,62	-1,58	-1,97	0,77	2,72	1,14
NTN-F 2029 (12,000000%)	0,99	4,74	2,87	5,83	6,29	7,10	7,83
Var. SELIC p.p.	-0,04	0,40	0,06	0,69	-1,61	-3,14	-7,80
NTN-B 150840 (4,200000%)	1,32	6,81	4,68	8,02	14,03	21,68	23,43
Var. IPCA p.p.	0,85	2,02	1,50	2,47	2,30	0,95	0,43
LTN 01012024 (6,100000%)	0,52	2,45	1,49	3,00	6,10	12,55	19,38
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,40	-1,59	-1,56	-1,94	0,84	2,86	1,38
NTN-B 150850 (5,730001%)	1,45	4,48	5,06	5,81	12,03	20,23	22,62
Var. IPCA p.p.	0,98	-0,31	1,88	0,26	0,29	-0,50	-0,38
NTN-B 150850 (5,740002%)	1,45	4,48	5,06	5,81	12,03	20,23	22,62
Var. IPCA p.p.	0,98	-0,31	1,88	0,26	0,30	-0,50	-0,37
PIATÁ FI RF LONGO PRAZO	-0,01	-56,91	-53,93	-56,98	-57,37	-57,89	-44,18
% do CDI	-1,30	-1.310,21	-1.916,03	-1.108,39	-726,80	-565,23	-282,71
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	0,24	2,38	1,50	2,51	3,85	-0,51	-7,05
% do CDI	22,90	54,79	53,29	48,84	48,78	-4,94	-45,13
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	-2,40	-4,04	-3,38	-4,41	-21,09		
% do CDI	-232,53	-92,90	-120,18	-85,84	-267,17		
ILLUMINATI FIDC	-0,07	-6,49	-2,82	-9,73	-10,06	-11,44	-17,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,05	-13,80	-7,51	-18,40	-28,49	-47,06	-64,30
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,63 -3,85	-2,77 -9,00	-5,44 -3,85	-3,44 -12,70	-35,70 -23,92	-13,94 -41,34	-10,95 -25,71
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p.	3,07 -0,15	7,71 1,48	6,63 8,21	13,94 4,68	-5,96 5,82	47,16 19,76	
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA Var. IBOVESPA p.p.	3,20 -0,03	10,00 3,77	5,42 7,01	13,36 4,11	-1,97 9,81	30,23 2,83	33,35 18,59
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-1,92 -5,14	-3,80 -10,02	-2,40 -0,82	0,29 -8,97	-27,69 -15,91	10,89 -16,51	8,25 -6,51
FIA CAIXA DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	4,03 0,80	13,48 7,25	8,40 9,98	15,21 5,95	-0,98 10,80	24,26 -3,14	23,56 8,80
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	0,36 -2,86	0,69 -5,53	-3,32 -1,73	3,18 -6,08	-26,38 -14,61	12,16 -15,24	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-4,44 -0,12	-28,42 -0,24	-14,62 -0,09	-27,20 -0,25	-14,82 -1,78	13,58 -3,06	74,74 -4,50
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	-4,24 -7,46	-30,78 -37,01	-15,43 -13,85	-28,39 -37,65	-16,29 -4,51	9,34 -18,06	59,51 44,75
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO % do CDI	-0,10 -9,98	0,56 12,81	1,24 44,10	0,53 10,41	-3,79 -48,04	-0,49 -4,78	-16,33 -104,50
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	0,97 4,83	-10,62 15,92	-3,59 9,69	-5,65 18,22	4,99 16,16	42,87 24,59	57,03 -23,15
WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP Var. IPCA + 7,00% p.p.	-0,52 -1,59	10,52 2,80	13,56 8,62	9,95 0,76	-22,24 -41,79	-20,24 -58,43	-30,84 -81,43
BRADESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA Var. S&P 500 p.p.	0,91 4,77	-10,85 15,68	-3,69 9,60	-5,97 17,90	4,30 15,46	42,50 24,21	58,75 -21,43
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	0,95 -2,27	-10,54 -16,77	-3,56 -1,97	-5,69 -14,95	4,81 16,59	42,65 15,25	58,30 43,54
W7 FIP MULTISTRATÉGIA % do CDI	-0,14 -13,73	-0,61 -14,09	-0,38 -13,58	-0,75 -14,50	-1,46 -18,48	1,41 13,80	-0,57 -3,64
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,01 -0,99	-0,22 -7,53	-0,12 -4,81	-0,33 -9,00	-0,97 -19,41	-2,69 -38,31	29,06 -17,36
SÃO DOMINGOS FI IMOBILIÁRIO FII Var. IFIX p.p.	1,16 0,90	-4,56 -5,11	1,44 -1,45	-3,55 -12,94	-0,57 -0,71	32,01 25,89	-11,56 -22,05
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO Var. IFIX p.p.	-0,04 -0,30	0,48 -0,08	0,24 -2,65	0,56 -8,83	1,99 1,85	3,96 -2,16	4,18 -6,31
AQ3 RENDA FI IMOBILIÁRIO	-1,66	68,70	72,07	65,61	-47,15		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-4,88	62,48	73,66	56,35	-35,37		
OSASCO - CONSOLIDADO	0,91	2,03	2,18	3,20			
Var. IPCA + 4,95% p.p.	0,01	-4,84	-2,25	-4,94			
CDI	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63
IBOVESPA	3,22	6,23	-1,58	9,26	-11,78	27,40	14,76
INPC + 6,00%	0,96	7,49	4,75	8,85	18,61	36,88	48,04
IPCA + 6,00%	0,98	7,31	4,69	8,67	18,43	35,62	46,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AQ3 RENDA FI IMOBILIÁRIO	Não se aplica	Não se aplica				
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
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
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA			D+0	D+1 du		1,20
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRADESCO 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	1,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					base em 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 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						
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
SÃO DOMINGOS FI IMOBILIÁRIO 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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,95	4,02	2,61	4,93	6,43	8,67	15,54	23,85	33,97
IRF-M 1+	0,39	0,65	0,67	2,95	-0,89	-1,17	12,32	30,13	44,56
IRF-M TOTAL	0,58	1,82	1,31	3,74	1,60	2,33	13,90	29,08	42,46
IMA-B 5	0,78	6,25	5,02	7,09	9,55	17,65	28,78	45,80	60,12
IMA-B 5+	1,16	3,17	4,84	2,82	-0,25	10,41	15,02	52,46	63,45
IMA-B TOTAL	0,96	4,73	4,93	4,96	4,59	14,18	21,81	50,71	63,86
IMA-GERAL TOTAL	0,92	4,04	3,06	4,94	5,26	9,68	18,01	34,24	46,62
IDKA 2	0,85	6,35	4,97	7,23	9,24	18,49	29,19	44,76	60,19
IDKA 20	1,21	0,35	3,98	-1,94	-10,01	4,21	1,84	54,09	61,61
CDI	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63	22,99	32,44

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,22	6,23	-1,58	9,26	-11,78	27,40	14,76	45,08	77,56
IBRX 100	3,23	6,61	-1,68	9,95	-12,43	29,27	17,73	50,94	83,12
IBRX 50	3,30	6,74	-2,55	10,76	-11,91	31,55	16,59	45,38	78,31
SMALL CAP	-1,82	-4,02	-2,10	-0,37	-26,87	15,36	13,41	44,72	71,86
IFIX	0,26	0,56	2,89	9,39	0,14	6,12	10,49	27,39	37,13
Índice Consumo - ICON	-3,02		-12,01	-12,30	-36,86	-19,27	-13,06	7,05	10,44
Índice Dividendos - IDIV	4,26	14,16	8,74	15,99	2,41	41,18	33,41	82,88	105,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,47	4,78	3,18	5,55	11,73	20,73	23,00	28,73	32,40
INPC	0,45	4,96	3,23	5,73	11,90	21,85	24,35	30,30	32,59
IGPM	0,52	7,54	3,71	8,47	10,72	51,73	61,61	73,96	81,38
SELIC	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63	23,00	32,46

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-3,86	-26,53	-13,29	-23,87	-11,17	18,29	80,18	91,96	149,78
MSCI ACWI	-3,99	-26,71	-14,01	-24,39	-17,07	11,67	59,19	61,99	105,20

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,81	6,48	4,20	7,64	16,20	30,56	38,31	50,52	60,94
IPCA + 5,00%	0,90	6,90	4,45	8,16	17,32	33,08	42,33	56,38	68,79
IPCA + 5,50%	0,94	7,10	4,57	8,41	17,88	34,35	44,37	59,37	72,83
IPCA + 5,89%	0,97	7,26	4,67	8,61	18,31	35,34	45,97	61,73	76,03
IPCA + 6,00%	0,98	7,31	4,69	8,67	18,43	35,62	46,43	62,40	76,94
INPC + 4,00%	0,79	6,66	4,25	7,82	16,37	31,77	39,83	52,36	61,17
INPC + 6,00%	0,96	7,49	4,75	8,85	18,61	36,88	48,04	64,38	77,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3421	02/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	18.108,47	7.271,28891300	2,4904071640
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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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
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
Total			117.953.259,37	110.022.969,66		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 8.562.514,57

Value-At-Risk: 1,61%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
OSASCO - CONSOLIDADO		1,61	1,61			531.674.940,97	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,44%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545		3,73	0,06	3,72			15.487.128,19	2,91
LTN 01012024 (6,030000%)		0,00	-0,00	1,02			5.497.383,24	1,03
LTN 01012024 (6,100000%)		0,00	0,00	1,02			5.499.852,59	1,03
NTN-B 150545 (4,930000%)		0,26	0,00	0,27			27.303.893,29	5,14
NTN-B 150555 (5,742000%)		0,39	-0,00	0,39			41.328.239,86	7,77
NTN-B 150840 (4,200000%)		0,26	0,00	0,27			27.563.877,81	5,18
NTN-B 150850 (5,730001%)		0,39	-0,00	0,41			43.009.807,62	8,09
NTN-B 150850 (5,740002%)		0,39	-0,00	0,41			41.823.525,49	7,87
NTN-F 2029 (12,000000%)		0,00	-0,00	0,00			5.353.007,82	1,01
Sub-total	0,86	0,31	0,05		0,35	1,33	212.866.715,91	40,04

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		2,07	0,04	0,03			17.703.588,98	3,33
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		2,07	0,02	0,04			7.833.955,49	1,47
BB PREV RF IDKA2		1,26	0,01	0,25			13.130.513,95	2,47
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,35	0,03	0,33			23.760.641,82	4,47
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,10	0,01	0,03			7.852.923,40	1,48
BB PREV RF VII		0,69	0,00	2,06			752.135,96	0,14
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP		0,69	0,00	0,94			4.310.181,75	0,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,54	0,01	0,55			27.749.919,80	5,22
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI		0,04	0,00	0,03			9.130.425,35	1,72
Sub-total	2,42	1,04	0,11		-0,08	0,83	112.224.286,50	21,11

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	0,03			28.345.739,34	5,33
BRA1 FI RENDA FIXA		0,61	0,00	1,84			444.144,25	0,08
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,04	0,00	0,03			38.125.740,73	7,17
TMJ IMA-B FI RF		0,71	-0,00	2,25			1.049.248,92	0,20
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5		0,46	0,00	1,23			1.150.252,58	0,22
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5		1,12	0,02	0,05			21.737.336,69	4,09
FI BARCELONA RENDA FIXA		1,76	-0,00	1,76			523.437,34	0,10
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B		0,64	0,00	2,03			417.360,43	0,08
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,04	0,00	0,02			10.972.846,05	2,06
MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA		0,09	0,00	2,07			53.355,74	0,01
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5		0,43	0,00	0,78			1.075.643,92	0,20
Sub-total	0,43	0,24	0,02		-0,05	1,01	103.895.105,99	19,54

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC		0,11	-0,00	0,11			3.335.640,31	0,63
ILLUMINATI FIDC		0,31	-0,00	0,34			2.069.068,95	0,39
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC		0,19	0,00	0,19			369.808,54	0,07
Sub-total	0,15	0,08	-0,00		-7,03	-0,05	5.774.517,80	1,09

Artigo 7º V, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PIATÁ FI RF LONGO PRAZO		3,86	0,00	3,86			1.160.695,84	0,22
Sub-total	0,05	3,86	0,00		-22,85	-0,01	1.160.695,84	0,22

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 9,32%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP		2,25	0,00	2,25			393.967,90	0,07
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO		0,99	0,00	0,99			4.070.784,96	0,77
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		13,07	0,31	10,55			13.469.916,60	2,53
BRADESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA		13,24	0,22	8,20			9.404.712,10	1,77
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		13,22	0,33	8,23			13.866.949,84	2,61
Sub-total	27,14	11,75	0,86		-0,01	0,83	41.206.331,40	7,75

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
W7 FIP MULTISTRATÉGIA		0,03	-0,00	0,04			9.620.623,40	1,81
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP		0,01	0,00	0,12			1.130.730,14	0,21
Sub-total	0,43	0,03	-0,00		-2,68	-0,13	10.751.353,54	2,02

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,80%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA DIVIDENDOS		8,46	0,04	5,30			3.770.632,79	0,71
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA		9,98	0,07	5,66			5.001.493,06	0,94
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		10,98	0,04	5,84			2.906.610,01	0,55
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		12,89	0,07	7,69			3.891.036,01	0,73
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE		8,77	0,04	4,56			2.973.375,88	0,56
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES		10,80	0,09	5,09			5.911.772,59	1,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	20,36	9,80	0,35		0,01	1,31	24.454.920,34	4,60

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 11,90%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		10,80	0,09	1,87			6.564.387,82	1,23
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		13,50	0,12	14,14			6.530.010,78	1,23
Sub-total	25,76	11,90	0,21		-0,21	-4,34	13.094.398,60	2,46

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,03%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO		0,02	-0,00	2,21			5.742.398,12	1,08
SÃO DOMINGOS FI IMOBILIÁRIO FII		0,21	-0,00	2,30			444.684,76	0,08
AQ3 RENDA FI IMOBILIÁRIO		2,40	-0,00	10,33			59.532,17	0,01
Sub-total	1,53	0,03	-0,00		-0,37	0,47	6.246.615,05	1,17