



**LDB**  
EMPRESAS

**OSASCO - CONSOLIDADO**  
JUNHO 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. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	9,46	-1,63	1,53	15.235.219,30	2,84
TESOURO NACIONAL	LTN 01012024 (6,030000%)	0,00	0,49	2,92	5.524.272,30	1,03
TESOURO NACIONAL	LTN 01012024 (6,100000%)	0,00	0,49	2,96	5.527.057,70	1,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,930000%)	0,53	0,93	8,10	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	7,73	27.803.064,49	5,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730001%)	4,01	0,99	5,95	43.435.748,56	8,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,740002%)	4,01	0,99	4,79	42.238.018,01	7,88
TESOURO NACIONAL	NTN-F 2029 (12,000000%)	5,24	0,95	5,73	5.403.801,40	1,01
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>1,57</b>	<b>0,75</b>	<b>6,77</b>	<b>214.461.935,55</b>	<b>40,02</b>

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,42	-0,35	4,22	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	4,16	7.803.287,86	1,46	561.265.385,95	1,39
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,59	0,27	6,46	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	6,41	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. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,61	0,32	6,47	7.877.871,31	1,47	6.996.220.208,06	0,11
BB	BB	BB PREV RF VII	1,69	0,31	7,18	754.477,06	0,14	258.295.551,92	0,29
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	1,69	0,31	7,17	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	4,59	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	2,99	11.230.337,54	2,10	3.689.784.641,04	0,30
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,49</b>	<b>0,18</b>	<b>4,90</b>	<b>114.423.943,92</b>	<b>21,35</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,20	1,06	5,60	28.841.451,62	5,38	12.613.402.228,26	0,23
QUELUZ	RJI	BRA1 FI RENDA FIXA	1,72	0,26	3,85	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	5,54	41.367.144,36	7,72	9.838.414.136,64	0,42
VERITAS	RJI	TMJ IMA-B FI RF	32,13	-24,60	-20,95	791.176,41	0,15	47.968.395,99	1,65
GENIAL	RJI	TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	4,38	0,17	1,22	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	6,31	21.797.520,68	4,07	1.352.871.181,17	1,61
VERITAS	RJI	FI BARCELONA RENDA FIXA	25,85	0,27	-26,79	524.842,25	0,10	35.366.727,00	1,48
BRPP	PLANNER	FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	12,86	0,33	3,44	418.738,71	0,08	14.729.621,10	2,84
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,18	1,08	5,71	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	-9,70	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	2,58	1.076.267,43	0,20	53.596.660,28	2,01
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,60</b>	<b>0,66</b>	<b>5,19</b>	<b>107.502.209,10</b>	<b>20,06</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1,44	0,23	2,69	3.345.644,90	0,62	74.029.557,03	4,52
QUELUZ	PLANNER	ILLUMINATI FIDC	17,89	-0,53	-6,99	2.058.056,65	0,38	110.418.572,95	1,86
BRPP	RJI	INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	15,70	-0,11	-4,14	369.389,67	0,07	7.618.849,75	4,85
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>			<b>1,33</b>	<b>-0,07</b>	<b>-1,42</b>	<b>5.773.091,22</b>	<b>1,08</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	85,97	-6,94	-59,90	858.713,37	0,16	34.460.454,63	2,49
		<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea b</b>	<b>85,97</b>	<b>-6,94</b>	<b>-59,90</b>	<b>858.713,37</b>	<b>0,16</b>		
		Renda Fixa	3,54	0,56	5,27	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. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	18,21	-8,31	4,05	3.457.309,80	0,65	228.591.211,08	1,51
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	22,51	-10,34	-1,37	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	-13,21	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	-19,47	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	-3,62	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	-11,42	5.200.569,51	0,97	186.337.490,13	2,79
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>20,61</b>	<b>-11,45</b>	<b>-7,99</b>	<b>21.654.597,08</b>	<b>4,04</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>18,50</b>	<b>-11,45</b>	<b>-7,99</b>	<b>21.654.597,08</b>	<b>4,04</b>		

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. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	21,13	0,83	-27,83	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	-29,84	6.619.006,52	1,24	1.420.707.173,52	0,47
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>22,94</b>	<b>1,09</b>	<b>-28,85</b>	<b>13.237.712,90</b>	<b>2,47</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>22,22</b>	<b>1,09</b>	<b>-28,85</b>	<b>13.237.712,90</b>	<b>2,47</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,63%

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	30,31	1,02	11,65	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	0,66	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	-17,44	12.431.337,00	2,32	948.117.020,14	1,31
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA	20,01	-7,86	-17,86	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	-17,57	12.788.076,25	2,39	2.072.988.175,00	0,62
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>22,24</b>	<b>-6,77</b>	<b>-15,61</b>	<b>40.856.301,69</b>	<b>7,62</b>		

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	-0,12	-0,73	9.608.996,51	1,79	136.133.781,03	7,06
QUELUZ	BNY MELLON	BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	0,29	-0,06	-0,28	1.130.077,59	0,21	27.804.185,53	4,06
<b>Sub-total Artigo 10º II</b>			<b>0,39</b>	<b>-0,11</b>	<b>-0,68</b>	<b>10.739.074,10</b>	<b>2,00</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>17,62</b>	<b>-5,42</b>	<b>-12,75</b>	<b>51.595.375,79</b>	<b>9,63</b>		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,19%

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	3,16	3,11	3,60	5.920.762,08	1,10	74.820.991,99	7,91
VERITAS	RJI	SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	12,32	-0,12	-4,68	414.260,46	0,08	83.215.784,41	0,50
REDITUS	INDIGO	AQUILLA RENDA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	127,93	4,53	76,34	62.228,37	0,01	74.329.618,05	0,08
<b>Sub-total Artigo 11º</b>			<b>4,21</b>	<b>2,89</b>	<b>3,32</b>	<b>6.397.250,91</b>	<b>1,19</b>		
<b>Fundos Imobiliários</b>			<b>4,21</b>	<b>2,89</b>	<b>3,32</b>	<b>6.397.250,91</b>	<b>1,19</b>		
<b>Total</b>			<b>3,31</b>	<b>-0,52</b>	<b>1,51</b>	<b>535.904.829,84</b>	<b>100,00</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	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
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>443.019.893,16</b>	<b>82,67</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	21.654.597,08	4,04	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>21.654.597,08</b>	<b>4,04</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	13.237.712,90	2,47	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>13.237.712,90</b>	<b>2,47</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
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
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>51.595.375,79</b>	<b>9,63</b>					15,00
<b>Fundos Imobiliários</b>								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	6.397.250,91	1,19	0,00	1,00	1,45	0,00	5,00
	<b>Total Fundos Imobiliários</b>	<b>6.397.250,91</b>	<b>1,19</b>					5,00
<b>Total</b>		<b>535.904.829,84</b>	<b>100,00</b>					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,75 73,94	6,77 125,34	3,57 122,91	6,77 125,34		1.595.219,64	9.859.224,35
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,18 17,60	4,90 90,68	2,03 69,85	4,90 90,68		199.657,42	7.066.703,46
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,66 64,89	5,19 96,04	2,59 89,03	5,19 96,04		733.010,70	6.393.919,97
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,07 -6,42	-1,42 -26,24	-0,29 -9,85	-1,42 -26,24		-3.761,35	-83.009,99
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	-6,94 -684,41	-59,90 -1.109,02	-56,88 -1.957,11	-59,90 -1.109,02		-2.632,86	-1.535.872,72
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-11,45 0,05	-7,99 -2,00	-16,65 1,23	-7,99 -2,00		-2.800.323,26	-1.880.549,07
Artigo 9º III % do CDI	1,09 107,98	-28,85 -534,06	-10,22 -351,48	-28,85 -534,06		143.314,30	-5.203.516,30
Artigo 10º I % do CDI	-6,77 -668,44	-15,61 -289,00	-13,11 -451,05	-15,61 -289,00		-2.850.029,71	-7.132.549,22
Artigo 10º II % do CDI	-0,11 -11,27	-0,68 -12,68	-0,35 -12,01	-0,68 -12,68		-12.279,44	-74.225,64
Artigo 11º % do CDI	2,89 285,10	3,32 61,52	3,48 119,71	3,32 61,52		180.504,74	206.642,91
Disponibilidades Financeiras	0,00	-11,95	0,00	-11,95		0,00	-10.209,55
<b>OSASCO - CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>-2.817.319,82</b>	<b>7.606.558,20</b>

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LTN 01012024 (6,030000%)	5.497.383,24	0,00	0,00	0,00	5.524.272,30	26.889,06	156.890,22
LTN 01012024 (6,100000%)	5.499.852,59	0,00	0,00	0,00	5.527.057,70	27.205,11	158.712,97
NTN-B 150545	15.487.128,19	0,00	0,00	0,00	15.235.219,30	-251.908,89	243.940,92
NTN-B 150545 (4,930000%)	27.303.893,29	0,00	0,00	0,00	27.556.841,13	252.947,84	2.109.246,41

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (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	2.005.148,89
NTN-B 150850 (5,730001%)	43.009.807,62	0,00	0,00	0,00	43.435.748,56	425.940,94	2.437.394,71
NTN-B 150850 (5,740002%)	41.823.525,49	0,00	0,00	0,00	42.238.018,01	414.492,52	1.929.551,57
NTN-F 2029 (12,000000%)	5.353.007,82	0,00	0,00	0,00	5.403.801,40	50.793,58	293.217,23
					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 Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IDKA2	13.130.513,95	0,00	0,00	0,00	13.165.455,04	34.941,09	798.501,21
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	713.518,26
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	478.900,90
BB PREV RF VII	752.135,96	0,00	0,00	0,00	754.477,06	2.341,10	50.753,68
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	4.310.181,75	0,00	0,00	0,00	4.323.567,82	13.386,07	290.679,60
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	311.391,55
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	1.435.097,65
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	1.737.004,74
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	230.337,54
					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 Financ. Ano (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	2.842.074,71
BRA1 FI RENDA FIXA	444.144,25	0,00	0,00	55.854,91	389.335,60	1.046,26	17.441,92
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	10.972.846,05	0,00	0,00	0,00	11.091.150,58	118.304,53	411.757,94
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	1.294.728,49
FI BARCELONA RENDA FIXA	523.437,34	0,00	0,00	0,00	524.842,25	1.404,91	-192.067,50
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	1.650.387,57
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	417.360,43	0,00	0,00	0,00	418.738,71	1.378,28	19.159,46

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA	53.355,74	0,00	0,00	0,00	52.411,73	-944,01	-5.859,55
TMJ IMA-B FI RF	1.049.248,92	0,00	0,00	0,00	791.176,41	-258.072,51	-208.561,14
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1.075.643,92	0,00	0,00	0,00	1.076.267,43	623,51	27.097,01
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	1.150.252,58	0,00	0,00	0,00	1.152.169,73	1.917,15	13.550,73
					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 Financ. Ano (R\$)
ILLUMINATI FIDC	2.069.068,95	0,00	0,00	0,00	2.058.056,65	-11.012,30	-154.587,50
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	369.808,54	0,00	0,00	0,00	369.389,67	-418,87	-15.970,22
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	3.337.975,08	0,00	0,00	0,00	3.345.644,90	7.669,82	87.547,73
					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 Financ. Ano (R\$)
PIATÁ FI RF LONGO PRAZO	1.160.695,84	0,00	0,00	299.349,61	858.713,37	-2.632,86	-1.535.872,72
					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 Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	2.906.610,01	0,00	0,00	0,00	2.594.532,77	-312.077,24	-394.980,59
FIA CAIXA DIVIDENDOS	3.770.632,79	0,00	0,00	0,00	3.457.309,80	-313.322,99	134.530,40
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	5.001.493,06	0,00	0,00	0,00	4.484.506,20	-516.986,86	-62.213,07
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	3.891.036,01	0,00	0,00	0,00	3.257.232,89	-633.803,12	-787.350,90
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	2.973.375,88	0,00	0,00	0,00	2.660.445,91	-312.929,97	-100.052,66
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	-670.482,25
					21.654.597,08	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	6.564.387,82	0,00	0,00	0,00	6.618.706,38	54.318,56	-2.500.159,99	
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	-2.703.356,31	
					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 Financ. Ano (R\$)	
BRADESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA	9.404.712,10	0,00	0,00	0,00	8.665.175,36	-739.536,74	-1.847.392,27	
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13.866.949,84	0,00	0,00	0,00	12.788.076,25	-1.078.873,59	-2.726.076,53	
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO	4.070.784,96	0,00	0,00	0,00	4.074.790,89	4.005,93	26.527,87	
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	-2.626.009,87	
WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP	393.967,90	0,00	0,00	0,00	397.983,50	4.015,60	41.462,89	
					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 Financ. Ano (R\$)	
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	1.130.730,14	0,00	0,00	0,00	1.130.077,59	-652,55	-3.191,93	
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	9.620.623,40	0,00	0,00	0,00	9.608.996,51	-11.626,89	-71.033,71	
					10.739.074,10	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\$)
AQUILLA RENDA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	59.532,17	0,00	0,00	0,00	0,00	62.228,37	2.696,20	26.940,22
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	5.742.398,12	0,00	0,00	0,00	0,00	5.920.762,08	178.363,96	205.766,07
SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	444.684,76	0,00	0,00	0,00	29.868,88	414.260,46	-555,42	-26.063,38
						6.397.250,91	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Disponibilidades Financeiras

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	21.167.976,62	0,00	-21.031.923,37	0,00	136.053,25	0,00	-10.209,55
					136.053,25	0,00	0,00



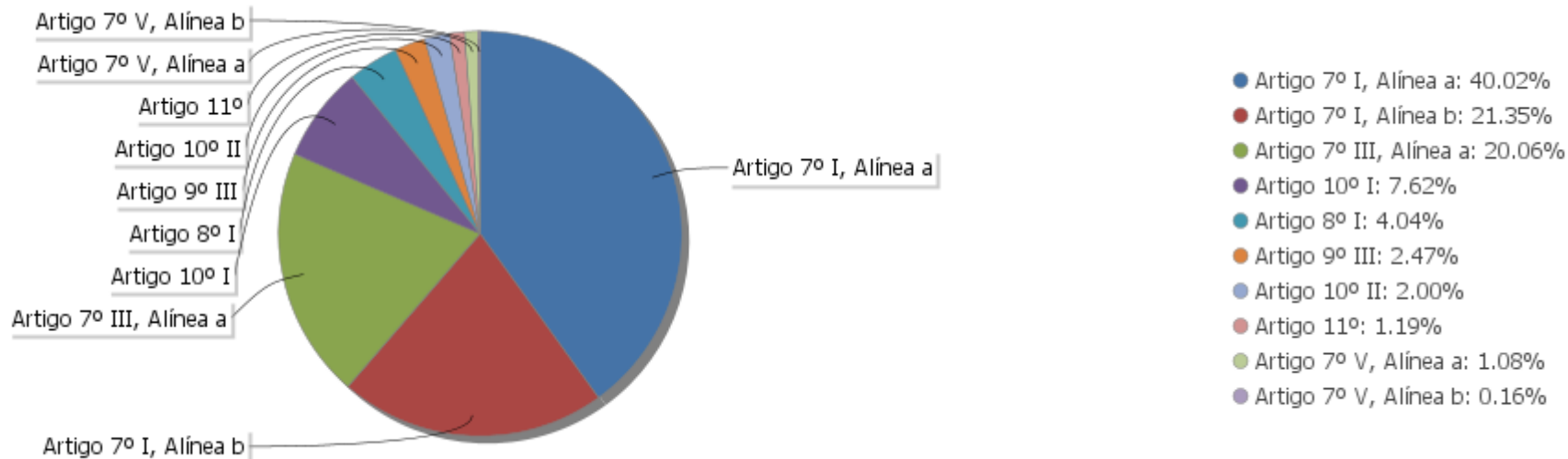
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

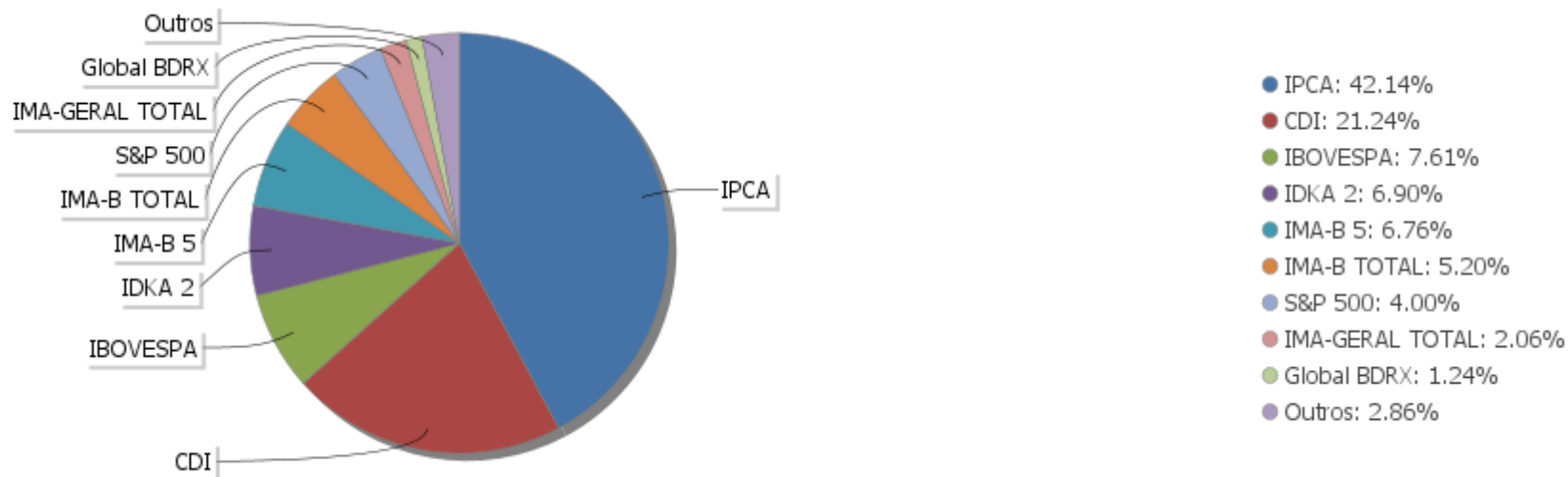
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	301.975.830,37	56,35	301.975.830,37	56,35
de 31 a 365 dias	7.672.577,65	1,43	309.648.408,02	57,78
acima de 365 dias	226.256.421,82	42,22	535.904.829,84	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

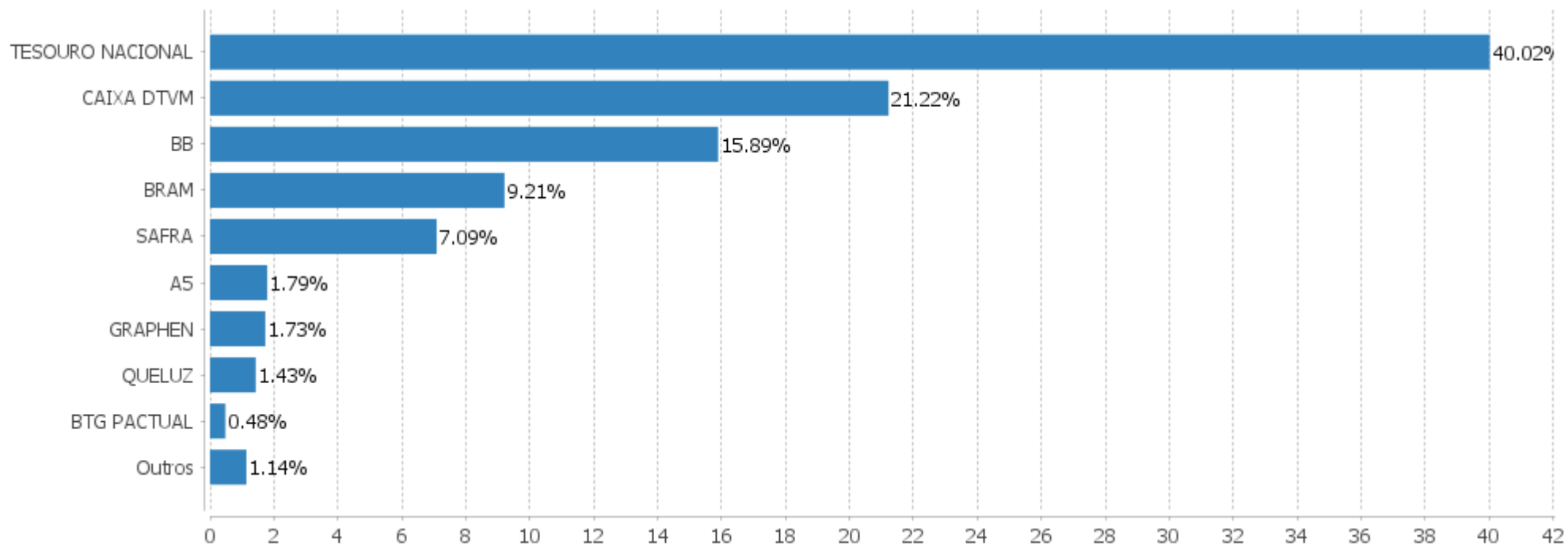


Alocação Por Estratégia



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

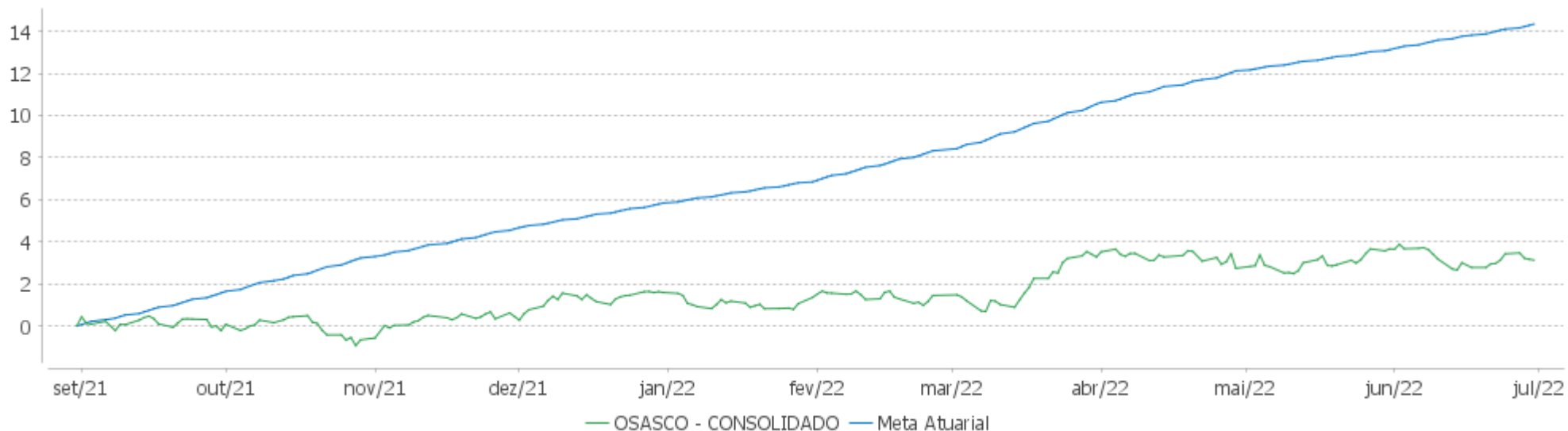
**Performance Sobre a Meta Atuarial**

**Relatório**

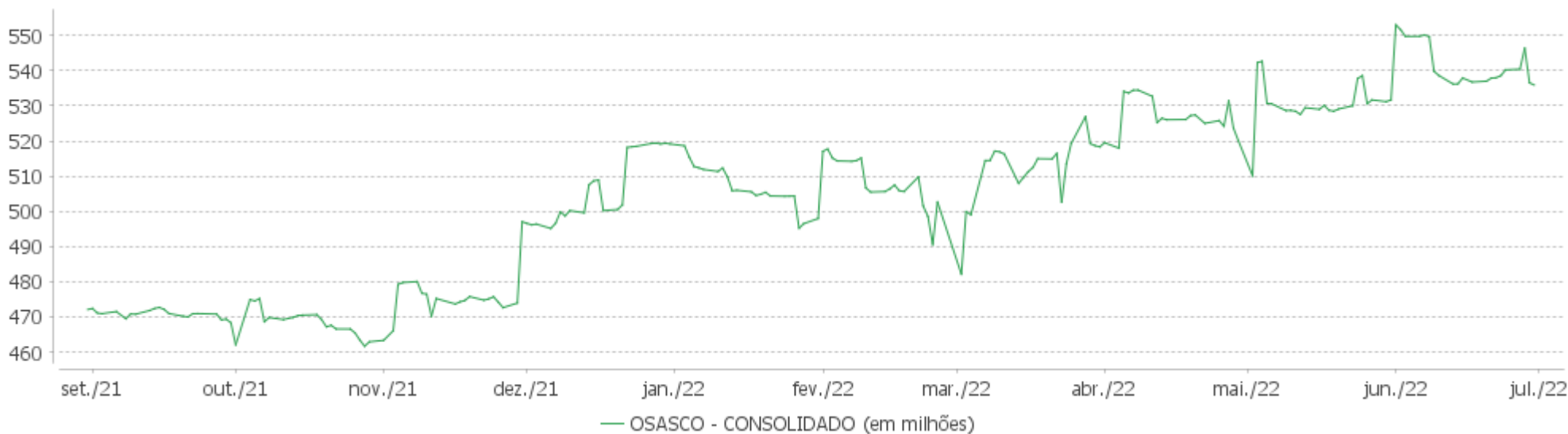
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	1	10,00	03 meses	-0,15	3,44	-3,59	3,65
Meses abaixo - Meta Atuarial	9	90,00	06 meses	1,51	8,02	-6,52	3,43
			12 meses				
			24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,80	2022-03	Desde 31/08/2021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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

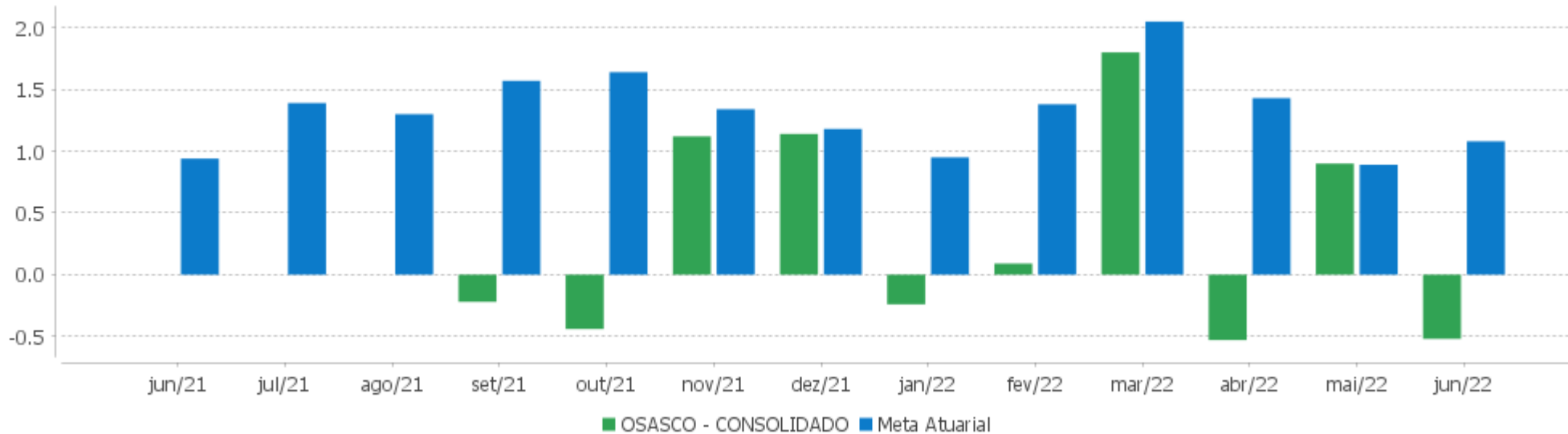


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO % do CDI	-6,94 -684,41	-59,90 -1.109,02	-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	1,53 -3,96	-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	5,52 0,03	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	8,10 2,62	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	2,92 -1,56	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	5,73 0,33	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	2,96 -1,53	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	7,73 2,25	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	5,51 0,02	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	5,51 0,02	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	7,17 0,56	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	7,18 2,83	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	6,46 -0,39	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	4,59 -0,90	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	6,47 -0,14	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	6,41 -0,43	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	4,22	1,41	4,22	3,48	10,88	16,14

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,01	-0,13	-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	5,35 99,09	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	4,16 -0,19	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	2,69 49,75	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	-4,14 -76,72	-3,29 -113,22	-4,14 -76,72	-21,18 -244,68		
ILLUMINATI FIDC Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,53 -1,69	-6,99 -15,54	-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	-9,70 -14,04	-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	5,06 0,71	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	6,31 -0,29	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	5,71 105,77	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	5,54 102,62	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	1,22 -5,39	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	-26,79 -495,99	-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	5,60 103,61	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	2,58 -4,03	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	3,85 -0,49	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	-20,95 -25,29	-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	-13,21 -7,22	-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	-3,62	-10,56	-3,62	-15,12	21,27	



## 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.	0,98	2,37	7,32	2,37	7,16	17,60	
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	-10,34	-1,37	-12,54	-1,37	-11,64	8,62	13,65
Var. IBOVESPA p.p.	1,17	4,62	5,34	4,62	10,65	4,95	16,05
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-16,29	-19,47	-24,74	-19,47	-40,12	-17,78	-14,84
Var. IBOVESPA p.p.	-4,79	-13,48	-6,86	-13,48	-17,83	-21,45	-12,44
FIA CAIXA DIVIDENDOS	-8,31	4,05	-9,45	4,05	-7,36	11,21	9,52
Var. IBOVESPA p.p.	3,19	10,04	8,44	10,04	14,93	7,54	11,92
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES	-12,03	-11,42	-19,34	-11,42	-37,28	-12,84	
Var. IBOVESPA p.p.	-0,53	-5,43	-1,46	-5,43	-14,99	-16,51	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,83	-27,83	-10,22	-27,83	-13,08	9,72	69,62
Var. Global BDRX p.p.	0,03	-0,22	0,06	-0,22	-0,98	-2,78	-4,54
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	1,36	-29,84	-10,21	-29,84	-14,97	9,82	54,22
Var. IBOVESPA p.p.	12,87	-23,85	7,67	-23,85	7,32	6,16	56,62
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	1,25	7,04	3,77	7,04	8,79	11,43	16,79
% do CDI	122,87	130,41	129,68	130,41	101,53	102,79	103,27
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO	0,10	0,66	1,56	0,66	-3,86	1,07	-12,40
% do CDI	9,71	12,13	53,61	12,13	-44,54	9,58	-76,26
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-7,78	-17,57	-14,98	-17,57	-5,74	30,65	35,22
Var. S&P 500 p.p.	-9,25	7,88	-7,35	7,88	2,03	13,86	-40,66
WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP	1,02	11,65	16,01	11,65	-21,13	-19,66	-28,57
Var. IPCA + 7,00% p.p.	-0,22	2,59	12,08	2,59	-40,85	-58,41	-80,24
BRASESCO H FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA	-7,86	-17,86	-15,11	-17,86	-6,37	30,10	36,52
Var. S&P 500 p.p.	-9,33	7,59	-7,49	7,59	1,39	13,31	-39,36
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-7,71	-17,44	-14,89	-17,44	-5,80	30,47	36,44
Var. IBOVESPA p.p.	3,79	-11,45	2,99	-11,45	16,48	26,80	38,84
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,12	-0,73	-0,38	-0,73	-1,46	1,46	-0,54
% do CDI	-11,92	-13,55	-12,95	-13,55	-16,85	13,11	-3,32
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	-0,06	-0,28	-0,12	-0,28	-0,93	-2,59	29,18
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,22	-8,84	-3,81	-8,84	-19,53	-38,77	-18,28
SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	-0,12	-4,68	1,40	-4,68	-0,81	31,86	-11,37
Var. IFIX p.p.	0,76	-4,35	0,83	-4,35	-2,29	32,24	-17,83
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	3,11	3,60	3,15	3,60	3,70	4,83	7,29
Var. IFIX p.p.	3,99	3,92	2,59	3,92	2,22	5,21	0,84
AQUILLA RENDA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	4,53	76,34	88,25	76,34	-44,68		
Var. IBOVESPA p.p.	16,03	82,34	106,13	82,34	-22,39		
OSASCO - CONSOLIDADO	-0,52	1,51	-0,15	1,51			

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 4,95% p.p.	-1,59	-6,52	-3,59	-6,52			
CDI	1,01	5,40	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25
IBOVESPA	-11,50	-5,99	-17,88	-5,99	-22,29	3,67	-2,40
INPC + 6,00%	1,11	8,68	3,60	8,68	18,63	37,32	49,01
IPCA + 6,00%	1,16	8,56	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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,93	4,99	2,65	4,99	7,19	9,37	15,94	24,32	34,03
IRF-M 1+	0,09	0,73	-0,06	0,73	-1,02	-2,10	9,44	30,43	42,54
IRF-M TOTAL	0,37	2,19	0,83	2,19	1,76	1,90	11,90	29,50	41,08
IMA-B 5	0,33	6,61	2,69	6,61	10,06	16,74	27,03	45,64	59,81
IMA-B 5+	-1,10	2,03	0,12	2,03	-2,16	6,18	8,27	52,42	61,74
IMA-B TOTAL	-0,36	4,35	1,43	4,35	3,78	11,48	17,00	50,64	62,99
IMA-GERAL TOTAL	0,43	4,49	1,90	4,49	5,34	9,08	16,19	34,66	46,06
IDKA 2	0,47	6,85	2,86	6,85	10,11	17,88	28,22	45,20	59,68
IDKA 20	-2,95	-2,61	-2,97	-2,61	-13,58	-2,92	-7,47	53,52	57,70
CDI	1,01	5,40	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25	23,60	32,71

**Renda Variável**

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

**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	0,67	5,49	2,22	5,49	11,89	21,23	23,81	27,98	33,60
INPC	0,62	5,61	2,12	5,61	11,92	22,24	25,11	29,26	33,82
IGPM	0,59	8,16	2,54	8,16	10,70	50,28	61,27	71,77	83,66
SELIC	1,01	5,40	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25	23,60	32,72

**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	1,47	-25,45	-7,62	-25,45	-7,76	16,79	75,88	89,17	147,32
MSCI ACWI	1,26	-25,79	-7,28	-25,79	-13,20	8,75	55,83	60,47	103,16

**Meta Atuarial**

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



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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
<b>Total</b>			<b>34.395.302,01</b>	<b>26.965.354,69</b>		

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 <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	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 <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	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
<b>Sub-total</b>	0,52	0,30	0,06		-0,51	0,75	214.461.935,55	40,02

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
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 <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	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
<b>Sub-total</b>	2,70	1,17	0,13		-0,31	0,18	114.423.943,92	21,35

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
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
<b>Sub-total</b>	0,85	0,24	0,02		-0,42	0,66	107.502.209,10	20,06

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
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
<b>Sub-total</b>	0,23	0,07	-0,00		-4,78	-0,07	5.773.091,22	1,08

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PIATÁ FI RF LONGO PRAZO		4,18	0,00	4,18			858.713,37	0,16
<b>Sub-total</b>	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 <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	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
<b>Sub-total</b>	25,37	11,68	0,85		-0,31	-6,77	40.856.301,69	7,62

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	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
<b>Sub-total</b>	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 <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	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
<b>Sub-total</b>	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 <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	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
<b>Sub-total</b>	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 <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	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
<b>Sub-total</b>	9,87	0,15	-0,00		0,19	2,89	6.397.250,91	1,19