



**LDB**  
EMPRESAS

**LINHARES**  
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 85,67%

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 150822 (6,750000%)	2,98	1,54	6,87	2.073.563,44	0,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,850000%)	2,94	1,46	7,50	2.620.118,27	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (6,050000%)	2,94	1,48	6,77	3.108.391,29	0,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (3,200000%)	0,53	1,24	6,39	1.107.114,12	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,410000%)	0,53	1,34	6,90	1.095.611,29	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,640000%)	2,85	1,44	1,65	2.419.742,91	0,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,800000%)	4,14	1,46	5,08	1.449.818,68	0,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,200000%)	2,84	1,41	7,23	4.218.390,03	1,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,270000%)	2,85	1,41	7,25	2.074.706,45	0,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,500000%)	2,88	1,43	7,35	5.368.018,26	1,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,800000%)	2,74	1,37	7,06	5.432.225,35	1,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,350000%)	3,96	1,42	3,35	1.857.989,01	0,54
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,54</b>	<b>1,42</b>	<b>7,28</b>	<b>32.825.689,10</b>	<b>9,49</b>

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,19	1,07	4,45	1.244.203,43	0,36	17.208.166.278,38	0,01

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	6,59	0,97	3,93	21.080.652,47	6,09	168.904.683,20	12,48
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,74	0,92	3,90	3.054.558,80	0,88	5.107.140.425,93	0,06
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,48	0,96	4,58	18.357.345,30	5,31	6.293.749.685,70	0,29
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,47	0,97	4,65	18.681.830,88	5,40	4.185.112.705,47	0,45
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,74	0,93	3,91	381.857,05	0,11	5.274.375.201,05	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,64	0,76	6,16	22.323.768,25	6,45	12.390.634.636,61	0,18
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,59	0,77	6,17	15.834.983,19	4,58	9.450.283.491,65	0,17
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,70	0,85	6,17	29.017.042,07	8,39	11.182.665.779,99	0,26
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	3,53	0,66	5,05	674.540,26	0,19	538.527.333,53	0,13
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,67	0,77	6,14	11.754.473,11	3,40	6.992.058.203,56	0,17
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,59	0,96	4,05	1.032.111,71	0,30	311.465.025,65	0,33
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,04	0,76	6,43	3.207.088,05	0,93	449.188.281,67	0,71
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,61	0,82	3,37	13.979.494,30	4,04	5.396.025.552,32	0,26
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,07	1,07	4,35	2.760.329,85	0,80	7.455.971.013,11	0,04
BANCO DO NORDESTE	SANTANDER	BNB IMA-B FI RF	4,90	0,91	4,73	1.092.445,08	0,32	221.103.725,50	0,49
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>3,47</b>	<b>0,87</b>	<b>5,06</b>	<b>164.476.723,80</b>	<b>47,54</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	1,08	4,49	11.281.357,12	3,26	12.704.053.440,98	0,09
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	5,98	1,00	4,53	16.006.921,91	4,63	221.577.930,69	7,22
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	1,07	4,47	26.927.634,50	7,78	9.967.340.356,95	0,27
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,22	1,12	4,62	8.638.139,78	2,50	3.265.938.021,00	0,26
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,22	1,06	4,34	15.322.410,58	4,43	296.475.369,34	5,17
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	1,47	1,06	4,38	13.523.400,39	3,91	133.629.120,01	10,12
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,19	0,93	3,82	6.723.848,19	1,94	3.819.723.058,42	0,18
BANCO DO NORDESTE	SANTANDER	BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,18	1,04	4,36	675.711,48	0,20	1.013.339.293,67	0,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
		<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>	<b>0,69</b>	<b>1,05</b>	<b>4,42</b>	<b>99.099.423,95</b>	<b>28,64</b>		
		Renda Fixa	2,59	0,99	5,04	296.401.836,85	85,67		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

9,52%

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	1.878.369,01	0,54	246.992.960,33	0,76
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	16,79	-0,90	-0,91	760.071,18	0,22	1.229.905.496,16	0,06
SOMMA	BEM	SOMMA BRASIL FIA	19,44	5,25	5,25	999.871,27	0,29	352.249.774,47	0,28
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,99	3,11	11,39	17.740.152,05	5,13	982.155.022,61	1,81
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	24,41	-0,61	-2,77	5.697.858,37	1,65	150.453.199,56	3,79
BANESTES	BANESTES	BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	18,24	2,23	8,06	1.742.254,62	0,50	13.371.478,32	13,03
BB	BB	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	18,45	3,68	6,33	4.104.268,94	1,19	1.478.507.662,79	0,28
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>17,50</b>	<b>2,42</b>	<b>7,58</b>	<b>32.922.845,44</b>	<b>9,52</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>17,26</b>	<b>2,42</b>	<b>7,58</b>	<b>32.922.845,44</b>	<b>9,52</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,08%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	18,56	-6,18	-25,64	2.098.713,29	0,61	119.473.744,39	1,76
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	47,55	-25,14	-60,00	957.467,34	0,28	179.719.720,12	0,53
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	30,02	-12,12	-45,54	519.635,47	0,15	604.231.252,12	0,09
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	19,36	-5,94	-27,56	3.636.525,97	1,05	269.250.802,03	1,35
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>21,17</b>	<b>-9,54</b>	<b>-35,55</b>	<b>7.212.342,07</b>	<b>2,08</b>		
Investimentos no Exterior			21,17	-9,54	-35,55	7.212.342,07	2,08		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,74%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO	6,58	0,01	-2,18	2.001.635,72	0,58	111.411.330,94	1,80
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	5,69	1,63	5,81	3.064.072,03	0,89	1.029.806.099,50	0,30
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	5,61	0,26	-2,28	4.397.413,24	1,27	123.296.586,91	3,57
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>3,73</b>	<b>0,65</b>	<b>0,98</b>	<b>9.463.120,99</b>	<b>2,74</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>3,73</b>	<b>0,65</b>	<b>0,98</b>	<b>9.463.120,99</b>	<b>2,74</b>		
<b>Total</b>			<b>3,43</b>	<b>0,88</b>	<b>3,77</b>	<b>346.000.145,35</b>	<b>100,00</b>		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	32.825.689,10	9,49	0,00	34,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	164.476.723,80	47,54	0,00	15,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	99.099.423,95	28,64	0,00	28,00	60,00	0,00	60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>296.401.836,85</b>	<b>85,67</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	32.922.845,44	9,52	0,00	11,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>32.922.845,44</b>	<b>9,52</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	7.212.342,07	2,08	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>7.212.342,07</b>	<b>2,08</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	9.463.120,99	2,74	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>9.463.120,99</b>	<b>2,74</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>346.000.145,35</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	1,42 138,01	7,28 167,60	4,97 176,71	8,58 166,95	17,20 217,93	463.101,18	1.991.851,66
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,87 84,35	5,06 116,39	4,51 160,10	5,63 109,45	6,14 77,74	1.418.114,66	7.899.877,24
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,05 101,93	4,42 101,68	3,17 112,61	4,42 85,92	4,42 55,96	1.030.608,47	4.191.988,91
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	2,42 -0,80	7,58 1,35	1,32 2,90			798.679,87	2.278.254,89
Artigo 9º II % do CDI	-9,54 -925,60	-35,55 -818,33	-18,68 -663,73	-36,53 -710,63	-27,86 -352,98	-760.893,31	-3.977.793,57
Artigo 10º I % do CDI	0,65 63,03	0,98 22,61	-0,36 -12,77			61.096,04	21.204,65
<b>LINHARES (Total)</b>						<b>3.010.706,91</b>	<b>12.405.383,78</b>

**RESULTADO POR ATIVO**

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150523 (5,850000%)	2.658.578,40	0,00	0,00	76.899,04	2.620.118,27	38.438,91	187.667,56
NTN-B 150523 (6,050000%)	3.153.666,10	0,00	0,00	91.390,65	3.108.391,29	46.115,84	202.524,74
NTN-B 150535 (3,200000%)	1.118.626,68	0,00	0,00	25.243,45	1.107.114,12	13.730,89	67.880,96
NTN-B 150535 (4,410000%)	1.108.815,98	0,00	0,00	27.931,41	1.095.611,29	14.726,72	72.347,99
NTN-B 150535 (5,640000%)	2.453.518,79	0,00	0,00	68.835,15	2.419.742,91	35.059,27	39.922,54
NTN-B 150822 (6,750000%)	2.042.184,91	0,00	0,00	0,00	2.073.563,44	31.378,53	133.843,93
NTN-B 150824 (5,800000%)	1.428.993,41	0,00	0,00	0,00	1.449.818,68	20.825,27	70.078,19
NTN-B 150828 (5,200000%)	4.159.860,32	0,00	0,00	0,00	4.218.390,03	58.529,71	286.027,76
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.045.802,89	0,00	0,00	0,00	2.074.706,45	28.903,56	141.208,59
NTN-B 150828 (5,500000%)	5.292.223,25	0,00	0,00	0,00	5.368.018,26	75.795,01	369.890,31
NTN-B 150830 (4,800000%)	5.358.635,03	0,00	0,00	0,00	5.432.225,35	73.590,32	360.290,66
NTN-B 150832 (5,350000%)	1.831.981,86	0,00	0,00	0,00	1.857.989,01	26.007,15	60.168,42

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					32.825.689,10	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\$)
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	20.877.472,02	0,00	0,00	0,00	21.080.652,47	203.180,45	666.737,63
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1.022.334,74	0,00	0,00	0,00	1.032.111,71	9.776,97	40.185,25
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	13.866.120,93	0,00	0,00	0,00	13.979.494,30	113.373,37	456.050,37
BB PREV RF IDKA2	15.713.206,24	0,00	0,00	0,00	15.834.983,19	121.776,95	920.829,29
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	18.182.886,48	0,00	0,00	0,00	18.357.345,30	174.458,82	804.619,73
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	11.664.668,38	0,00	0,00	0,00	11.754.473,11	89.804,73	669.107,23
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	3.026.665,24	0,00	0,00	0,00	3.054.558,80	27.893,56	114.621,48
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	3.182.968,57	0,00	0,00	0,00	3.207.088,05	24.119,48	194.638,56
BNB IMA-B FI RF	1.082.553,17	0,00	0,00	0,00	1.092.445,08	9.891,91	49.362,91
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	28.771.569,91	0,00	0,00	0,00	29.017.042,07	245.472,16	1.687.478,12
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	22.154.366,84	0,00	0,00	0,00	22.323.768,25	169.401,41	1.270.872,74
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	18.503.108,27	0,00	0,00	0,00	18.681.830,88	178.722,61	829.605,40
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	378.345,69	0,00	0,00	0,00	381.857,05	3.511,36	14.370,97
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.230.986,01	0,00	0,00	0,00	1.244.203,43	13.217,42	53.003,30
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2.731.241,40	0,00	0,00	0,00	2.760.329,85	29.088,45	114.988,08
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	670.115,25	0,00	0,00	0,00	674.540,26	4.425,01	15.730,19
					164.476.723,80	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\$)
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	13.381.949,04	0,00	0,00	0,00	13.523.400,39	141.451,35	567.335,98
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	15.848.237,02	0,00	0,00	0,00	16.006.921,91	158.684,89	694.115,43
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	8.542.170,36	0,00	0,00	0,00	8.638.139,78	95.969,42	381.293,70
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	15.160.974,57	0,00	0,00	0,00	15.322.410,58	161.436,01	636.687,22
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	6.661.923,70	0,00	0,00	0,00	6.723.848,19	61.924,49	247.324,57

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	26.643.566,99	0,00	0,00	0,00	26.927.634,50	284.067,51	1.152.433,26
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	668.784,88	0,00	0,00	0,00	675.711,48	6.926,60	28.203,28
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.161.208,92	0,00	0,00	0,00	11.281.357,12	120.148,20	484.595,47
					99.099.423,95	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\$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	766.938,18	0,00	0,00	0,00	760.071,18	-6.867,00	-6.995,45
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	1.704.263,53	0,00	0,00	0,00	1.742.254,62	37.991,09	129.965,61
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	5.733.004,85	0,00	0,00	0,00	5.697.858,37	-35.146,48	-162.540,38
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	3.958.559,80	0,00	0,00	0,00	4.104.268,94	145.709,14	230.283,88
FIA CAIXA DIVIDENDOS	1.805.686,24	0,00	0,00	0,00	1.878.369,01	72.682,77	223.101,53
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17.205.712,97	0,00	0,00	0,00	17.740.152,05	534.439,08	1.814.568,43
SOMMA BRASIL FIA	0,00	950.000,00	0,00	0,00	999.871,27	49.871,27	49.871,27
					32.922.845,44	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	2.236.838,79	0,00	0,00	0,00	2.098.713,29	-138.125,50	-723.479,22
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.279.066,17	0,00	0,00	0,00	957.467,34	-321.598,83	-1.436.370,95
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	591.279,53	0,00	0,00	0,00	519.635,47	-71.644,06	-434.471,58
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	3.866.050,89	0,00	0,00	0,00	3.636.525,97	-229.524,92	-1.383.471,82
					7.212.342,07	0,00	0,00

## Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	3.014.804,76	0,00	0,00	0,00	3.064.072,03	49.267,27	168.359,81

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO	2.001.411,61	0,00	0,00	0,00	2.001.635,72	224,11	-44.568,40
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	4.385.808,58	0,00	0,00	0,00	4.397.413,24	11.604,66	-102.586,76
					9.463.120,99	0,00	0,00

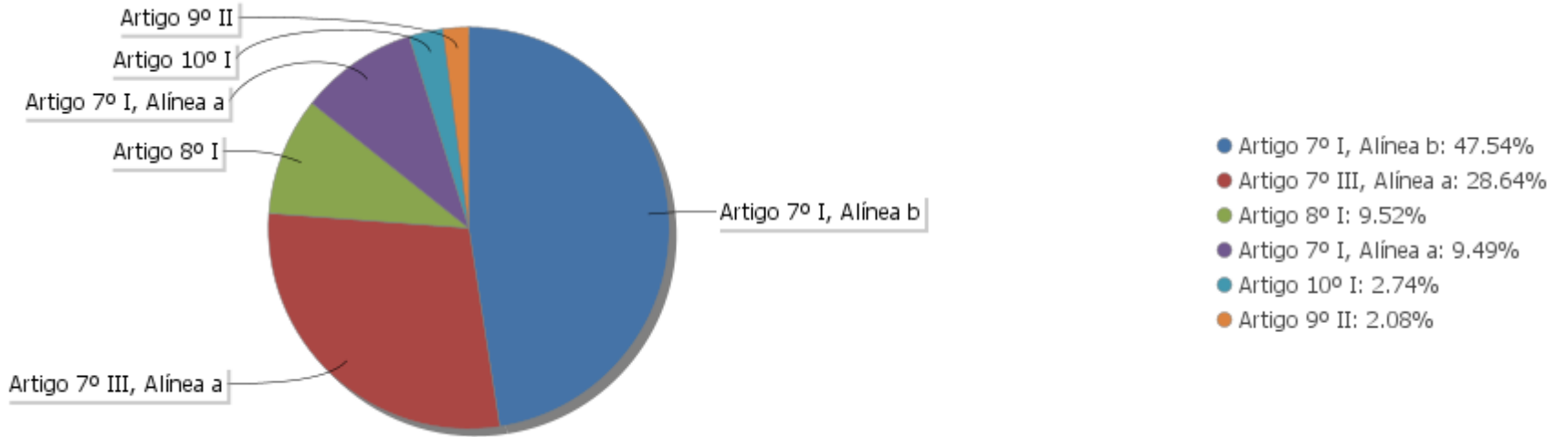
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

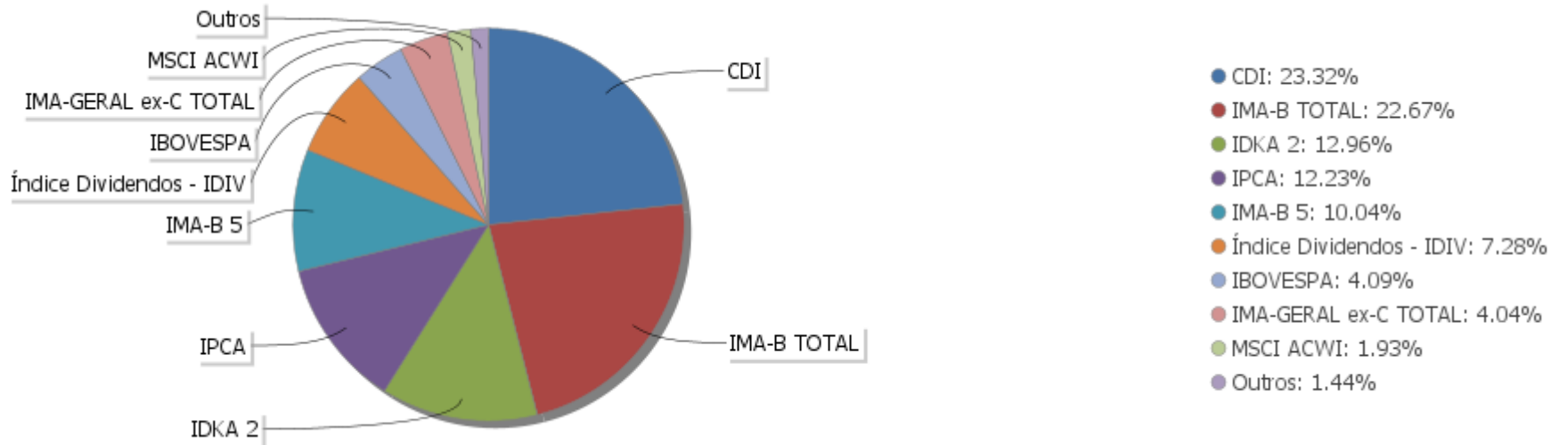
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	288.602.921,22	83,41	288.602.921,22	83,41
de 31 a 365 dias	29.166.519,98	8,43	317.769.441,20	91,84
acima de 365 dias	28.230.704,15	8,16	346.000.145,35	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

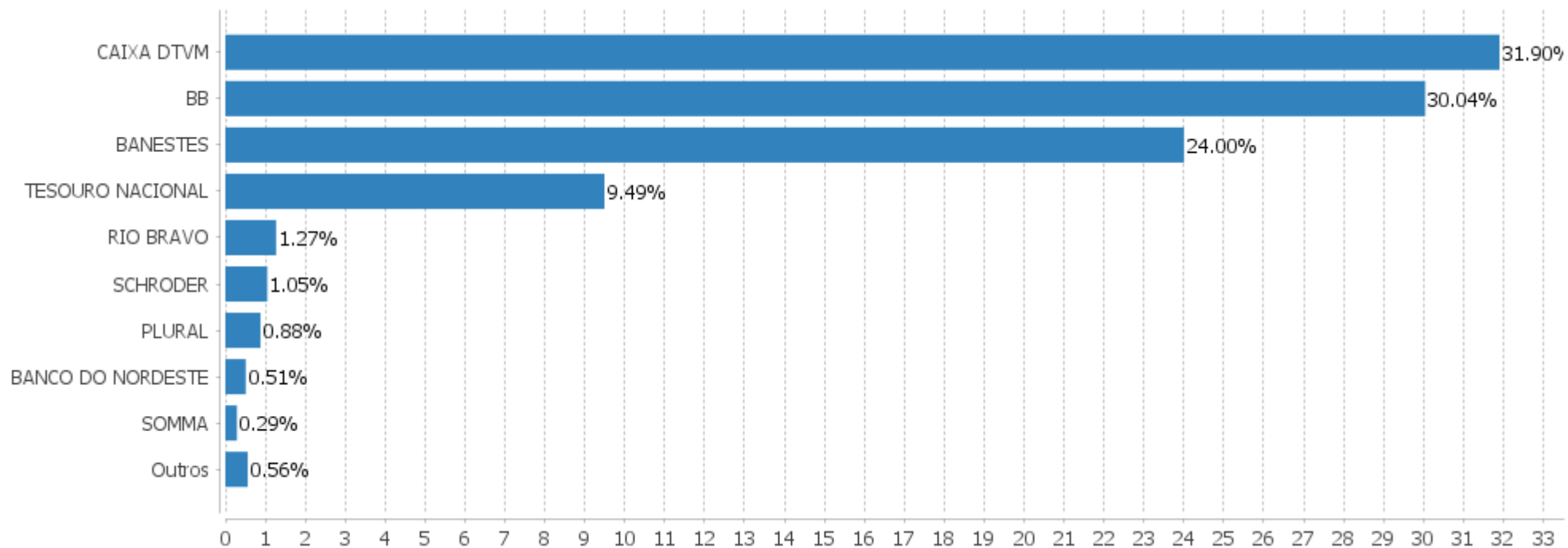


Alocação Por Estratégia



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	0,23	0,39	2,25	-0,02	0,88								3,77
INPC + 4,93%	1,07	1,37	2,14	1,41	0,87								7,05
p.p. indexador	-0,85	-0,97	0,11	-1,43	0,00								-3,28
2021	-0,93	-1,16	0,23	0,72	1,07	0,17	-0,44	-0,62	-0,56	-1,41	1,62	0,55	-0,80
INPC + 5,45%	0,69	1,20	1,35	0,80	1,41	1,05	1,49	1,35	1,65	1,59	1,27	1,22	16,14
p.p. indexador	-1,63	-2,36	-1,12	-0,08	-0,34	-0,87	-1,93	-1,97	-2,21	-3,00	0,35	-0,67	-16,94
2020	0,49	-0,30	-6,00	1,19	1,40	1,41	2,77	-1,09	-1,53	0,16	1,96	3,27	3,46
INPC + 6,00%	0,70	0,59	0,69	0,23	0,21	0,79	0,98	0,85	1,36	1,38	1,42	1,98	11,75
p.p. indexador	-0,21	-0,89	-6,69	0,96	1,19	0,63	1,79	-1,94	-2,89	-1,22	0,55	1,29	-8,29
2019	2,03	0,57	0,45	0,98	2,17	2,28	1,23	-0,12	1,94	2,06	-1,14	1,47	14,79
INPC + 6,00%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,44	0,57	1,01	1,71	10,78
p.p. indexador	1,15	-0,43	-0,77	-0,11	1,51	1,83	0,60	-0,75	1,50	1,49	-2,14	-0,25	4,02
2018	3,06	0,59	0,52	0,09	-2,34	-0,08	1,29	0,01	0,40	3,08	0,67	1,06	8,56
INPC + 6,00%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	0,74	0,91	0,21	0,60	9,59
p.p. indexador	2,32	-0,01	-0,04	-0,60	-3,25	-2,00	0,53	-0,53	-0,34	2,17	0,46	0,46	-1,03

Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

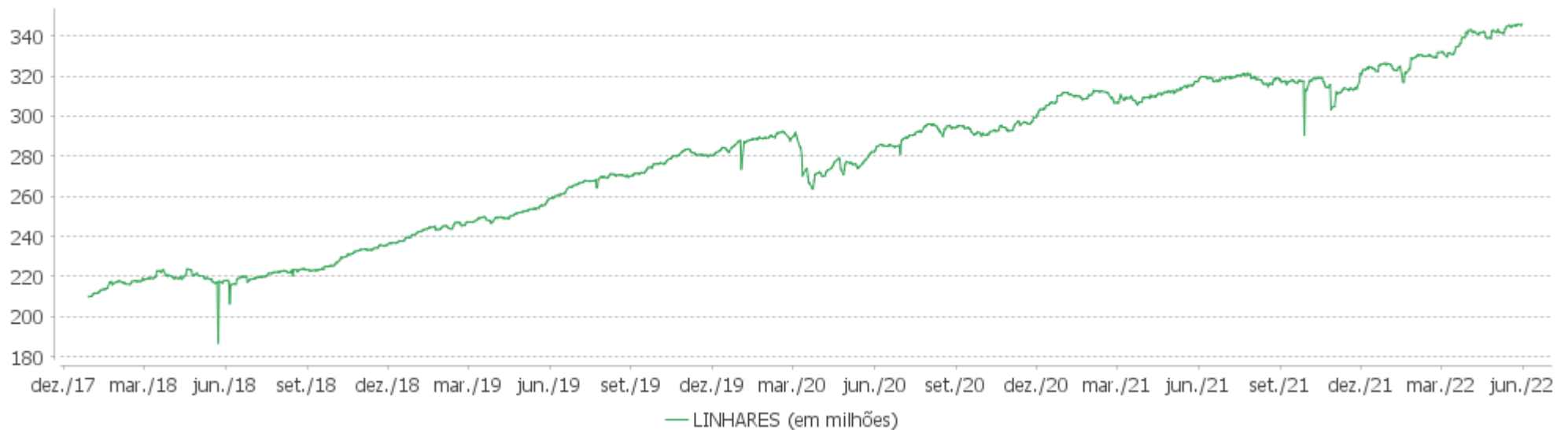
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	20	37,74	03 meses	3,12	4,48	-1,36	3,26
Meses abaixo - Meta Atuarial	33	62,26	06 meses	4,33	8,35	-4,02	2,98
			12 meses	3,02	17,76	-14,74	3,43
			24 meses	10,20	35,61	-25,41	3,45
Maior rentabilidade da Carteira	3,27	2020-12	36 meses	14,95	46,66	-31,72	4,60
Menor rentabilidade da Carteira	-6,00	2020-03	48 meses	30,28	62,86	-32,58	4,13
			Desde 29/12/2017	32,71	68,66	-35,95	4,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Evolução**

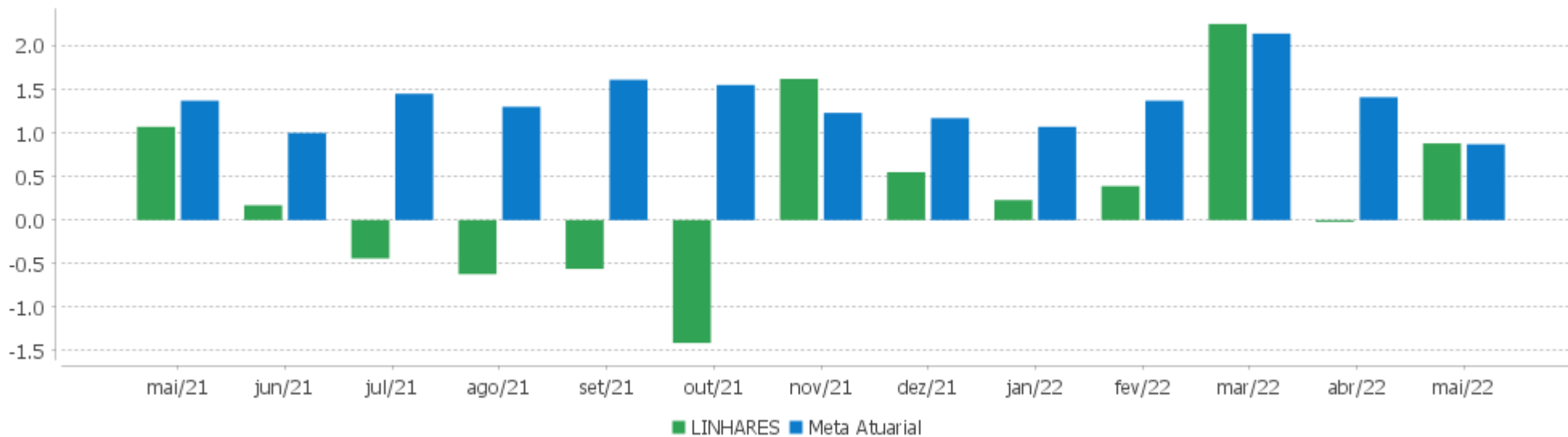


**Patrimônio Líquido**



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
NTN-B 150822 (6,750000%) Var. IPCA p.p.	1,54 1,07	7,87 3,08	5,31 2,13	9,34 3,79	16,17 4,44	25,51 4,78	28,82 5,82
NTN-B 150535 (4,410000%) Var. IPCA p.p.	1,34 0,87	6,90 2,11	4,73 1,55	8,13 2,58	16,88 5,15	19,17 -1,56	39,71 16,72
NTN-B 150828 (5,200000%) Var. IPCA p.p.	1,41 0,94	7,23 2,44	4,93 1,75	8,54 2,99	14,65 2,92	22,50 1,76	24,40 1,41
NTN-B 150523 (6,050000%) Var. IPCA p.p.	1,48 1,01	7,58 2,79	5,14 1,96	8,98 3,43	15,43 3,70	23,98 3,25	26,54 3,54
NTN-B 150824 (5,800000%) Var. IPCA p.p.	1,46 0,99	4,40 -0,38	5,08 1,90	5,74 0,19	11,89 0,16	19,94 -0,79	22,20 -0,80
NTN-B 150830 (4,800000%) Var. IPCA p.p.	1,37 0,90	7,06 2,27	4,83 1,65	8,33 2,78	14,33 2,60	21,95 1,21	23,64 0,64
NTN-B 150832 (5,350000%) Var. IPCA p.p.	1,42 0,95	4,35 -0,43	4,97 1,79	5,65 0,10	11,70 -0,03	19,55 -1,19	21,61 -1,39
NTN-B 150535 (3,200000%) Var. IPCA p.p.	1,24 0,77	6,39 1,60	4,43 1,25	7,50 1,95	15,54 3,81	27,35 6,62	32,00 9,00
NTN-B 150535 (5,640000%) Var. IPCA p.p.	1,44 0,97	7,41 2,62	5,04 1,86	8,77 3,22	15,10 3,37	23,39 2,66	25,72 2,72
NTN-B 150828 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	1,41 0,94	7,25 2,47	4,95 1,77	8,58 3,03	14,72 2,98	22,62 1,89	24,58 1,58
NTN-B 150523 (5,850000%) Var. IPCA p.p.	1,46 0,99	7,50 2,71	5,09 1,91	8,88 3,33	15,22 3,49	23,55 2,82	25,91 2,91
NTN-B 150828 (5,500000%) Var. IPCA p.p.	1,43 0,96	7,35 2,57	5,00 1,82	8,70 3,15	14,93 3,19	23,02 2,28	25,15 2,15
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,97 0,00	4,65 -0,08	4,89 -0,04	4,87 -0,10	4,33 -0,26	13,64 -0,54	20,72 -1,09
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	0,66 -0,12	5,05 -1,20	4,26 -0,76	5,90 -1,19	6,05 -3,50	12,00 -5,64	25,68 -3,10
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,76 -0,02	6,16 -0,10	4,96 -0,06	6,97 -0,12	9,31 -0,24	17,06 -0,59	27,78 -1,00
BNB IMA-B FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,91 -0,05	4,73 0,01	4,77 -0,16	4,93 -0,03	4,77 0,18	12,97 -1,21	20,21 -1,60
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,92	3,90	2,51	4,78	6,14	7,98	14,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,12	-0,10	-0,16	-0,29	-0,69	-1,04
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
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,07	4,45	2,73	5,26	8,07	9,89	15,30
% do CDI	104,14	102,43	96,84	102,34	102,22	96,56	97,91
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	0,76	6,43	4,97	7,18	10,31	17,93	28,84
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,21	1,71	0,04	2,22	5,72	3,75	7,03
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,96	4,05	2,64	4,88	6,44	7,88	19,21
Var. IRF-M 1 p.p.	0,01	0,03	0,03	-0,05	0,01	-0,78	3,66
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,97	3,93	4,49	4,00	1,10	7,74	10,06
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,01	-0,80	-0,44	-0,96	-3,49	-6,44	-11,74
BB PREV RF IDKA2	0,77	6,17	4,95	6,92	9,45	17,95	27,46
Var. IDKA 2 p.p.	-0,08	-0,17	-0,02	-0,30	0,21	-0,54	-1,73
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,82	3,37	2,70	4,32	3,78	7,35	15,50
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.							
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,07	4,35	2,83	5,21	3,49	7,06	19,89
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
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,93	3,91	2,54	4,79	6,18	8,19	14,80
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,11	-0,07	-0,14	-0,25	-0,48	-0,74
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
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	1,00	4,53	4,78	4,98	3,36	8,92	10,33
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,04	-0,19	-0,15	0,01	-1,23	-5,26	-11,48
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	1,06	4,34	2,77	5,10	8,05	11,63	12,80
% do CDI	103,28	99,80	98,28	99,20	101,95	113,55	81,93
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	1,12	4,62	2,94	5,45	8,76	12,85	14,10
% do CDI	108,97	106,31	104,33	105,94	110,94	125,45	90,20
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	1,06	4,38	2,98	5,11	6,42	9,17	18,16
% do CDI	102,52	100,81	106,04	99,50	81,34	89,56	116,19
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1,07	4,47	2,84	5,31	8,23	10,70	15,42
% do CDI	103,41	102,93	100,83	103,21	104,30	104,45	98,68
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,93	3,82	2,93	4,61	4,84	9,18	
Var. IPCA p.p.	0,46	-0,97	-0,25	-0,94	-6,90	-11,55	
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,08	4,49	2,83	5,28	8,37	10,69	15,39

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	104,41	103,32	100,55	102,65	106,04	104,34	98,47
<b>BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO</b>	<b>1,04</b>	<b>4,36</b>	<b>2,77</b>	<b>5,12</b>	<b>7,98</b>	<b>9,82</b>	<b>14,76</b>
% do CDI	100,45	100,27	98,43	99,64	101,16	95,88	94,43
<b>BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL</b>	<b>-0,61</b>	<b>-2,77</b>	<b>-5,37</b>	<b>-3,43</b>	<b>-35,56</b>	<b>-13,87</b>	<b>-10,91</b>
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-4,88	-16,93	-14,11	-19,42	-37,98	-55,05	-44,31
<b>FIA CAIXA DIVIDENDOS</b>	<b>4,03</b>	<b>13,48</b>	<b>8,40</b>	<b>15,21</b>	<b>-0,98</b>	<b>24,26</b>	<b>23,56</b>
Var. IBOVESPA p.p.	0,80	7,25	9,98	5,95	10,80	-3,14	8,80
<b>AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA</b>	<b>-0,90</b>	<b>-0,91</b>	<b>-2,02</b>	<b>1,38</b>	<b>-19,71</b>	<b>18,09</b>	<b>22,99</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-4,12	-7,14	-0,43	-7,88	-7,94	-9,31	8,23
<b>BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI</b>	<b>3,68</b>	<b>6,33</b>	<b>0,19</b>	<b>10,12</b>	<b>-6,56</b>	<b>43,71</b>	<b>39,08</b>
Var. IBOVESPA p.p.	0,46	0,10	1,77	0,86	5,22	16,31	24,32
<b>FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS</b>	<b>3,11</b>	<b>11,39</b>	<b>3,10</b>	<b>11,03</b>	<b>-5,63</b>	<b>29,12</b>	<b>27,60</b>
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,16	-2,76	-5,64	-4,95	-8,04	-12,06	-5,81
<b>SOMMA BRASIL FIA</b>	<b>3,54</b>	<b>5,24</b>	<b>-0,94</b>	<b>7,69</b>	<b>-14,14</b>	<b>18,30</b>	<b>6,30</b>
Var. IBOVESPA p.p.	0,32	-0,99	0,64	-1,57	-2,36	-9,10	-8,46
<b>BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA</b>	<b>2,23</b>	<b>8,06</b>	<b>3,61</b>	<b>8,84</b>	<b>-14,62</b>		
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-2,03	-6,09	-5,13	-7,15	-17,04		
<b>GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE</b>	<b>-6,18</b>	<b>-25,64</b>	<b>-11,23</b>	<b>-22,12</b>	<b>-10,57</b>		
Var. MSCI ACWI p.p.	-2,18	1,08	2,78	2,27	6,50		
<b>SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE</b>	<b>-5,94</b>	<b>-27,56</b>	<b>-13,72</b>	<b>-26,37</b>	<b>-18,03</b>		
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,94	-0,85	0,29	-1,98	-0,96		
<b>GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE</b>	<b>-25,14</b>	<b>-60,00</b>	<b>-39,52</b>	<b>-65,18</b>	<b>-56,89</b>		
Var. MSCI ACWI p.p.	-21,15	-33,29	-25,51	-40,79	-39,82		
<b>MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>	<b>-12,12</b>	<b>-45,54</b>	<b>-26,53</b>	<b>-46,95</b>	<b>-43,51</b>	<b>-20,77</b>	
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-13,10	-52,85	-31,22	-55,62	-61,94	-56,39	
<b>RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO</b>	<b>0,26</b>	<b>-2,18</b>	<b>-0,41</b>				
Var. IBOVESPA p.p.	-2,96	-4,24	1,17				
<b>FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO</b>	<b>1,63</b>	<b>5,81</b>	<b>2,08</b>	<b>7,16</b>	<b>3,00</b>	<b>13,92</b>	<b>16,76</b>
% do CDI	158,50	133,85	73,89	139,30	37,95	135,92	107,23
<b>FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO</b>	<b>0,01</b>	<b>-2,18</b>	<b>-3,77</b>	<b>-0,85</b>	<b>0,72</b>		
Var. IBOVESPA p.p.	-3,21	-8,41	-2,18	-10,11	12,50		
<b>LINHARES</b>	<b>0,88</b>	<b>3,77</b>	<b>3,12</b>	<b>4,33</b>	<b>3,02</b>	<b>10,20</b>	<b>14,95</b>
Var. INPC + 4,93% p.p.	0,00	-3,28	-1,36	-3,97	-14,40	-23,94	-28,66
<b>CDI</b>	<b>1,03</b>	<b>4,34</b>	<b>2,81</b>	<b>5,14</b>	<b>7,89</b>	<b>10,24</b>	<b>15,63</b>
<b>IBOVESPA</b>	<b>3,22</b>	<b>6,23</b>	<b>-1,58</b>	<b>9,26</b>	<b>-11,78</b>	<b>27,40</b>	<b>14,76</b>

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
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
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	-	2,00
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du		0,50
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	D+1 du	D+0	D+30	D+34		0,00
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,15
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0		D+3 du		
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 IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BNB IMA-B FI RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
LP						
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
FIA CAIXA DIVIDENDOS	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 FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO	D+0	D+0		D+2		
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	D+1	D+1	D+1	D+5		
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+2		
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	-	
SOMMA BRASIL FIA	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du	-	2,00
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40

**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
22	12/05/2022	SOMMA BRASIL FIA	950.000,00	0,00	580.848,12875800	1,6355394000
	<b>Total</b>		<b>950.000,00</b>	<b>0,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.813.750,81

Value-At-Risk: 1,39%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LINHARES		1,39	1,39			346.000.145,35	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,91%

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 150822 (6,750000%)		0,26	-0,00	0,27			2.073.563,44	0,60
NTN-B 150523 (5,850000%)		0,26	-0,00	0,27			2.620.118,27	0,76
NTN-B 150523 (6,050000%)		0,26	-0,00	0,27			3.108.391,29	0,90
NTN-B 150535 (3,200000%)		0,26	-0,00	0,27			1.107.114,12	0,32
NTN-B 150535 (4,410000%)		0,26	-0,00	0,27			1.095.611,29	0,32
NTN-B 150535 (5,640000%)		0,27	-0,00	0,27			2.419.742,91	0,70
NTN-B 150824 (5,800000%)		0,40	-0,00	0,42			1.449.818,68	0,42
NTN-B 150828 (5,200000%)		0,26	-0,00	0,27			4.218.390,03	1,22
NTN-B 150828 (5,270000%)		0,26	-0,00	0,27			2.074.706,45	0,60
NTN-B 150828 (5,500000%)		0,26	-0,00	0,27			5.368.018,26	1,55
NTN-B 150830 (4,800000%)		0,26	-0,00	0,27			5.432.225,35	1,57
NTN-B 150832 (5,350000%)		0,39	-0,00	0,41			1.857.989,01	0,54
<b>Sub-total</b>	0,44	0,25	-0,00		0,88	1,42	32.825.689,10	9,49

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,05	-0,00	0,05			1.244.203,43	0,36
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B		2,19	0,11	0,19			21.080.652,47	6,09
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,31	0,00	0,01			3.054.558,80	0,88
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,07	0,09	0,03			18.357.345,30	5,31

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
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,09	0,09	0,02			18.681.830,88	5,40
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,31	0,00	0,01			381.857,05	0,11
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,08	0,05	0,02			22.323.768,25	6,45
BB PREV RF IDKA2		1,26	0,04	0,25			15.834.983,19	4,58
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,35	0,08	0,33			29.017.042,07	8,39
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF		1,64	0,00	0,72			674.540,26	0,19
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,10	0,03	0,03			11.754.473,11	3,40
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1		0,21	0,00	0,12			1.032.111,71	0,30
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI		0,88	0,00	1,57			3.207.088,05	0,93
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,01	0,03	1,01			13.979.494,30	4,04
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,54	0,00	0,55			2.760.329,85	0,80
BNB IMA-B FI RF		1,90	0,00	0,19			1.092.445,08	0,32
<b>Sub-total</b>	2,92	1,40	0,54		-0,06	0,87	164.476.723,80	47,54

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	0,03			11.281.357,12	3,26
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF		2,01	0,08	0,22			16.006.921,91	4,63
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,04	0,00	0,03			26.927.634,50	7,78
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI		0,05	0,00	0,04			8.638.139,78	2,50
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI		0,05	0,00	0,04			15.322.410,58	4,43
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF		0,30	0,01	0,30			13.523.400,39	3,91
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		0,77	0,01	0,77			6.723.848,19	1,94
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO		0,04	0,00	0,03			675.711,48	0,20
<b>Sub-total</b>	0,96	0,42	0,10		0,02	1,05	99.099.423,95	28,64

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,45%

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
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

## 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
FIA CAIXA DIVIDENDOS		8,46	0,04	5,30			1.878.369,01	0,54
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,63	0,02	5,10			760.071,18	0,22
SOMMA BRASIL FIA		8,56	0,02	1,86			999.871,27	0,29
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		8,34	0,36	2,61			17.740.152,05	5,13
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL		10,88	0,14	7,49			5.697.858,37	1,65
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA		8,65	0,04	5,46			1.742.254,62	0,50
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI		9,17	0,08	2,88			4.104.268,94	1,19
<b>Sub-total</b>	17,70	8,45	0,68		0,08	2,42	32.922.845,44	9,52

## Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 1,87%

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
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO		1,87	-0,00	10,44			2.001.635,72	0,58
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO		2,83	0,02	2,83			3.064.072,03	0,89
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO		2,83	0,02	8,45			4.397.413,24	1,27
<b>Sub-total</b>	1,47	1,87	0,04		-0,26	0,65	9.463.120,99	2,74

## Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,00%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE		10,57	-0,00	12,61			2.098.713,29	0,61
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		32,16	0,03	31,08			957.467,34	0,28
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		18,26	0,01	18,26			519.635,47	0,15
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		11,16	-0,00	13,67			3.636.525,97	1,05
<b>Sub-total</b>	29,43	12,00	0,03		-0,36	-9,54	7.212.342,07	2,08