



LDB
EMPRESAS

PORTO FERREIRA
AGOSTO 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 31.08.2022.

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 78,46%

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 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA	2,10	-0,14	0,22	12.026.168,98	6,62	3.869.092.439,64	0,31
CAIXA DTVM	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA APORTE IMEDIATO 495 RENDA FIXA LONGO PRAZO	5,34	0,57	1,90	28.531.499,30	15,71	216.487.573,74	13,18
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,17	1,17	7,85	8.663.596,78	4,77	17.769.721.367,05	0,05
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,42	1,08	4,40	5.282.190,57	2,91	5.835.905.819,70	0,09
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,44	1,20	4,52	8.742.769,20	4,81	3.845.825.844,81	0,23
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,62	0,05	6,58	13.558.148,17	7,47	9.644.358.000,69	0,14
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,74	-0,04	6,17	8.848.801,58	4,87	9.083.863.850,50	0,10
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,76	2,45	2,41	4.083.270,45	2,25	783.713.938,48	0,52
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,62	-0,01	6,48	1.761.270,43	0,97	1.027.616.539,87	0,17
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,70	2,49	2,50	7.587.339,72	4,18	1.139.138.764,48	0,67
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,82	-0,11	5,99	8.857.115,92	4,88	9.773.675.955,20	0,09
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,49	1,21	5,39	7.495.409,86	4,13	4.651.858.401,06	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,65	1,47	6,96	4.261.972,77	2,35	5.888.909.396,66	0,07
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,97	0,71	5,66	119.699.553,73	65,92		

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
GRAPHEN	RJI	LME REC IMA B FI RENDA FIXA	1,91	0,05	3,79	4.584.577,36	2,52	70.680.854,25	6,49
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,52	1,18	4,49	14.860.349,21	8,18	1.960.439.704,74	0,76
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,16	1,18	7,90	5.871,96	0,00	11.325.025.814,75	0,00
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			4,87	0,91	4,32	19.450.798,53	10,71		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GENIAL	RJI	INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I	3,26	0,00	-2,17	481.439,04	0,27	7.637.175,57	6,30
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1,43	-0,22	2,68	1.245.110,80	0,69	74.021.458,84	1,68
GENIAL	RJI	INCENTIVO MULTISSETORIAL I FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS	0,00	0,00	0,00	63.038,89	0,03	861.375,60	7,32
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			0,91	-0,06	0,72	1.789.588,73	0,99		

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	-0,35	-60,22	1.531.375,15	0,84	34.187.339,26	4,48
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			85,97	-0,35	-60,22	1.531.375,15	0,84		
Renda Fixa			3,43	0,71	3,23	142.471.316,14	78,46		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

18,36%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FIA DIVIDENDOS	17,82	5,55	10,15	3.851.106,06	2,12	667.925.198,12	0,58
BRAM	BEM	BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	25,19	6,88	-1,45	1.318.901,63	0,73	1.029.772.402,46	0,13
XP	SANTANDER	XP INVESTOR FI DE ACOES	18,77	6,95	18,13	7.702.596,23	4,24	181.119.495,16	4,25
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,60	6,58	3,72	4.642.315,73	2,56	890.869.419,69	0,52
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO ACOES ALOCACAO FUNDO INVEST COTAS FUNDOS INVEST	20,08	7,56	7,40	4.769.472,21	2,63	403.028.988,94	1,18
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	20,61	6,76	5,84	2.514.874,59	1,38	135.507.881,88	1,86
BRAM	BEM	BRDESCO F I A SELECTION	21,50	8,60	9,65	4.285.484,96	2,36	505.794.186,64	0,85
BB	BB	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	19,53	5,73	2,04	4.261.841,39	2,35	1.440.461.207,87	0,30
Sub-total Artigo 8º I			17,65	6,86	8,50	33.346.592,80	18,36		
Renda Variável			18,43	6,86	8,50	33.346.592,80	18,36		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,76%

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	22,38	-3,92	-25,19	1.378.674,24	0,76	2.252.028.422,82	0,06
Sub-total Artigo 9º III			22,38	-3,92	-25,19	1.378.674,24	0,76		
Investimentos no Exterior			22,38	-3,92	-25,19	1.378.674,24	0,76		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,10%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GRAPHEN	RJI	LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	0,74	-0,35	-3,85	18.098,06	0,01	1.492.737,45	1,21
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	21,09	-3,24	-12,18	1.977.501,13	1,09	1.976.589.170,89	0,10
Sub-total Artigo 10º I			23,45	-3,21	-12,11	1.995.599,19	1,10		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GENIAL	RJI	GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	0,83	0,00	-100,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Sub-total Artigo 10º II			0,83	0,00	-100,00	0,00	0,00		

Investimentos Estruturados			30,70	-3,21	-22,90	1.995.599,19	1,10		
-----------------------------------	--	--	--------------	--------------	---------------	---------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,32%

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	3,15	0,14	3,88	2.392.321,37	1,32	74.960.388,94	3,19
Sub-total Artigo 11º			3,15	0,14	3,88	2.392.321,37	1,32		
Fundos Imobiliários			3,80	0,14	3,88	2.392.321,37	1,32		
Total			5,27	1,70	3,51	181.584.503,74	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	119.699.553,73	65,92	0,00	55,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	19.450.798,53	10,71	0,00	15,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.789.588,73	0,99	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	1.531.375,15	0,84	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	142.471.316,14	78,46					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	33.346.592,80	18,36	0,00	20,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	33.346.592,80	18,36					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	1.378.674,24	0,76	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	1.378.674,24	0,76					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	1.995.599,19	1,10	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	0,00	0,00	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	1.995.599,19	1,10					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.392.321,37	1,32	0,00	1,50	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	2.392.321,37	1,32					5,00
Total		181.584.503,74	100,00					

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 b % do CDI	0,71 60,49	5,66 73,13	1,06 32,58	4,83 78,46	7,15 70,10	834.883,62	6.443.230,88
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,91 77,70	4,32 55,89	0,13 4,12	4,28 69,52	5,20 50,98	174.864,27	806.075,56
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,06 -5,55	0,72 9,34	0,24 7,23	0,32 5,20		-1.161,22	12.839,61
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	-0,35 -29,84	-60,22 -778,49	-7,67 -236,10	-57,47 -933,39		-5.353,30	-2.773.093,26
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	6,86 0,69	8,50 4,02	0,51 2,16	1,78 4,98		2.139.370,52	2.613.807,55
Artigo 9º III % do CDI	-3,92 -335,31	-25,19 -325,67	4,51 138,79	-10,76 -174,83	-16,57 -162,40	-56.176,01	-464.286,23
Artigo 10º I % do CDI	-3,21 -275,24	-12,11 -156,58	-1,74 -53,63	-5,25 -85,34		-66.262,77	-275.025,84
Artigo 10º II % do CDI	0,00 0,00	-100,00 -1.292,72	0,00 0,00	-100,00 -1.624,24		0,00	-317.616,99
Artigo 11º % do CDI	0,14 12,39	3,88 50,15	3,39 104,19	3,64 59,09		3.454,69	89.483,73
PORTO FERREIRA (Total)						3.023.619,80	6.135.415,01

RESULTADO POR ATIVO

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	7.406.143,50	0,00	0,00	0,00	7.495.409,86	89.266,36	383.212,40
BB PREV RF IDKA2	8.852.746,37	0,00	0,00	0,00	8.848.801,58	-3.944,79	514.575,54
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5.225.956,67	0,00	0,00	0,00	5.282.190,57	56.233,90	222.801,34
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	3.985.743,35	0,00	0,00	0,00	4.083.270,45	97.527,10	96.061,32
FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA	12.043.275,61	0,00	0,00	0,00	12.026.168,98	-17.106,63	26.168,98
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8.866.758,58	0,00	0,00	0,00	8.857.115,92	-9.642,66	500.253,65
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	13.551.696,14	0,00	0,00	0,00	13.558.148,17	6.452,03	837.535,12

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7.402.650,85	0,00	0,00	0,00	7.587.339,72	184.688,87	185.018,76
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8.639.424,78	0,00	0,00	0,00	8.742.769,20	103.344,42	378.280,28
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8.566.663,19	2.321.271,17	-2.329.700,00	0,00	8.663.596,78	105.362,42	711.296,60
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	4.200.121,30	0,00	0,00	0,00	4.261.972,77	61.851,47	1.495.125,00
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA APORTE IMEDIATO 495 RENDA FIXA LONGO PRAZO	28.370.535,78	0,00	0,00	0,00	28.531.499,30	160.963,52	531.499,30
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	1.761.382,82	0,00	0,00	0,00	1.761.270,43	-112,39	107.233,54
					119.699.553,73	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	5.803,29	0,00	0,00	0,00	5.871,96	68,67	429,84
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	14.687.697,47	0,00	0,00	0,00	14.860.349,21	172.651,74	638.336,62
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	4.582.433,50	0,00	0,00	0,00	4.584.577,36	2.143,86	167.309,10
					19.450.798,53	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\$)
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I	479.799,06	0,00	0,00	0,00	481.439,04	1.639,98	-19.609,39
INCENTIVO MULTISSETORIAL I FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS	63.038,89	0,00	0,00	0,00	63.038,89	0,00	0,00
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1.247.912,00	0,00	0,00	0,00	1.245.110,80	-2.801,20	32.449,00
					1.789.588,73	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	1.536.728,45	0,00	0,00	0,00	1.531.375,15	-5.353,30	-2.773.093,26
					1.531.375,15	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	4.355.851,35	0,00	0,00	0,00	4.642.315,73	286.464,38	166.534,03
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	4.030.969,09	0,00	0,00	0,00	4.261.841,39	230.872,30	85.011,41
BB PREVIDENCIARIO ACOES ALOCACAO FUNDO INVEST COTAS FUNDOS INVEST	4.434.113,54	0,00	0,00	0,00	4.769.472,21	335.358,67	328.537,16
BRADESCO F I A SELECTION	3.946.226,75	0,00	0,00	0,00	4.285.484,96	339.258,21	377.304,64
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	1.233.980,28	0,00	0,00	0,00	1.318.901,63	84.921,35	-19.349,01
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	3.648.757,68	0,00	0,00	0,00	3.851.106,06	202.348,38	354.956,48
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	2.355.581,56	0,00	0,00	0,00	2.514.874,59	159.293,03	138.755,80
XP INVESTOR FI DE ACOES	7.201.742,03	0,00	0,00	0,00	7.702.596,23	500.854,20	1.182.057,04
					33.346.592,80	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	1.434.850,25	0,00	0,00	0,00	1.378.674,24	-56.176,01	-464.286,23
					1.378.674,24	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.043.700,02	0,00	0,00	0,00	1.977.501,13	-66.198,89	-274.302,01
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	18.161,94	0,00	0,00	0,00	18.098,06	-63,88	-723,83
					1.995.599,19	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\$)
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	-317.616,99
					0,00	0,00	0,00

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	2.388.866,68	0,00	0,00	0,00	0,00	2.392.321,37	3.454,69	89.483,73
						2.392.321,37	0,00	0,00

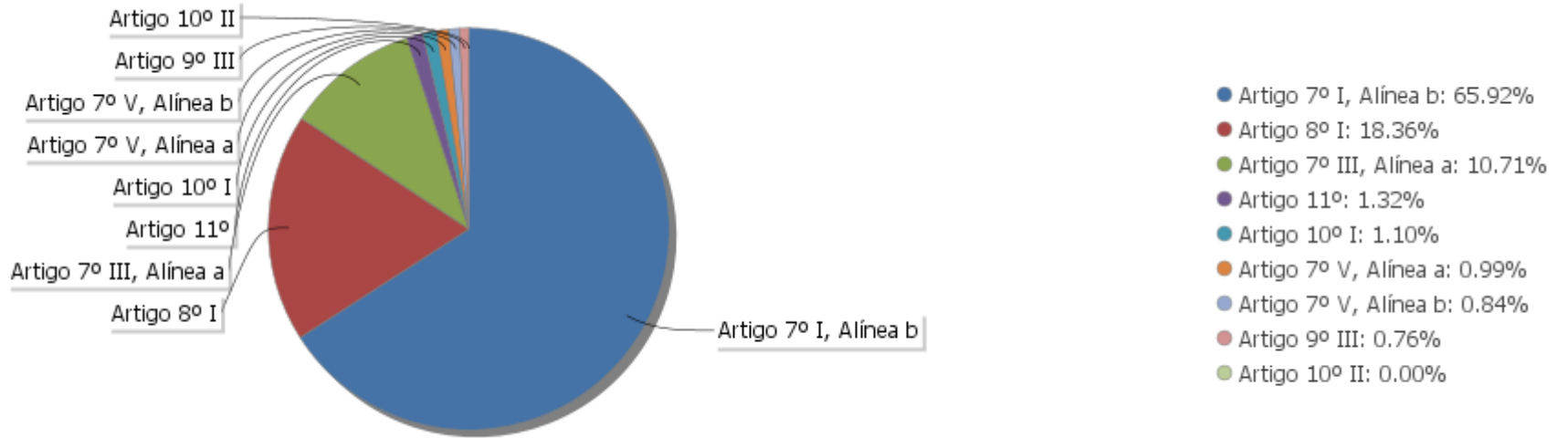
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

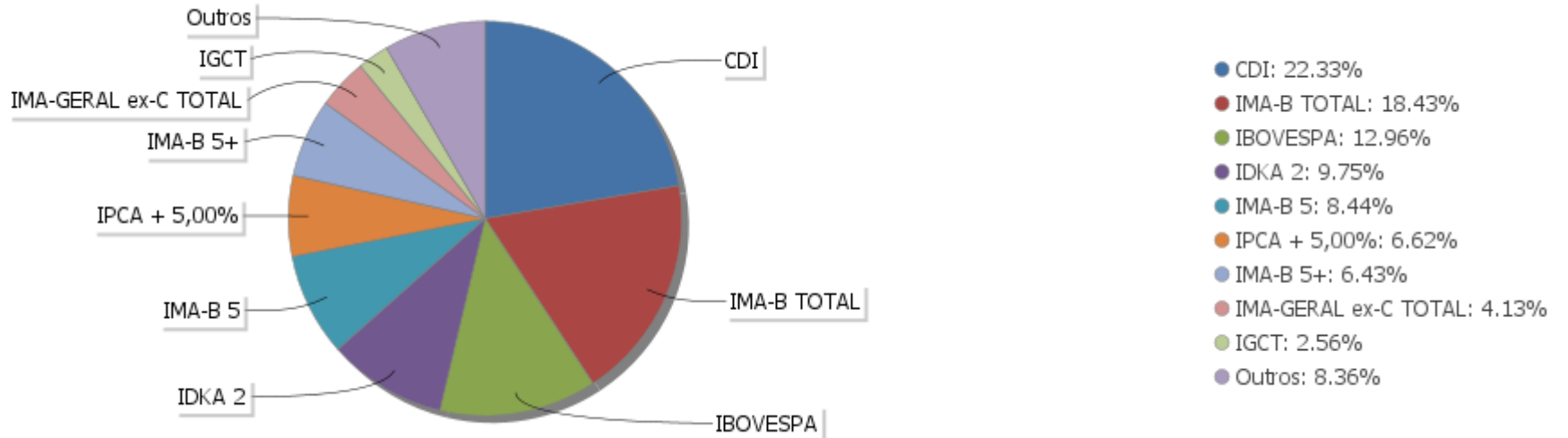
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	134.910.882,95	74,30	134.910.882,95	74,30
de 31 a 365 dias	12.026.168,98	6,62	146.937.051,93	80,92
acima de 365 dias	34.647.451,81	19,08	181.584.503,74	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

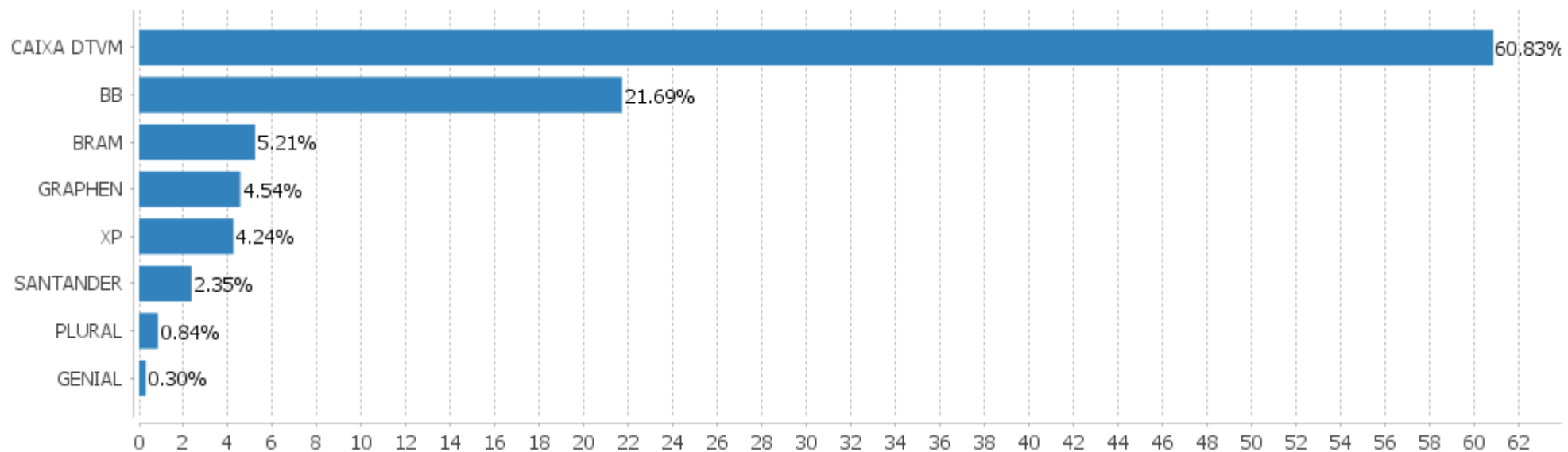


Alocação Por Estratégia



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	0,90	0,32	2,54	-2,42	1,29	-1,90	1,12	1,70					3,51
IPCA + 4,84%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,29	0,07					7,73
p.p. indexador	-0,03	-1,05	0,50	-3,84	0,40	-2,97	1,41	1,63					-4,23
2021	-0,87	-1,11	0,42	1,13	1,62	0,49	-1,14	-1,30	-1,12	-2,34	1,30	0,98	-2,01
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,67	1,37	1,22	15,99
p.p. indexador	-1,54	-2,35	-0,99	0,40	0,35	-0,48	-2,56	-2,64	-2,73	-4,01	-0,07	-0,24	-18,00
2020	0,22	-1,14	-7,62	-0,32	1,94	1,77	2,89	0,49	-1,40	-0,10	2,74	3,33	2,34
IPCA + 5,86%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,62
p.p. indexador	-0,49	-1,80	-8,19	-0,46	1,87	1,03	2,01	-0,22	-2,52	-1,44	1,40	1,48	-8,28
2019	3,17	0,13	0,33	0,93	1,68	2,27	1,00	0,16	1,69	1,80	0,46	2,27	17,05
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	2,34	-0,76	-0,87	-0,13	1,04	1,82	0,27	-0,46	1,25	1,17	-0,52	0,63	6,46
2018	2,72	-0,87	0,78	0,37	-2,04	-0,27	2,02	-0,90	0,55	4,00	0,72	0,93	8,16
IPCA + 6,00%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	1,92	-1,61	0,20	-0,34	-2,93	-2,02	1,18	-1,34	-0,37	3,04	0,46	0,31	-1,76

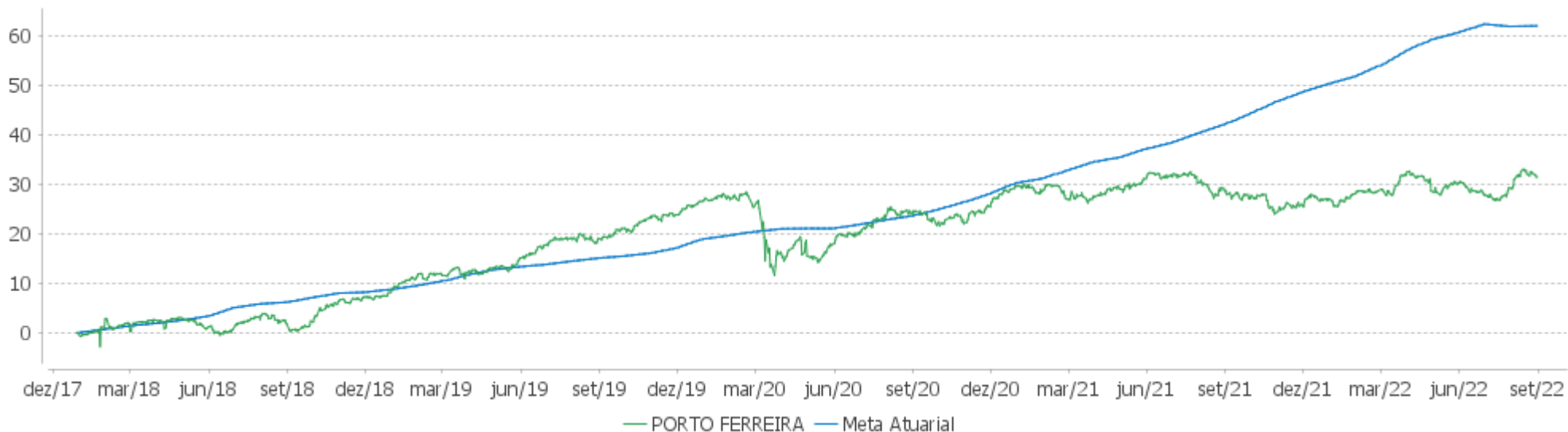
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	24	42,86	03 meses	0,89	0,85	0,04	4,92
Meses abaixo - Meta Atuarial	32	57,14	06 meses	2,25	5,29	-3,04	5,63
			12 meses	2,24	14,20	-11,95	5,27
			24 meses	6,06	32,19	-26,12	5,15
Maior rentabilidade da Carteira	4,00	2018-10	36 meses	10,41	43,41	-33,00	7,41
Menor rentabilidade da Carteira	-7,62	2020-03	48 meses	29,16	57,11	-27,96	6,81
			Desde 29/12/2017	31,41	68,03	-36,62	7,13

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

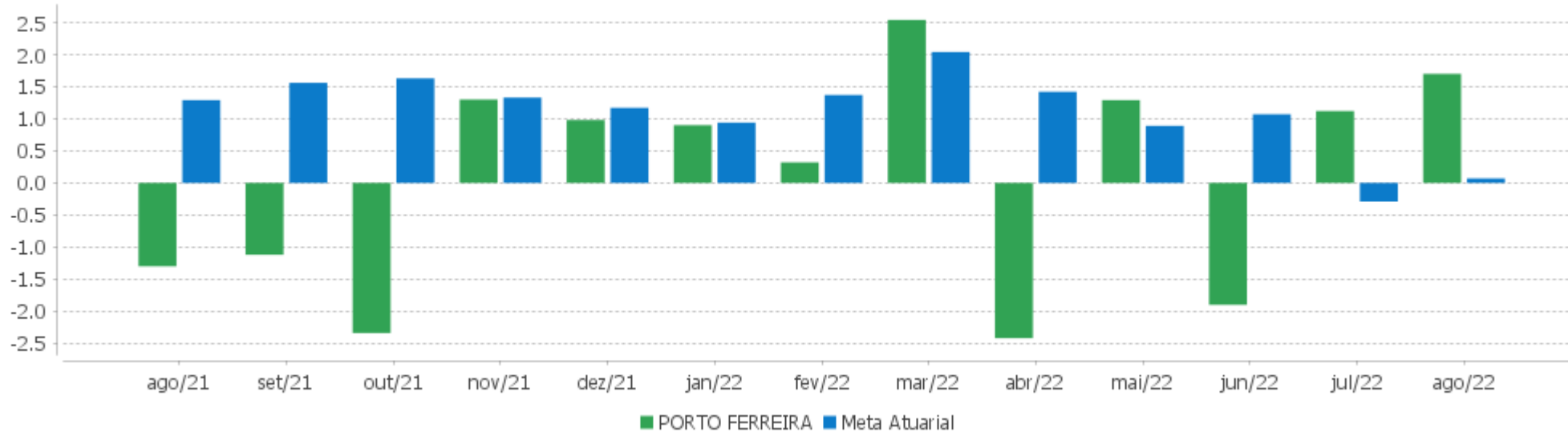


Patrimônio Líquido



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	-0,35 -29,84	-60,22 -778,49	-7,67 -236,10	-57,47 -933,39	-60,45 -592,59	-60,90 -462,08	-48,21 -274,46
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,20 0,09	4,52 -0,05	-0,12 0,03	4,77 -0,01	5,40 -0,14	8,57 -0,42	15,31 -0,92
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-0,01 -0,01	6,48 -0,14	0,31 -0,04	5,28 -0,10	9,66 -0,22	14,64 -0,48	25,00 -0,75
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,05 0,05	6,58 -0,04	0,40 0,06	5,38 -0,00	9,75 -0,13	14,69 -0,43	24,92 -0,83
FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,14 -0,23	6,38 0,01	0,26 -0,63	5,47 0,10			
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA APORTE IMEDIATO 495 RENDA FIXA LONGO PRAZO % do CDI	0,57 48,59	-0,02 -0,72					
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	1,17 100,57	7,85 101,46	3,25 100,12	6,07 98,57	10,37 101,71	12,85 97,47	17,25 98,19
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	2,49 0,01	2,50 -0,15	-0,56 -0,06	4,16 -0,15	1,06 -0,38	2,61 -0,66	6,98 -1,16
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	-0,04 0,32	6,17 -0,10	0,00 0,07	4,95 0,05	9,27 -0,16	14,82 -0,16	24,78 -1,36
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,21	5,39	1,95	4,70	6,43	7,49	13,99
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,47 1,83	6,96 2,57	2,51 2,88	5,40 2,61	8,49 -0,24	8,48 -10,77	18,47 -3,69
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,11 0,25	5,99 -0,29	-0,18 -0,11	4,77 -0,14	9,08 -0,34	14,35 -0,63	24,46 -1,68
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,08 -0,03	4,40 -0,17	-0,17 -0,03	4,65 -0,12	5,26 -0,28	8,44 -0,54	15,36 -0,86
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	2,45 -0,04	2,41 -0,24	-0,56 -0,06	4,13 -0,18	1,08 -0,36	2,59 -0,68	7,24 -0,89
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I % do CDI	0,34 29,27	-3,91 -50,59	0,13 3,91	-3,26 -52,95	-7,12 -69,75	1.799.093.258,17 13.651.602.355,39	8.648.136,40 49.233.664,78
INCENTIVO MULTISSETORIAL I FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	-0,22 -19,23	2,68 34,59	0,22 6,73	1,79 29,12	4,00 39,19	0,60 4,58	-4,66 -26,53
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,18 101,35	7,90 102,10	3,28 100,92	6,21 100,89	10,49 102,80	13,56 102,88	17,44 99,27
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,18 0,07	4,49 -0,09	-0,09 0,06	4,79 0,01	5,37 -0,18	8,54 -0,45	15,33 -0,90
LME REC IMA B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,05 -1,06	3,79 -0,79	0,86 1,00	2,67 -2,11	1,08 -4,46	-0,31 -9,30	-0,28 -16,50
BRADESCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	5,55 1,28	10,15 -1,06	0,33 2,91	1,69 -4,24	2,04 -2,25	20,27 -4,25	6,21 -13,77
BB PREVIDENCIARIO ACOES ALOCACAO FUNDO INVEST COTAS FUNDOS INVEST Var. IBOVESPA p.p.	7,56 1,40	7,40 2,91	0,58 2,22	0,06 3,26	-5,59 2,20	11,66 1,44	5,39 -2,90
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	8,60 2,43	9,65 5,17	2,54 4,18	4,73 7,93	-8,09 -0,30	6,00 -4,22	-4,55 -12,84
XP INVESTOR FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	6,95 0,79	18,13 13,64	5,16 6,80	10,72 13,92	5,41 13,21	7,33 -2,89	15,17 6,87
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	6,76 0,60	5,84 1,36	-1,19 0,45	-1,11 2,09	-12,72 -4,93	-4,36 -14,58	-10,26 -18,55
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	5,73 -0,44	2,04 -2,45	-4,04 -2,40	-3,86 -0,66	-5,07 2,73	16,50 6,28	25,86 17,56
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	6,58 -0,14	3,72 -0,73	-1,83 -0,17	-3,56 -0,41	-9,46 -0,90	8,39 -2,09	7,97 -3,19
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	6,88 -4,02	-1,45 4,90	-4,15 -1,73	-3,82 0,66	-16,67 5,58	-3,06 5,99	2,95 6,52
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-3,92 -0,87	-25,19 -0,74	4,51 -0,69	-10,76 -0,68	-16,57 -1,26	-3,06 -3,72	63,70 -5,37
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V % do CDI	-0,35 -30,12	-3,85 -49,71	-1,03 -31,56	-2,36 -38,29	-5,46 -53,54	-10,20 -77,40	-8,19 -46,61
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-3,24 1,18	-12,18 10,81	-1,75 -6,57	-5,28 3,82	-5,31 6,64	23,21 16,25	44,11 -25,02
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,00 -0,17	-0,99 -9,52	0,00 -1,13	-0,32 -6,20	-2,20 -17,45	131,54 97,58	-92,80 -138,26
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO Var. IFIX p.p.	0,14 -5,62	3,88 -2,23	3,39 -2,14	3,64 -4,94	4,22 -4,02	5,05 -1,92	7,66 -4,36
PORTO FERREIRA Var. IPCA + 4,84% p.p.	1,70 1,63	3,51 -4,23	0,89 0,04	2,25 -3,04	2,24 -11,75	6,06 -24,99	10,41 -30,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
CDI	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18	17,57
IBOVESPA	6,16	4,48	-1,64	-3,20	-7,79	10,22	8,29
INPC + 6,00%	0,22	8,80	1,22	6,02	15,36	34,99	47,30
IPCA + 6,00%	0,17	8,53	1,13	5,88	15,25	33,96	45,46

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
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 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-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+2 du	D+2 du		0,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIARIO ACOES ALOCACAO FUNDO INVEST COTAS FUNDOS INVEST	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA						
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 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 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA APORTE IMEDIATO 495 RENDA FIXA LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+0		
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA	Não se aplica	Não se aplica				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Não se aplica	Não se aplica				
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I	Não se aplica	Não se aplica				
INCENTIVO MULTISSETORIAL I FUNDO INVEST DIREITOS CREDITÓRIOS	Não se aplica	Não se aplica				
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,00
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	D+0	D+0				
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1008 du	D+1009 du	PERÍODO SEMESTRAL, C / VENCIMENTO NO ÚLTIMO DIA ÚTIL DE DEZEMBRO E JUNHO.	0,00
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
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,10
XP INVESTOR FI DE ACOES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	Para informações adicionais, vide o Regulamento	2,00

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	1,23	7,40	3,25	5,94	9,04	11,48	17,12	25,79	34,47
IRF-M 1+	2,60	4,60	3,92	4,62	4,80	1,32	12,10	35,02	42,44
IRF-M TOTAL	2,05	5,49	3,60	4,96	6,17	4,85	13,97	32,97	40,86
IMA-B 5	0,00	6,62	0,35	5,38	9,88	15,12	25,75	43,90	53,48
IMA-B 5+	2,49	2,65	-0,51	4,31	1,44	3,27	8,13	49,44	53,36
IMA-B TOTAL	1,10	4,57	-0,15	4,78	5,54	8,99	16,23	48,22	54,99
IMA-GERAL TOTAL	1,40	6,45	2,32	5,44	7,87	9,89	17,04	35,56	43,86
IDKA 2	-0,36	6,28	-0,07	4,90	9,42	14,98	26,14	42,02	53,43
IDKA 20	5,45	-0,98	-1,32	2,60	-6,74	-6,09	-6,32	50,07	49,07
CDI	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18	17,57	24,95	33,50

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,16	4,48	-1,64	-3,20	-7,79	10,22	8,29	42,84	54,62
IBRX 100	6,15	4,48	-2,00	-3,64	-8,18	10,99	9,74	48,00	58,88
IBRX 50	6,33	4,81	-1,81	-4,31	-7,38	13,10	10,63	42,79	55,02
SMALL CAP	10,90	-6,34	-2,42	-4,48	-22,25	-9,05	-3,57	45,68	42,28
IFIX	5,76	6,11	5,52	8,58	8,23	6,98	12,03	39,12	42,81
Índice Consumo - ICON	6,66		-0,20	-12,18	-31,25	-30,97	-26,99	10,55	-1,44
Índice Dividendos - IDIV	4,27	11,21	-2,58	5,93	4,28	24,51	19,98	80,27	80,79

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	-0,36	4,39	-0,37	2,79	8,73	19,25	22,16	26,35	31,65
INPC	-0,31	4,65	-0,29	2,93	8,83	20,17	23,70	27,76	32,42
IGPM	-0,70	7,63	0,09	3,81	8,59	42,37	60,92	68,88	83,90
SELIC	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18	17,57	24,95	33,51

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	-4,42	-22,99	4,82	-9,10	-11,94	6,95	69,12	70,71	163,33
MSCI ACWI	-4,03	-24,62	2,86	-11,55	-16,72	-0,77	50,18	46,85	110,90

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	-0,00	7,16	0,64	4,86	13,08	28,96	37,39	47,72	60,02
IPCA + 5,00%	0,08	7,84	0,89	5,37	14,16	31,45	41,39	53,46	67,82
IPCA + 5,50%	0,13	8,19	1,01	5,63	14,71	32,70	43,41	56,39	71,84
IPCA + 5,89%	0,16	8,45	1,11	5,83	15,13	33,68	45,01	58,71	75,02
IPCA + 6,00%	0,17	8,53	1,13	5,88	15,25	33,96	45,46	59,36	75,93
INPC + 4,00%	0,05	7,43	0,72	5,00	13,18	29,95	39,12	49,37	60,95
INPC + 6,00%	0,22	8,80	1,22	6,02	15,36	34,99	47,30	61,15	76,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
93	05/08/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	118.471,17	0,00	26.241,01056578	4,5147335200
101	05/08/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.800,00	0,00	1.506,17970400	4,5147335200
96	12/08/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.200,00	1.148,83551900	4,5263216000
97	19/08/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	500,00	110,17236800	4,5383416200
105	25/08/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.066.000,00	0,00	454.256,84274225	4,5480877900
98	25/08/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	130.000,00	0,00	28.583,44121800	4,5480877900
99	30/08/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	48.000,00	10.537,50789400	4,5551572000
103	30/08/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.720.000,00	377.594,01068600	4,5551569975
100	31/08/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	52.000,00	11.410,07350800	4,5573761700
104	31/08/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	504.000,00	110.589,94916600	4,5573761700
Total			2.321.271,17	2.329.700,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.706.219,09

Value-At-Risk: 2,59%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PORTO FERREIRA		2,59	2,59			181.584.503,74	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,58%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA		1,09	0,02	1,06			12.026.168,98	6,62
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA APORTE IMEDIATO 495 RENDA FIXA LONGO PRAZO		2,06	0,22	2,06			28.531.499,30	15,71
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,05	-0,00	0,04			8.663.596,78	4,77
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,29	0,05	0,05			5.282.190,57	2,91
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,34	0,08	0,05			8.742.769,20	4,81
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,10	0,05	0,04			13.558.148,17	7,47
BB PREV RF IDKA2		1,38	0,04	0,34			8.848.801,58	4,87
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		4,02	0,06	0,14			4.083.270,45	2,25
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,12	0,01	0,01			1.761.270,43	0,97
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		4,13	0,12	0,06			7.587.339,72	4,18
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,49	0,05	0,44			8.857.115,92	4,88
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,01	0,03	1,01			7.495.409,86	4,13
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,24	0,02	1,27			4.261.972,77	2,35
Sub-total	4,13	1,58	0,75		-0,11	0,71	119.699.553,73	65,92

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LME REC IMA B FI RENDA FIXA		0,51	0,00	2,14			4.584.577,36	2,52
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		2,39	0,14	0,10			14.860.349,21	8,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,04	0,00	0,02			5.871,96	0,00
Sub-total	5,30	1,88	0,15		-0,05	0,91	19.450.798,53	10,71

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I		0,14	-0,00	0,14			481.439,04	0,27
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC		0,05	-0,00	0,06			1.245.110,80	0,69
INCENTIVO MULTISSETORIAL I FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS		0,00	0,00	0,02			63.038,89	0,03
Sub-total	0,21	0,03	-0,00		-5,74	-0,06	1.789.588,73	0,99

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PIATÁ FI RF LONGO PRAZO		3,89	0,00	3,89			1.531.375,15	0,84
Sub-total	1,16	3,89	0,00		-1,31	-0,35	1.531.375,15	0,84

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,51%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADERCO FIA DIVIDENDOS		8,83	0,16	3,52			3.851.106,06	2,12
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		11,84	0,08	3,57			1.318.901,63	0,73
XP INVESTOR FI DE ACOES		9,32	0,35	4,38			7.702.596,23	4,24
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		9,55	0,21	0,12			4.642.315,73	2,56
BB PREVIDENCIARIO ACOES ALOCACAO FUNDO INVEST COTAS FUNDOS INVEST		10,54	0,23	2,14			4.769.472,21	2,63
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES		9,90	0,12	1,45			2.514.874,59	1,38
BRADERCO F I A SELECTION		10,62	0,23	3,18			4.285.484,96	2,36
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI		9,53	0,19	2,03			4.261.841,39	2,35
Sub-total	18,17	9,51	1,56		0,31	6,86	33.346.592,80	18,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,15%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO		0,15	-0,00	1,80			2.392.321,37	1,32
Sub-total	0,48	0,15	-0,00		-2,14	0,14	2.392.321,37	1,32

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 14,51%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V		0,02	0,00	0,03			18.098,06	0,01
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		14,64	0,10	8,42			1.977.501,13	1,09
Sub-total	18,86	14,51	0,10		-0,23	-3,21	1.995.599,19	1,10

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
Sub-total	0,00	NaN	0,00		0,00	NaN	0,00	0,00

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,06%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		12,06	0,02	2,87			1.378.674,24	0,76
Sub-total	22,60	12,06	0,02		-0,22	-3,92	1.378.674,24	0,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de Agosto de 2022, vale observar que:

- O Instituto está com 7,32% do patrimônio líquido do fundo INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I - SERIE B, percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O Instituto está com 6,30% do patrimônio líquido do fundo INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I, percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;