



LDB
EMPRESAS

VILA VELHA - 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

84,76%

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 150523 (5,661000%)	2,93	0,98	8,47	21.174.568,88	4,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,840000%)	2,94	1,00	8,57	16.036.039,93	3,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (6,000000%)	2,94	1,01	3,38	40.165.108,14	8,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (6,760000%)	4,16	0,61	0,61	22.130.786,97	4,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (3,680000%) ..	0,53	0,83	7,47	7.447.388,90	1,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,290000%) ..	0,53	0,87	7,78	379.270,11	0,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,100000%) ..	0,53	0,94	8,19	14.720.660,80	2,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	4,55	0,99	7,92	26.190.231,11	5,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,260000%)	0,53	0,95	8,27	21.260.558,39	4,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,250000%)	2,82	0,95	8,27	26.822.839,40	5,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,270000%)	2,74	0,95	8,28	32.219.301,11	6,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,290000%)	2,69	0,96	8,29	26.861.227,85	5,38
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,72	0,97	8,34	255.407.981,59	51,16

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 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,15	0,22	6,17	20.645.963,27	4,14	2.358.630.614,34	0,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,15	0,22	6,17	15.472.445,40	3,10	475.287.978,07	3,26
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	1,69	0,31	7,18	3.717.130,57	0,74	495.612.154,77	0,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	1,02	8,66	7.807.476,91	1,56	100.979.522,46	7,73
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,59	0,27	6,46	6.122.816,01	1,23	9.717.321.383,29	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,67	0,22	6,41	33.060.336,96	6,62	11.226.926.091,22	0,29
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,16	0,88	4,59	708.993,97	0,14	794.285.280,96	0,09
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,29	0,33	7,12	4.407.726,08	0,88	2.872.769.394,76	0,15
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	1,85	0,28	6,84	2.589.874,88	0,52	306.971.613,84	0,84
BB	BB	BB PREV RF VII	1,69	0,31	7,18	1.653.484,10	0,33	258.295.551,92	0,64
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,02	0,27	6,72	5.845.843,27	1,17	450.401.274,36	1,30
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	1,69	0,31	7,17	7.014.174,54	1,40	214.696.158,62	3,27
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,17	1,02	1,26	7.981.990,93	1,60	3.689.784.641,04	0,22
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,60	0,36	6,65	117.028.256,89	23,44		

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
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,15	0,77	3,96	1.440.707,16	0,29	951.713.272,00	0,15
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	1,03	4,60	3.896.140,71	0,78	9.838.414.136,64	0,04
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,18	0,93	4,87	1.305.448,05	0,26	3.467.595.820,39	0,04
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,22	1,04	5,70	39.043.698,03	7,82	3.350.165.548,27	1,17
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,22	1,04	3,73	5.072.133,90	1,02	3.260.931.310,44	0,16
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,14	1,02	5,44	50.758.127,85	10,17		
Renda Fixa			1,81	0,81	7,37	423.194.366,33	84,76		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

2,68%

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	-8,08	3.230.868,61	0,65	228.591.211,08	1,41
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇÁ FI	20,44	-11,79	-6,80	256.260,62	0,05	849.686.726,55	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	20,06	-11,26	-5,82	9.882.065,44	1,98	468.102.681,74	2,11
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	19,99	-7,44	-17,82	20.605,70	0,00	1.567.240.403,34	0,00
Sub-total Artigo 8º I			18,78	-10,57	-17,78	13.389.800,37	2,68		
Renda Variável			16,21	-10,57	-17,78	13.389.800,37	2,68		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,68%

Artigo 9º III (Fundos de 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	15.101.420,77	3,02	2.225.410.384,30	0,68
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	21,84	1,36	-29,84	3.681.099,10	0,74	1.420.707.173,52	0,26
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	20,14	0,02	-27,37	4.598.911,72	0,92	775.941.708,13	0,59
Sub-total Artigo 9º III			20,53	0,75	-28,00	23.381.431,59	4,68		
Investimentos no Exterior			20,53	0,75	-28,00	23.381.431,59	4,68		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,87%

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	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	19,96	-7,78	-17,57	39.310.645,18	7,87	2.072.988.175,00	1,90
Sub-total Artigo 10º I			19,96	-7,78	-17,57	39.310.645,18	7,87		
Investimentos Estruturados			24,98	-7,78	-17,57	39.310.645,18	7,87		
Total			5,18	-0,27	-0,25	499.276.243,47	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 a	Títulos do Tesouro Nacional	255.407.981,59	51,16	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	117.028.256,89	23,44	0,00	14,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	50.758.127,85	10,17	0,00	14,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	423.194.366,33	84,76					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	13.389.800,37	2,68	0,00	16,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	13.389.800,37	2,68					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	23.381.431,59	4,68	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	23.381.431,59	4,68					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	39.310.645,18	7,87	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	39.310.645,18	7,87					15,00
Total		499.276.243,47	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 a % do CDI	0,97 95,98	8,34 154,44	4,53 155,85	8,34 154,44	17,54 202,66	2.371.464,56	16.378.351,30
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,36 35,17	6,65 123,04	2,77 95,32	6,65 123,04	8,54 98,62	445.515,68	6.255.158,91
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,02 100,31	5,44 100,77	2,95 101,41	5,44 100,77		564.519,18	2.751.698,36
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	0,45 8,30	0,00 0,00	0,45 8,30		0,00	30.909,22
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-10,57 0,93	-17,78 -11,78	-16,55 1,33	-17,78 -11,78		-1.582.444,74	-5.666.942,01
Artigo 9º III % do CDI	0,75 74,09	-28,00 -518,45	-10,22 -351,58	-28,00 -518,45	-12,55 -144,95	174.270,56	-12.210.835,82
Artigo 10º I % do CDI	-7,78 -767,62	-17,57 -325,31	-14,98 -515,35	-17,57 -325,31		-3.316.465,81	-8.379.980,35
VILA VELHA - CONSOLIDADO (Total)						-1.343.140,57	-841.640,39

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 (5,661000%)	20.968.068,10	0,00	0,00	0,00	21.174.568,88	206.500,78	1.693.667,35
NTN-B 150523 (5,840000%)	15.877.412,29	0,00	0,00	0,00	16.036.039,93	158.627,64	1.295.266,57
NTN-B 150523 (6,000000%)	39.762.797,12	0,00	0,00	0,00	40.165.108,14	402.311,02	1.335.196,92
NTN-B 150523 (6,760000%)	0,00	21.997.094,03	0,00	0,00	22.130.786,97	133.692,94	133.692,94
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	7.386.398,50	0,00	0,00	0,00	7.447.388,90	60.990,40	526.856,37
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	375.980,46	0,00	0,00	0,00	379.270,11	3.289,65	27.905,93
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	14.583.572,59	0,00	0,00	0,00	14.720.660,80	137.088,21	1.138.301,61
NTN-B 150545 (5,730000%)	25.933.405,59	0,00	0,00	0,00	26.190.231,11	256.825,52	1.966.667,46
NTN-B 150555 (5,260000%)	21.059.898,43	0,00	0,00	0,00	21.260.558,39	200.659,96	1.659.146,98
NTN-B 150830 (5,250000%)	26.569.877,05	0,00	0,00	0,00	26.822.839,40	252.962,35	2.059.295,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150840 (5,270000%)	31.914.935,59	0,00	0,00	0,00	32.219.301,11	304.365,52	2.475.992,84
NTN-B 150850 (5,290000%)	26.607.077,28	0,00	0,00	0,00	26.861.227,85	254.150,57	2.066.361,28
					255.407.981,59	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 RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	3.705.549,21	0,00	0,00	0,00	3.717.130,57	11.581,36	250.264,21
BB PREV RF IDKA2	6.106.566,07	0,00	0,00	0,00	6.122.816,01	16.249,94	371.356,40
BB PREV RF IPCA	4.393.337,06	0,00	0,00	0,00	4.407.726,08	14.389,02	293.361,83
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	2.582.617,07	0,00	0,00	0,00	2.589.874,88	7.257,81	166.542,00
BB PREV RF VII	1.648.353,44	0,00	0,00	0,00	1.653.484,10	5.130,66	111.229,89
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	5.830.099,61	0,00	0,00	0,00	5.845.843,27	15.743,66	369.573,10
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	6.992.458,17	0,00	0,00	0,00	7.014.174,54	21.716,37	471.572,91
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.728.951,30	0,00	0,00	0,00	7.807.476,91	78.525,61	626.167,22
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.438.367,50	0,00	0,00	0,00	15.472.445,40	34.077,90	902.606,42
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.600.350,59	0,00	0,00	0,00	20.645.963,27	45.612,68	1.203.717,90
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	664.160,63	417.859,68	-379.215,76	0,00	708.993,97	6.189,42	29.413,48
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	42.951.765,62	0,00	-10.000.000,00	0,00	33.060.336,96	108.571,34	1.416.713,67
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	7.901.521,02	0,00	0,00	0,00	7.981.990,93	80.469,91	99.396,21
					117.028.256,89	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 INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.331.426,05	18.626.550,13	-18.545.767,60	0,00	1.440.707,16	28.498,58	141.233,31
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	46.766.650,69	3.840.000,00	-11.997.000,00	0,00	39.043.698,03	434.047,34	2.049.356,17
BB PREV RF FLUXO FIC	1.111.717,66	309.951,67	-126.539,88	0,00	1.305.448,05	10.318,60	53.514,54
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.856.575,66	0,00	0,00	0,00	3.896.140,71	39.565,05	171.392,33
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	5.020.044,29	0,00	0,00	0,00	5.072.133,90	52.089,61	182.278,86
					50.758.127,85	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 BOLSA AMERICANA FIA	22.262,85	0,00	0,00	0,00	20.605,70	-1.657,15	-4.229.302,50
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	290.501,32	0,00	0,00	0,00	256.260,62	-34.240,70	-18.686,53
FIA CAIXA BRASIL IBOVSPA	11.135.810,86	0,00	0,00	0,00	9.882.065,44	-1.253.745,42	-1.536.562,55
FIA CAIXA DIVIDENDOS	3.523.670,08	0,00	0,00	0,00	3.230.868,61	-292.801,47	-284.131,39
					13.389.800,37	0,00	0,00

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	4.598.070,06	0,00	0,00	0,00	4.598.911,72	841,66	-4.822.275,82
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	14.977.486,02	0,00	0,00	0,00	15.101.420,77	123.934,75	-5.823.136,66
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	3.631.604,95	0,00	0,00	0,00	3.681.099,10	49.494,15	-1.565.423,34
					23.381.431,59	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	42.627.110,99	0,00	0,00	0,00	39.310.645,18	-3.316.465,81	-8.379.980,35
					39.310.645,18	0,00	0,00

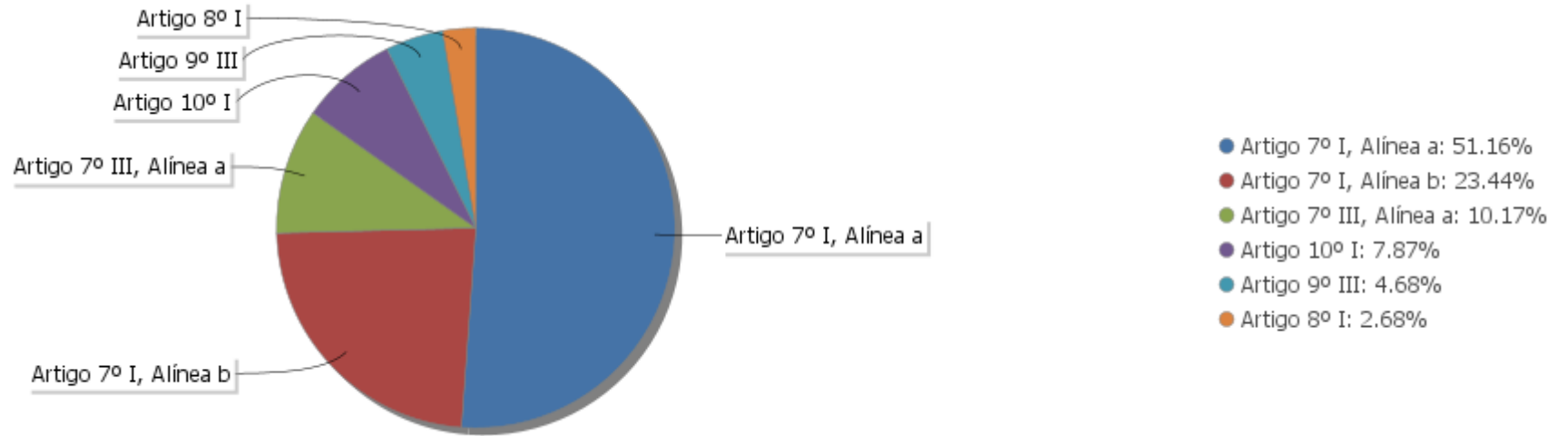
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

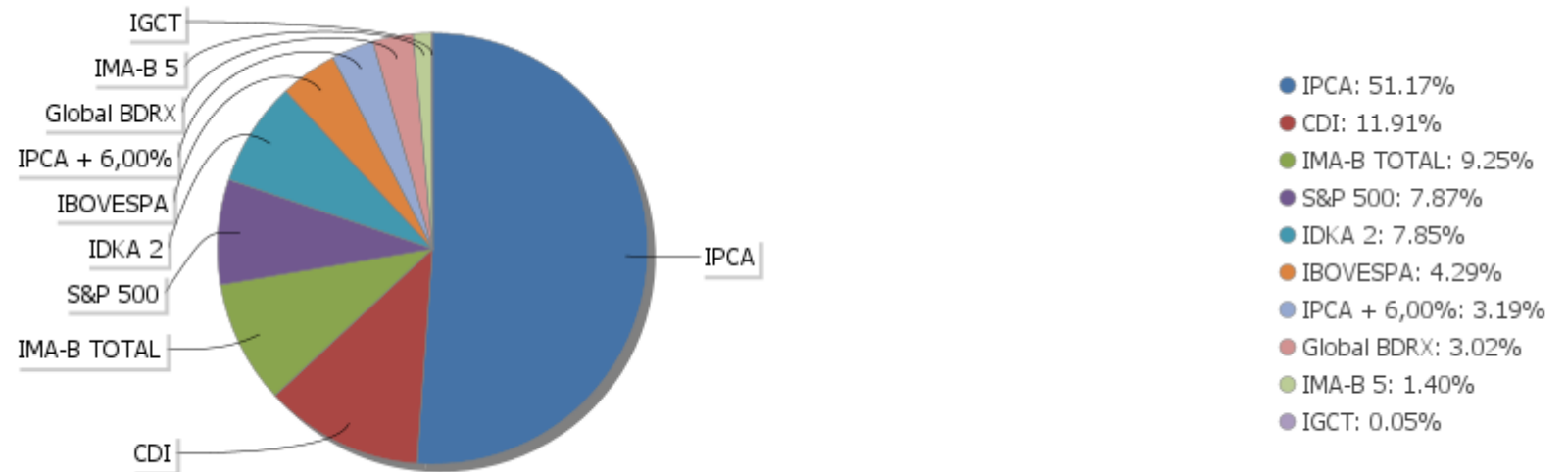
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	194.906.408,98	39,04	194.906.408,98	39,04
de 31 a 365 dias	103.914.230,00	20,81	298.820.638,98	59,85
acima de 365 dias	200.455.604,49	40,15	499.276.243,47	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

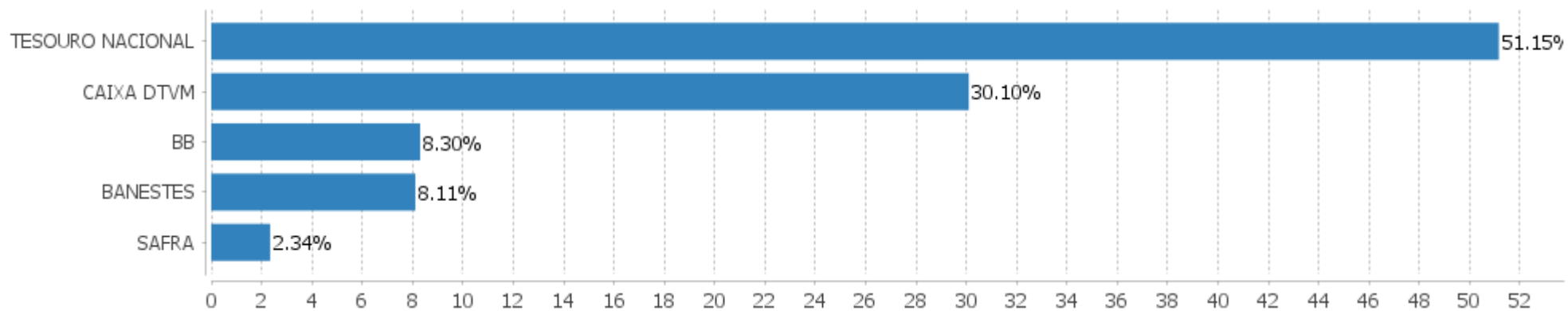


Alocação Por Estratégia



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	-1,78	-0,48	1,88	-0,54	0,98	-0,27							-0,25
IPCA + 4,92%	0,94	1,38	2,05	1,43	0,89	1,07							8,01
p.p. indexador	-2,72	-1,86	-0,16	-1,97	0,09	-1,35							-8,26
2021	-0,48	-1,03	1,05	1,06	0,94	0,42	0,32	0,32	-1,16	1,81	0,80	2,14	6,31
IPCA + 5,43%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,97	1,43	1,34	1,61	1,68	1,37	1,22	16,01
p.p. indexador	-1,15	-2,27	-0,37	0,33	-0,33	-0,56	-1,10	-1,02	-2,77	0,13	-0,57	0,93	-9,70
2020	0,49	-0,79	-6,98	1,89	2,02	2,02	2,94	-0,49	-1,49	-0,01	2,81	3,55	5,63
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,63
p.p. indexador	-0,22	-1,45	-7,55	1,75	1,95	1,28	2,06	-1,21	-2,61	-1,35	1,46	1,69	-5,00
2019	2,66	0,46	0,52	1,25	2,07	2,43	1,16	-0,08	2,05	2,10	-0,88	2,10	16,97
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	1,83	-0,43	-0,68	0,19	1,43	1,98	0,44	-0,70	1,60	1,47	-1,85	0,46	6,38
2018								0,28	0,40	3,39	0,72	1,12	6,02
IPCA + 6,00%								0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	3,23
p.p. indexador								-0,17	-0,52	2,42	0,47	0,51	2,78

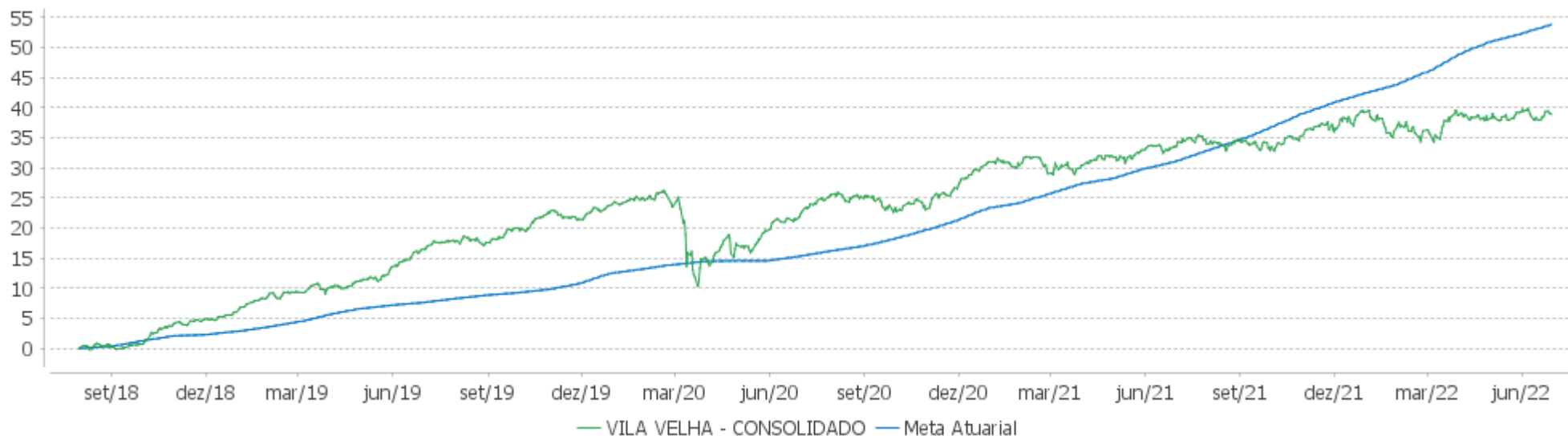
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

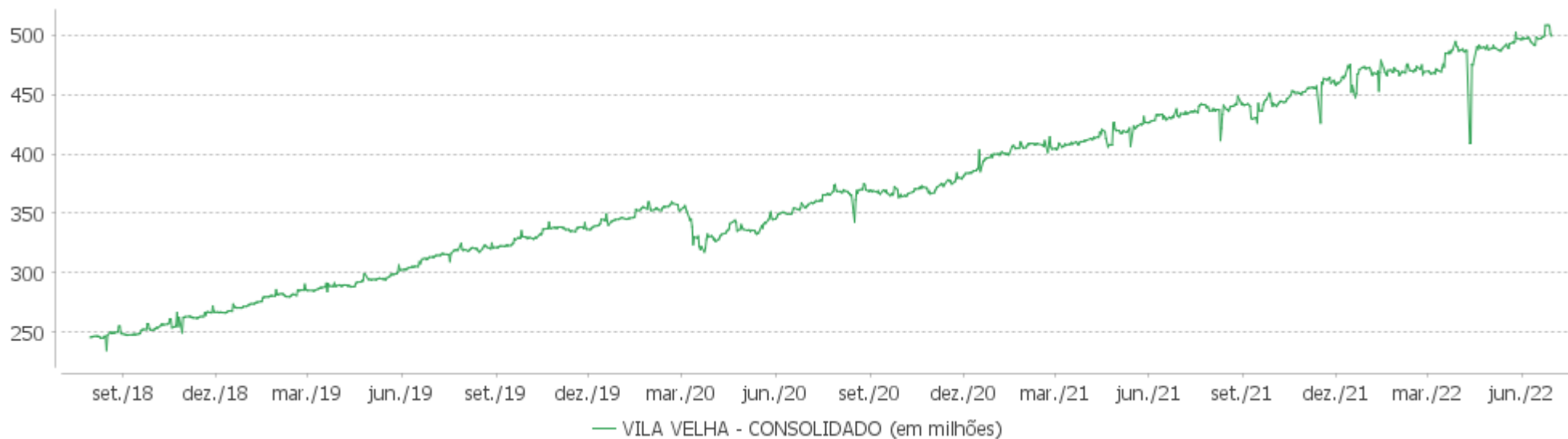
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	21	44,68	03 meses	0,16	3,43	-3,27	4,12
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	55,32	06 meses	-0,25	8,01	-8,26	5,47
			12 meses	4,01	17,68	-13,67	5,18
			24 meses	13,90	34,68	-20,78	4,81
Maior rentabilidade da Carteira	3,55	2020-12	36 meses	19,39	45,75	-26,36	6,26
Menor rentabilidade da Carteira	-6,98	2020-03	Desde 31/07/2018	38,90	58,26	-19,36	5,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

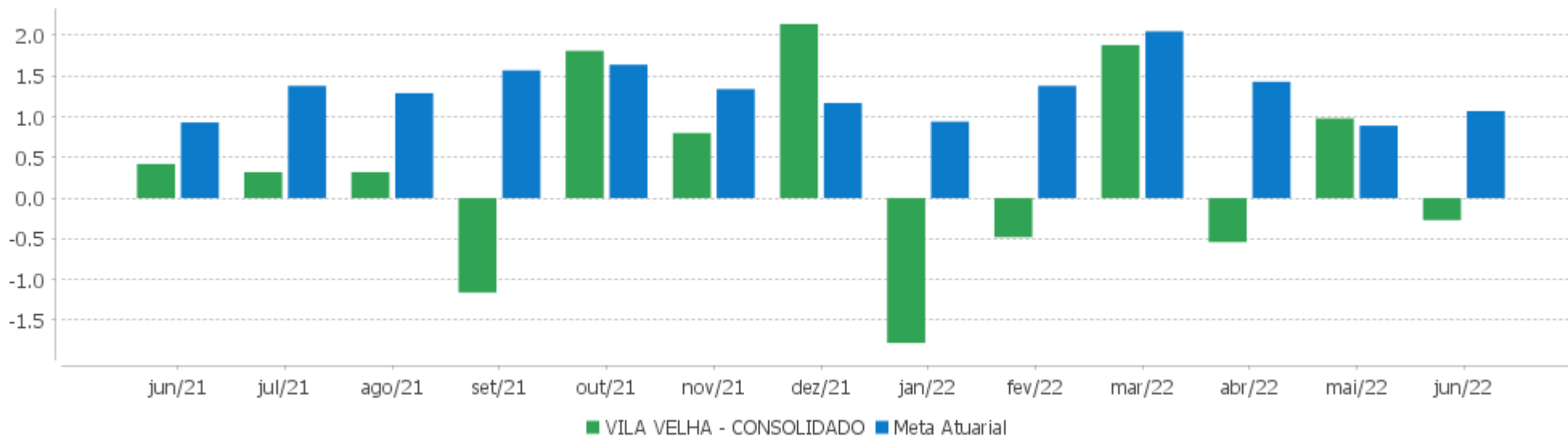


Patrimônio Líquido



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 150523 (6,000000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,34	8,65 3,16	4,34 2,12	8,65 3,16	15,10 3,22	24,54 3,32	27,11 3,30
NTN-B 150545 (5,100000%) .. Var. IPCA p.p.	0,94 0,27	8,19 2,70	4,12 1,90	8,19 2,70	17,50 5,61	33,62 12,39	43,31 19,50
NTN-B 150523 (5,661000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,31	8,47 2,99	4,26 2,04	8,47 2,99	14,75 2,86	23,82 2,59	26,03 2,22
NTN-B 150850 (5,290000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,29	8,29 2,80	4,17 1,95	8,29 2,80	14,64 2,76	23,90 2,67	26,30 2,49
NTN-B 150545 (4,290000%) .. Var. IPCA p.p.	0,87 0,20	7,78 2,29	3,92 1,71	7,78 2,29	16,59 4,70	31,57 10,34	40,02 16,21
NTN-B 150523 (5,840000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,33	8,57 3,08	4,30 2,08	8,57 3,08	14,94 3,05	24,20 2,97	26,60 2,79
NTN-B 150545 (3,680000%) .. Var. IPCA p.p.	0,83 0,16	7,47 1,98	3,77 1,56	7,47 1,98	15,91 4,02	30,04 8,81	37,58 13,77
NTN-B 150840 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,28	8,28 2,79	4,16 1,95	8,28 2,79	14,57 2,68	23,69 2,47	25,97 2,16
NTN-B 150523 (6,760000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,40	5,88 0,39	1,50 -0,71	5,88 0,39	12,54 0,66	22,54 1,31	25,81 2,00
NTN-B 150830 (5,250000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,28	8,27 2,78	4,16 1,94	8,27 2,78	14,45 2,57	23,34 2,12	25,40 1,59
NTN-B 150555 (5,260000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,28	8,27 2,79	4,16 1,94	8,27 2,79	17,68 5,79	27,20 5,98	29,70 5,89
NTN-B 150545 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,32	8,51 3,02	6,67 4,45	8,51 3,02	14,92 3,04	24,28 3,06	26,77 2,96
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,28 0,64	6,84 2,50	2,81 1,38	6,84 2,50	10,89 7,12	17,89 6,41	28,97 11,97
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 RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,31 -0,85	7,18 -1,37	3,03 -0,66	7,18 -1,37	11,79 -6,81	19,50 -16,68	29,55 -17,91
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
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,88	4,59	2,50	4,59	7,12	8,63	12,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	86,38	85,01	85,98	85,01	82,22	77,61	78,03
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,27 0,63	6,72 2,37	2,73 1,30	6,72 2,37	10,57 6,79	16,93 5,44	26,76 9,76
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,22 0,58	6,17 1,83	2,37 0,94	6,17 1,83	9,15 5,37	14,45 2,97	26,22 9,23
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,02 -0,14	8,66 0,11	4,35 0,66	8,66 0,11	18,54 -0,06	35,87 -0,31	43,10 -4,36
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
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,33 -0,83	7,12 -1,43	3,08 -0,61	7,12 -1,43	10,31 -8,29	16,86 -19,32	28,75 -18,71
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,22 0,59	6,17 1,82	2,37 0,94	6,17 1,82	9,15 5,38	14,46 2,98	26,24 9,24
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
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	1,04 102,28	5,70 105,57	3,02 103,85	5,70 105,57	9,48 109,49	13,50 121,41	14,72 90,56
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
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,93 91,99	4,87 90,16	2,63 90,64	4,87 90,16	7,48 86,44	8,72 78,45	12,53 77,09
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO % do CDI	0,77 75,64	3,96 73,37	2,18 74,92	3,96 73,37	5,92 68,42	6,49 58,38	8,23 50,66
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	1,04 102,38	5,69 105,34	2,94 101,27	5,69 105,34	9,23 106,59	11,71 105,31	16,48 101,37
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-11,26 0,24	-5,82 0,17	-17,59 0,29	-5,82 0,17	-22,15 0,14	3,40 -0,27	-2,76 -0,36
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA Var. IBOVESPA p.p.	-7,44 4,06	-17,82 -11,82	-14,85 3,03	-17,82 -11,82	-7,14 15,15	28,23 24,56	
FIA CAIXA DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	-8,31 3,19	4,05 10,04	-9,45 8,44	4,05 10,04	-7,36 14,93	11,21 7,54	9,52 11,92
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	-11,79 0,04	-6,80 -0,45	-18,32 -0,10	-6,80 -0,45	-24,50 -0,65	2,17 -1,98	-1,85 -2,77
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,83	-27,83	-10,22	-27,83	-13,08	9,72	69,62

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Global BDRX p.p.	0,03	-0,22	0,06	-0,22	-0,98	-2,78	-4,54
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	0,02	-27,37	-9,82	-27,37	-11,10	9,17	61,64
Var. IBOVESPA p.p.	11,52	-21,38	8,07	-21,38	11,18	5,50	64,04
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
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
VILA VELHA - CONSOLIDADO	-0,27	-0,25	0,16	-0,25	4,01	13,90	19,39
Var. IPCA + 4,92% p.p.	-1,35	-8,26	-3,27	-8,26	-13,38	-19,52	-23,61
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
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+0		1,70
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,60
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IPCA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI 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 PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50
FIA CAIXA DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI			D+0	D+0		0,10

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
1528	01/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.950,27	0,00	227,37674038	8,5772625500
1545	01/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	82.674,75	41.011,09006700	2,0159120000
1514	03/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.027,25	0,00	119,67931903	8,5833543200
1538	03/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	15.873,26	6.988,13663600	2,2714581620
1539	08/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.457,93	4.158,38008900	2,2744265310
1523	08/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	5.097,77	593,27858158	8,5925401000
1516	10/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	988,33	0,00	114,94004150	8,5986570700
1540	10/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.880,44	826,06156800	2,2763920680
1546	10/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	94.192,67	0,00	46.591,79247900	2,0216580000
1511	13/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	26.970,25	3.135,43940249	8,6017449400
1524	13/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	235.593,80	27.389,07067982	8,6017449400
1517	14/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	11.992.119,25	0,00	1.393.660,00294906	8,6047667500
1509	14/06/2022	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	5.826.615,33	3.044.249,78304174	1,9139741300
1508	14/06/2022	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	6.170.384,67	3.223.860,01633157	1,9139741300
1525	14/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	25.815,82	3.000,17661827	8,6047667500
1513	15/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	841,79	97,79345420	8,6078358400
1512	15/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	486.729,41	56.544,92299269	8,6078358400
1518	15/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	6.552.174,62	761.187,21835273	8,6078358400
1550	15/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	989,39	114,94062136	8,6078358400
1515	15/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.030,18	119,67931896	8,6078358400
1537	15/06/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	10.000.000,00	3.740.998,68952816	2,6730830000
1530	15/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	514.452,06	0,00	59.765,55193323	8,6078358400
1547	15/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.334,27	659,18783300	2,0241120000
1553	15/06/2022	NTN-B 150523 (6,760000%)	21.997.094,03	0,00	5.543,00000000	3.968,4456130000
1519	20/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.840.000,00	445.777,36646422	8,6141654800
1510	20/06/2022	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	3.840.000,00	0,00	2.003.161,48962099	1,9169697600
1541	20/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	25.892,01	11.349,31524200	2,2813719990
1532	20/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	114.626,59	0,00	13.306,75505650	8,6141654800

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1521	22/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	427,76	0,00	49,61997178	8,6207223500
1522	23/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	409,68	0,00	47,50582228	8,6237850500
1542	24/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	15.234,37	6.665,54842400	2,2855388680
1534	24/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	6.000.548,94	0,00	695.552,62917741	8,6270235900
1548	24/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	323.667,01	0,00	159.500,33411200	2,0292560000
1520	28/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	380.806,72	44.108,89697725	8,6333312800
1543	28/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	309.951,67	0,00	135.491,96041000	2,2876019290
1526	28/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	70.743,62	8.194,24365201	8,6333312800
1551	29/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	656.045,70	75.963,83207233	8,6362902200
1533	29/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	114.921,00	13.306,75505650	8,6362902200
1527	29/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	486.488,16	56.330,68738143	8,6362902200
1531	29/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	516.152,65	59.765,55174173	8,6362902200
1535	29/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	4.346.628,41	503.298,09435237	8,6362902200
1529	29/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.963,69	227,37674040	8,6362902200
1552	30/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	29.846,76	3.454,57349903	8,6397814400
1544	30/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	58.201,87	25.419,64103000	2,2896416960
1536	30/06/2022	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	766.927,86	88.767,04409061	8,6397814400
1549	30/06/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	295.206,74	145.226,66084200	2,0327310000
Total			45.191.455,51	41.048.523,24		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 9.230.420,51

Value-At-Risk: 1,85%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VILA VELHA - CONSOLIDADO		1,85	1,85			499.276.243,47	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,31%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150523 (5,661000%)		0,12	0,00	0,15			21.174.568,88	4,24
NTN-B 150523 (5,840000%)		0,12	0,00	0,15			16.036.039,93	3,21
NTN-B 150523 (6,000000%)		0,12	0,00	0,15			40.165.108,14	8,04
NTN-B 150523 (6,760000%)		0,25	-0,00	0,26			22.130.786,97	4,43
NTN-B 150545 (3,680000%) ..		0,12	0,00	0,15			7.447.388,90	1,49
NTN-B 150545 (4,290000%) ..		0,12	0,00	0,15			379.270,11	0,08
NTN-B 150545 (5,100000%) ..		0,12	0,00	0,15			14.720.660,80	2,95
NTN-B 150545 (5,730000%)		0,31	0,00	0,34			26.190.231,11	5,25
NTN-B 150555 (5,260000%)		0,12	0,00	0,15			21.260.558,39	4,26
NTN-B 150830 (5,250000%)		0,12	0,00	0,15			26.822.839,40	5,37
NTN-B 150840 (5,270000%)		0,12	0,00	0,15			32.219.301,11	6,45
NTN-B 150850 (5,290000%)		0,12	0,00	0,15			26.861.227,85	5,38
Sub-total	0,37	0,11	0,00		-0,11	0,97	255.407.981,59	51,16

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,51	0,02	1,14			20.645.963,27	4,14
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,51	0,02	1,14			15.472.445,40	3,10
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI		0,81	0,00	0,78			3.717.130,57	0,74
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,12	0,00	0,15			7.807.476,91	1,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IDKA2		1,29	0,01	0,28			6.122.816,01	1,23
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,39	0,03	0,37			33.060.336,96	6,62
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,02	-0,00	0,00			708.993,97	0,14
BB PREV RF IPCA		0,91	0,00	0,88			4.407.726,08	0,88
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI		0,84	0,00	1,80			2.589.874,88	0,52
BB PREV RF VII		0,81	0,00	2,13			1.653.484,10	0,33
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI		0,97	0,00	1,65			5.845.843,27	1,17
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP		0,81	0,00	0,94			7.014.174,54	1,40
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI		0,03	0,00	0,02			7.981.990,93	1,60
Sub-total	2,37	1,06	0,08		-0,28	0,36	117.028.256,89	23,44

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO		0,02	-0,00	0,01			1.440.707,16	0,29
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,03	0,00	0,02			3.896.140,71	0,78
BB PREV RF FLUXO FIC		0,02	-0,00	0,01			1.305.448,05	0,26
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI		0,04	0,00	0,04			39.043.698,03	7,82
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,04	-0,00	0,03			5.072.133,90	1,02
Sub-total	0,06	0,04	0,00		0,05	1,02	50.758.127,85	10,17

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 14,16%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		14,16	1,08	8,35			39.310.645,18	7,87
Sub-total	28,96	14,16	1,08		-0,30	-7,78	39.310.645,18	7,87

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 13,02%

Artigo 9º III

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		12,84	0,31	2,47			15.101.420,77	3,02
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		15,23	0,09	15,09			3.681.099,10	0,74
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I		12,80	0,10	13,40			4.598.911,72	0,92
Sub-total	25,45	13,02	0,50		-0,01	0,75	23.381.431,59	4,68

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,36%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA DIVIDENDOS		7,63	0,03	5,33			3.230.868,61	0,65
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		9,85	0,00	0,11			256.260,62	0,05
FIA CAIXA BRASIL IBOVSPA		10,18	0,14	0,16			9.882.065,44	1,98
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA		15,54	0,00	11,03			20.605,70	0,00
Sub-total	17,41	9,36	0,18		-0,67	-10,57	13.389.800,37	2,68