



LDB
EMPRESAS

HORTOLÂNDIA
JULHO 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 29.07.2022.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 81,55%

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 150824	3,19	-0,31	5,97	37.105.075,02	5,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	9,66	-2,06	-0,56	14.592.082,88	2,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,170000%)	0,58	0,43	8,69	21.027.514,37	3,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,660001%)	2,83	0,47	7,36	20.876.489,96	3,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,859998%)	2,90	0,48	6,10	20.621.044,47	3,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,020001%)	2,68	0,42	8,60	50.540.685,01	7,57
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		2,89	0,04	7,01	164.762.891,71	24,67

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,75	1,04	5,95	66.295.450,84	9,93	4.977.668.769,91	1,33
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,48	-0,89	3,29	73.667.337,59	11,03	5.189.858.068,29	1,42
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,76	-0,29	6,10	65.728.184,14	9,84	10.530.457.571,28	0,62
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,17	0,80	6,12	52.310.609,27	7,83	2.528.329.321,31	2,07
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,55	0,41	4,13	50.277.846,29	7,53	4.928.627.960,16	1,02
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,02	0,79	5,41	64.404.849,43	9,64	6.217.671.822,00	1,04
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,37	0,26	5,15	372.684.277,56	55,81		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	2,43	0,46	3,74	3.728.566,79	0,56	70.647.802,32	5,28
QUELUZ	RJI	BRA1 FI RENDA FIXA	1,72	-0,03	3,82	319.690,20	0,05	7.664.959,91	4,17
VERITAS	RJI	FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	51,41	20,28	3,69	544.511,69	0,08	83.017.939,07	0,66
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			4,01	2,45	3,55	4.592.768,68	0,69		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1,43	0,21	2,91	1.873.863,72	0,28	74.187.990,30	2,53
PETRA	FINAXIS	FIDC PREMIUM	88,51	-0,38	-59,25	679.607,35	0,10	81.898.860,94	0,83
BRPP	GENIAL	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
BRPP	GENIAL	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
BRPP	GENIAL	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			42,48	0,06	-26,81	2.553.471,07	0,38		
Renda Fixa			2,23	0,21	5,45	544.593.409,02	81,55		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

13,33%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	24,80	5,81	-7,79	22.092.135,58	3,31	978.721.458,42	2,26
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	16,91	3,78	-8,64	41.902.677,33	6,27	1.062.628.935,91	3,94
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,86	6,01	-3,20	25.048.906,68	3,75	1.957.830.490,61	1,28
Sub-total Artigo 8º I			18,78	4,90	-6,96	89.043.719,59	13,33		
Renda Variável			18,11	4,90	-6,96	89.043.719,59	13,33		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,37%

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
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	33,83	11,73	-40,87	8.352.518,54	1,25	622.030.531,24	1,34
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	20,54	7,67	-21,75	20.816.407,94	3,12	286.089.629,20	7,28
Sub-total Artigo 9º II			22,94	8,80	-28,38	29.168.926,48	4,37		
Investimentos no Exterior			22,94	8,80	-28,38	29.168.926,48	4,37		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,24%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
VERITAS	RJI	CONQUEST FI MULTIMERCADO-EM LIQUIDAÇÃO	0,00	0,00	0,00	-88.757,47	-0,01	-13.532.239,17	
GRAPHEN	RJI	LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	0,74	-0,34	-3,51	211.523,05	0,03	1.498.006,47	14,12
Sub-total Artigo 10º I			239,17	-83,79	-84,31	122.765,58	0,02		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
QUELUZ	BNY MELLON	BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	0,28	-0,06	-0,34	1.505.901,54	0,23	27.804.185,53	5,42
GENIAL	RJI	GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	0,89	0,00	-100,00	0,00	0,00	0,00	
VALORA	BEM	FIP BRASIL ÓLEO & GÁS	241,03	1.008,07	-13.031,76	455,01	0,00	114.948,45	0,40
Sub-total Artigo 10º II			39,11	0,25	-25,82	1.506.356,55	0,23		
Investimentos Estruturados			37,59	-10,16	-31,53	1.629.122,13	0,24		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,50%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	14,28	1,21	-5,29	1.811.800,00	0,27	1.194.682.127,67	0,15
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BRCR11	22,20	-7,38	-17,67	184.535,10	0,03	2.689.411.478,04	0,01
QUELUZ	RJI	ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	55,21	-0,10	15,12	1.363.981,83	0,20	146.040.332,17	0,93
Sub-total Artigo 11º			11,40	0,17	1,01	3.360.316,93	0,50		
Fundos Imobiliários			11,40	0,17	1,01	3.360.316,93	0,50		
Total			3,81	1,14	1,38	667.795.494,15	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	164.762.891,71	24,67	0,00	27,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	372.684.277,56	55,81	0,00	35,50	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	4.592.768,68	0,69	0,00	1,00	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	2.553.471,07	0,38	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	544.593.409,02	81,55					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	89.043.719,59	13,33	0,00	18,00	35,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	89.043.719,59	13,33					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	29.168.926,48	4,37	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	29.168.926,48	4,37					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	122.765,58	0,02	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	1.506.356,55	0,23	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	1.629.122,13	0,24					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	3.360.316,93	0,50	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	3.360.316,93	0,50					5,00
Total		667.795.494,15	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	0,04 4,27	7,01 107,92	1,90 61,01	6,55 114,56	9,16 97,58	72.702,00	10.434.719,63
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,26 24,89	5,15 79,39	1,52 48,92	5,03 88,02	6,49 69,16	972.471,77	18.298.820,57
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	2,45 237,17	3,55 54,75	3,10 99,58	2,90 50,80		110.260,12	157.687,98
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,06 5,46	-26,81 -412,89	-27,46 -882,51	-26,94 -471,09		1.441,45	-935.146,12
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	4,90 0,21	-6,96 -5,38	-6,99 -2,62	-9,33 -1,33		4.156.567,86	-6.658.712,13
Artigo 9º II % do CDI	8,80 850,21	-28,38 -437,15	-0,25 -7,93	-17,23 -301,34	-23,05 -245,43	2.358.863,40	-11.558.835,11
Artigo 10º I % do CDI	-83,79 -8.096,88	-84,31 -1.298,56	-83,92 -2.697,56	-84,24 -1.473,20		-178.235,23	-185.201,12
Artigo 10º II % do CDI	0,25 24,13	-25,82 -397,69	0,18 5,87	-25,72 -449,88		3.766,62	-526.752,06
Artigo 11º % do CDI	0,17 16,56	1,01 15,60	-3,75 -120,47	2,98 52,17		5.789,41	33.071,69
HORTOLÂNDIA (Total)						7.503.627,40	9.059.653,33

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 150535 (5,170000%)	20.938.072,57	0,00	0,00	0,00	21.027.514,37	89.441,80	1.716.336,86
NTN-B 150545	14.898.440,77	0,00	0,00	0,00	14.592.082,88	-306.357,89	-67.809,35
NTN-B 150545 (5,660001%)	20.779.646,63	0,00	0,00	0,00	20.876.489,96	96.843,33	1.459.570,92
NTN-B 150545 (5,859998%)	20.522.139,76	0,00	0,00	0,00	20.621.044,47	98.904,71	1.208.330,57
NTN-B 150824	37.220.150,86	0,00	0,00	0,00	37.105.075,02	-115.075,84	2.096.797,78
NTN-B 150840 (5,020001%)	50.331.739,12	0,00	0,00	0,00	50.540.685,01	208.945,89	4.021.492,85
					164.762.891,71	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	50.075.012,21	0,00	0,00	0,00	50.277.846,29	202.834,08	1.995.501,93
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	74.325.520,54	0,00	0,00	0,00	73.667.337,59	-658.182,95	2.348.006,51
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	62.642.409,12	7.731.000,00	-4.780.000,00	0,00	66.295.450,84	702.041,72	3.453.087,14
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	65.920.975,65	0,00	0,00	0,00	65.728.184,14	-192.791,51	4.180.549,16
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	63.902.508,15	0,00	0,00	0,00	64.404.849,43	502.341,28	3.305.133,54
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	51.894.380,12	0,00	0,00	0,00	52.310.609,27	416.229,15	3.016.542,29
					372.684.277,56	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\$)
BRA1 FI RENDA FIXA	319.797,33	0,00	0,00	0,00	319.690,20	-107,13	14.219,53
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	460.873,61	0,00	0,00	9.838,44	544.511,69	93.476,52	9.079,23
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	3.711.676,06	0,00	0,00	0,00	3.728.566,79	16.890,73	134.389,22
					4.592.768,68	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\$)
FIDC PREMIUM	682.167,64	0,00	0,00	0,00	679.607,35	-2.560,29	-988.077,80
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1.869.861,98	0,00	0,00	0,00	1.873.863,72	4.001,74	52.931,68
					2.553.471,07	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	40.377.623,01	0,00	0,00	0,00	41.902.677,33	1.525.054,32	-3.964.819,51
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	20.879.615,13	0,00	0,00	0,00	22.092.135,58	1.212.520,45	-1.866.768,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	23.629.913,59	0,00	0,00	0,00	25.048.906,68	1.418.993,09	-827.124,37
					89.043.719,59	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\$)
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	7.475.744,20	0,00	0,00	0,00	8.352.518,54	876.774,34	-5.773.051,10
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	19.334.318,88	0,00	0,00	0,00	20.816.407,94	1.482.089,06	-5.785.784,01
					29.168.926,48	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CONQUEST FI MULTIMERCADO-EM LIQUIDAÇÃO	0,00	88.757,47	0,00	0,00	-88.757,47	0,00	0,00
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	212.243,34	0,00	0,00	0,00	211.523,05	-720,29	-7.686,18
					122.765,58	0,00	0,00

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	1.506.770,12	0,00	0,00	0,00	1.505.901,54	-868,58	-5.124,49
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS	459,80	0,00	0,00	4.639,99	455,01	4.635,20	7.734,08
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	-529.361,65
					1.506.356,55	0,00	0,00

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRCR11	200.894,94	0,00	0,00	0,00	1.525,62	184.535,10	-14.834,22	-40.250,40
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	1.811.800,00	0,00	0,00	0,00	22.000,00	1.811.800,00	22.000,00	-105.800,00
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	1.365.358,20	0,00	0,00	0,00	0,00	1.363.981,83	-1.376,37	179.122,09

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
						3.360.316,93	0,00	0,00

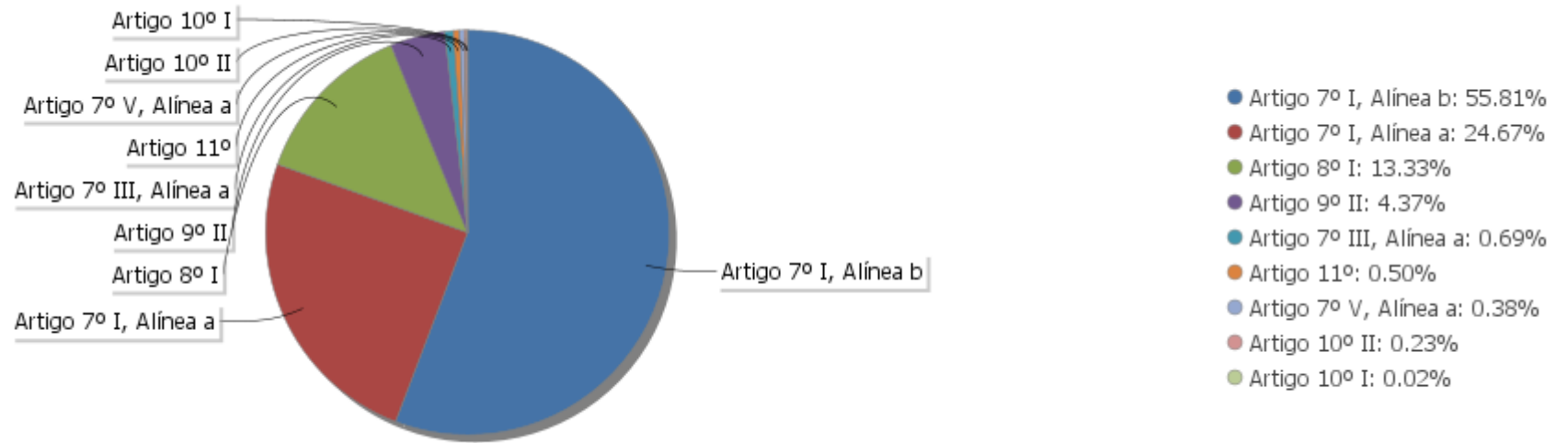
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

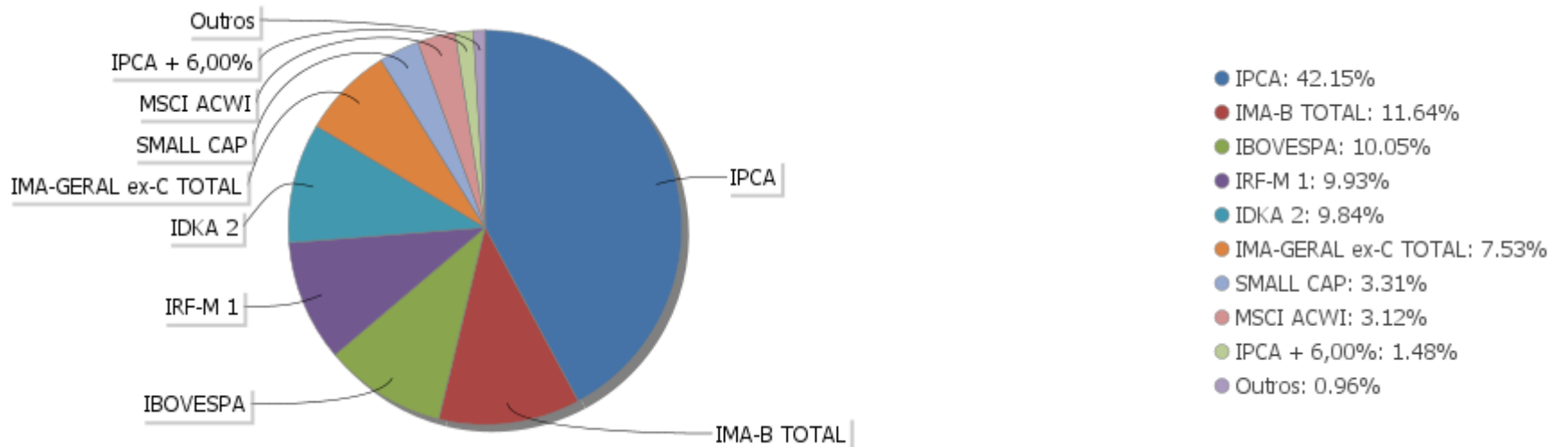
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	470.215.145,25	70,41	470.215.145,25	70,41
de 31 a 365 dias	25.048.906,68	3,75	495.264.051,93	74,16
acima de 365 dias	172.531.442,22	25,84	667.795.494,15	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

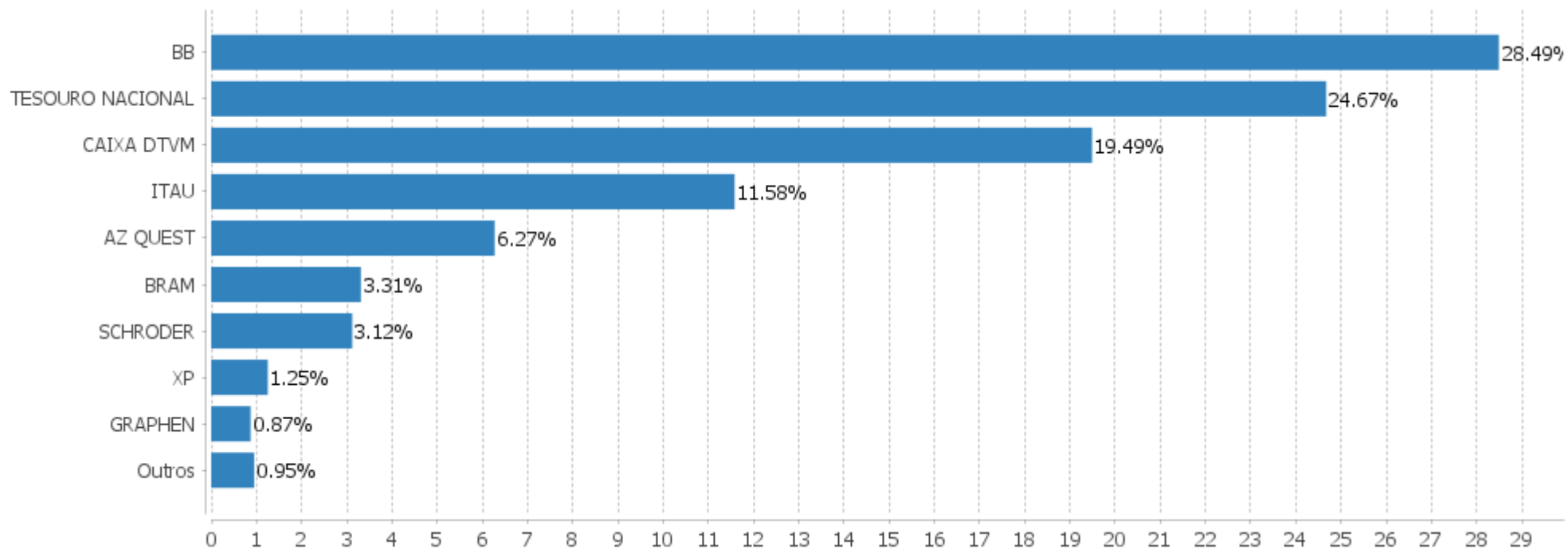


Alocação Por Estratégia



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	-0,33	0,06	2,07	-0,52	0,46	-1,47	1,14						1,38
IPCA + 4,84%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,29						7,66
p.p. indexador	-1,26	-1,31	0,03	-1,94	-0,43	-2,54	1,42						-6,28
2021	-0,37	-0,60	0,51	1,09	1,28	0,17	-0,77	-1,12	-0,53	-1,71	0,97	0,80	-0,33
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	-1,04	-1,84	-0,90	0,36	0,01	-0,80	-2,19	-2,46	-2,14	-3,38	-0,40	-0,42	-16,32
2020	0,74	-0,95	-6,76	0,85	2,01	1,95	2,67	-0,62	-1,01	0,15	2,81	2,88	4,40
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	0,03	-1,61	-7,33	0,71	1,94	1,21	1,79	-1,34	-2,13	-1,19	1,46	1,02	-6,22
2019	2,83	0,10	0,40	1,16	1,59	2,44	1,21	0,05	1,70	1,87	-0,25	2,19	16,35
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	2,00	-0,79	-0,79	0,10	0,95	1,99	0,49	-0,57	1,25	1,24	-1,23	0,55	5,76

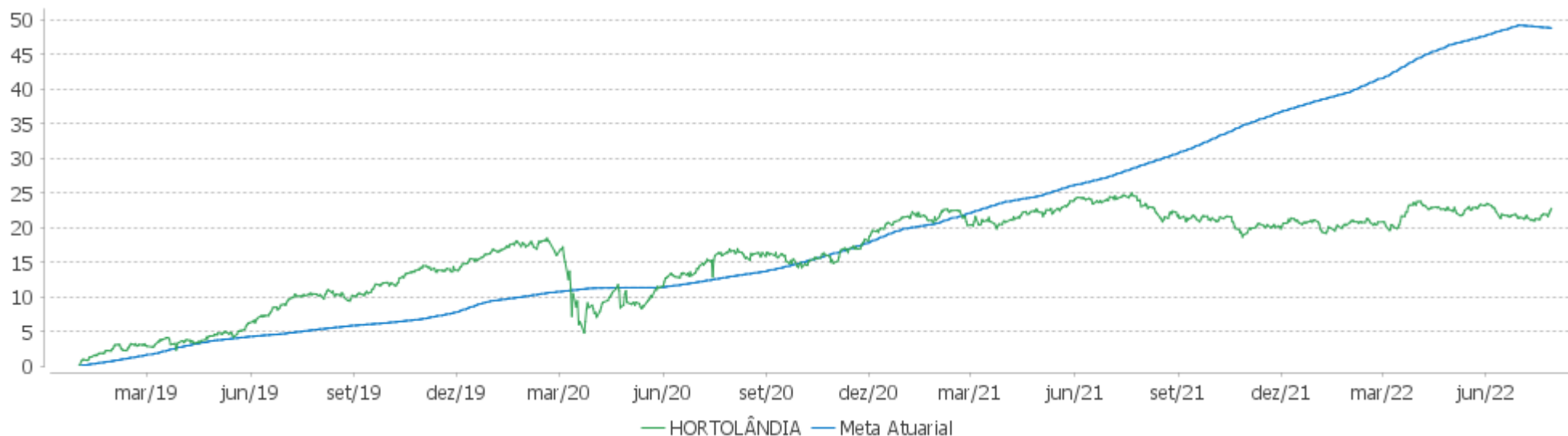
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	19	44,19	03 meses	0,10	1,67	-1,57	3,41
Meses abaixo - Meta Atuarial	24	55,81	06 meses	1,71	6,66	-4,95	3,62
			12 meses	-0,26	15,64	-15,90	3,81
			24 meses	5,30	33,04	-27,75	4,18
Maior rentabilidade da Carteira	2,88	2020-12	36 meses	11,46	44,21	-32,74	6,57
Menor rentabilidade da Carteira	-6,76	2020-03	Desde 31/12/2018	22,74	52,77	-30,03	6,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

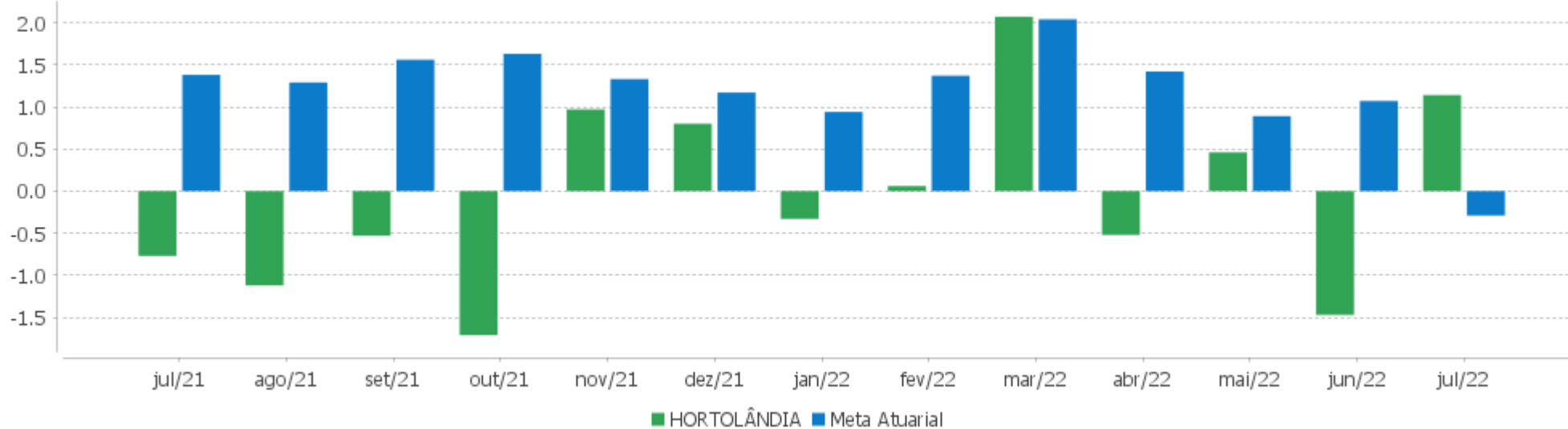


Patrimônio Líquido



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 150545 Var. IPCA p.p.	-2,06 -1,38	-0,56 -5,33	-2,40 -2,86	0,91 -3,30	-6,05 -16,12	-4,75 -24,72	1,21 -21,52
NTN-B 150824 Var. IPCA p.p.	-0,31 0,37	5,97 1,20	0,84 0,38	5,98 1,77	9,25 -0,82	12,63 -7,34	25,51 2,77
NTN-B 150545 (5,660001%) Var. IPCA p.p.	0,47 1,15	8,98 4,21	2,92 2,47	7,76 3,55	14,05 3,98	23,77 3,80	26,46 3,72
NTN-B 150840 (5,020001%) Var. IPCA p.p.	0,42 1,10	8,60 3,83	2,76 2,31	7,44 3,23	13,57 3,50	22,96 2,99	25,34 2,60
NTN-B 150535 (5,170000%) Var. IPCA p.p.	0,43 1,11	8,69 3,92	2,80 2,35	7,51 3,31	16,74 6,67	26,33 6,36	28,73 6,00
NTN-B 150545 (5,859998%) Var. IPCA p.p.	0,48 1,16	9,10 4,33	2,97 2,52	7,86 3,65	14,19 4,12	23,97 4,01	26,73 3,99
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,41	4,13	1,56	4,09	4,69	5,26	12,73
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,79 1,47	5,41 0,64	2,09 1,64	4,71 0,50	5,36 -4,71	6,31 -13,66	16,60 -6,13
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,04 -0,01	5,95 -0,14	2,91 -0,05	5,30 -0,13	7,86 -0,25	9,57 -0,69	15,29 -1,04
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,29 -0,12	6,10 -0,56	0,78 -0,37	6,08 -0,53	9,41 -0,70	15,38 -1,21	24,72 -1,99
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,89 -0,01	3,29 -0,14	-0,29 -0,00	4,09 -0,10	2,96 -0,29	5,30 -0,56	13,66 -0,83
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,80 1,48	6,12 1,35	2,60 2,14	5,57 1,36	9,65 -0,42	10,96 -9,01	16,73 -6,00
FIDC PREMIUM % do CDI	-0,38 -36,27	-59,25 -912,61	-59,06 -1.898,35	-59,18 -1.034,96	-59,86 -637,39	-59,35 -492,43	-63,79 -379,84
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3 % 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	-94,34 -561,74
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4 % 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	-94,34 -561,74
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2 % 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	-94,34 -561,74
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	0,21	2,91	0,75	2,40	3,98	0,64	-4,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	20,68	44,77	24,17	41,91	42,39	5,29	-26,30
BRA1 FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03 0,84	3,82 0,39	0,47 0,76	4,02 -0,18	4,52 1,26	1,73 -4,13	-41,92 -56,42
LME REC IMA B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,46 1,33	3,74 0,31	1,34 1,63	2,83 -1,37	-0,39 -3,64	-0,91 -6,77	-0,48 -14,98
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	20,28 20,27	1,53 -5,10	16,34 15,21	1,88 -4,63	-39,02 -49,06	-38,82 -54,42	-42,32 -68,14
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,78 -0,91	-8,64 -7,06	-8,63 -4,26	-10,99 -2,99	-23,76 -8,46	-12,16 -12,41	-1,83 -3,16
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	6,01 1,31	-3,20 -1,62	-2,21 2,16	-4,48 3,53	-18,57 -3,27	0,76 0,51	-0,16 -1,49
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	5,81 0,65	-7,79 7,75	-8,94 4,68	-11,31 7,03	-24,18 8,39	-10,73 8,27	-2,31 10,32
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	7,67 1,82	-21,75 -0,30	1,61 -1,29	-11,94 1,97	-13,52 -2,72		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	11,73 11,92	-40,87 -49,21	-4,59 -6,54	-28,01 -35,25	-38,67 -55,31	-22,68 -57,38	
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V % do CDI	-0,34 -32,79	-3,51 -54,01	-1,16 -37,41	-3,09 -54,10	-5,51 -58,73	-10,04 -83,28	-8,65 -51,53
CONQUEST FI MULTIMERCADO-EM LIQUIDAÇÃO Var. IMA-B 5 p.p.	0,00 -0,37	0,00 -0,37					
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,00 0,20	-0,99 -9,34	0,00 -1,95	-0,68 -7,92	-2,50 -19,14	130,49 95,78	-92,78 -138,89
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,06 0,14	-0,34 -8,68	-0,12 -2,08	-0,28 -7,52	-0,88 -17,53	-2,48 -37,18	29,35 -16,77
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS % do CDI	1.008,08 97.413,02	972,21 14.974,97	972,21 31.249,33	972,21 17.002,37	972,21 10.352,83	470,61 3.904,72	136,91 815,24
BRCR11 Var. IBOVESPA p.p.	-7,38 -12,08	-17,67 -16,08	-16,53 -12,16	-16,36 -8,36	-23,69 -8,39	-27,50 -27,74	-28,59 -29,92
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII Var. IFIX p.p.	-0,10 -0,76	15,12 14,79	1,19 1,16	16,14 14,80	-31,72 -31,37	-32,55 -35,52	-33,29 -39,10
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII % do CDI	1,21 117,34	-5,29 -81,45	-5,66 -181,86	-2,80 -49,01	-12,56 -133,70	-13,36 -110,81	-15,31 -91,19
HORTOLÂNDIA Var. IPCA + 4,84% p.p.	1,14 1,42	1,38 -6,28	0,10 -1,57	1,71 -4,95	-0,26 -15,64	5,30 -26,49	11,46 -29,92
CDI	1,03	6,49	3,11	5,72	9,39	12,05	16,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	4,69	-1,58	-4,37	-8,01	-15,30	0,25	1,33
INPC + 6,00%	-0,12	8,56	1,96	7,31	16,71	35,83	47,90
IPCA + 6,00%	-0,20	8,34	1,95	7,24	16,65	34,70	46,11

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
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS 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
BRA1 FI RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1440	D+1445		1,30
BRANCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	Não se aplica	Não se aplica				
BRCR11	Não se aplica	Não se aplica				
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	Não se aplica	Não se aplica				
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	D+0	D+0	D+30 ou D+1800 (isento de taxa de resgate)	D+31 ou D+1801 (isento de taxa de resgate)		0,00
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIDC PREMIUM	Não se aplica	Não se aplica				
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	Não se aplica	Não se aplica				
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3	Não se aplica	Não se aplica				
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4	Não se aplica	Não se aplica				
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS	Não se aplica	Não se aplica				
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	Não se aplica	Não se aplica				
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
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
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	-	
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	Não se aplica	Não se aplica				

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	1,05	6,09	2,96	5,43	8,11	10,26	16,33	24,81	34,03
IRF-M 1+	1,20	1,94	1,68	2,45	1,01	-2,37	9,37	29,67	40,37
IRF-M TOTAL	1,15	3,36	2,11	3,45	3,42	1,97	11,97	29,08	39,48
IMA-B 5	0,01	6,62	1,13	6,50	10,04	15,61	25,82	43,53	55,41
IMA-B 5+	-1,84	0,16	-1,79	1,79	-3,22	-2,89	4,70	45,06	51,68
IMA-B TOTAL	-0,88	3,43	-0,28	4,20	3,25	5,86	14,50	45,94	55,35
IMA-GERAL TOTAL	0,47	4,98	1,83	4,76	5,95	7,72	15,62	33,41	43,39
IDKA 2	-0,17	6,66	1,15	6,61	10,11	16,59	26,71	42,67	55,48
IDKA 20	-3,59	-6,10	-5,30	-3,27	-15,47	-16,49	-12,36	41,45	43,04
CDI	1,03	6,49	3,11	5,72	9,39	12,05	16,79	24,21	33,01

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	4,69	-1,58	-4,37	-8,01	-15,30	0,25	1,33	30,22	56,50
IBRX 100	4,40	-1,57	-4,69	-7,90	-16,32	1,03	3,22	35,06	60,67
IBRX 50	4,54	-1,43	-4,61	-8,44	-15,95	2,74	2,97	30,16	56,41
SMALL CAP	5,16	-15,55	-13,62	-18,34	-32,57	-19,00	-12,63	25,78	39,30
IFIX	0,66	0,33	0,04	1,34	-0,35	2,96	5,81	30,62	36,20
Índice Consumo - ICON	9,18		-9,26	-19,73	-38,06	-36,23	-28,49	-1,52	0,77
Índice Dividendos - IDIV	1,98	6,66	-2,58	-0,76	-0,49	13,65	17,63	66,49	85,47

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	-0,68	4,77	0,46	4,21	10,07	19,97	22,74	26,69	32,37
INPC	-0,60	4,98	0,47	4,28	10,12	20,98	24,23	28,16	32,79
IGPM	0,21	8,39	1,32	6,45	10,08	47,31	60,97	71,26	85,37
SELIC	1,03	6,49	3,11	5,72	9,39	12,05	16,79	24,21	33,03

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	8,08	-19,43	5,43	-11,42	-4,80	25,90	90,98	102,65	177,09
MSCI ACWI	5,85	-21,45	2,90	-13,91	-10,79	15,22	67,60	69,52	121,29

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	-0,35	7,16	1,46	6,24	14,45	29,70	38,02	48,12	60,90
IPCA + 5,00%	-0,28	7,75	1,71	6,74	15,55	32,19	42,03	53,87	68,75
IPCA + 5,50%	-0,24	8,05	1,83	6,99	16,10	33,44	44,06	56,81	72,78
IPCA + 5,89%	-0,21	8,28	1,93	7,18	16,53	34,43	45,66	59,14	75,99
IPCA + 6,00%	-0,20	8,34	1,95	7,24	16,65	34,70	46,11	59,80	76,90
INPC + 4,00%	-0,27	7,37	1,47	6,31	14,51	30,79	39,70	49,84	61,41
INPC + 6,00%	-0,12	8,56	1,96	7,31	16,71	35,83	47,90	61,65	77,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
57	01/07/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	50.000,00	17.033,64701900	2,9353666860
58	01/07/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	621.000,00	0,00	211.557,89597321	2,9353666860
67	07/07/2022	CONQUEST FI MULTIMERCADO-EM LIQUIDAÇÃO	-88.757,47	0,00	88.757,47248939	-1,0000000000
64	07/07/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	220.000,00	0,00	74.839,68495835	2,9396168640
60	08/07/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	6.290.000,00	0,00	2.139.222,13559812	2,9403211080
65	08/07/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	480.000,00	0,00	163.247,47616647	2,9403211080
55	26/07/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	160.000,00	54.120,64330700	2,9563580590
61	26/07/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	4.520.000,00	1.528.908,17343313	2,9563580590
54	29/07/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	50.000,00	16.872,50881600	2,9634004370
63	29/07/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	120.000,00	0,00	40.494,02115952	2,9634004370
Total			7.642.242,53	4.780.000,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 11.641.144,60

Value-At-Risk: 1,74%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
HORTOLÂNDIA		1,74	1,74			667.795.494,15	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,89%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824		1,67	0,06	1,63			37.105.075,02	5,56
NTN-B 150545		4,01	0,06	3,97			14.592.082,88	2,19
NTN-B 150535 (5,170000%)		0,31	-0,00	0,30			21.027.514,37	3,15
NTN-B 150545 (5,660001%)		0,31	-0,00	0,30			20.876.489,96	3,13
NTN-B 150545 (5,859998%)		0,31	-0,00	0,30			20.621.044,47	3,09
NTN-B 150840 (5,020001%)		0,31	-0,00	0,30			50.540.685,01	7,57
Sub-total	1,41	0,72	0,11		-0,70	0,04	164.762.891,71	24,67

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,24	0,01	0,02			66.295.450,84	9,93
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,14	0,16	0,03			73.667.337,59	11,03
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,48	0,09	0,39			65.728.184,14	9,84
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		0,24	0,01	0,35			52.310.609,27	7,83
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,02	0,05	1,02			50.277.846,29	7,53
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,23	0,06	1,25			64.404.849,43	9,64
Sub-total	2,19	0,99	0,39		-0,36	0,26	372.684.277,56	55,81

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LME REC IMA B FI RENDA FIXA		0,35	0,00	2,07			3.728.566,79	0,56
BRA1 FI RENDA FIXA		0,68	0,00	1,98			319.690,20	0,05
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5		2,51	0,00	2,75			544.511,69	0,08
Sub-total	6,94	0,42	0,00		0,20	2,45	4.592.768,68	0,69

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC		0,09	-0,00	0,10			1.873.863,72	0,28
FIDC PREMIUM		4,10	-0,00	4,10			679.607,35	0,10
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
Sub-total	0,20	1,07	-0,00		-5,00	0,06	2.553.471,07	0,38

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,37%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		12,54	0,37	3,48			22.092.135,58	3,31
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,01	0,44	5,16			41.902.677,33	6,27
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		9,82	0,31	4,56			25.048.906,68	3,75
Sub-total	15,58	9,37	1,12		0,25	4,90	89.043.719,59	13,33

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 13,30%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		21,70	0,09	21,72			8.352.518,54	1,25
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		11,58	0,03	14,53			20.816.407,94	3,12

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	28,05	13,30	0,12		0,28	8,80	29.168.926,48	4,37

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,30%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII		0,05	-0,00	0,06			1.811.800,00	0,27
BRCR11		0,70	-0,00	10,05			184.535,10	0,03
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII		0,73	-0,00	1,74			1.363.981,83	0,20
Sub-total	2,80	0,30	-0,00		-0,31	0,17	3.360.316,93	0,50

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,01%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONQUEST FI MULTIMERCADO-EM LIQUIDAÇÃO		-0,00	0,00	-1,19			-88.757,47	-0,01
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V		0,02	-0,00	0,03			211.523,05	0,03
Sub-total	628,47	0,03	-0,00		-0,13	-83,79	122.765,58	0,02

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP		0,01	0,00	0,28			1.505.901,54	0,23
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS		10,87	-0,00	10,87			455,01	0,00
Sub-total	1,09	0,01	0,00		-0,72	0,25	1.506.356,55	0,23