



**LDB**  
EMPRESAS

**ILHA SOLTEIRA**  
MAIO 2022



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.05.2022.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 74,76%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF IRF M	3,58	0,21	0,58	1,77	1.900.223,85	1,02	3.694.753.029,30	0,05
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,48	0,46	0,96	4,58	16.428.860,69	8,79	6.293.749.685,70	0,26
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,47	0,47	0,97	4,65	13.781.674,38	7,37	4.185.112.705,47	0,33
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,64	0,28	0,76	6,16	12.001.581,77	6,42	12.390.634.636,61	0,10
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,64	0,28	0,76	6,16	13.748.030,88	7,36	1.354.094.140,52	1,02
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	5,46	0,46	0,94	4,62	20.454.766,53	10,94	883.836.264,31	2,31
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,67	0,65	1,14	3,08	7.190.368,35	3,85	1.260.228.114,42	0,57
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,16	0,04	0,89	3,68	105.528,04	0,06	764.814.820,33	0,01
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,67	0,28	0,77	6,14	13.150.167,43	7,04	6.992.058.203,56	0,19
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>4,62</b>	<b>0,40</b>	<b>0,90</b>	<b>4,96</b>	<b>98.761.201,92</b>	<b>52,84</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,20	0,05	1,08	4,49	11.731.944,20	6,28	12.704.053.440,98	0,09
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	5,40	0,52	0,93	4,64	7.429.050,75	3,98	780.174.239,87	0,95
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	0,05	1,07	4,47	1.793.806,82	0,96	9.967.340.356,95	0,02
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,67	0,29	0,75	6,02	14.041.151,11	7,51	1.346.062.592,73	1,04
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,19	0,05	1,10	1,63	3.093.541,54	1,66	2.097.589.788,62	0,15
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,18	0,05	1,10	4,59	2.875.386,28	1,54	5.183.790.691,53	0,06
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>1,96</b>	<b>0,22</b>	<b>0,94</b>	<b>4,92</b>	<b>40.964.880,70</b>	<b>21,92</b>		

**Renda Fixa** **3,99** **0,34** **0,91** **4,94** **139.726.082,62** **74,76**

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

25,24%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	18,24	0,23	2,49	10,78	3.427.584,00	1,83	698.204.129,73	0,49
BRAM	BEM	BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	23,43	0,27	1,54	2,82	5.857.669,15	3,13	1.136.895.114,73	0,52
CAIXA DTVM	CEF	FIA BRASIL IBX-50	20,06	0,20	1,19	6,70	9.354.039,24	5,01	815.275.928,07	1,15
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	19,58	0,24	3,10	5,02	3.219.628,65	1,72	535.242.726,45	0,60
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	19,75	0,18	2,93	5,66	2.525.641,92	1,35	974.253.508,27	0,26
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	26,52	-0,67	-1,92	-3,80	2.953.533,05	1,58	748.259.041,27	0,39
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	19,18	0,13	3,61	6,77	3.955.828,72	2,12	447.031.184,53	0,88
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	19,83	0,06	3,21	7,11	1.038.337,99	0,56	151.250.086,44	0,69
BRAM	BRADERCO	BRADERCO FIA IBOVESPA PLUS	19,71	0,28	3,24	6,17	10.811.015,71	5,78	304.892.373,78	3,55
BRAM	BEM	BRADERCO F I A SELECTION	20,63	0,16	3,33	6,94	4.023.589,31	2,15	484.305.597,88	0,83
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>19,02</b>	<b>0,16</b>	<b>2,24</b>	<b>5,51</b>	<b>47.166.867,74</b>	<b>25,24</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>19,94</b>	<b>0,16</b>	<b>2,24</b>	<b>5,51</b>	<b>47.166.867,74</b>	<b>25,24</b>		
<b>Total</b>			<b>6,94</b>	<b>0,30</b>	<b>1,24</b>	<b>5,03</b>	<b>186.892.950,36</b>	<b>100,00</b>		

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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	98.761.201,92	52,84	20,00	30,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	40.964.880,70	21,92	0,00	0,00	60,00	0,00	65,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>139.726.082,62</b>	<b>74,76</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	47.166.867,74	25,24	0,00	20,00	30,00	0,00	35,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>47.166.867,74</b>	<b>25,24</b>					35,00
<b>Total</b>		<b>186.892.950,36</b>	<b>100,00</b>					

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades por Artigo**

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,90 87,75	4,96 114,12	4,82 171,24	5,36 104,22	5,44 68,88	886.411,24	4.665.548,96
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,94 91,39	4,92 113,29	4,03 143,00			383.307,66	1.993.779,23
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	2,24 -0,98	5,51 -0,72	-0,81 0,77			1.032.626,91	2.463.974,09
<b>ILHA SOLTEIRA (Total)</b>						<b>2.302.345,81</b>	<b>9.123.302,28</b>

**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 IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	16.272.729,19	0,00	0,00	0,00	16.428.860,69	156.131,50	720.092,44
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	13.049.699,52	0,00	0,00	0,00	13.150.167,43	100.467,91	760.170,13
BB PREV RF IRF M	1.889.344,54	0,00	0,00	0,00	1.900.223,85	10.879,31	32.975,46
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	104.599,12	0,00	0,00	0,00	105.528,04	928,92	3.749,57
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8.933.277,61	3.000.000,00	0,00	0,00	12.001.581,77	68.304,16	522.096,50
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.067.070,37	0,00	-3.000.000,00	0,00	7.190.368,35	123.297,98	313.206,01
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	13.649.829,89	0,00	0,00	0,00	13.781.674,38	131.844,49	612.003,78
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	13.644.521,56	0,00	0,00	0,00	13.748.030,88	103.509,32	797.344,54
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	20.263.718,88	0,00	0,00	0,00	20.454.766,53	191.047,65	903.910,53
					98.761.201,92	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.091.817,14	0,00	-320.000,00	0,00	1.793.806,82	21.989,68	84.106,77
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	2.126.006,12	720.000,00	0,00	0,00	2.875.386,28	29.380,16	82.386,79
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	13.937.210,64	0,00	0,00	0,00	14.041.151,11	103.940,47	797.449,40
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	7.360.520,45	0,00	0,00	0,00	7.429.050,75	68.530,30	329.635,36

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.974.966,73	0,00	-370.000,00	0,00	11.731.944,20	126.977,47	539.220,32
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	2.211.051,96	1.350.000,00	-500.000,00	0,00	3.093.541,54	32.489,58	43.541,54
					40.964.880,70	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\$)
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	3.818.046,49	0,00	0,00	0,00	3.955.828,72	137.782,23	250.995,81
BB AÇÕES DIVIDENDOS	3.344.391,19	0,00	0,00	0,00	3.427.584,00	83.192,81	333.570,97
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	2.453.816,42	0,00	0,00	0,00	2.525.641,92	71.825,50	135.229,22
BRADESCO F I A SELECTION	3.893.758,42	0,00	0,00	0,00	4.023.589,31	129.830,89	261.162,58
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	5.768.614,69	0,00	0,00	0,00	5.857.669,15	89.054,46	160.689,89
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	10.471.460,03	0,00	0,00	0,00	10.811.015,71	339.555,68	628.673,84
FIA BRASIL IBX-50	9.244.101,13	0,00	0,00	0,00	9.354.039,24	109.938,11	587.471,37
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	3.011.323,36	0,00	0,00	0,00	2.953.533,05	-57.790,31	-116.552,11
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	3.122.731,59	0,00	0,00	0,00	3.219.628,65	96.897,06	153.765,55
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	1.005.997,51	0,00	0,00	0,00	1.038.337,99	32.340,48	68.966,97
					47.166.867,74	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

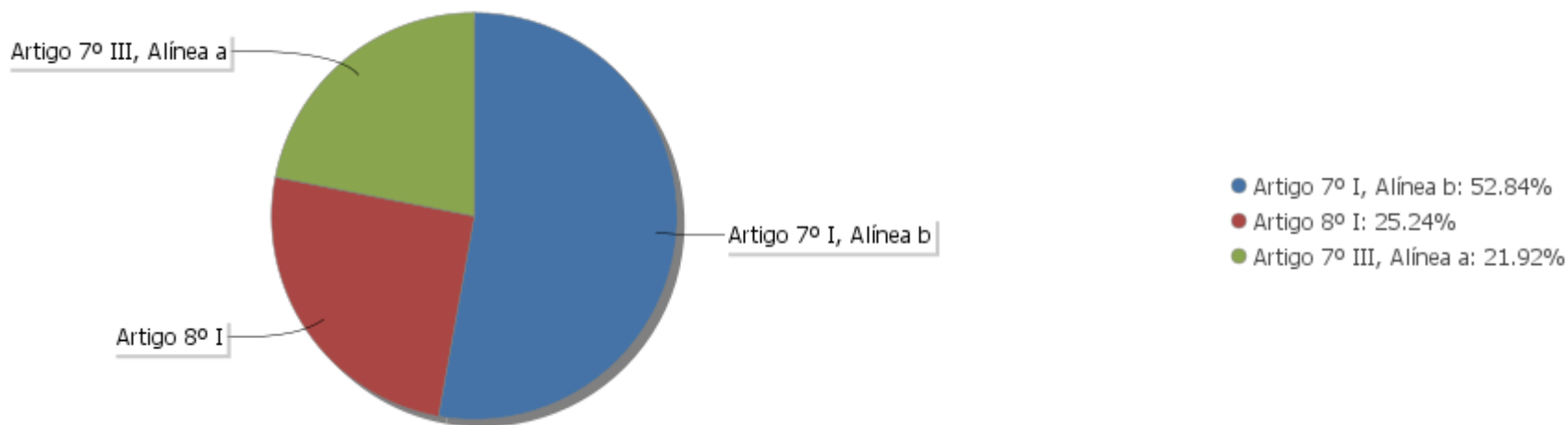
## Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	186.892.950,36	100,00	186.892.950,36	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	186.892.950,36	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	186.892.950,36	100,00	

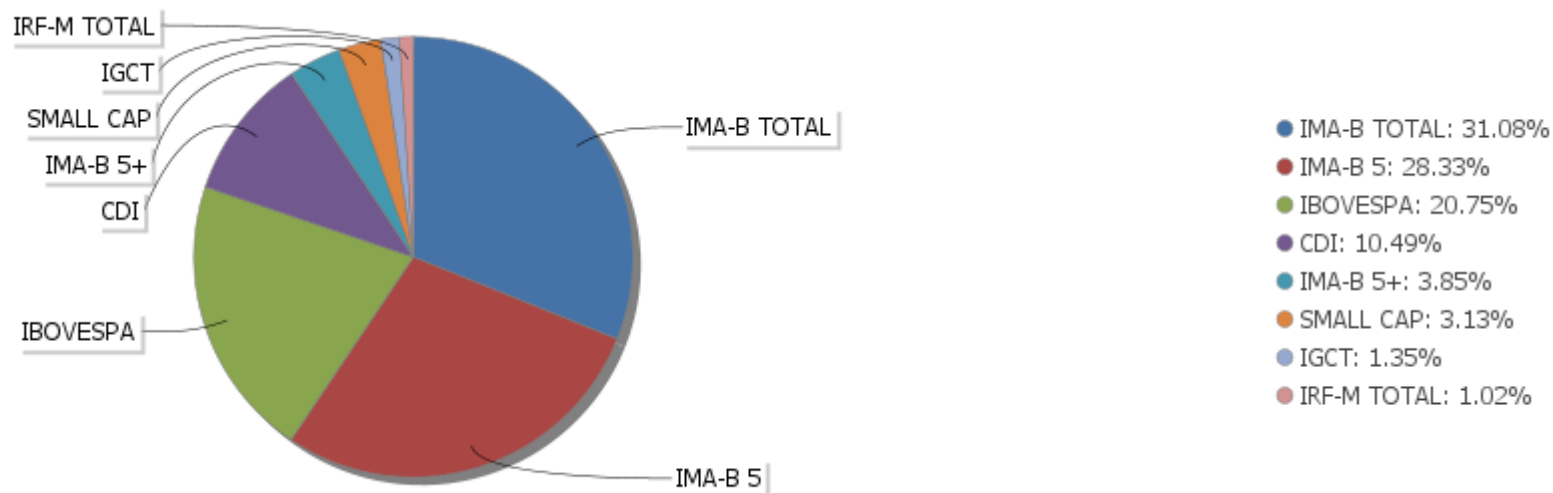


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

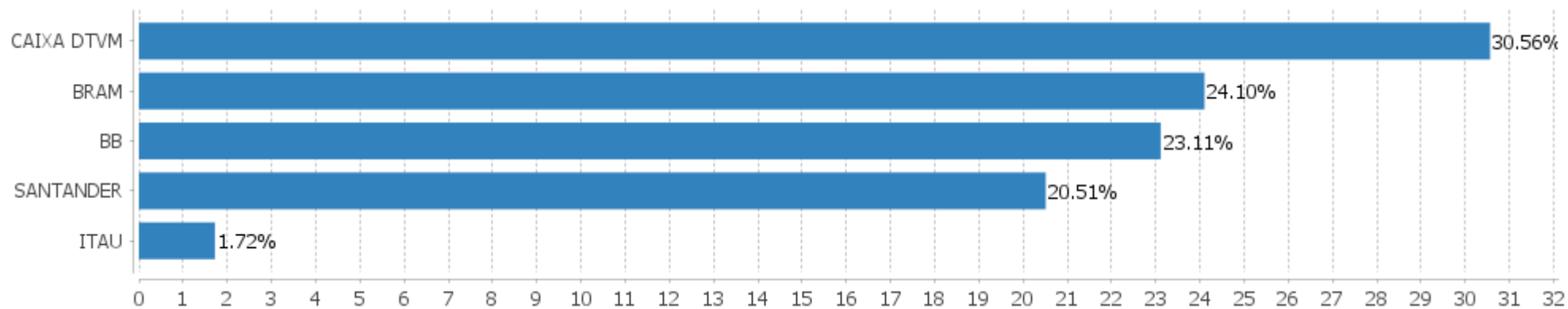


Alocação Por Estratégia



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	1,34	0,49	3,60	-1,67	1,24								5,03
IPCA + 4,80%	0,93	1,37	2,04	1,42	0,88								6,81
p.p. indexador	0,41	-0,88	1,57	-3,09	0,36								-1,78
2021	-1,25	-1,72	1,08	1,36	2,39	0,39	-1,37	-1,38	-1,68	-3,56	1,56	1,08	-3,23
IPCA + 5,42%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,68	1,37	1,22	16,00
p.p. indexador	-1,92	-2,97	-0,34	0,63	1,12	-0,58	-2,79	-2,72	-3,29	-5,24	0,19	-0,13	-19,23
2020	0,07	-2,11	-11,70	2,89	2,80	3,28	4,26	-1,48	-1,92	-0,10	4,59	4,91	4,37
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,65
p.p. indexador	-0,64	-2,77	-12,27	2,74	2,73	2,54	3,38	-2,19	-3,04	-1,44	3,24	3,06	-6,28
2019	4,73	-0,18	0,32	1,16	1,98	3,00	1,22	-0,06	2,34	2,42	-0,78	3,49	21,34
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	3,90	-1,08	-0,87	0,10	1,34	2,55	0,50	-0,68	1,90	1,79	-1,75	1,85	10,75
2018	3,56	0,54	0,75	0,28	-3,68	-1,22	3,16	-0,91	0,92	5,90	1,11	0,71	11,33
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	2,75	-0,20	0,17	-0,43	-4,57	-2,97	2,32	-1,35	-0,00	4,93	0,85	0,09	1,41
2017	1,97	1,97	0,71	0,39	-0,92	0,38	2,98	1,87	1,82	0,02	-0,78	1,65	12,66
IPCA + 6,00%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	1,07	1,22	-0,08	-0,17	-1,75	0,13	2,26	1,15	1,20	-0,89	-1,53	0,75	3,61

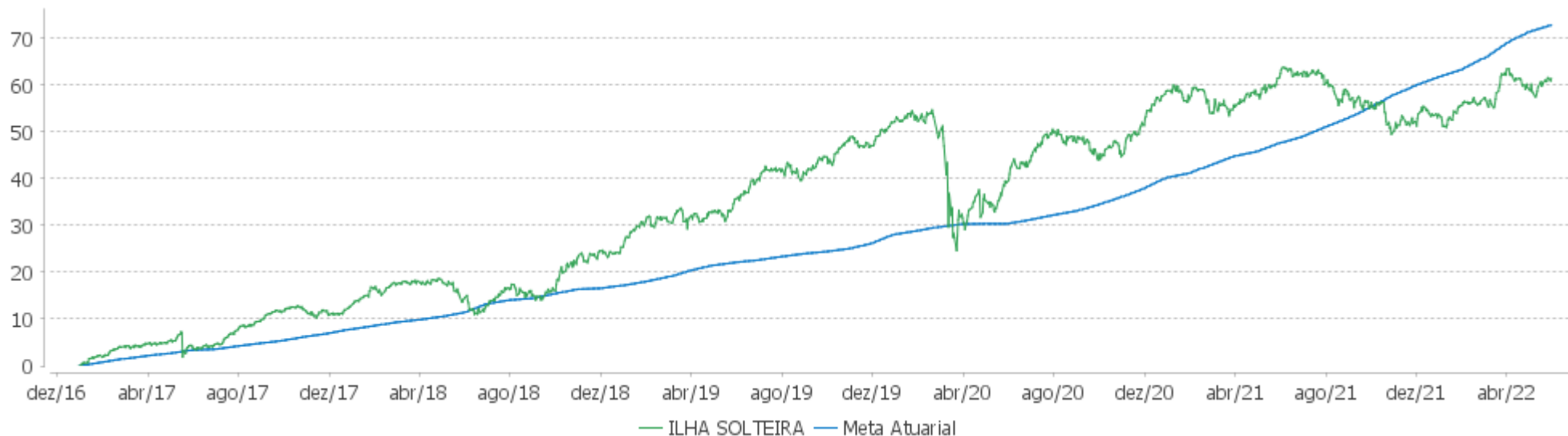
**Performance Sobre a Meta Atuarial**

**Relatório**

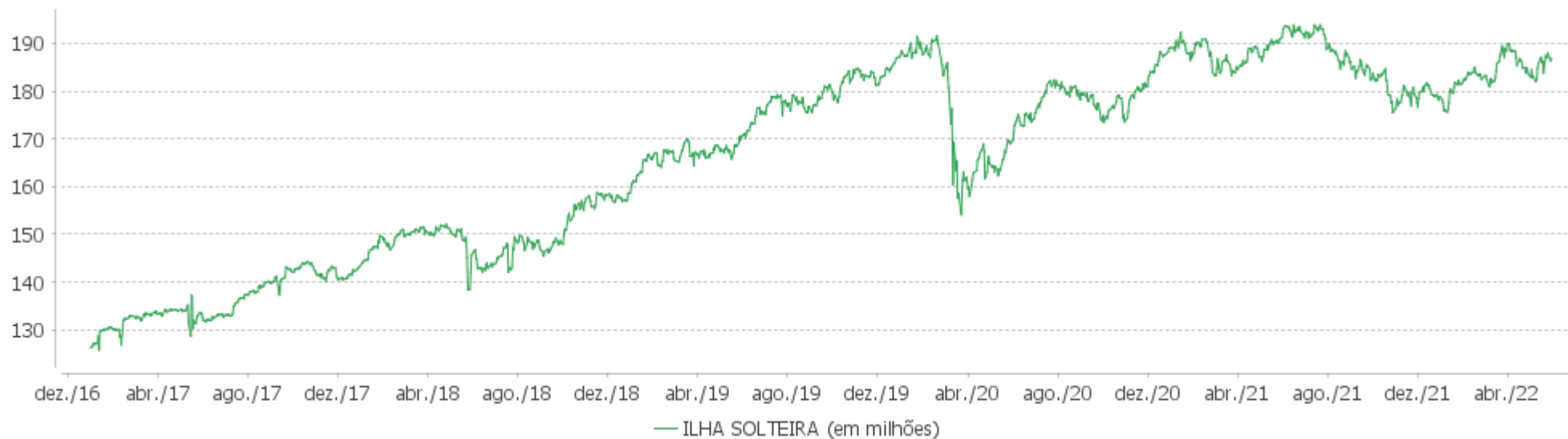
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	33	50,77	03 meses	3,14	4,40	-1,26	7,05
Meses abaixo - Meta Atuarial	32	49,23	06 meses	6,17	8,11	-1,94	6,30
			12 meses	-0,16	17,50	-17,66	6,94
			24 meses	15,94	34,18	-18,23	7,28
Maior rentabilidade da Carteira	5,90	2018-10	36 meses	18,96	44,80	-25,84	10,66
Menor rentabilidade da Carteira	-11,70	2020-03	48 meses	41,43	60,60	-19,17	9,98
			60 meses	55,00	74,98	-19,97	9,13
			Desde 30/12/2016	61,43	81,74	-20,30	9,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Evolução**

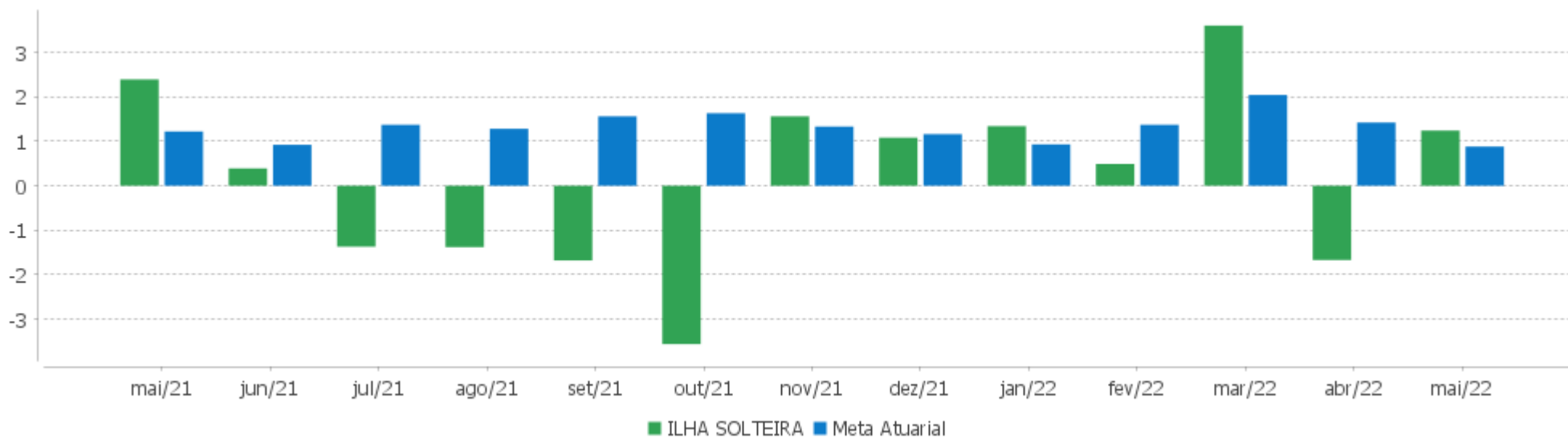


**Patrimônio Líquido**



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
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,97 0,00	4,65 -0,08	4,89 -0,04	4,87 -0,10	4,33 -0,26	13,64 -0,54	20,72 -1,09
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,76 -0,02	6,16 -0,10	4,95 -0,06	6,97 -0,12	9,31 -0,25	17,10 -0,55	27,98 -0,79
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,76 -0,02	6,16 -0,10	4,96 -0,06	6,97 -0,12	9,31 -0,24	17,06 -0,59	27,78 -1,00
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,77 -0,01	6,14 -0,12	4,95 -0,07	6,94 -0,15	9,18 -0,37	16,95 -0,70	27,79 -0,99
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,96 -0,01	4,58 -0,14	4,83 -0,10	4,80 -0,17	4,24 -0,35	13,52 -0,66	20,88 -0,93
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,58 -0,01	1,77 -0,05	1,32 0,01	3,68 -0,06	1,34 -0,26	1,85 -0,47	13,05 -0,85
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	1,14 -0,02	3,08 -0,09	4,75 -0,09	2,73 -0,09	-0,76 -0,51	9,69 -0,72	13,77 -1,24
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,89 86,14	3,68 84,81	2,41 85,55	4,34 84,36	6,44 81,54	7,84 76,58	12,16 77,80
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,94 -0,02	4,62 -0,10	4,87 -0,06	4,84 -0,12	4,34 -0,26	13,54 -0,64	20,52 -1,28
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,93 -0,03	4,64 -0,08	4,85 -0,08	4,82 -0,15	4,07 -0,52	12,82 -1,36	20,19 -1,62
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,75 -0,04	6,02 -0,23	4,85 -0,17	6,84 -0,25	9,01 -0,54	16,08 -1,57	27,04 -1,74
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,10 106,28	4,59 105,56	2,93 104,02	5,43 105,69	8,57 108,59	11,10 108,36	15,66 100,22
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,07 103,41	4,47 102,93	2,84 100,83	5,31 103,21	8,23 104,30	10,70 104,45	15,42 98,68
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,08 104,41	4,49 103,32	2,83 100,55	5,28 102,65	8,37 106,04	10,69 104,34	15,39 98,47
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	1,10 106,26	4,58 105,52	2,91 103,48	5,43 105,67	8,55 108,32	11,16 108,97	15,62 99,95
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,61 0,39	6,77 0,55	-0,52 1,06	10,08 0,82	-12,44 -0,66	25,84 -1,56	9,58 -5,18
BRADESCO F I A SELECTION	3,33	6,94	2,14	9,08	-14,92	22,53	0,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	0,11	0,71	3,73	-0,17	-3,15	-4,87	-13,86
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-1,92 -5,14	-3,80 -10,02	-2,40 -0,82	0,29 -8,97	-27,69 -15,91	10,89 -16,51	8,25 -6,51
FIA BRASIL IBX-50 Var. IBOVESPA p.p.	1,19 -2,03	6,70 0,47	-2,16 -0,58	10,78 1,52	-13,21 -1,43	28,94 1,54	14,28 -0,48
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	3,21 -0,01	7,11 0,89	0,09 1,67	9,45 0,20	-16,25 -4,47	13,15 -14,25	-3,51 -18,27
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	3,10 -0,12	5,02 -1,21	-2,40 -0,82	6,99 -2,27	-16,98 -5,20	16,47 -10,92	10,39 -4,37
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	2,93 -0,13	5,66 -0,56	-1,76 -0,25	9,29 -0,62	-13,66 -0,85	26,13 -2,76	15,98 -3,44
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	2,49 -0,73	10,78 4,55	3,33 4,91	12,58 3,33	-10,92 0,86	18,33 -9,07	-0,08 -14,84
BRADERCO FIA IBOVESPA PLUS Var. IBOVESPA p.p.	3,24 0,02	6,17 -0,05	-1,61 -0,03	9,23 -0,03	-11,95 -0,17	26,75 -0,65	13,88 -0,88
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	1,54 3,37	2,82 6,84	0,34 2,45	6,82 7,19	-17,62 9,25	16,89 1,53	20,01 6,60
ILHA SOLTEIRA Var. IPCA + 4,80% p.p.	1,24 0,36	5,03 -1,78	3,14 -1,26	6,17 -1,88	-0,16 -17,26	15,94 -16,63	18,96 -22,56
CDI	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63
IBOVESPA	3,22	6,23	-1,58	9,26	-11,78	27,40	14,76
INPC + 6,00%	0,96	7,49	4,75	8,85	18,61	36,88	48,04
IPCA + 6,00%	0,98	7,31	4,69	8,67	18,43	35,62	46,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IRF M	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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 FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	D+0	D+0	D+0	D+2 du		0,50
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
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 RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA BRASIL IBX-50	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	D+1 du	D+0	D+2 du	D+4 du		1,50
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
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Indexadores**

**Renda Fixa**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,95	4,02	2,61	4,93	6,43	8,67	15,54	23,85	33,97
IRF-M 1+	0,39	0,65	0,67	2,95	-0,89	-1,17	12,32	30,13	44,56
IRF-M TOTAL	0,58	1,82	1,31	3,74	1,60	2,33	13,90	29,08	42,46
IMA-B 5	0,78	6,25	5,02	7,09	9,55	17,65	28,78	45,80	60,12
IMA-B 5+	1,16	3,17	4,84	2,82	-0,25	10,41	15,02	52,46	63,45
IMA-B TOTAL	0,96	4,73	4,93	4,96	4,59	14,18	21,81	50,71	63,86
IMA-GERAL TOTAL	0,92	4,04	3,06	4,94	5,26	9,68	18,01	34,24	46,62
IDKA 2	0,85	6,35	4,97	7,23	9,24	18,49	29,19	44,76	60,19
IDKA 20	1,21	0,35	3,98	-1,94	-10,01	4,21	1,84	54,09	61,61
CDI	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63	22,99	32,44

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,22	6,23	-1,58	9,26	-11,78	27,40	14,76	45,08	77,56
IBRX 100	3,23	6,61	-1,68	9,95	-12,43	29,27	17,73	50,94	83,12
IBRX 50	3,30	6,74	-2,55	10,76	-11,91	31,55	16,59	45,38	78,31
SMALL CAP	-1,82	-4,02	-2,10	-0,37	-26,87	15,36	13,41	44,72	71,86
Índice Consumo - ICON	-3,02		-12,01	-12,30	-36,86	-19,27	-13,06	7,05	10,44
Índice Dividendos - IDIV	4,26	14,16	8,74	15,99	2,41	41,18	33,41	82,88	105,54

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Investimentos Estruturados**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-3,86	-26,53	-13,29	-23,87	-11,17	18,29	80,18	91,96	149,78

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,26	0,56	2,89	9,39	0,14	6,12	10,49	27,39	37,13

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-3,99	-26,71	-14,01	-24,39	-17,07	11,67	59,19	61,99	105,20

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,47	4,78	3,18	5,55	11,73	20,73	23,00	28,73	32,40
INPC	0,45	4,96	3,23	5,73	11,90	21,85	24,35	30,30	32,59
IGPM	0,52	7,54	3,71	8,47	10,72	51,73	61,61	73,96	81,38
SELIC	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63	23,00	32,46

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,81	6,48	4,20	7,64	16,20	30,56	38,31	50,52	60,94
IPCA + 5,00%	0,90	6,90	4,45	8,16	17,32	33,08	42,33	56,38	68,79
IPCA + 5,50%	0,94	7,10	4,57	8,41	17,88	34,35	44,37	59,37	72,83
IPCA + 5,89%	0,97	7,26	4,67	8,61	18,31	35,34	45,97	61,73	76,03
IPCA + 6,00%	0,98	7,31	4,69	8,67	18,43	35,62	46,43	62,40	76,94
INPC + 4,00%	0,79	6,66	4,25	7,82	16,37	31,77	39,83	52,36	61,17
INPC + 6,00%	0,96	7,49	4,75	8,85	18,61	36,88	48,04	64,38	77,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
159	02/05/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	80.000,00	19.776,82838014	4,0451380000
160	04/05/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	70.000,00	17.285,41454252	4,0496570000
157	06/05/2022	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	720.000,00	0,00	53.849,25100000	13,3706596000
165	12/05/2022	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	1.350.000,00	0,00	6.620,37397500	203,9159729000
161	17/05/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	50.000,00	12.293,22790661	4,0672800000
158	20/05/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	3.000.000,00	1.109.671,41482300	2,7035030000
162	20/05/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	50.000,00	12.275,49048564	4,0731570000
164	23/05/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.000.000,00	0,00	839.051,23442616	3,5754670000
167	27/05/2022	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	500.000,00	2.438,59094914	205,0364372000
156	27/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	320.000,00	127.316,74688605	2,5134164030
163	30/05/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	120.000,00	29.376,95157822	4,0848350000
<b>Total</b>			<b>5.070.000,00</b>	<b>4.190.000,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.598.509,13

Value-At-Risk: 3,00%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ILHA SOLTEIRA		3,00	3,00			186.892.950,36	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,42%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF M		1,57	0,01	0,03			1.900.223,85	1,02
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,07	0,13	0,03			16.428.860,69	8,79
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,09	0,11	0,02			13.781.674,38	7,37
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,08	0,04	0,02			12.001.581,77	6,42
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,09	0,05	0,01			13.748.030,88	7,36
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR		2,08	0,16	0,01			20.454.766,53	10,94
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		3,36	0,09	0,05			7.190.368,35	3,85
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,03	-0,00	0,00			105.528,04	0,06
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,10	0,04	0,03			13.150.167,43	7,04
<b>Sub-total</b>	<b>3,74</b>	<b>1,71</b>	<b>0,62</b>		<b>-0,03</b>	<b>0,90</b>	<b>98.761.201,92</b>	<b>52,84</b>

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,04	0,00	0,03			11.731.944,20	6,28
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B		2,04	0,06	0,16			7.429.050,75	3,98
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,04	0,00	0,03			1.793.806,82	0,96
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5		1,12	0,05	0,05			14.041.151,11	7,51
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,04	-0,00	0,03			3.093.541,54	1,66
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,04	-0,00	0,02			2.875.386,28	1,54
<b>Sub-total</b>	<b>1,55</b>	<b>0,73</b>	<b>0,11</b>		<b>-0,06</b>	<b>0,94</b>	<b>40.964.880,70</b>	<b>21,92</b>

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,49%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS		8,80	0,15	3,90			3.427.584,00	1,83
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		10,69	0,30	4,40			5.857.669,15	3,13
FIA BRASIL IBX-50		9,77	0,44	2,50			9.354.039,24	5,01
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		9,61	0,16	1,94			3.219.628,65	1,72
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		9,86	0,12	0,17			2.525.641,92	1,35
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		12,89	0,18	7,69			2.953.533,05	1,58
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		9,05	0,17	2,00			3.955.828,72	2,12
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES		9,13	0,05	2,06			1.038.337,99	0,56
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS		9,65	0,52	0,04			10.811.015,71	5,78
BRADESCO F I A SELECTION		9,65	0,19	3,11			4.023.589,31	2,15
<b>Sub-total</b>	20,53	9,49	2,27		0,06	2,24	47.166.867,74	25,24