



**LDB**  
EMPRESAS

**GUARULHOS - CONSOLIDADO**  
OUTUBRO 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 31.10.2022.

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

65,77%

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 150535 (5,523000%)	2,83	0,52	8,00	37.767.377,16	4,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,170000%)	2,69	0,50	9,01	3.192.185,56	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,640100%)	2,82	0,53	7,99	26.251.176,50	2,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	2,86	0,54	3,99	16.260.872,54	1,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,850000%)	4,04	0,17	0,17	50.086.173,78	5,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,504000%)	2,83	0,52	5,28	21.129.900,77	2,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,522000%)	2,84	0,52	4,89	21.089.351,66	2,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,791000%)	2,92	0,55	6,10	12.297.613,16	1,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,170000%)	0,73	0,50	9,01	3.139.087,70	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,540000%)	0,68	0,53	9,27	31.042.485,86	3,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,700100%)	2,87	0,54	4,45	10.434.633,73	1,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,732000%)	2,88	0,54	7,36	56.316.918,56	6,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,761000%)	2,89	0,54	4,38	20.701.535,33	2,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,844000%)	2,92	0,55	3,41	27.135.154,72	2,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,930000%)	2,95	0,56	1,42	40.736.712,99	4,36

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,73</b>	<b>0,54</b>	<b>9,41</b>	<b>377.581.180,02</b>	<b>40,40</b>

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,92	1,89	8,17	4.403.694,60	0,47	470.754.249,93	0,94
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	6,31	1,06	6,77	7.205.613,50	0,77	223.691.964,46	3,22
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,01	2,24	9,55	8.021.589,25	0,86	3.736.730.846,68	0,21
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	1,54	0,35	10,87	0,00	0,00	44.904.397,51	0,00
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,95</b>	<b>1,76</b>	<b>8,26</b>	<b>19.630.897,35</b>	<b>2,10</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
MONGERAL	BEM	MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	5,28	0,98	7,05	9.232.353,55	0,99	175.642.635,67	5,26
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	5,24	1,17	6,84	5.892.538,75	0,63	80.164.150,46	7,35
BRAM	BRASESCO	BRASESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,12	0,05	0,05	4.502.187,63	0,48	573.532.495,89	0,78
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,12	1,04	6,62	17.659.119,72	1,89	12.427.649.222,70	0,14
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,12	0,95	9,10	26.819.104,33	2,87	3.859.205.707,52	0,69
XP	INTRAG	XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP	3,60	1,34	8,02	18.006.270,22	1,93	596.682.358,50	3,02
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>2,71</b>	<b>1,15</b>	<b>7,80</b>	<b>82.111.574,20</b>	<b>8,79</b>		

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRASESCO	BRASESCO	CDB - BBDC - BANCO BRASESCO SA. 972	0,00	0,31	1,38	0,00	0,00		
BRASESCO	BRASESCO	CDB - BBDC - BANCO BRASESCO SA. 403	0,00	0,51	0,51	156.003,18	0,02		
BRASESCO	BRASESCO	CDB - BBDC - BANCO BRASESCO SA. 256	0,00	0,23	0,84	0,00	0,00		
BRASESCO	BRASESCO	CDB - BBDC - BANCO BRASESCO SA. 744	0,00	1,02	1,02	3.293.755,72	0,35		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 8,13% a.a	1,63	0,72	1,19	50.594.214,73	5,41		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
<b>Sub-total Artigo 7º IV</b>			<b>1,56</b>	<b>0,76</b>	<b>1,39</b>	<b>54.043.973,63</b>	<b>5,78</b>		
Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	0,21	1,11	11,03	12.597.749,58	1,35	361.179.345,42	3,49
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	3,36	1,85	10,25	42.635.148,72	4,56	823.161.779,75	5,18
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	0,15	1,15	11,04	26.023.696,38	2,78	1.267.842.103,65	2,05
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea b</b>			<b>1,82</b>	<b>1,51</b>	<b>10,47</b>	<b>81.256.594,68</b>	<b>8,70</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,70</b>	<b>0,82</b>	<b>8,31</b>	<b>614.624.219,88</b>	<b>65,77</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

18,52%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CLARITAS	SANTANDER	CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	20,82	5,33	15,73	11.573.009,45	1,24	525.494.064,86	2,20
VINCI	BEM	VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	18,05	5,63	15,50	17.875.685,83	1,91	555.292.121,29	3,22
CONSTANCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	17,84	5,41	13,80	18.812.868,19	2,01	1.326.372.993,27	1,42
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	25,81	7,80	1,72	5.849.025,67	0,63	336.786.237,45	1,74
QUELUZ	BEM	QUELUZ VALOR FI EM ACOES	40,47	-25,44	-21,56	1.607.228,64	0,17	66.828.756,09	2,40
SOMMA	BEM	SOMMA BRASIL FIA	20,47	4,53	6,34	12.614.493,08	1,35	358.954.822,33	3,51
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	17,63	5,54	11,30	17.408.226,56	1,86	544.088.818,27	3,20
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	19,53	6,75	13,34	17.233.313,17	1,84	1.054.252.592,18	1,63
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FIA	21,93	8,35	10,11	18.049.177,43	1,93	966.527.510,12	1,87
ARX	BEM	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	19,59	5,58	5,72	9.065.324,32	0,97	323.434.596,50	2,80
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	17,82	8,19	3,24	25.562.693,48	2,74	491.946.044,22	5,20
BB	BB	BB AÇÕES AGRO FIC FI	16,16	8,23	6,69	9.592.133,28	1,03	410.875.812,03	2,33
BB	BB	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	20,17	4,36	6,11	5.508.914,71	0,59	1.488.244.493,95	0,37
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	29,85	4,79	4,53	2.298.221,39	0,25	242.814.961,57	0,95
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>18,44</b>	<b>6,00</b>	<b>8,69</b>	<b>173.050.315,20</b>	<b>18,52</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>17,97</b>	<b>6,00</b>	<b>8,69</b>	<b>173.050.315,20</b>	<b>18,52</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,51%

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
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	31,43	1,83	-34,28	9.551.536,94	1,02	146.868.190,44	6,50
XP	BNP PARIBAS	ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	21,43	-3,42	-29,31	6.351.764,67	0,68	55.539.253,68	11,44
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	31,25	6,29	-33,05	1.888.195,71	0,20	66.562.059,18	2,84
BB	BB	BB MULTIMERCADO SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	22,70	1,71	-25,94	6.213.521,01	0,66	596.182.698,70	1,04
MONGERAL	BEM	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	30,73	-6,80	-48,66	6.356.009,72	0,68	55.466.586,89	11,46
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	38,26	-1,68	-47,14	7.291.791,15	0,78	529.565.364,86	1,38
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	24,01	1,76	-12,08	8.951.896,58	0,96	256.882.795,89	3,48
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>21,27</b>	<b>-0,58</b>	<b>-36,34</b>	<b>46.604.715,78</b>	<b>4,99</b>		

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
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	24,28	2,32	-31,47	8.772.089,04	0,94	1.004.133.508,36	0,87
BB	BB	BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO FIC DE FIA - BDR ETF NÍVEL I	20,99	6,24	-15,47	4.259.910,53	0,46	429.089.925,09	0,99
RBR	BTG PACTUAL	RBR REITS US DOLAR FIC FI AÇÕES BDR NÍVEL I	21,18	0,52	-12,11	10.546.855,22	1,13	69.275.221,47	15,22
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>19,89</b>	<b>2,18</b>	<b>-27,27</b>	<b>23.578.854,79</b>	<b>2,52</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>19,18</b>	<b>0,33</b>	<b>-33,69</b>	<b>70.183.570,57</b>	<b>7,51</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

8,20%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	38,31	-0,39	4,33	12.519.644,40	1,34	163.443.498,63	7,66
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	22,87	8,84	-8,93	51.748.920,81	5,54	403.547.884,46	12,82
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	6,25	2,11	3,20	12.383.412,16	1,33	130.113.979,03	9,52
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>19,01</b>	<b>6,11</b>	<b>-8,36</b>	<b>76.651.977,37</b>	<b>8,20</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>19,01</b>	<b>6,11</b>	<b>-8,36</b>	<b>76.651.977,37</b>	<b>8,20</b>		
<b>Total</b>			<b>5,71</b>	<b>2,15</b>	<b>2,81</b>	<b>934.510.083,02</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 2	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	377.581.180,02	40,40	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	19.630.897,35	2,10	0,00	0,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	82.111.574,20	8,79	0,00	5,00	60,00	0,00	70,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	54.043.973,63	5,78	0,00	0,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	81.256.594,68	8,70	0,00	15,00	15,00	0,00	10,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>614.624.219,88</b>	<b>65,77</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	173.050.315,20	18,52	0,00	10,00	30,00	0,00	40,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>173.050.315,20</b>	<b>18,52</b>					40,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	46.604.715,78	4,99	0,00	7,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	23.578.854,79	2,52	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>70.183.570,57</b>	<b>7,51</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	76.651.977,37	8,20	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>76.651.977,37</b>	<b>8,20</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>934.510.083,02</b>	<b>100,00</b>					

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,54 53,14	9,41 94,06	0,61 18,57	3,55 54,57		1.835.152,10	18.401.558,67
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,76 172,32	8,26 82,61	3,03 92,07	3,63 55,71	11,16 97,12	359.518,26	6.808.734,29
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,15 112,22	7,80 77,97	3,15 95,53	4,59 70,44	11,82 102,82	1.112.135,49	6.341.116,95
Artigo 7º IV % do CDI	0,76 74,37	1,39 36,58	1,40 42,38			408.771,03	738.556,04
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,51 148,00	10,47 104,65	3,52 106,72	5,67 87,03		1.209.207,69	7.359.960,48
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	6,00 0,55	8,69 -2,01	12,35 -0,13	5,99 -1,58		9.797.294,81	14.425.312,40
Artigo 9º II % do CDI	-0,58 -56,55	-36,34 -363,31	-10,95 -332,12	-12,12 -186,19	-37,32 -324,71	-270.569,20	-19.725.445,16
Artigo 9º III % do CDI	2,18 213,92	-27,27 -272,69	-9,72 -295,04	-8,98 -137,96	-24,92 -216,80	503.833,19	-6.260.795,55
Artigo 10º I % do CDI	6,11 598,28	-8,36 -83,56	1,80 54,57	3,08 47,39		4.411.409,19	-3.931.580,11
<b>GUARULHOS - CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>19.366.752,56</b>	<b>24.157.418,01</b>

## RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (5,523000%)	37.570.138,14	0,00	0,00	0,00	37.767.377,16	197.239,02	2.848.934,08
NTN-B 150545 (5,170000%)	3.176.359,05	0,00	0,00	0,00	3.192.185,56	15.826,51	268.851,69
NTN-B 150545 (5,640100%)	26.111.781,03	0,00	0,00	0,00	26.251.176,50	139.395,47	1.977.962,81
NTN-B 150545 (5,760000%)	16.173.069,11	0,00	0,00	0,00	16.260.872,54	87.803,43	629.886,23
NTN-B 150545 (5,850000%)	0,00	50.000.154,63	0,00	0,00	50.086.173,78	86.019,15	86.019,15
NTN-B 150840 (5,504000%)	21.019.853,72	0,00	0,00	0,00	21.129.900,77	110.047,05	1.085.440,35
NTN-B 150840 (5,522000%)	20.979.225,40	0,00	0,00	0,00	21.089.351,66	110.126,26	1.006.399,32

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150840 (5,791000%)	12.230.934,30	0,00	0,00	0,00	12.297.613,16	66.678,86	724.770,28
NTN-B 150850 (5,170000%)	3.123.525,18	0,00	0,00	0,00	3.139.087,70	15.562,52	266.834,57
NTN-B 150850 (5,540000%)	30.879.975,55	0,00	0,00	0,00	31.042.485,86	162.510,31	2.711.262,68
NTN-B 150850 (5,700100%)	10.378.758,80	0,00	0,00	0,00	10.434.633,73	55.874,93	455.293,88
NTN-B 150850 (5,732000%)	56.013.986,66	0,00	0,00	0,00	56.316.918,56	302.931,90	3.960.464,80
NTN-B 150850 (5,761000%)	20.589.750,48	0,00	0,00	0,00	20.701.535,33	111.784,85	888.592,50
NTN-B 150850 (5,844000%)	26.986.940,27	0,00	0,00	0,00	27.135.154,72	148.214,45	914.614,09
NTN-B 150850 (5,930000%)	40.511.575,60	0,00	0,00	0,00	40.736.712,99	225.137,39	576.232,18
					377.581.180,02	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 RF IPCA	7.845.646,67	0,00	0,00	0,00	8.021.589,25	175.942,58	714.730,97
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	7.414.704,63	0,00	-7.440.628,61	0,00	0,00	25.923,98	731.647,26
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	7.129.702,55	0,00	0,00	0,00	7.205.613,50	75.910,95	466.245,56
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.321.953,85	0,00	0,00	0,00	4.403.694,60	81.740,75	340.813,51
					19.630.897,35	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 FLUXO FIC	35.909.340,75	84.415.505,59	-93.838.885,73	0,00	26.819.104,33	333.143,72	2.325.357,48
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	34.212.403,73	36.000.000,00	-52.934.479,07	0,00	17.659.119,72	381.195,06	1.101.370,81
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	5.824.401,32	0,00	0,00	0,00	5.892.538,75	68.137,43	376.989,21
BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	4.500.000,00	0,00	0,00	4.502.187,63	2.187,63	270.164,06
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	9.142.935,63	0,00	0,00	0,00	9.232.353,55	89.417,92	608.346,24
XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP	17.768.216,49	0,00	0,00	0,00	18.006.270,22	238.053,73	1.336.290,48
					82.111.574,20	0,00	0,00

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 256	112.818,75	0,00	-113.075,40	0,00	0,00	256,65	1.883,00
CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 403	0,00	188.122,72	-32.959,81	0,00	156.003,18	840,27	840,27
CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 744	4.753.107,49	0,00	-1.497.591,03	0,00	3.293.755,72	38.239,26	38.239,26
CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 972	3.196.982,03	0,00	-3.204.804,71	0,00	0,00	7.822,68	47.180,30
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 8,13% a.a	50.232.602,56	0,00	0,00	0,00	50.594.214,73	361.612,17	594.214,73
					54.043.973,63	0,00	0,00

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	41.859.115,72	0,00	0,00	0,00	42.635.148,72	776.033,00	3.962.470,41
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	25.728.380,22	0,00	0,00	0,00	26.023.696,38	295.316,16	2.498.896,34
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	12.459.891,05	0,00	0,00	0,00	12.597.749,58	137.858,53	898.593,73
					81.256.594,68	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\$)
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	8.586.291,90	0,00	0,00	0,00	9.065.324,32	479.032,42	490.342,36
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	23.628.125,21	0,00	0,00	0,00	25.562.693,48	1.934.568,27	801.211,95
BB AÇÕES AGRO FIC FI	8.862.711,44	0,00	0,00	0,00	9.592.133,28	729.421,84	601.881,76
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	5.278.714,23	0,00	0,00	0,00	5.508.914,71	230.200,48	317.050,78
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	5.425.824,72	0,00	0,00	0,00	5.849.025,67	423.200,95	98.780,88
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	10.987.340,83	0,00	0,00	0,00	11.573.009,45	585.668,62	1.573.009,45
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	17.847.835,10	0,00	0,00	0,00	18.812.868,19	965.033,09	2.280.788,68
OCCAM FIC FIA	16.144.000,37	0,00	0,00	0,00	17.233.313,17	1.089.312,80	2.027.702,98
QUELUZ VALOR FI EM ACOES	2.155.512,55	0,00	0,00	0,00	1.607.228,64	-548.283,91	-441.743,44
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	2.193.172,59	0,00	0,00	0,00	2.298.221,39	105.048,80	99.518,80
SOMMA BRASIL FIA	12.067.400,90	0,00	0,00	0,00	12.614.493,08	547.092,18	752.389,61
VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	16.923.255,33	0,00	0,00	0,00	17.875.685,83	952.430,50	2.399.095,68

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
VINCI MOSAICO FIA	16.658.868,19	0,00	0,00	0,00	18.049.177,43	1.390.309,24	1.657.775,33
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	16.493.967,03	0,00	0,00	0,00	17.408.226,56	914.259,53	1.767.507,58
					173.050.315,20	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\$)
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	9.380.069,10	0,00	0,00	0,00	9.551.536,94	171.467,84	-3.114.114,93
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	6.576.699,59	0,00	0,00	0,00	6.351.764,67	-224.934,92	-2.633.253,15
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.776.380,82	0,00	0,00	0,00	1.888.195,71	111.814,89	-932.010,03
BB MULTIMERCADO SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	6.108.898,37	0,00	0,00	0,00	6.213.521,01	104.622,64	-2.176.386,02
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	6.819.605,88	0,00	0,00	0,00	6.356.009,72	-463.596,16	-3.319.652,96
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	7.416.487,07	0,00	0,00	0,00	7.291.791,15	-124.695,92	-6.501.924,65
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	8.797.144,15	0,00	0,00	0,00	8.951.896,58	154.752,43	-1.048.103,42
					46.604.715,78	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 BOLSAS GLOBAIS ATIVO FIC DE FIA - BDR ETF NÍVEL I	4.009.643,58	0,00	0,00	0,00	4.259.910,53	250.266,95	-779.620,02
RBR REITS US DOLAR FIC FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10.491.873,21	0,00	0,00	0,00	10.546.855,22	54.982,01	-1.453.144,78
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	8.573.504,81	0,00	0,00	0,00	8.772.089,04	198.584,23	-4.028.030,75
					23.578.854,79	0,00	0,00

## Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	47.544.327,94	0,00	0,00	0,00	51.748.920,81	4.204.592,87	-4.055.498,46

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	12.127.263,84	0,00	0,00	0,00	12.383.412,16	256.148,32	383.412,16
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	12.568.976,40	0,00	0,00	0,00	12.519.644,40	-49.332,00	519.644,40
					76.651.977,37	0,00	0,00

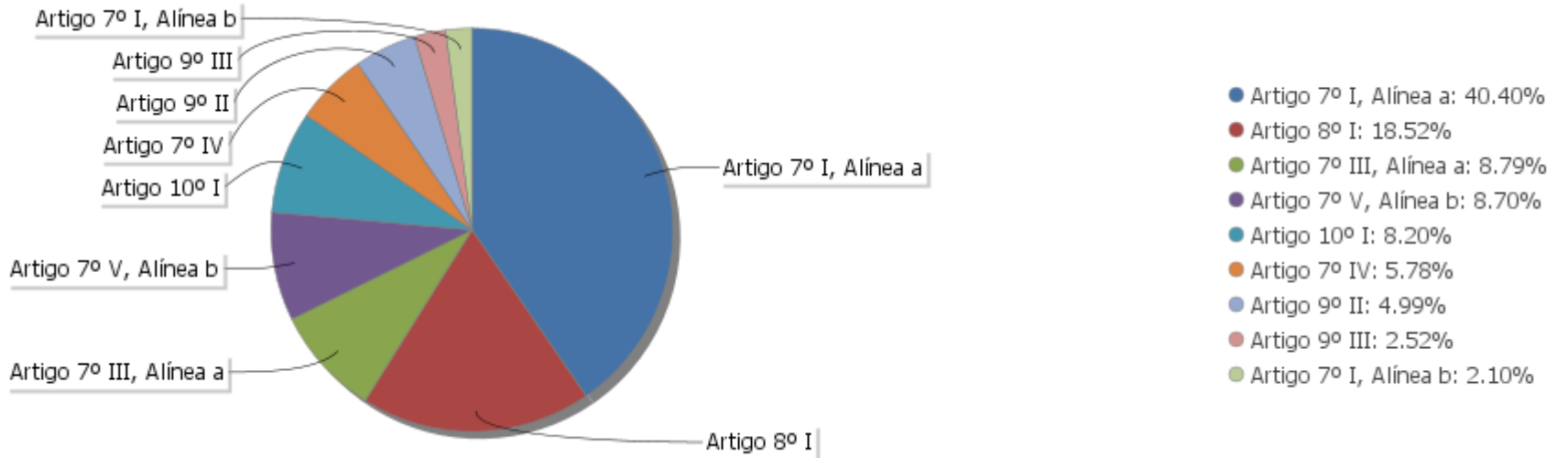
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

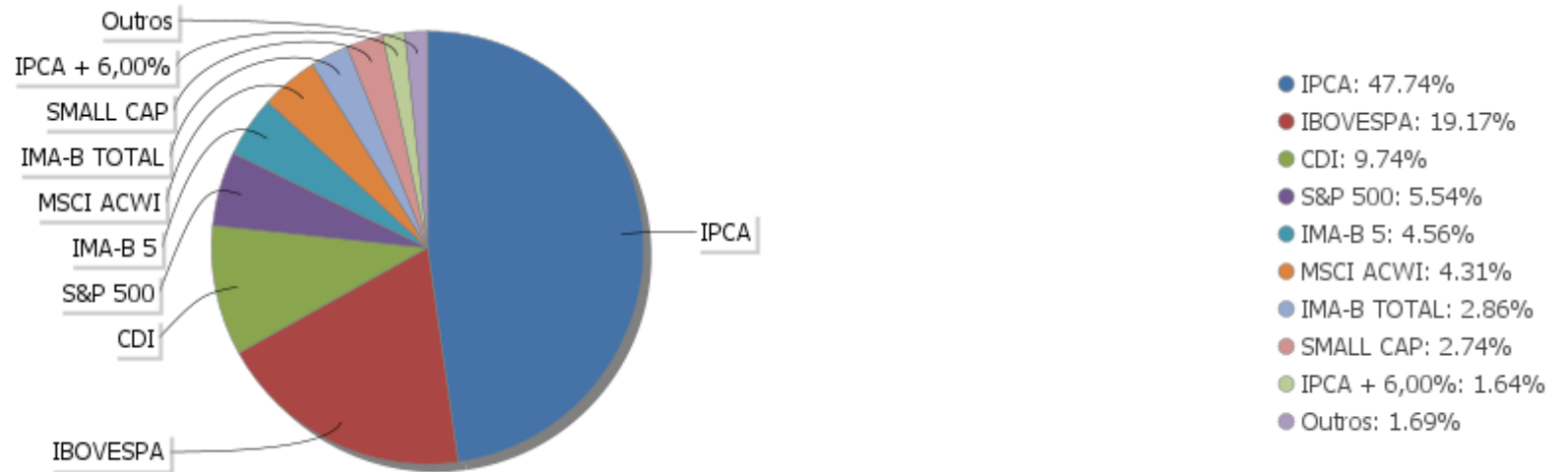
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	416.049.711,36	44,52	416.049.711,36	44,52
de 31 a 365 dias	75.225.909,91	8,05	491.275.621,27	52,57
acima de 365 dias	443.234.461,75	47,43	934.510.083,02	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

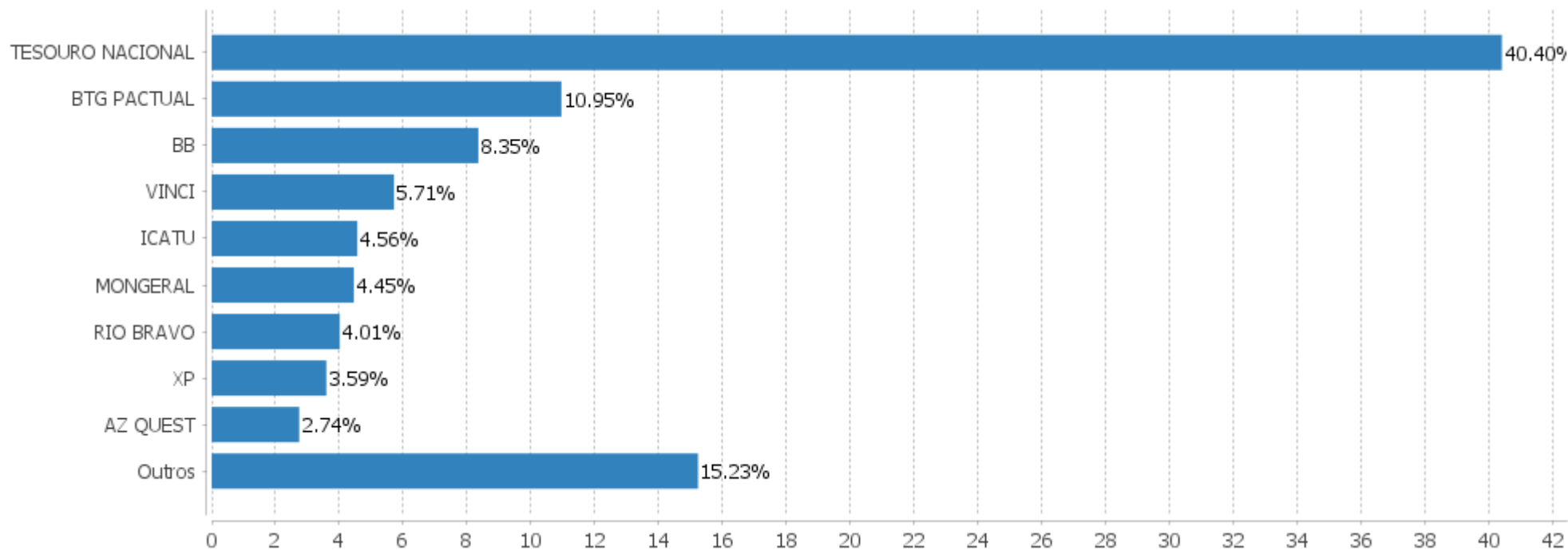


Alocação Por Estratégia



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	-0,24	-0,23	2,42	-1,87	0,74	-2,28	2,02	0,96	-0,77	2,15			2,81
IPCA + 4,96%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,90	1,08	-0,28	0,08	0,11	0,98			8,99
p.p. indexador	-1,19	-1,61	0,37	-3,30	-0,15	-3,36	2,30	0,88	-0,88	1,17			-6,18
2021	-0,76	-0,81	0,95	1,85	1,21	0,40	-0,37	-0,49	-1,48	-1,09	0,67	1,68	1,69
INPC + 5,45%	0,69	1,20	1,35	0,80	1,41	1,05	1,49	1,35	1,65	1,59	1,27	1,22	16,14
p.p. indexador	-1,46	-2,01	-0,40	1,05	-0,20	-0,65	-1,86	-1,84	-3,13	-2,68	-0,59	0,46	-14,45
2020	0,53	-0,88	-6,05	2,01	2,03	2,14	3,14	-1,11	-1,67	-0,41	3,82	3,63	6,94
INPC + 5,88%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,97	0,84	1,35	1,37	1,41	1,97	11,62
p.p. indexador	-0,16	-1,46	-6,73	1,78	1,83	1,36	2,17	-1,95	-3,02	-1,78	2,41	1,66	-4,69
2019	2,07	0,41	0,50	0,79	1,47	1,74	0,86	0,16	1,41	1,46	-0,04	2,38	14,00
INPC + 6,00%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,44	0,57	1,01	1,71	10,78
p.p. indexador	1,20	-0,59	-0,71	-0,30	0,81	1,29	0,23	-0,47	0,98	0,88	-1,05	0,67	3,22
2018	2,20	0,71	1,15	0,15	-1,66	0,02	1,59	-0,00	0,57	3,13	0,57	0,96	9,71
INPC + 6,00%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	0,74	0,91	0,21	0,60	9,59
p.p. indexador	1,46	0,11	0,59	-0,55	-2,57	-1,91	0,83	-0,53	-0,17	2,21	0,36	0,36	0,12

## Performance Sobre a Meta Atuarial

## Relatório

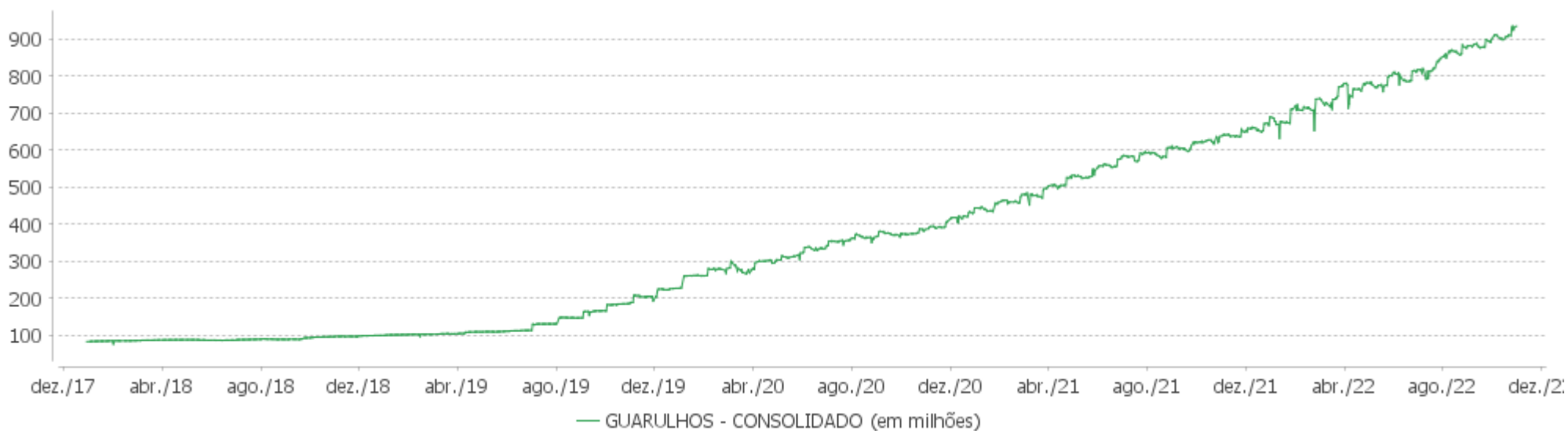
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	26	44,83	03 meses	2,34	1,17	1,16	5,16
Meses abaixo - Meta Atuarial	32	55,17	06 meses	2,78	2,89	-0,11	5,35
			12 meses	5,24	11,72	-6,48	5,71
			24 meses	12,48	30,89	-18,41	5,59
Maior rentabilidade da Carteira	3,82	2020-11	36 meses	14,41	45,16	-30,75	7,09
Menor rentabilidade da Carteira	-6,05	2020-03	48 meses	29,41	57,80	-28,39	6,26
			Desde 29/12/2017	39,83	71,53	-31,70	5,84

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

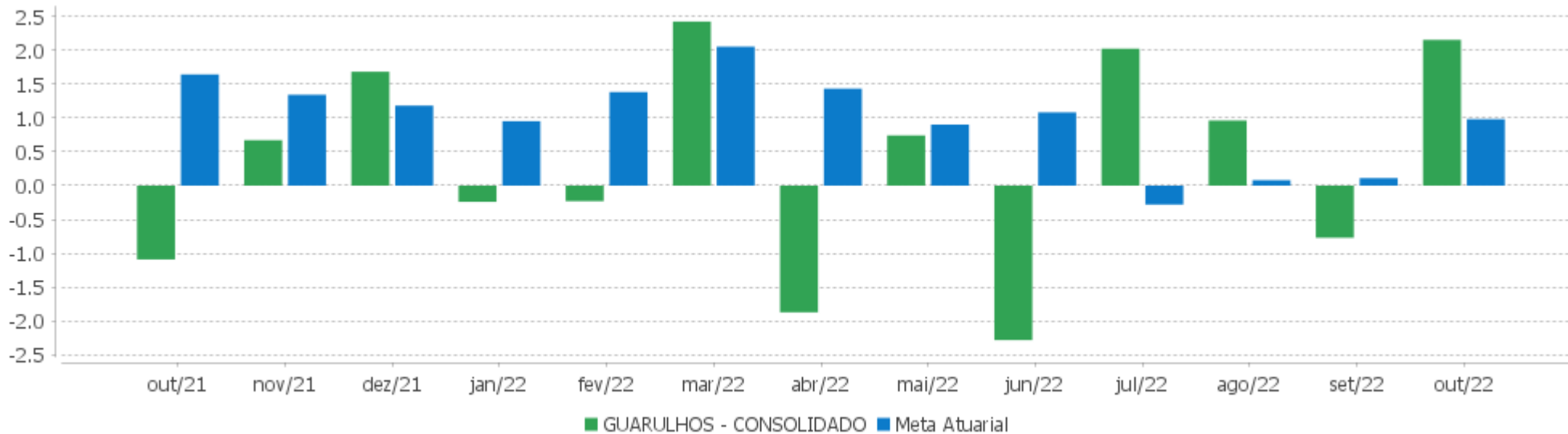


Patrimônio Líquido



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
CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 972 % do CDI	1,02 100,00	2,10 100,00					
CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 403 % do CDI	0,51 100,00	0,51 100,00					
CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 256 % do CDI	1,02 100,00	1,64 100,00					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 8,13% a.a Var. IPCA p.p.	0,72 0,13	1,19 1,58	1,19 1,26				
CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 744 % do CDI	1,02 100,00	1,02 100,00					
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV Var. IMA-B 5 p.p.	1,85 -0,06	10,25 1,12	3,41 1,06	4,68 1,17	15,01 2,28	19,96 2,23	24,76 0,31
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA % do CDI	1,11 108,40	11,03 110,25	3,63 110,13	7,14 109,75	12,68 110,35	17,86 117,53	18,14 95,95
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO % do CDI	1,15 112,46	11,04 110,37	3,65 110,87	7,14 109,65	12,74 110,86	19,19 126,25	18,74 99,11
NTN-B 150840 (5,791000%) Var. IPCA p.p.	0,55 -0,04	6,67 1,97	0,63 0,70	3,61 3,21	9,88 3,41	21,12 3,29	25,28 2,83
NTN-B 150840 (5,522000%) Var. IPCA p.p.	0,52 -0,07	6,53 1,83	0,57 0,63	3,47 3,08	9,69 3,22	20,81 2,98	24,86 2,41
NTN-B 150545 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	0,54 -0,05	9,72 5,02	0,63 0,69	3,59 3,20	9,86 3,39	21,12 3,29	25,29 2,84
NTN-B 150850 (5,844000%) Var. IPCA p.p.	0,55 -0,04	6,71 2,01	0,65 0,71	3,63 3,24	9,93 3,46	21,23 3,39	25,44 2,99
NTN-B 150850 (5,732000%) Var. IPCA p.p.	0,54 -0,05	6,66 1,96	0,62 0,68	3,58 3,18	9,86 3,39	21,13 3,29	25,31 2,86
NTN-B 150850 (5,700100%) Var. IPCA p.p.	0,54 -0,05	6,65 1,95	0,61 0,67	3,56 3,17	9,84 3,37	21,10 3,26	25,27 2,82
NTN-B 150535 (5,523000%) Var. IPCA p.p.	0,52 -0,07	9,52 4,81	0,57 0,63	3,47 3,08	9,66 3,19	20,72 2,89	24,70 2,25
NTN-B 150545 (5,640100%) Var. IPCA p.p.	0,53 -0,06	9,62 4,91	0,60 0,66	3,53 3,14	9,78 3,31	21,00 3,17	25,13 2,68
NTN-B 150850 (5,540000%)	0,53	9,53	0,57	3,48	12,78	24,30	28,55

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	-0,06	4,83	0,64	3,09	6,31	6,47	6,10
NTN-B 150840 (5,504000%) Var. IPCA p.p.	0,52 -0,07	6,52 1,82	0,56 0,63	3,46 3,07	9,67 3,20	20,79 2,96	24,83 2,38
NTN-B 150850 (5,930000%) Var. IPCA p.p.	0,56 -0,03	6,75 2,05	0,67 0,73	3,68 3,28	9,98 3,51	21,31 3,47	25,54 3,09
NTN-B 150545 (5,170000%) Var. IPCA p.p.	0,50 -0,09	9,01 4,31	0,48 0,55	3,30 2,90	9,47 3,00	20,51 2,68	24,48 2,03
NTN-B 150850 (5,170000%) Var. IPCA p.p.	0,50 -0,09	9,01 4,31	0,48 0,55	3,30 2,90	12,38 5,91	23,77 5,94	27,91 5,46
NTN-B 150545 (5,850000%) Var. IPCA p.p.	0,55 -0,04	6,71 2,00	0,65 0,71	0,72 0,33	6,83 0,36		
NTN-B 150850 (5,761000%) Var. IPCA p.p.	0,54 -0,05	6,68 1,97	0,63 0,69	3,59 3,20	9,87 3,40	21,15 3,32	25,34 2,89
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	1,00 -0,91	11,59 2,47	3,27 0,93	5,12 1,62	14,19 1,46	21,77 4,04	29,79 5,34
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	2,24 1,19	9,55 -0,34	2,18 0,76	3,12 -0,29	12,46 -0,40	18,19 -14,14	25,17 -20,53
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,06 -0,17	6,77 -0,66	3,31 -0,55	3,21 -0,36	11,74 0,34	12,12 -1,32	11,66 -0,65
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,89 0,66	8,17 0,74	2,21 -1,65	3,01 -0,56	12,04 0,64	15,96 2,52	21,70 9,40
BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO % do CDI	0,98 96,04	9,56 95,61	3,16 96,02	6,25 96,08	10,95 95,24	14,53 95,58	17,47 92,38
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,98 -0,25	7,05 -0,37	3,72 -0,14	3,30 -0,27	11,16 -0,25	12,57 -0,87	10,99 -1,32
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,04 101,81	10,21 102,09	3,35 101,70	6,62 101,68	11,79 102,61	15,78 103,83	18,90 99,93
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,17 -0,06	6,84 -0,59	3,83 -0,04	3,34 -0,23	10,64 -0,76	11,01 -2,43	8,96 -3,34
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,95 93,10	9,10 91,00	3,06 92,71	6,00 92,25	10,39 90,38	12,85 84,54	15,18 80,28
XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP Var. IPCA p.p.	1,34 0,75	8,02 3,31	2,65 2,71	3,23 2,84	11,99 5,51	16,97 -0,86	22,49 0,04
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,58 0,13	5,72 -4,98	12,54 0,06	3,52 -4,05	9,38 -2,74		
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	5,33	18,81	13,09	7,27	21,30	32,97	29,97

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBRX 100 p.p.	-0,24	8,56	1,08	0,51	9,51	9,55	20,19
BB AÇÕES AGRO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	8,23 2,78	6,69 -4,00	11,83 -0,65	3,14 -4,43	12,04 -0,07		
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	4,36 -1,09	6,11 -4,59	9,95 -2,53	3,47 -4,10	8,25 -3,86	28,30 4,79	25,37 17,15
VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	5,63 0,17	15,50 4,80	12,80 0,32	8,94 1,37	17,24 5,13	26,93 3,43	17,26 9,04
SOMMA BRASIL FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,53 -0,92	6,34 -4,36	12,13 -0,35	4,63 -2,94	6,09 -6,02	16,01 -7,49	-1,85 -10,08
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	5,41 -0,05	13,80 3,10	11,43 -1,04	6,85 -0,71	16,82 4,71	29,56 6,06	17,35 9,12
VINCI MOSAICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,35 2,89	10,11 -0,59	15,53 3,05	9,35 1,79	14,12 2,01	18,46 -5,04	14,35 6,13
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,79 -0,66	4,53 -6,17	16,22 3,74	4,56 -3,01	0,24 -11,87	-4,38 -27,88	0,60 -7,62
VINCI SELECTION EQUITIES FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,54 0,09	11,30 0,60	12,13 -0,34	9,84 2,28	13,53 1,41	17,92 -5,59	17,54 9,31
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA Var. SMALL CAP p.p.	8,19 0,88	3,24 4,58	12,15 -4,66	3,09 2,18	1,52 1,46	11,23 7,55	
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	7,80 2,35	1,72 -8,98	14,12 1,64	-2,10 -9,66	3,86 -8,25	8,25 -15,26	-0,19 -8,41
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	6,75 1,29	13,34 2,64	14,19 1,71	11,04 3,48	14,16 2,05	21,83 -1,68	13,23 5,01
QUELUZ VALOR FI EM ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-25,44 -30,89	-21,56 -32,26	-21,29 -33,77	-24,08 -31,64	-21,21 -33,32	-28,69 -52,19	-39,50 -47,72
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO FIC DE FIA - BDR ETF NÍVEL I Var. MSCI World p.p.	6,24	-15,47	-5,51	-5,97	-13,63		
RBR REITS US DOLAR FIC FI AÇÕES BDR NÍVEL I Var. MSCI ACWI p.p.	0,52 -2,51	-28,34 -1,52	-11,96 -5,13	-13,00 -8,86	-24,59 2,10		
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	2,32 -3,14	-31,47 -42,17	-8,91 -21,39	-5,19 -12,76	-28,95 -41,07	-5,65 -29,16	39,53 31,31
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IBOVESPA p.p.	1,83 -3,62	-34,28 -44,97	-10,00 -22,48	-5,86 -13,43	-34,35 -46,46	-7,78 -31,29	67,26 59,04
BB MULTIMERCADO SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI ACWI p.p.	1,71 -1,32	-25,94 0,88	-6,48 0,36	-5,59 -1,46	-25,28 1,42	-0,60 2,47	61,72 17,66
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	1,76	-28,26	-8,32	-6,85	-28,78	-3,07	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,27	-1,44	-1,49	-2,72	-2,09	-0,00	
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-3,42 -6,45	-29,31 -2,49	-13,80 -6,96	-17,40 -13,27	-29,52 -2,82	-19,81 -16,74	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,68 -2,74	-47,14 -57,02	-10,60 -12,03	-14,70 -18,11	-49,97 -62,83	-41,16 -73,50	
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	-6,80 -9,83	-48,66 -21,84	-20,46 -13,62	-24,21 -20,07	-49,82 -23,12	-33,77 -30,70	
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	6,29 3,26	-33,05 -6,23	-10,58 -3,74	-11,60 -7,47	-29,91 -3,21	-5,17 -2,10	
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	2,11 -3,34	3,23 -3,13	6,02 -6,46	5,81 -1,76			
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-0,39 -5,85	4,33 -0,83	4,79 -7,69				
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	8,84 3,85	-8,93 14,54	0,15 5,17	2,79 2,64	-4,35 17,33	39,24 31,39	
GUARULHOS - CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,96% p.p.	2,15 1,17	2,81 -6,18	2,34 1,16	2,78 -0,11	5,24 -6,51	12,48 -17,28	14,41 -27,07
CDI	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91
IBOVESPA	5,45	10,70	12,48	7,57	12,11	23,51	8,22
INPC + 6,00%	0,94	10,00	1,33	3,32	12,85	32,81	47,43
IPCA + 6,00%	1,06	9,89	1,43	3,41	12,86	32,34	45,71

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		1,30
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du	-	
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		0,80
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	-	2,00
BB AÇÕES AGRO FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+2	Será devida taxa de performance de 20% (vinte por cento), com base no resultado do FUNDO, sobre a rentabilidade que exceder 100% da variação do índice IBOVESPA, calculada e provisionada diariamente nos dias considerados úteis, após a dedução de todas as despesas do FUNDO, inclusive taxa de administração.	
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO FIC DE FIA - BDR ETF NÍVEL I					Será devida taxa de performance de 10% (dez por cento), com base no resultado do FUNDO, sobre a rentabilidade que exceder 100% da variação do índice MSCI ACWI,	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					calculada e provisionada diariamente nos dias considerados úteis, após a dedução de todas as despesas do FUNDO, inclusive taxa de administração.	
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB MULTIMERCADO SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	D+1 a D+30 (de acordo com a data de solicitação)	D+0	D+1 du	D+5 du		0,08
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
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 PREVIDENCIÁRIO XI TP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	D+0	D+0	D+2 du	D+3 du		0,50
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	D+1 du	D+0	D+5 du	D+7 du	Cobrança semestral, no último dia útil de dezembro e junho ou no resgate total ou parcial das cotas, o que ocorrer primeiro	2,00
BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+0	D+2 du		
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+31 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+33 (isento de taxa de resgate)	Para informações adicionais, vide o Regulamento	0,70
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	D+1 du	D+0	D+14 du	D+15 du		2,00
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	D+0	D+0	D+5 du	D+6 du		0,40

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+2 du	D+3 du	-	0,50
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,45
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
OCCAM FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+15 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+17 (isento de taxa de resgate)	-	3,00
QUELUZ VALOR FI EM ACOES	D+1 du	D+0	D+10	D+12	-	2,00
RBR REITS US DOLAR FIC FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+1	D+1	D+13	D+15	O fundo cobrará 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice REITBMF. A taxa de performance será paga no(s) mes(es) de Janeiro e Julho	
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,45
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+2		
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+3 d.u		
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32	Método Passivo.	0,00
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	-	
SOMMA BRASIL FIA	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du	-	2,00
VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)	-	1,97
VINCI MOSAICO FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)	-	1,97
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	D+1 du	D+0	D+60	D+62	-	0,97
XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA	D+0	D+0	D+0 ou D+4 (isento de	D+1 du ou D+5 (isento		0,50

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FIXA LP			taxa de resgate)	de taxa de resgate)		

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	1,00	9,68	3,38	6,44	11,52	13,50	18,11	26,53	35,47
IRF-M 1+	0,92	7,22	5,18	6,95	12,08	5,46	10,35	30,15	43,64
IRF-M TOTAL	0,93	7,95	4,44	6,64	11,95	8,26	13,06	29,67	41,90
IMA-B 5	1,91	9,12	2,35	3,50	12,73	17,73	24,45	41,60	54,77
IMA-B 5+	0,65	5,79	5,62	3,73	10,15	9,03	2,65	40,63	55,93
IMA-B TOTAL	1,23	7,43	3,86	3,57	11,40	13,44	12,30	42,33	56,98
IMA-GERAL TOTAL	1,01	8,88	3,72	5,61	11,80	12,98	15,99	33,17	45,02
IDKA 2	1,78	8,84	2,04	3,22	12,50	17,69	25,62	40,76	54,48
IDKA 20	-0,33	3,63	10,36	4,51	7,43	2,00	-11,54	37,24	53,99
CDI	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91	26,30	34,57

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,45	10,70	12,48	7,57	12,11	23,51	8,22	32,73	56,16
IBRX 100	5,57	10,25	12,01	6,76	11,78	23,41	9,78	37,01	60,34
IBRX 50	5,32	10,92	12,53	7,34	13,01	26,17	10,50	32,80	56,33
SMALL CAP	7,30	-1,35	16,81	0,91	0,06	3,68	-2,72	39,01	46,73
IFIX	0,02	6,66	6,30	6,34	11,80	8,12	7,14	33,40	34,37
Índice Consumo - ICON	6,28		12,02	1,65	-14,96	-22,29	-23,79	10,51	-0,91
Índice Dividendos - IDIV	4,03	13,61	6,51	3,76	16,46	32,51	18,49	64,97	73,53

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	0,59	4,70	-0,06	0,39	6,47	17,83	22,45	25,55	31,28
INPC	0,47	4,81	-0,16	0,30	6,46	18,26	23,90	27,06	32,15
IGPM	-0,97	5,58	-2,59	-1,31	6,52	29,66	56,80	61,74	79,20
SELIC	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91	26,30	34,58

**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	5,00	-23,47	-5,01	0,15	-21,68	7,85	67,36	101,91	141,21
MSCI ACWI	3,03	-26,82	-6,84	-4,13	-26,70	-3,07	44,06	71,11	89,42

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,90	8,17	0,94	2,41	10,73	27,41	37,65	46,79	59,57
IPCA + 5,00%	0,98	9,03	1,18	2,91	11,79	29,86	41,64	52,49	67,35
IPCA + 5,50%	1,02	9,46	1,31	3,16	12,33	31,10	43,66	55,41	71,35
IPCA + 5,89%	1,05	9,79	1,40	3,35	12,74	32,06	45,25	57,71	74,53
IPCA + 6,00%	1,06	9,89	1,43	3,41	12,86	32,34	45,71	58,36	75,43
INPC + 4,00%	0,78	8,27	0,84	2,32	10,72	27,87	39,28	48,55	60,63
INPC + 6,00%	0,94	10,00	1,33	3,32	12,85	32,81	47,43	60,26	76,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1327	05/10/2022	CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 972	0,00	1.100.000,00	0,24148364	4.555.174,0068188470
1312	06/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.867,36	0,00	789,88801900	2,3640819370
1299	07/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	198.119,06	0,00	83.764,32018200	2,3651962980
1328	07/10/2022	CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 972	0,00	500.000,00	0,10965388	4.559.802,0989818110
1303	10/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	100.000,00	42.259,32699000	2,3663415180
1325	10/10/2022	CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 744	0,00	697.591,03	0,14631881	4.767.609,9422917900
1329	10/10/2022	CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 972	0,00	1.604.804,71	0,35176748	4.562.117,8796857510
1313	11/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	7.440.628,61	0,00	3.142.870,52897800	2,3674626560
1311	11/10/2022	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	0,00	7.440.628,61	3.638.736,71921500	2,0448384110
1326	11/10/2022	CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 744	0,00	800.000,00	0,16771378	4.770.031,4190044490
1314	13/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	158.649,68	66.980,70419600	2,3685878180
1304	13/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	236.436,83	99.821,85511700	2,3685878180
1315	14/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	321.637,24	0,00	135.729,24617400	2,3696973870
1334	14/10/2022	CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 256	0,00	1.757,46	0,00494548	355.366,6638611211
1333	14/10/2022	CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 256	0,00	45.409,66	0,12778255	355.366,6638611211
1332	14/10/2022	CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 256	0,00	7.487,60	0,02107007	355.366,6638611211
1331	14/10/2022	CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 256	0,00	3.121,56	0,00878405	355.366,6638611211
1330	14/10/2022	CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 256	0,00	41.653,86	0,11721375	355.366,6638611211
1335	14/10/2022	CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 256	0,00	13.645,26	0,03839769	355.366,6638611211
1316	17/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	674.038,84	0,00	284.303,60923000	2,3708416570
1305	17/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	88,80	0,00	37,45505300	2,3708416570
1336	17/10/2022	CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 403	188.122,72	0,00	1,00000000	188.122,7200000000
1317	20/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	32.976.949,11	13.889.635,69154600	2,3742126750
1321	20/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	33.000.000,00	0,00	12.478.244,50211900	2,6446027720
1306	20/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.027.536,75	1.275.175,04302700	2,3742126750
1310	20/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.000.000,00	0,00	1.134.385,86382900	2,6446027720
1337	20/10/2022	CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 403	0,00	32.959,81	0,17493709	188.409,4969084549
1318	25/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	64.735.865,15	0,00	27.227.778,92794700	2,3775668710

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1322	25/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	43.106.729,86	16.274.897,30520500	2,6486637090
1307	25/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	150.000,00	63.089,70815100	2,3775668710
1319	26/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	43.106.729,86	18.122.050,11674400	2,3786894740
1323	26/10/2022	NTN-B 150545 (5,850000%)	50.000.154,63	0,00	12.088,00000000	4.136,3463459629
1300	26/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	9.827.749,21	0,00	4.131.581,40960400	2,3786894740
1302	26/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	9.827.749,21	3.708.561,70543000	2,6500163650
1320	27/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	545.813,26	229.352,67887134	2,3797989310
1301	27/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	13.220.141,15	5.555.150,46997800	2,3797989310
1308	27/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	316.629,09	133.048,67309400	2,3797989310
1324	28/10/2022	BRAPRECO FI RF MAXI PODER PUBLICO	4.500.000,00	0,00	1.147.160,23925000	3,9227301000
1309	31/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.215.511,32	0,00	510.283,20805600	2,3820327630
<b>Total</b>			<b>175.103.782,94</b>	<b>159.062.424,36</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 22.711.821,41

Value-At-Risk: 2,43%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GUARULHOS - CONSOLIDADO		2,43	2,43			934.510.083,02	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,27%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,523000%)		0,18	-0,00	0,19			37.767.377,16	4,04
NTN-B 150545 (5,170000%)		0,18	-0,00	0,19			3.192.185,56	0,34
NTN-B 150545 (5,640100%)		0,18	-0,00	0,19			26.251.176,50	2,81
NTN-B 150545 (5,760000%)		0,18	-0,00	0,19			16.260.872,54	1,74
NTN-B 150545 (5,850000%)		0,18	-0,00	0,19			50.086.173,78	5,36
NTN-B 150840 (5,504000%)		0,18	-0,00	0,19			21.129.900,77	2,26
NTN-B 150840 (5,522000%)		0,18	-0,00	0,19			21.089.351,66	2,26
NTN-B 150840 (5,791000%)		0,18	-0,00	0,19			12.297.613,16	1,32
NTN-B 150850 (5,170000%)		0,18	-0,00	0,19			3.139.087,70	0,34
NTN-B 150850 (5,540000%)		0,18	-0,00	0,19			31.042.485,86	3,32
NTN-B 150850 (5,700100%)		0,18	-0,00	0,19			10.434.633,73	1,12
NTN-B 150850 (5,732000%)		0,18	-0,00	0,19			56.316.918,56	6,03
NTN-B 150850 (5,761000%)		0,18	-0,00	0,19			20.701.535,33	2,22
NTN-B 150850 (5,844000%)		0,18	-0,00	0,19			27.135.154,72	2,90
NTN-B 150850 (5,930000%)		0,18	-0,00	0,19			40.736.712,99	4,36
<b>Sub-total</b>	0,33	0,18	-0,01		-1,47	0,54	377.581.180,02	40,40

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,53	0,00	1,62			4.403.694,60	0,47

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF		2,92	0,01	0,82			7.205.613,50	0,77
BB PREV RF IPCA		0,79	0,00	0,75			8.021.589,25	0,86
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
<b>Sub-total</b>	1,62	1,47	0,01		0,45	1,76	19.630.897,35	2,10

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
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO		2,62	0,01	0,22			9.232.353,55	0,99
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF		2,59	0,01	0,25			5.892.538,75	0,63
BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO		0,02	-0,00	0,02			4.502.187,63	0,48
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	0,00	0,01			17.659.119,72	1,89
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	0,00	0,01			26.819.104,33	2,87
XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP		1,81	0,01	1,81			18.006.270,22	1,93
<b>Sub-total</b>	1,03	0,87	0,03		0,12	1,15	82.111.574,20	8,79

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 972		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 403		0,00	-0,00	0,01			156.003,18	0,02
CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 256		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
CDB - BBDC - BANCO BRADESCO SA. 744		0,00	-0,00	0,01			3.293.755,72	0,35
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 8,13% a.a		0,07	0,00	0,17			50.594.214,73	5,41
<b>Sub-total</b>	2,38	0,07	0,00		-0,11	0,76	54.043.973,63	5,78

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA		0,03	0,00	0,03			12.597.749,58	1,35
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV		1,39	0,02	0,49			42.635.148,72	4,56

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO		0,03	0,00	0,02			26.023.696,38	2,78
<b>Sub-total</b>	0,83	0,73	0,02		0,59	1,51	81.256.594,68	8,70

## Renda Variável

Value-At-Risk: 9,40%

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
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA		11,41	0,12	4,15			11.573.009,45	1,24
VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM AÇÕES		9,08	0,14	2,31			17.875.685,83	1,91
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES		8,50	0,14	3,79			18.812.868,19	2,01
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES		11,82	0,06	6,48			5.849.025,67	0,63
QUELUZ VALOR FI EM ACOES		11,04	0,01	10,96			1.607.228,64	0,17
SOMMA BRASIL FIA		10,53	0,12	1,36			12.614.493,08	1,35
VINCI SELECTION EQUITIES FIA		9,25	0,15	2,89			17.408.226,56	1,86
OCCAM FIC FIA		10,40	0,16	1,97			17.233.313,17	1,84
VINCI MOSAICO FIA		11,01	0,19	3,89			18.049.177,43	1,93
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA		10,21	0,09	2,28			9.065.324,32	0,97
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA		8,81	0,20	6,23			25.562.693,48	2,74
BB AÇÕES AGRO FIC FI		7,30	0,06	5,85			9.592.133,28	1,03
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI		10,72	0,05	1,46			5.508.914,71	0,59
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		12,88	0,03	6,54			2.298.221,39	0,25
<b>Sub-total</b>	27,84	9,40	1,52		0,18	6,00	173.050.315,20	18,52

## Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 8,69%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO		6,13	-0,02	13,00			12.519.644,40	1,34
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		12,78	0,58	8,10			51.748.920,81	5,54
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO		3,10	0,03	7,42			12.383.412,16	1,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
<b>Sub-total</b>	19,42	8,69	0,60		0,26	6,11	76.651.977,37	8,20

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,42%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR		13,07	0,06	16,35			9.551.536,94	1,02
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE		9,00	0,04	9,95			6.351.764,67	0,68
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		16,24	0,03	12,20			1.888.195,71	0,20
BB MULTIMERCADO SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI		10,80	-0,00	11,68			6.213.521,01	0,66
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		15,47	-0,01	14,40			6.356.009,72	0,68
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		20,55	0,04	20,56			7.291.791,15	0,78
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		11,50	-0,01	12,16			8.951.896,58	0,96
<b>Sub-total</b>	28,85	10,28	0,15		-0,06	-0,58	46.604.715,78	4,99

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		11,18	0,04	15,42			8.772.089,04	0,94
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO FIC DE FIA - BDR ETF NÍVEL I		10,52	0,04	10,52			4.259.910,53	0,46
RBR REITS US DOLAR FIC FI AÇÕES BDR NÍVEL I		12,24	0,03	9,29			10.546.855,22	1,13
<b>Sub-total</b>	27,49	10,02	0,11		0,04	2,18	23.578.854,79	2,52

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

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

- O Instituto está com 5,18% do Patrimônio Líquido do fundo ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV, percentual este, superior ao permitido na Resolução CMN nº 4963 de 25 de novembro de 2021;
- O Instituto está com 15,22% do Patrimônio Líquido do fundo RBR REITS US DOLAR FIC FI AÇÕES BDR NÍVEL I, percentual este, superior ao permitido na Resolução CMN nº 4963 de 25 de novembro de 2021;