



LDB
EMPRESAS

CAMPO MOURÃO
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

71,89%

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	0,74	0,92	3,90	5.481.755,47	2,85	5.107.140.425,93	0,11
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,74	0,93	3,91	17.585.110,71	9,15	5.274.375.201,05	0,33
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,64	0,76	6,16	13.206.006,98	6,87	12.390.634.636,61	0,11
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,59	0,77	6,17	22.458.833,61	11,69	9.450.283.491,65	0,24
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,70	0,85	6,17	25.811.253,74	13,43	11.182.665.779,99	0,23
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,67	0,77	6,14	15.446.701,25	8,04	6.992.058.203,56	0,22
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,16	0,99	4,45	11.686.239,11	6,08	2.722.459.745,02	0,43
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,25	0,85	5,50	111.675.900,87	58,12		

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
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	2,25	0,83	3,74	24.911.280,32	12,96	880.220.730,58	2,83
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			2,25	0,83	3,74	24.911.280,32	12,96		

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	CM CAPITAL	GBX PRIME I FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS	5,27	-0,02	-3,68	1.549.916,73	0,81	155.844.626,83	0,99
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			5,27	-0,02	-3,68	1.549.916,73	0,81		
Renda Fixa			2,14	0,84	5,06	138.137.097,92	71,89		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

9,72%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	21,68	0,02	-0,27	3.412.749,70	1,78	563.542.547,78	0,61
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	19,56	3,07	7,71	15.254.594,87	7,94	479.743.885,81	3,18
Sub-total Artigo 8º I			17,03	2,50	6,16	18.667.344,57	9,72		
Renda Variável			15,96	2,50	6,16	18.667.344,57	9,72		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,67%

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	20,04	-4,44	-28,42	12.820.819,73	6,67	2.266.073.116,40	0,57
Sub-total Artigo 9º III			20,04	-4,44	-28,42	12.820.819,73	6,67		
Investimentos no Exterior			20,04	-4,44	-28,42	12.820.819,73	6,67		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

10,62%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	18,35	0,97	-10,62	16.554.625,22	8,62	2.423.271.241,40	0,68
Sub-total Artigo 10º I			18,35	0,97	-10,62	16.554.625,22	8,62		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
A5	PLANNER	W7 FIP MULTISTRATÉGIA	0,42	-0,14	-0,61	3.136.754,97	1,63	135.122.562,11	2,32
LEGATUS	BTG PACTUAL	FIP LA SHOPPING CENTERS	125,62	-0,06	2,16	723.958,18	0,38	69.908.687,24	1,04
Sub-total Artigo 10º II			0,72	-0,13	-0,11	3.860.713,15	2,01		
Investimentos Estruturados			19,69	0,76	-8,80	20.415.338,37	10,62		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,10%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
PLANNER	PLANNER	CARE11	71,49	22,25	68,59	2.109.028,04	1,10	293.685.366,89	0,72
Sub-total Artigo 11º			71,49	22,25	68,59	2.109.028,04	1,10		
Fundos Imobiliários			75,67	22,25	68,59	2.109.028,04	1,10		
Total			5,02	0,82	0,77	192.149.628,63	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	111.675.900,87	58,12	0,00	27,33	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	24.911.280,32	12,96	0,00	3,73	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.549.916,73	0,81	0,00	0,95	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	138.137.097,92	71,89					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	18.667.344,57	9,72	0,00	4,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	18.667.344,57	9,72					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	12.820.819,73	6,67	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	12.820.819,73	6,67					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	16.554.625,22	8,62	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	3.860.713,15	2,01	0,00	3,32	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	20.415.338,37	10,62					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.109.028,04	1,10	0,00	0,67	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	2.109.028,04	1,10					5,00
Total		192.149.628,63	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,85 82,15	5,50 126,56	4,23 150,24	6,31 122,81	7,57 95,95	938.125,82	5.755.010,15
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,83 80,86	3,74 86,17	2,81 99,75			205.957,36	898.855,40
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,02 -2,22	-3,68 -84,72	0,58 20,65			-355,04	-59.219,48
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	2,50 -0,72	6,16 -0,07	4,33 5,92			454.876,61	1.082.736,90
Artigo 9º III % do CDI	-4,44 -430,35	-28,42 -654,28	-14,62 -519,25	-27,20 -529,17	-14,82 -187,70	-595.270,78	-5.090.729,54
Artigo 10º I % do CDI	0,97 94,41	-10,62 -244,42	-3,59 -127,65			159.583,15	-1.966.461,80
Artigo 10º II % do CDI	-0,13 -12,20	-0,11 -2,43	-0,37 -13,05			-4.863,66	-4.081,79
Artigo 11º % do CDI	22,25 2.158,18	68,59 1.579,04	74,91 2.661,25			383.870,20	858.062,80
CAMPO MOURÃO (Total)						1.541.923,66	1.474.172,64

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 IDKA2	22.286.116,76	0,00	0,00	0,00	22.458.833,61	172.716,85	1.306.016,65
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	15.328.687,71	0,00	0,00	0,00	15.446.701,25	118.013,54	892.925,59
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	5.431.697,28	0,00	0,00	0,00	5.481.755,47	50.058,19	205.701,37
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.592.901,26	0,00	0,00	0,00	25.811.253,74	218.352,48	1.452.947,83
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	13.105.794,67	0,00	0,00	0,00	13.206.006,98	100.212,31	765.960,03
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.032.464,91	2.250.003,53	-1.861.766,27	0,00	17.585.110,71	164.408,54	633.059,00
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	11.571.875,20	0,00	0,00	0,00	11.686.239,11	114.363,91	498.399,68
					111.675.900,87	938.125,82	0,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	24.705.322,96	0,00	0,00	0,00	24.911.280,32	205.957,36	898.855,40
					24.911.280,32	205.957,36	0,11

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
GBX PRIME I FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS	1.550.271,77	0,00	0,00	0,00	1.549.916,73	-355,04	-59.219,48
					1.549.916,73	-355,04	-0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	14.800.328,46	0,00	0,00	0,00	15.254.594,87	454.266,41	1.092.144,83
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	3.412.139,50	0,00	0,00	0,00	3.412.749,70	610,20	-9.407,93
					18.667.344,57	454.876,61	0,24

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	13.416.090,51	0,00	0,00	0,00	12.820.819,73	-595.270,78	-5.090.729,54
					12.820.819,73	-595.270,78	-0,32

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	16.395.042,07	0,00	0,00	0,00	16.554.625,22	159.583,15	-1.966.461,80
					16.554.625,22	159.583,15	0,09

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIP LA SHOPPING CENTERS	724.376,08	0,00	0,00	0,00	723.958,18	-417,90	15.287,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	3.141.200,73	0,00	0,00	0,00	3.136.754,97	-4.445,76	-19.369,33
					3.860.713,15	-4.863,66	-0,00

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CARE11	1.725.157,84	0,00	0,00	0,00	0,00	2.109.028,04	383.870,20	858.062,80
						2.109.028,04	383.870,20	0,20

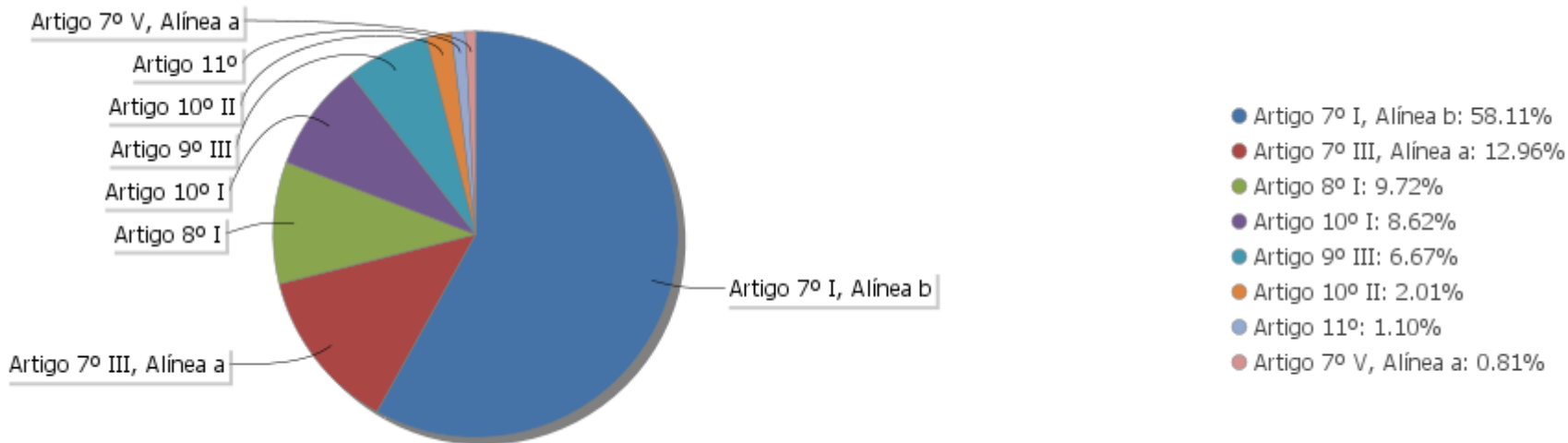
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

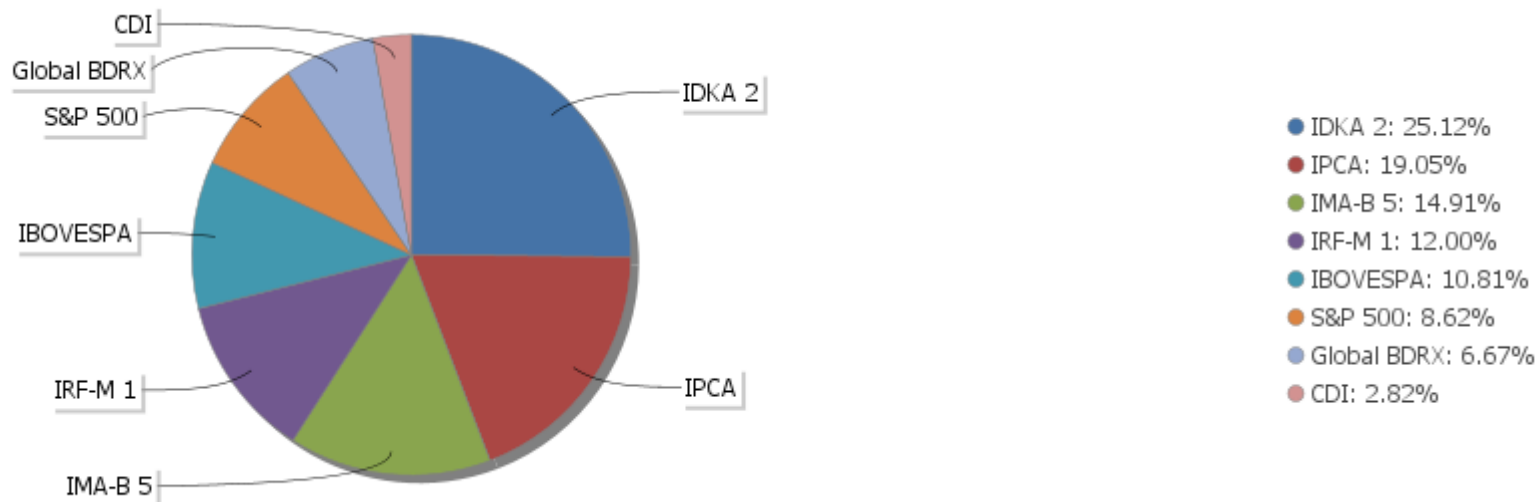
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	186.463.004,02	97,04	186.463.004,02	97,04
de 31 a 365 dias	3.412.749,70	1,78	189.875.753,72	98,82
acima de 365 dias	2.273.874,91	1,18	192.149.628,63	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

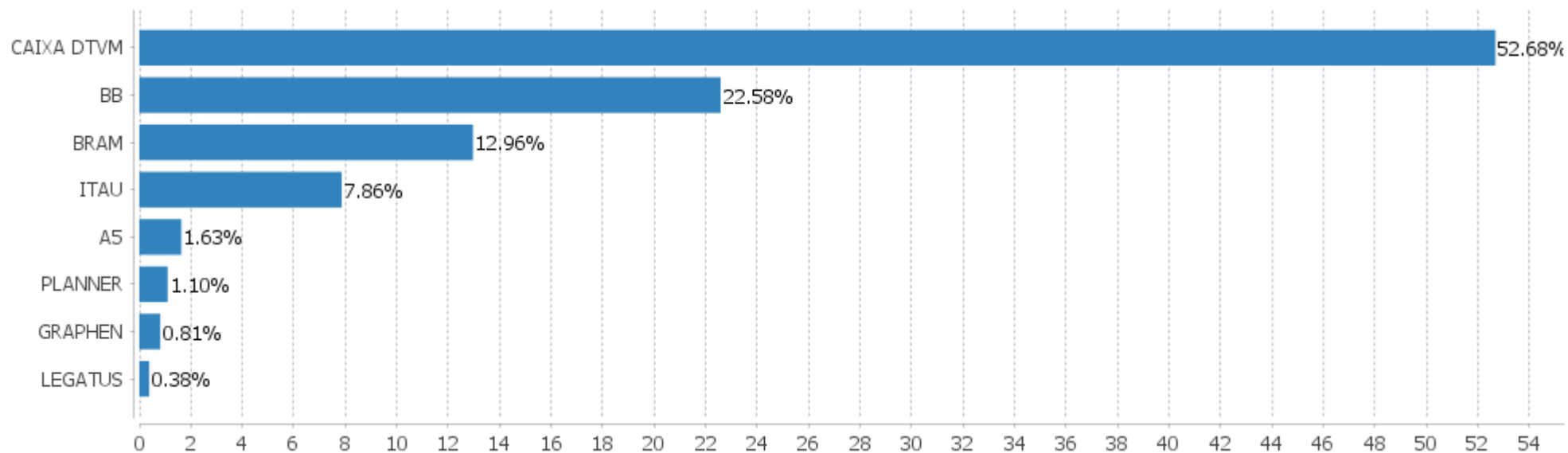


Alocação Por Estratégia



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	-1,33	-0,06	2,37	-1,00	0,82								0,77
IPCA + 4,95%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,89								6,87
p.p. indexador	-2,27	-1,43	0,32	-2,43	-0,07								-6,11
2021	-0,51	-0,51	1,29	2,00	1,14	0,28	-0,25	-0,09	-0,91	0,03	-0,18	1,93	4,23
IPCA + 5,45%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,98	1,43	1,34	1,61	1,68	1,38	1,22	16,03
p.p. indexador	-1,19	-1,75	-0,13	1,27	-0,14	-0,70	-1,68	-1,43	-2,52	-1,65	-1,56	0,71	-11,81
2020	0,13	-0,88	-5,49	1,11	1,81	1,72	2,31	-0,61	-1,04	0,13	2,62	2,64	4,25
IPCA + 5,88%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,64
p.p. indexador	-0,58	-1,54	-6,06	0,97	1,74	0,98	1,43	-1,33	-2,16	-1,21	1,27	0,79	-6,39

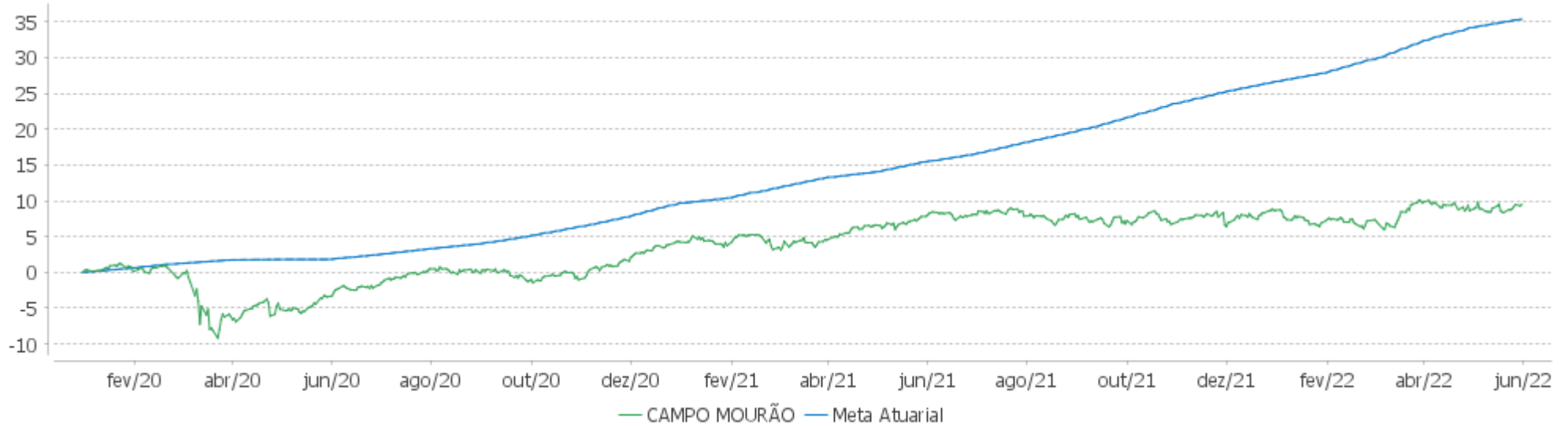
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

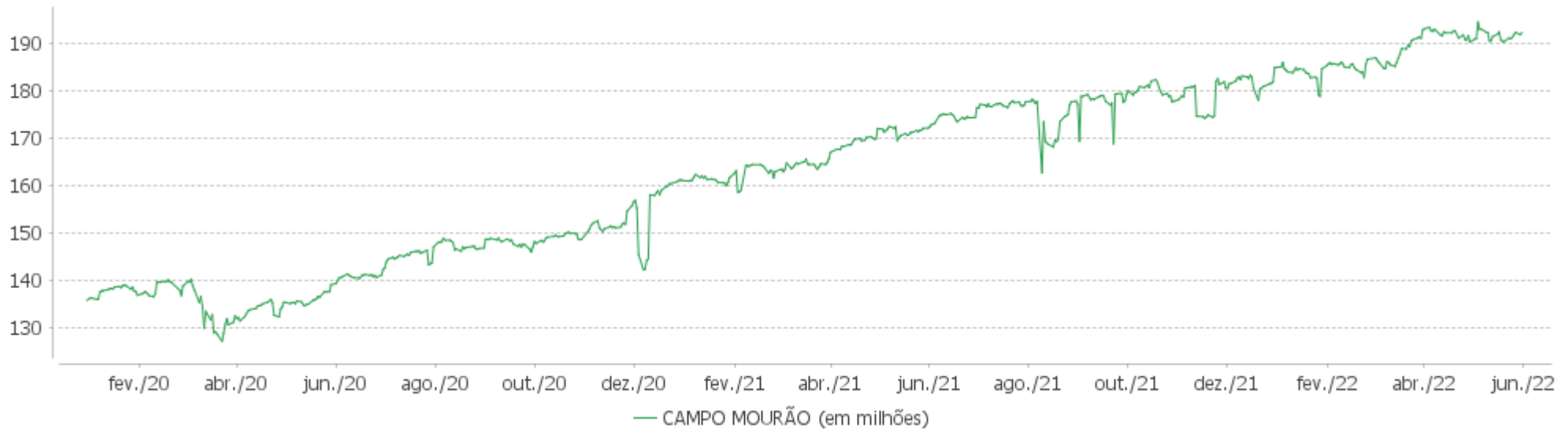
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	9	31,03	03 meses	2,18	4,43	-2,25	5,78
Meses abaixo - Meta Atuarial	20	68,97	06 meses	2,71	8,18	-5,46	5,12
			12 meses	1,56	17,59	-16,04	5,02
			24 meses	13,39	34,28	-20,89	4,67
Maior rentabilidade da Carteira	2,64	2020-12	Desde 31/12/2019	9,50	37,20	-27,71	6,57
Menor rentabilidade da Carteira	-5,49	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

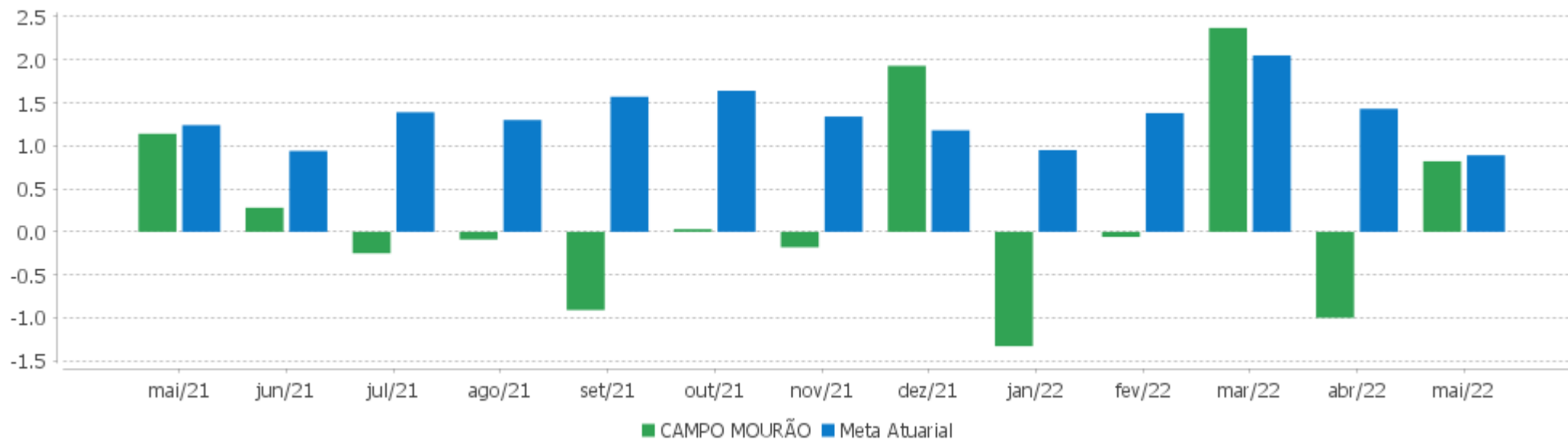


Patrimônio Líquido



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 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 IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,77 -0,08	6,17 -0,17	4,95 -0,02	6,92 -0,30	9,45 0,21	17,95 -0,54	27,46 -1,73
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,92 -0,03	3,90 -0,12	2,51 -0,10	4,78 -0,16	6,14 -0,29	7,98 -0,69	14,50 -1,04
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,85 0,00	6,17 -0,17	4,95 -0,02	6,94 -0,29	9,11 -0,13	17,79 -0,70	27,49 -1,70
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
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,93 -0,02	3,91 -0,11	2,54 -0,07	4,79 -0,14	6,18 -0,25	8,19 -0,48	14,80 -0,74
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,99 0,52	4,45 -0,33	2,96 -0,22	5,35 -0,20	8,41 -3,32	10,30 -10,43	18,95 -4,05
GBX PRIME I FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS % do CDI	-0,02 -2,22	-3,68 -84,72	0,58 20,65	-3,88 -75,52	-6,39 -80,94	-2,61 -25,52	-9,37 -59,94
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA Var. IPCA p.p.	0,83 0,36	3,74 -1,04	2,81 -0,37	4,56 -0,99	4,76 -6,97	7,53 -13,20	15,53 -7,47
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p.	3,07 -0,15	7,71 1,48	6,63 8,21	13,94 4,68	-5,96 5,82	47,16 19,76	
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	0,02 -3,20	-0,27 -6,50	-4,82 -3,24	0,12 -9,14	-23,71 -11,94	2,12 -25,28	-17,00 -31,76
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-4,44 -0,12	-28,42 -0,24	-14,62 -0,09	-27,20 -0,25	-14,82 -1,78	13,58 -3,06	74,74 -4,50
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	0,97 4,83	-10,62 15,92	-3,59 9,69	-5,65 18,22	4,99 16,16	42,87 24,59	57,03 -23,15
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA % do CDI	-0,14 -13,73	-0,61 -14,09	-0,38 -13,58	-0,75 -14,50	-1,46 -18,48	1,41 13,80	-0,57 -3,64
FIP LA SHOPPING CENTERS % do CDI	-0,06 -5,60	2,16 49,66	-0,30 -10,73	1,95 37,87	-71,17 -901,70	-68,91 -672,80	-65,28 -417,71
CARE11 Var. IBOVESPA p.p.	22,25 19,03	68,59 62,36	74,91 76,49	166,86 157,60	19,26 31,03	37,20 9,80	-36,46 -51,22
CAMPO MOURÃO	0,82	0,77	2,18	2,71	1,56	13,39	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 4,95% p.p.	-0,07	-6,11	-2,25	-5,42	-15,71	-19,56	
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 PREV RF IDKA2	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-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	D+0	D+0	D+3 du	D+4 du		0,40
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
CARE11	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 CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	D+1 du	D+0	D+13 du	D+15 du		2,00
FIP LA SHOPPING CENTERS	Não se aplica	Não se aplica				
GBX PRIME I FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS	D+0	D+0		D+1600		
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	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 VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	2,50
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	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	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
IFIX	0,26	0,56	2,89	9,39	0,14	6,12	10,49	27,39	37,13
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

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

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	-3,86	-26,53	-13,29	-23,87	-11,17	18,29	80,18	91,96	149,78
MSCI ACWI	-3,99	-26,71	-14,01	-24,39	-17,07	11,67	59,19	61,99	105,20

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
155	04/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	627.343,16	0,00	226.753,70884702	2,7666280000
152	04/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	157.428,94	0,00	56.902,82177438	2,7666280000
149	04/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.309.578,65	0,00	473.348,29619306	2,7666280000
153	06/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	155.652,78	0,00	56.272,33952095	2,7660620000
156	11/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.237.673,67	446.786,50175729	2,7701680000
154	11/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	481.221,98	173.715,81073783	2,7701680000
150	11/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.870,62	2.119,22886987	2,7701680000
151	30/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	137.000,00	49.158,35160924	2,7869120000
Total			2.250.003,53	1.861.766,27		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.989.991,80

Value-At-Risk: 2,60%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAMPO MOURÃO	5,76	2,60	2,60	-0,04	0,82	192.149.628,63	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,86%

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	0,43	0,31	0,00	0,01	-0,26	0,92	5.481.755,47	2,85
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,43	0,31	0,01	0,01	-0,24	0,93	17.585.110,71	9,15
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,16	1,08	0,03	0,02	-0,12	0,76	13.206.006,98	6,87
BB PREV RF IDKA2	2,45	1,26	0,06	0,25	-0,10	0,77	22.458.833,61	11,69
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,56	1,35	0,08	0,33	-0,07	0,85	25.811.253,74	13,43
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,18	1,10	0,04	0,03	-0,12	0,77	15.446.701,25	8,04
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,24	0,29	0,00	0,30	-0,18	0,99	11.686.239,11	6,08
Sub-total	1,68	0,90	0,24		-0,11	0,85	111.675.900,87	58,12

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	2,09	0,88	0,06	0,88	-0,09	0,83	24.911.280,32	12,96
Sub-total	2,09	0,88	0,06		-0,09	0,83	24.911.280,32	12,96

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GBX PRIME I FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS	0,08	0,17	-0,00	0,17	-13,60	-0,02	1.549.916,73	0,81
Sub-total	0,08	0,17	-0,00		-13,60	-0,02	1.549.916,73	0,81

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 10,72%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	30,63	13,22	1,04	8,23	-0,00	0,97	16.554.625,22	8,62
Sub-total	30,63	13,22	1,04		-0,00	0,97	16.554.625,22	8,62

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	0,48	0,03	-0,00	0,04	-2,45	-0,14	3.136.754,97	1,63
FIP LA SHOPPING CENTERS	0,20	0,10	0,00	0,10	-5,57	-0,06	723.958,18	0,38
Sub-total	0,43	0,02	-0,00		-2,71	-0,13	3.860.713,15	2,01

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,89%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	20,84	10,63	0,14	3,53	-0,05	0,02	3.412.749,70	1,78
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	17,49	8,77	0,52	4,56	0,12	3,07	15.254.594,87	7,94
Sub-total	17,73	8,89	0,65		0,08	2,50	18.667.344,57	9,72

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,80%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	24,56	10,80	0,52	1,87	-0,22	-4,44	12.820.819,73	6,67
Sub-total	24,56	10,80	0,52		-0,22	-4,44	12.820.819,73	6,67

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 37,03%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARE11	89,70	37,03	0,08	38,09	0,24	22,25	2.109.028,04	1,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	89,70	37,03	0,08		0,24	22,25	2.109.028,04	1,10