



LDB
EMPRESAS

CAMPO MOURÃO
JUNHO 2022



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 30.06.2022.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 78,83%

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 150545 (5,680000%)	3,96	0,41	0,41	10.038.238,59	5,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,760000%)	3,98	0,57	0,57	40.224.321,61	20,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,790000%)	4,00	0,52	0,52	10.048.689,56	5,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,820000%)	4,07	0,00	0,00	499.000,24	0,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,820000%)	4,05	0,20	0,20	5.007.168,64	2,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,930000%)	4,11	0,00	0,00	5.998.735,15	3,11
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,15	0,57	0,57	71.816.153,79	37,22

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	4,85	5.532.084,12	2,87	5.103.254.867,87	0,11
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,74	0,91	4,86	8.370.343,41	4,34	5.096.804.349,76	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,58	0,33	6,51	13.250.059,47	6,87	11.084.704.335,99	0,12
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,59	0,27	6,46	12.482.224,22	6,47	9.717.321.383,29	0,13
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,67	0,22	6,41	6.852.490,69	3,55	11.226.926.091,22	0,06
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,61	0,32	6,47	15.495.773,79	8,03	6.996.220.208,06	0,22
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,18	0,79	5,28	1.726.326,63	0,89	2.668.371.249,57	0,06
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,21	0,44	5,96	63.709.302,33	33,02		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,18	0,41	0,41	13.443,69	0,01	3.467.595.820,39	0,00
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	2,24	0,32	4,08	14.988.623,49	7,77	857.365.563,33	1,75
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,88	0,32	4,08	15.002.067,18	7,78		
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	5,39	1,15	-2,57	1.567.713,74	0,81	155.844.626,83	1,01
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			5,39	1,15	-2,57	1.567.713,74	0,81		
Renda Fixa			2,09	0,65	5,74	152.095.237,04	78,83		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

8,66%

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	22,18	-10,46	-10,71	3.055.658,79	1,58	420.106.519,35	0,73
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	19,85	-10,52	-3,62	13.649.140,29	7,07	433.471.840,97	3,15
Sub-total Artigo 8º I			17,32	-10,51	-5,00	16.704.799,08	8,66		
Renda Variável			16,69	-10,51	-5,00	16.704.799,08	8,66		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,21%

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	21,13	0,83	-27,83	8.125.438,14	4,21	2.225.410.384,30	0,37
Sub-total Artigo 9º III			21,13	0,83	-27,83	8.125.438,14	4,21		
Investimentos no Exterior			21,13	0,83	-27,83	8.125.438,14	4,21		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,32%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	19,96	-7,78	-17,57	10.270.748,91	5,32	2.072.988.175,00	0,50
Sub-total Artigo 10º I			19,96	-7,78	-17,57	10.270.748,91	5,32		

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 MULTIESTRATÉGIA	0,42	-0,12	-0,73	3.132.964,09	1,62	135.122.562,11	2,32
LEGATUS	BTG PACTUAL	FIP LA SHOPPING CENTERS	125,62	-0,26	1,89	722.059,13	0,37	69.908.687,24	1,03
Sub-total Artigo 10º II			0,69	-0,15	-0,25	3.855.023,22	2,00		
Investimentos Estruturados			20,19	-6,34	-14,58	14.125.772,13	7,32		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,97%

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	72,06	-10,92	50,18	1.878.705,92	0,97	293.450.470,78	0,64
Sub-total Artigo 11º			72,06	-10,92	50,18	1.878.705,92	0,97		
Fundos Imobiliários			70,37	-10,92	50,18	1.878.705,92	0,97		
Total			5,19	-1,40	-0,64	192.929.952,31	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	71.816.153,79	37,22	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	63.709.302,33	33,02	0,00	27,33	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	15.002.067,18	7,78	0,00	3,73	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.567.713,74	0,81	0,00	0,95	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	152.095.237,04	78,83					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	16.704.799,08	8,66	0,00	4,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	16.704.799,08	8,66					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	8.125.438,14	4,21	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	8.125.438,14	4,21					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	10.270.748,91	5,32	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	3.855.023,22	2,00	0,00	3,32	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	14.125.772,13	7,32					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	1.878.705,92	0,97	0,00	0,67	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	1.878.705,92	0,97					5,00
Total		192.929.952,31	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,57 116,90	0,57 116,90				330.903,61	330.903,61
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,44 43,47	5,96 110,39	2,55 87,75	5,96 110,39	8,07 93,22	346.299,88	6.101.310,03
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,32 31,89	4,08 75,51	1,69 58,23	4,08 75,51		77.370,31	976.225,71
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	1,15 113,29	-2,57 -47,66	1,96 67,31	-2,57 -47,66		17.797,01	-41.422,47
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-10,51 0,99	-5,00 0,99	-12,37 5,51	-5,00 0,99		-1.962.545,49	-879.808,59
Artigo 9º III % do CDI	0,83 81,64	-27,83 -515,21	-10,22 -351,53	-27,83 -515,21	-13,08 -151,09	304.618,41	-4.786.111,13
Artigo 10º I % do CDI	-7,78 -767,62	-17,57 -325,31	-14,98 -515,35	-17,57 -325,31		-1.283.876,31	-3.250.338,11
Artigo 10º II % do CDI	-0,15 -14,54	-0,25 -4,68	-0,40 -13,67	-0,25 -4,68		-5.689,93	-9.771,72
Artigo 11º % do CDI	-10,92 -1.077,48	50,18 929,01	7,22 248,29	50,18 929,01		-230.322,12	627.740,68
CAMPO MOURÃO (Total)						-2.405.444,63	-931.271,99

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 150545 (5,680000%)	0,00	9.997.290,62	0,00	0,00	10.038.238,59	40.947,97	40.947,97
NTN-B 150555 (5,760000%)	0,00	39.996.245,20	0,00	0,00	40.224.321,61	228.076,41	228.076,41
NTN-B 150555 (5,790000%)	0,00	9.996.867,46	0,00	0,00	10.048.689,56	51.822,10	51.822,10
NTN-B 150840 (5,820000%)	0,00	499.000,24	0,00	0,00	499.000,24	0,00	0,00
NTN-B 150850 (5,820000%)	0,00	4.997.111,51	0,00	0,00	5.007.168,64	10.057,13	10.057,13
NTN-B 150850 (5,930000%)	0,00	5.998.735,15	0,00	0,00	5.998.735,15	0,00	0,00
					71.816.153,79	330.903,61	0,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IDKA2	22.458.833,61	0,00	-10.000.000,00	0,00	12.482.224,22	23.390,61	1.329.407,26
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	15.446.701,25	0,00	0,00	0,00	15.495.773,79	49.072,54	941.998,13
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	5.481.755,47	0,00	0,00	0,00	5.532.084,12	50.328,65	256.030,02
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.811.253,74	0,00	-19.000.000,00	0,00	6.852.490,69	41.236,95	1.494.184,78
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	13.206.006,98	0,00	0,00	0,00	13.250.059,47	44.052,49	810.012,52
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.585.110,71	924.004,87	-10.236.903,29	0,00	8.370.343,41	98.131,12	731.190,12
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	11.686.239,11	0,00	-10.000.000,00	0,00	1.726.326,63	40.087,52	538.487,20
					63.709.302,33	346.299,88	0,20

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	0,00	13.416,55	0,00	0,00	13.443,69	27,14	27,14
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	24.911.280,32	0,00	-10.000.000,00	0,00	14.988.623,49	77.343,17	976.198,57
					15.002.067,18	77.370,31	0,04

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	1.549.916,73	0,00	0,00	0,00	1.567.713,74	17.797,01	-41.422,47
					1.567.713,74	17.797,01	0,01

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	15.254.594,87	0,00	0,00	0,00	13.649.140,29	-1.605.454,58	-513.309,75
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	3.412.749,70	0,00	0,00	0,00	3.055.658,79	-357.090,91	-366.498,84
					16.704.799,08	-1.962.545,49	-1,14

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	12.820.819,73	0,00	-5.000.000,00	0,00	8.125.438,14	304.618,41	-4.786.111,13
					8.125.438,14	304.618,41	0,18

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	16.554.625,22	0,00	-5.000.000,00	0,00	10.270.748,91	-1.283.876,31	-3.250.338,11
					10.270.748,91	-1.283.876,31	-0,75

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	723.958,18	0,00	0,00	0,00	722.059,13	-1.899,05	13.388,49
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	3.136.754,97	0,00	0,00	0,00	3.132.964,09	-3.790,88	-23.160,21
					3.855.023,22	-5.689,93	-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	2.109.028,04	0,00	0,00	0,00	0,00	1.878.705,92	-230.322,12	627.740,68
						1.878.705,92	-230.322,12	-0,13

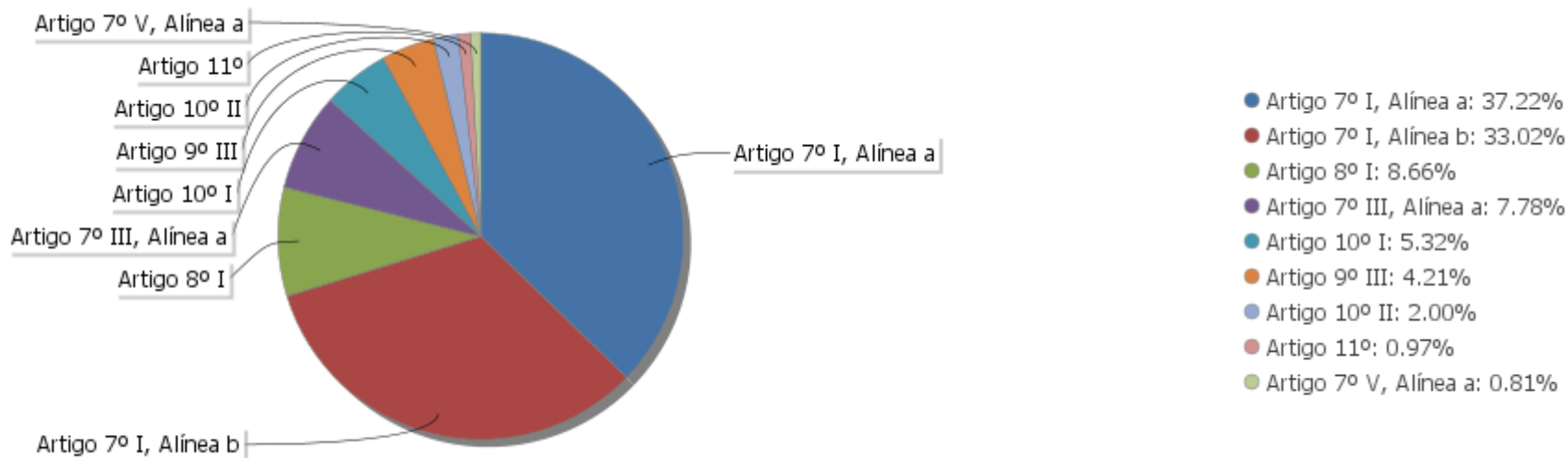
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

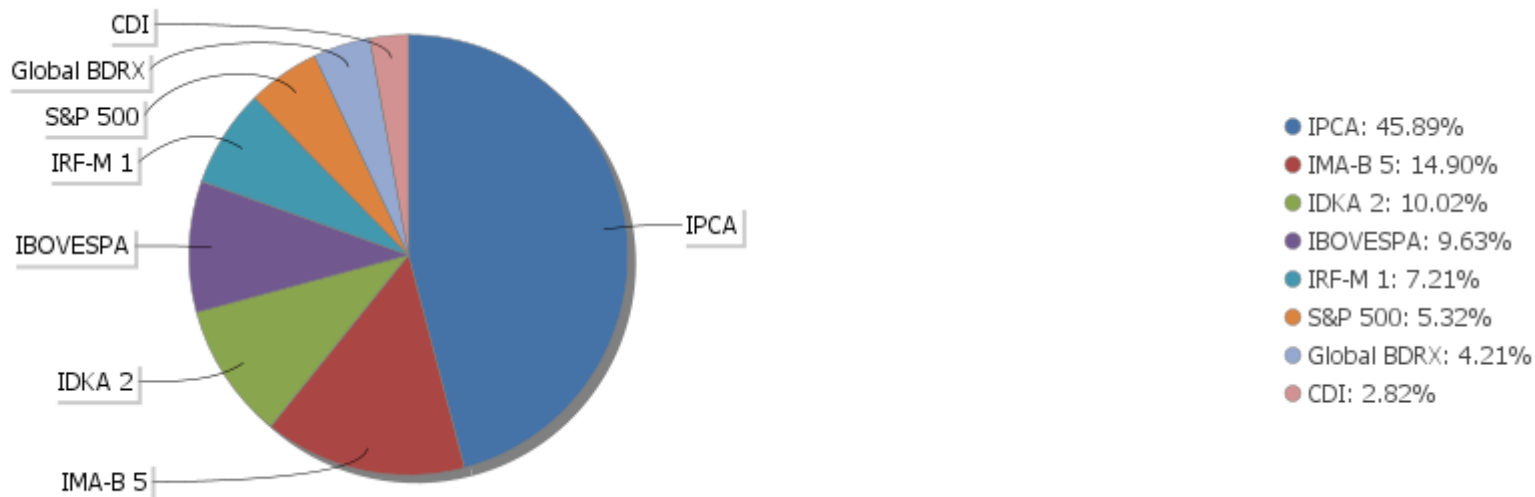
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	115.768.366,86	60,01	115.768.366,86	60,01
de 31 a 365 dias	3.055.658,79	1,58	118.824.025,65	61,59
acima de 365 dias	74.105.926,66	38,41	192.929.952,31	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

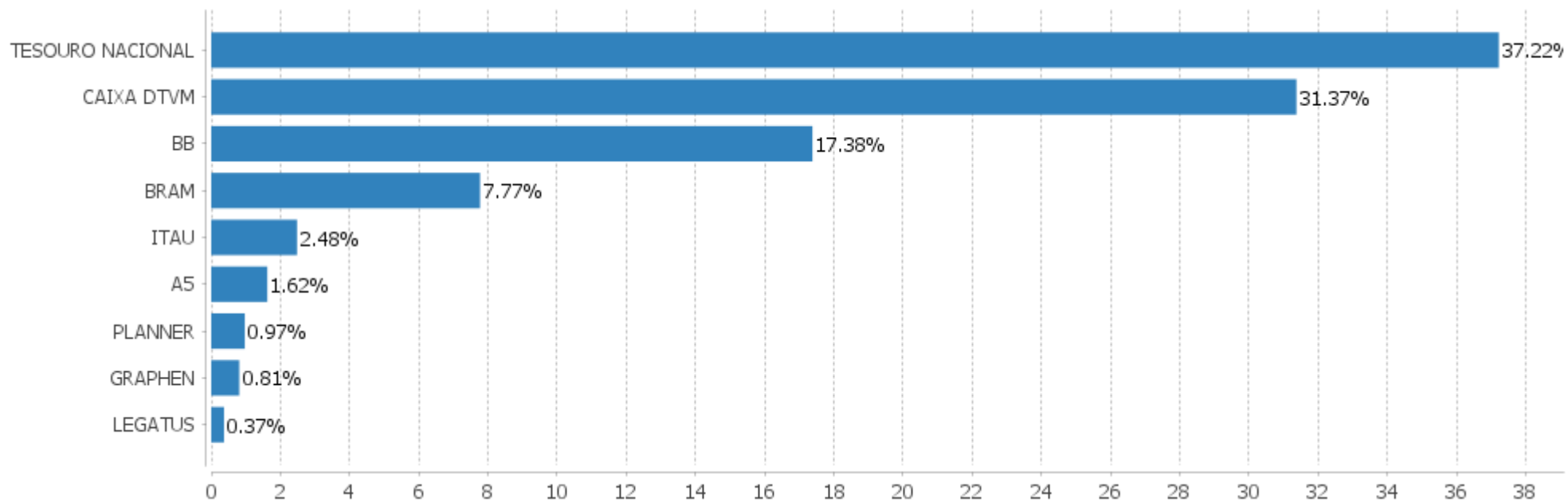


Alocação Por Estratégia



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	-1,40							-0,64
IPCA + 4,95%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,89	1,08							8,02
p.p. indexador	-2,27	-1,43	0,32	-2,43	-0,07	-2,47							-8,66
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

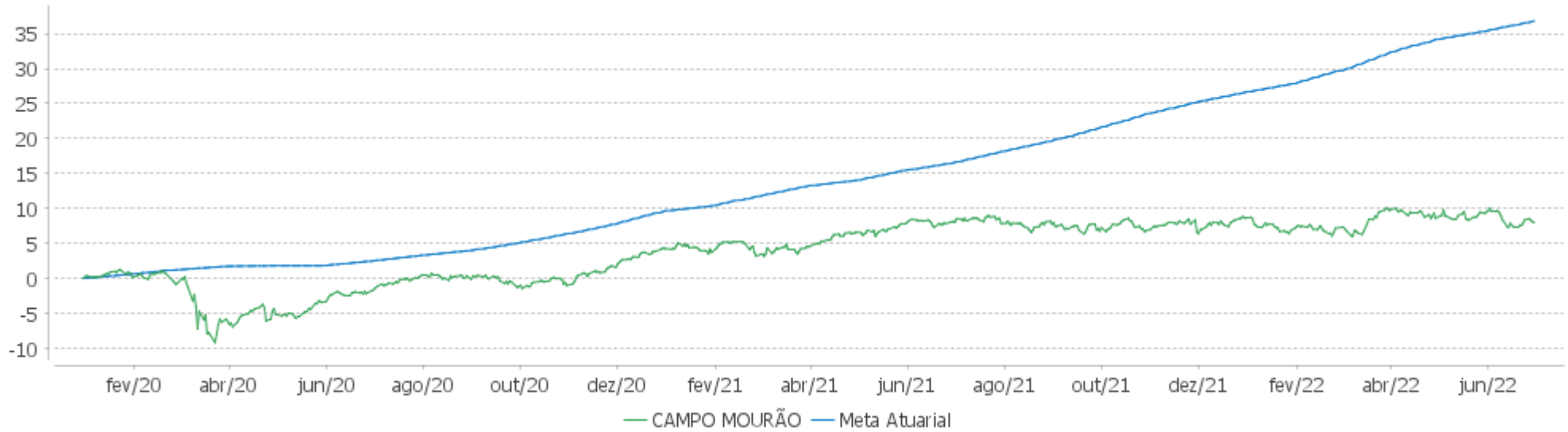
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

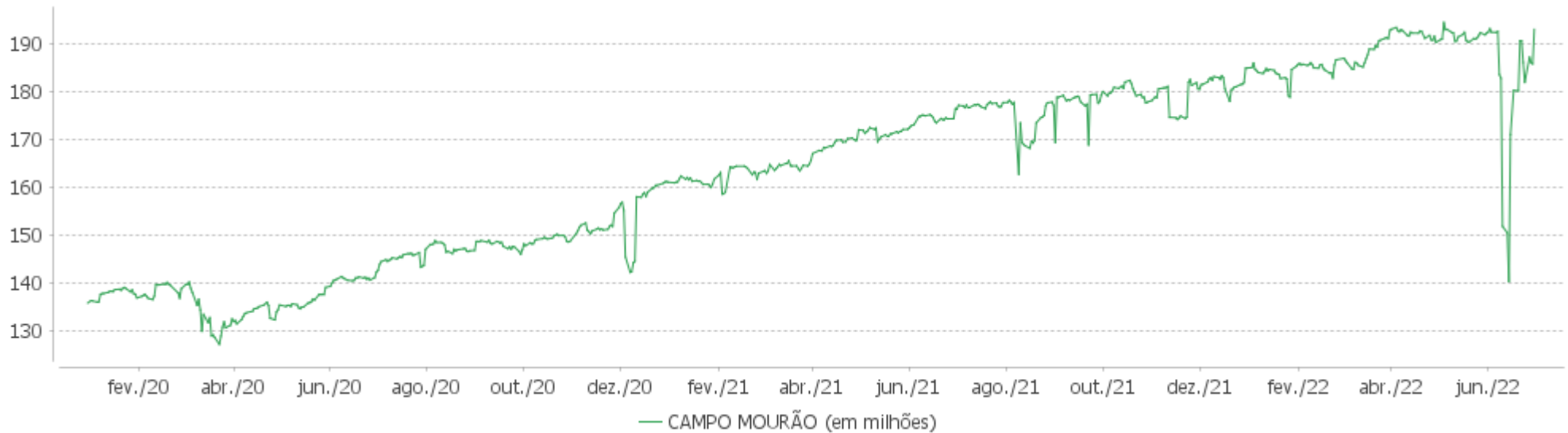
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	9	30,00	03 meses	-1,58	3,44	-5,02	5,62
Meses abaixo - Meta Atuarial	21	70,00	06 meses	-0,64	8,02	-8,66	5,34
			12 meses	-0,14	17,71	-17,85	5,19
			24 meses	9,91	34,73	-24,82	4,74
Maior rentabilidade da Carteira	2,64	2020-12	Desde 31/12/2019	7,96	38,68	-30,72	6,54
Menor rentabilidade da Carteira	-5,49	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

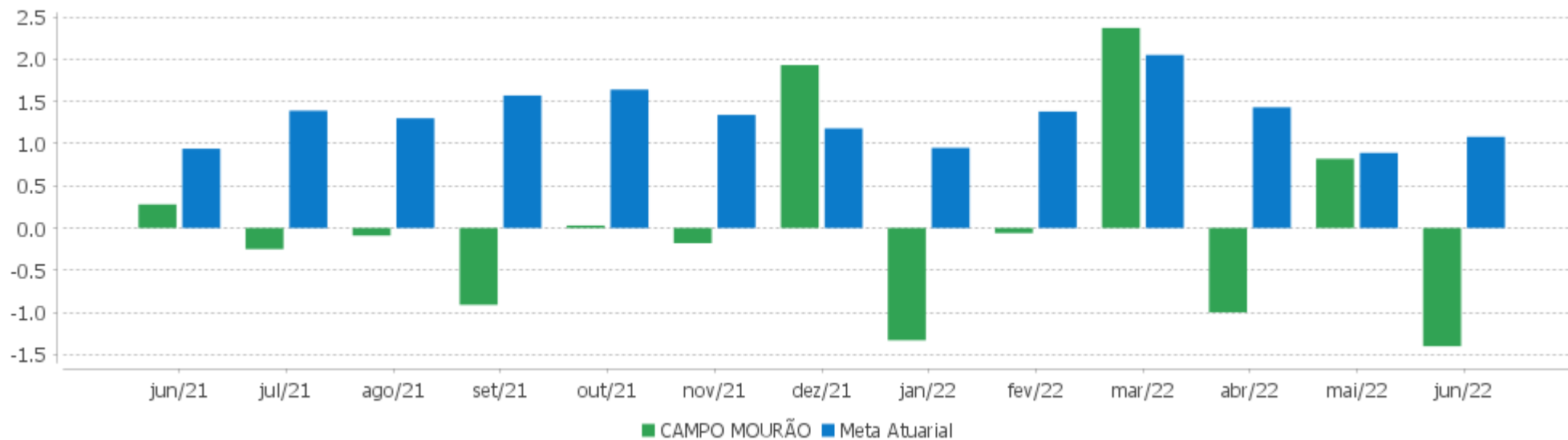


Patrimônio Líquido



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
NTN-B 150850 (5,820000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,33	5,52 0,03	4,29 2,08	5,52 0,03	11,78 -0,11	20,92 -0,31	23,38 -0,43
NTN-B 150840 (5,820000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,33	5,50 0,02	4,29 2,08	5,50 0,02	11,74 -0,14	20,85 -0,37	23,28 -0,53
NTN-B 150555 (5,790000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,33	5,52 0,03	1,39 -0,83	5,52 0,03	11,78 -0,11	20,93 -0,30	23,40 -0,42
NTN-B 150555 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,32	5,52 0,03	1,39 -0,83	5,52 0,03	11,77 -0,11	20,92 -0,31	23,38 -0,43
NTN-B 150850 (5,930000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,34	5,53 0,04	4,32 2,11	5,53 0,04	11,80 -0,09	20,97 -0,26	23,46 -0,36
NTN-B 150545 (5,680000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,32	5,49 0,00	1,38 -0,83	5,49 0,00	11,72 -0,17	20,80 -0,42	23,21 -0,60
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,33 -0,00	6,51 -0,10	2,65 -0,04	6,51 -0,10	9,84 -0,22	16,18 -0,56	26,06 -0,96
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,27 -0,21	6,46 -0,39	2,54 -0,31	6,46 -0,39	9,84 -0,26	16,85 -1,03	26,41 -1,81
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,92 -0,01	4,85 -0,14	2,56 -0,09	4,85 -0,14	6,92 -0,27	8,69 -0,68	14,89 -1,05
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,32 -0,02	6,47 -0,14	2,63 -0,06	6,47 -0,14	9,74 -0,33	16,08 -0,66	26,05 -0,98
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,22 -0,25	6,41 -0,43	2,50 -0,36	6,41 -0,43	9,66 -0,45	16,68 -1,21	26,24 -1,99
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,91 -0,02	4,86 -0,13	2,58 -0,07	4,86 -0,13	6,94 -0,24	8,89 -0,48	15,19 -0,76
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,79 0,12	5,28 -0,21	2,57 0,36	5,28 -0,21	8,95 -2,94	10,68 -10,54	16,90 -6,91
GBX PRIME I FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS % do CDI	1,15 113,29	-2,57 -47,66	1,96 67,31	-2,57 -47,66	-5,34 -61,70	-1,72 -15,50	-8,59 -52,84
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,93 91,99	4,87 90,16	2,63 90,64	4,87 90,16	7,48 86,44	8,72 78,45	12,53 77,09
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA Var. IPCA p.p.	0,32 -0,35	4,08 -1,41	1,69 -0,52	4,08 -1,41	4,75 -7,13	6,86 -14,36	13,53 -10,28
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	-10,52	-3,62	-10,56	-3,62	-15,12	21,27	

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.	0,98	2,37	7,32	2,37	7,16	17,60	
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-10,46 1,04	-10,71 -4,72	-19,62 -1,74	-10,71 -4,72	-32,68 -10,39	-18,43 -22,10	-29,14 -26,74
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	0,83 0,03	-27,83 -0,22	-10,22 0,06	-27,83 -0,22	-13,08 -0,98	9,72 -2,78	69,62 -4,54
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-7,78 -9,25	-17,57 7,88	-14,98 -7,35	-17,57 7,88	-5,74 2,03	30,65 13,86	35,22 -40,66
W7 FIP MULTISTRATÉGIA % do CDI	-0,12 -11,92	-0,73 -13,55	-0,38 -12,95	-0,73 -13,55	-1,46 -16,85	1,46 13,11	-0,54 -3,32
FIP LA SHOPPING CENTERS % do CDI	-0,26 -25,88	1,89 34,98	-0,49 -16,74	1,89 34,98	-71,21 -822,69	-71,72 -644,98	-65,32 -401,89
CARE11 Var. IBOVESPA p.p.	-10,92 0,58	50,18 56,17	7,22 25,10	50,18 56,17	3,39 25,68	18,77 15,11	-52,89 -50,49
CAMPO MOURÃO Var. IPCA + 4,95% p.p.	-1,40 -2,47	-0,64 -8,66	-1,58 -5,02	-0,64 -8,66	-0,14 -17,57	9,91 -23,58	
CDI	1,01	5,40	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25
IBOVESPA	-11,50	-5,99	-17,88	-5,99	-22,29	3,67	-2,40
INPC + 6,00%	1,11	8,68	3,60	8,68	18,63	37,32	49,01
IPCA + 6,00%	1,16	8,56	3,69	8,56	18,60	36,18	47,46

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF 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	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
FICFI						
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	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	0,93	4,99	2,65	4,99	7,19	9,37	15,94	24,32	34,03
IRF-M 1+	0,09	0,73	-0,06	0,73	-1,02	-2,10	9,44	30,43	42,54
IRF-M TOTAL	0,37	2,19	0,83	2,19	1,76	1,90	11,90	29,50	41,08
IMA-B 5	0,33	6,61	2,69	6,61	10,06	16,74	27,03	45,64	59,81
IMA-B 5+	-1,10	2,03	0,12	2,03	-2,16	6,18	8,27	52,42	61,74
IMA-B TOTAL	-0,36	4,35	1,43	4,35	3,78	11,48	17,00	50,64	62,99
IMA-GERAL TOTAL	0,43	4,49	1,90	4,49	5,34	9,08	16,19	34,66	46,06
IDKA 2	0,47	6,85	2,86	6,85	10,11	17,88	28,22	45,20	59,68
IDKA 20	-2,95	-2,61	-2,97	-2,61	-13,58	-2,92	-7,47	53,52	57,70
CDI	1,01	5,40	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25	23,60	32,71

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-11,50	-5,99	-17,88	-5,99	-22,29	3,67	-2,40	35,43	56,67
IBRX 100	-11,56	-5,72	-17,94	-5,72	-23,04	4,91	0,02	40,80	61,46
IBRX 50	-11,67	-5,71	-18,35	-5,71	-22,70	6,28	-1,09	35,60	56,73
SMALL CAP	-16,33	-19,69	-24,72	-19,69	-39,59	-15,65	-11,30	25,69	43,26
IFIX	-0,88	-0,33	0,56	-0,33	1,48	-0,38	6,46	31,54	34,78
Índice Consumo - ICON	-14,29		-28,67		-46,23	-37,15	-28,35	-3,87	-2,44
Índice Dividendos - IDIV	-8,38	4,58	-9,43	4,58	-4,10	18,72	18,53	75,13	90,63

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,67	5,49	2,22	5,49	11,89	21,23	23,81	27,98	33,60
INPC	0,62	5,61	2,12	5,61	11,92	22,24	25,11	29,26	33,82
IGPM	0,59	8,16	2,54	8,16	10,70	50,28	61,27	71,77	83,66
SELIC	1,01	5,40	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25	23,60	32,72

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	1,47	-25,45	-7,62	-25,45	-7,76	16,79	75,88	89,17	147,32
MSCI ACWI	1,26	-25,79	-7,28	-25,79	-13,20	8,75	55,83	60,47	103,16

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,00	7,54	3,21	7,54	16,36	31,10	39,27	49,65	62,39
IPCA + 5,00%	1,08	8,05	3,45	8,05	17,48	33,63	43,33	55,47	70,31
IPCA + 5,50%	1,12	8,30	3,57	8,30	18,04	34,90	45,38	58,44	74,39
IPCA + 5,89%	1,15	8,50	3,66	8,50	18,48	35,90	47,00	60,79	77,62
IPCA + 6,00%	1,16	8,56	3,69	8,56	18,60	36,18	47,46	61,46	78,54
INPC + 4,00%	0,95	7,67	3,11	7,67	16,40	32,20	40,73	51,14	62,66
INPC + 6,00%	1,11	8,68	3,60	8,68	18,63	37,32	49,01	63,07	78,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
170	08/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.551.903,29	3.059.048,41843047	2,7956090000
165	10/06/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	19.000.000,00	7.122.832,87809684	2,6674780000
171	10/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.000.000,00	357.222,84954524	2,7993730000
175	10/06/2022	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	10.000.000,00	506.725,28329617	19,7345590000
158	14/06/2022	BB PREV RF IDKA2	0,00	10.000.000,00	3.115.962,02361700	3,2092817320
218	15/06/2022	NTN-B 150555 (5,760000%)	753.396,46	0,00	182,00000000	4.139,5410060029
217	15/06/2022	NTN-B 150555 (5,760000%)	24.837.246,04	0,00	6.000,00000000	4.139,5410060029
216	15/06/2022	NTN-B 150555 (5,760000%)	1.986.979,68	0,00	480,00000000	4.139,5410060029
215	15/06/2022	NTN-B 150555 (5,760000%)	12.418.623,02	0,00	3.000,00000000	4.139,5410060029
163	15/06/2022	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	0,00	982.234,51	733.662,41913807	1,3388099000
162	15/06/2022	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	0,00	1.173.431,16	876.473,32156716	1,3388099000
161	15/06/2022	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	0,00	422.729,66	315.750,32422452	1,3388099000
160	15/06/2022	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	0,00	1.229.279,06	918.187,90703594	1,3388099000
159	15/06/2022	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	0,00	6.192.325,61	4.625.246,35499035	1,3388099000
220	17/06/2022	NTN-B 150555 (5,790000%)	4.124.120,24	0,00	1.000,00000000	4.124,1202392739
219	17/06/2022	NTN-B 150555 (5,790000%)	5.872.747,22	0,00	1.424,00000000	4.124,1202392739
176	17/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.177,14	0,00	516,20929100	2,2803541500
177	20/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	820,10	0,00	359,47666500	2,2813719990
221	21/06/2022	NTN-B 150545 (5,680000%)	9.997.290,62	0,00	2.400,00000000	4.165,5377583333
178	21/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.132,14	0,00	496,02351800	2,2824320980
179	22/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	3.560,40	0,00	1.559,21461100	2,2834573080
180	23/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	782,09	0,00	342,35017000	2,2844738170
186	23/06/2022	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	5.000.000,00	3.425.093,88539800	1,4598140000
181	24/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	704,08	0,00	308,05864200	2,2855388680
172	24/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	36.000,00	12.814,05103409	2,8094160000
187	24/06/2022	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,00	5.000.000,00	971.184,37652559	5,1483530000
182	27/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	976,12	0,00	426,89168700	2,2865753280
222	27/06/2022	NTN-B 150850 (5,820000%)	4.997.111,51	0,00	1.198,00000000	4.171,2116110184

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
166	28/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	511.000,00	181.782,15525334	2,8110570000
183	28/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.094,13	0,00	478,28688400	2,2876019290
173	28/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	138.000,00	49.091,85406059	2,8110570000
184	29/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.916,22	0,00	837,27517400	2,2886382610
168	30/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	139.125,05	0,00	49.441,91514367	2,8139090000
167	30/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	666.566,85	0,00	236.882,87361105	2,8139090000
185	30/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.254,13	0,00	547,74072300	2,2896416960
224	30/06/2022	NTN-B 150840 (5,820000%)	499.000,24	0,00	120,00000000	4.158,3353333333
223	30/06/2022	NTN-B 150850 (5,930000%)	5.998.735,15	0,00	1.456,00000000	4.120,0104052198
169	30/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	118.312,97	0,00	42.045,76978147	2,8139090000
Total			72.422.671,60	69.236.903,29		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.670.025,55

Value-At-Risk: 1,90%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAMPO MOURÃO	5,59	1,90	1,90	-0,43	-1,40	192.929.952,31	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,47%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545 (5,680000%)	0,37	0,24	-0,00	0,25	-0,07	0,99	10.038.238,59	5,20
NTN-B 150555 (5,760000%)	0,37	0,24	-0,00	0,25	-0,06	0,99	40.224.321,61	20,85
NTN-B 150555 (5,790000%)	0,37	0,24	-0,00	0,25	-0,05	1,00	10.048.689,56	5,21
NTN-B 150840 (5,820000%)	0,37	0,24	-0,00	0,27	-0,04	1,00	499.000,24	0,26
NTN-B 150850 (5,820000%)	0,38	0,24	-0,00	0,27	-0,04	1,00	5.007.168,64	2,60
NTN-B 150850 (5,930000%)	0,37	0,25	-0,00	0,27	-0,02	1,01	5.998.735,15	3,11
Sub-total	0,15	0,21	-0,00		0,57	0,57	71.816.153,79	37,22

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	0,36	0,26	0,00	0,01	-0,27	0,92	5.532.084,12	2,87
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	0,26	0,00	0,01	-0,29	0,91	8.370.343,41	4,34
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,59	1,11	0,03	0,02	-0,26	0,33	13.250.059,47	6,87
BB PREV RF IDKA2	2,90	1,29	0,04	0,28	-0,26	0,27	12.482.224,22	6,47
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,93	1,39	0,02	0,37	-0,27	0,22	6.852.490,69	3,55
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,65	1,14	0,04	0,03	-0,26	0,32	15.495.773,79	8,03
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,89	0,25	0,00	0,27	-0,26	0,79	1.726.326,63	0,89
Sub-total	2,08	0,94	0,14		-0,28	0,44	63.709.302,33	33,02

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,02	-0,00	0,01	-4,74	0,93	13.443,69	0,01
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	2,28	0,93	0,03	0,93	-0,30	0,32	14.988.623,49	7,77
Sub-total	2,28	0,93	0,03		-0,30	0,32	15.002.067,18	7,78

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	3,96	0,07	-0,00	0,08	0,03	1,15	1.567.713,74	0,81
Sub-total	3,96	0,07	-0,00		0,03	1,15	1.567.713,74	0,81

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,37%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	19,01	10,15	0,13	3,70	-0,60	-10,46	3.055.658,79	1,58
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	16,94	8,17	0,45	4,33	-0,68	-10,52	13.649.140,29	7,07
Sub-total	17,02	8,37	0,58		-0,68	-10,51	16.704.799,08	8,66

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 10,30%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	28,96	14,16	0,69	8,35	-0,30	-7,78	10.270.748,91	5,32
Sub-total	28,96	14,16	0,69		-0,30	-7,78	10.270.748,91	5,32

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	0,42	0,03	-0,00	0,04	-2,71	-0,12	3.132.964,09	1,62
FIP LA SHOPPING CENTERS	0,91	0,09	0,00	0,10	-1,40	-0,26	722.059,13	0,37
Sub-total	0,51	0,02	0,00		-2,27	-0,15	3.855.023,22	2,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,84%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	26,20	12,84	0,38	2,47	-0,01	0,83	8.125.438,14	4,21
Sub-total	26,20	12,84	0,38		-0,01	0,83	8.125.438,14	4,21

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 34,78%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARE11	31,73	34,78	0,07	35,65	-0,38	-10,92	1.878.705,92	0,97
Sub-total	31,73	34,78	0,07		-0,38	-10,92	1.878.705,92	0,97