



**LDB**  
EMPRESAS

**CAMPO MOURÃO**  
AGOSTO 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 31.08.2022.

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 84,79%

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 (5,750000%)	4,04	-0,04	0,32	548.916,50	0,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,680000%)	3,97	-0,04	0,84	10.080.835,31	5,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,760000%)	3,99	-0,04	1,01	40.400.348,91	20,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,790000%)	4,00	-0,03	0,96	10.093.163,85	5,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,790000%)	2,93	-0,03	0,33	9.260.834,55	4,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,820000%)	2,93	-0,03	0,45	487.133,06	0,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,820000%)	2,92	-0,03	0,65	4.888.808,10	2,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,930000%)	2,96	-0,02	0,47	5.855.581,64	3,04
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,49</b>	<b>-0,03</b>	<b>1,01</b>	<b>81.615.621,92</b>	<b>42,40</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
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,75	1,20	7,22	5.657.051,31	2,94	5.854.200.005,45	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,74	1,21	7,22	7.944.584,88	4,13	4.998.574.700,28	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,62	0,05	6,58	11.700.285,17	6,08	9.644.358.000,69	0,12
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,74	-0,04	6,17	12.449.102,04	6,47	9.083.863.850,50	0,14
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,82	-0,11	5,99	6.825.019,65	3,55	9.773.675.955,20	0,07
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,65	0,01	6,48	15.496.254,61	8,05	6.457.640.882,23	0,24
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,40	0,61	6,77	4.816.870,95	2,50	2.464.660.149,14	0,20

**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 I, Alínea b</b>			<b>2,10</b>	<b>0,33</b>	<b>6,52</b>	<b>64.889.168,61</b>	<b>33,71</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
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	1,08	2,46	35.381,68	0,02	3.244.269.098,03	0,00
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	2,20	1,31	5,81	15.237.603,75	7,92	741.849.651,37	2,05
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>2,09</b>	<b>1,31</b>	<b>5,81</b>	<b>15.272.985,43</b>	<b>7,93</b>		
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	5,92	-1,16	-6,10	1.438.869,79	0,75	137.680.919,87	1,05
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>			<b>5,92</b>	<b>-1,16</b>	<b>-6,10</b>	<b>1.438.869,79</b>	<b>0,75</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,83</b>	<b>0,22</b>	<b>6,30</b>	<b>163.216.645,75</b>	<b>84,79</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

2,18%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	19,30	6,37	7,00	4.205.109,88	2,18	499.506.406,98	0,84
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>19,30</b>	<b>6,37</b>	<b>5,09</b>	<b>4.205.109,88</b>	<b>2,18</b>		
Renda Variável			17,23	6,37	5,09	4.205.109,88	2,18		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,38%

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	22,38	-3,92	-25,19	8.422.303,76	4,38	2.252.028.422,82	0,37
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>22,38</b>	<b>-3,92</b>	<b>-25,19</b>	<b>8.422.303,76</b>	<b>4,38</b>		
Investimentos no Exterior			22,38	-3,92	-25,19	8.422.303,76	4,38		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,69%

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	21,09	-3,24	-12,18	10.942.367,05	5,68	1.976.589.170,89	0,55
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>21,09</b>	<b>-3,24</b>	<b>-12,18</b>	<b>10.942.367,05</b>	<b>5,68</b>		

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	0,40	-0,13	-0,92	3.126.997,73	1,62	125.456.295,49	2,49
LEGATUS	BTG PACTUAL	FIP LA SHOPPING CENTERS	125,66	-0,24	4,26	738.891,19	0,38	69.908.687,24	1,06
<b>Sub-total Artigo 10º II</b>			<b>0,82</b>	<b>-0,15</b>	<b>0,03</b>	<b>3.865.888,92</b>	<b>2,01</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>18,87</b>	<b>-2,45</b>	<b>-10,46</b>	<b>14.808.255,97</b>	<b>7,69</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,96%

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	73,34	-11,11	47,29	1.842.576,96	0,96	292.218.917,16	0,63
<b>Sub-total Artigo 11º</b>			<b>73,34</b>	<b>-11,11</b>	<b>47,29</b>	<b>1.842.576,96</b>	<b>0,96</b>		
Fundos Imobiliários			63,37	-11,11	47,29	1.842.576,96	0,96		
<b>Total</b>			<b>5,02</b>	<b>-0,18</b>	<b>0,57</b>	<b>192.494.892,32</b>	<b>100,00</b>		



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	81.615.621,92	42,40	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	64.889.168,61	33,71	0,00	27,33	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	15.272.985,43	7,93	0,00	3,73	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.438.869,79	0,75	0,00	0,95	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>163.216.645,75</b>	<b>84,79</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	4.205.109,88	2,18	0,00	4,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>4.205.109,88</b>	<b>2,18</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	8.422.303,76	4,38	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>8.422.303,76</b>	<b>4,38</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	10.942.367,05	5,68	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	3.865.888,92	2,01	0,00	3,32	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>14.808.255,97</b>	<b>7,69</b>					15,00
<b>Fundos Imobiliários</b>								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	1.842.576,96	0,96	0,00	0,67	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Fundos Imobiliários</b>	<b>1.842.576,96</b>	<b>0,96</b>					5,00
<b>Total</b>		<b>192.494.892,32</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	-0,03 -3,00	1,01 37,38				-29.292,31	678.990,13
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,33 28,60	6,52 84,34	0,97 29,94	5,24 85,16	9,19 90,09	196.068,69	6.415.379,50
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,31 112,53	5,81 75,07	1,99 61,21	4,85 78,83		198.150,23	1.226.001,10
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-1,16 -99,68	-6,10 -78,80	-2,51 -77,15	-1,94 -31,53		-17.793,96	-98.088,89
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	6,37 0,21	5,09 0,61	-1,00 0,64	3,29 6,49		251.877,46	-347.467,25
Artigo 9º III % do CDI	-3,92 -335,31	-25,19 -325,67	4,51 138,79	-10,76 -174,83	-16,57 -162,40	-343.178,50	-4.489.245,51
Artigo 10º I % do CDI	-3,24 -277,42	-12,18 -157,47	-1,75 -53,83	-5,28 -85,76		-366.306,96	-2.578.719,97
Artigo 10º II % do CDI	-0,15 -13,11	0,03 0,36	0,13 4,12	-0,23 -3,80		-5.928,80	1.093,98
Artigo 11º % do CDI	-11,11 -951,63	47,29 611,36	-12,63 -388,67	52,81 857,75		-230.322,12	591.611,72
<b>CAMPO MOURÃO (Total)</b>						<b>-346.726,27</b>	<b>1.399.554,81</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 (5,750000%)	549.119,79	0,00	0,00	0,00	548.916,50	-203,29	1.761,48
NTN-B 150545 (5,680000%)	10.085.178,23	0,00	0,00	0,00	10.080.835,31	-4.342,92	83.544,69
NTN-B 150555 (5,760000%)	40.414.962,36	0,00	0,00	0,00	40.400.348,91	-14.613,45	404.103,71
NTN-B 150555 (5,790000%)	10.096.553,35	0,00	0,00	0,00	10.093.163,85	-3.389,50	96.296,39
NTN-B 150840 (5,790000%)	9.531.236,39	0,00	0,00	266.967,82	9.260.834,55	-3.434,02	30.940,10
NTN-B 150840 (5,820000%)	501.388,98	0,00	0,00	14.088,01	487.133,06	-167,91	2.220,83
NTN-B 150850 (5,820000%)	5.031.137,59	0,00	0,00	140.645,31	4.888.808,10	-1.684,18	32.341,90

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150850 (5,930000%)	6.027.973,22	0,00	0,00	170.934,54	5.855.581,64	-1.457,04	27.781,03
					81.615.621,92	-29.292,31	-0,02

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	12.454.651,84	0,00	0,00	0,00	12.449.102,04	-5.549,80	1.296.285,08
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	15.495.307,15	0,00	0,00	0,00	15.496.254,61	947,46	942.478,95
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	5.589.735,80	0,00	0,00	0,00	5.657.051,31	67.315,51	380.997,21
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.832.450,01	0,00	0,00	0,00	6.825.019,65	-7.430,36	1.466.713,74
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	13.252.799,64	0,00	-1.561.000,00	0,00	11.700.285,17	8.485,53	821.238,22
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.611.724,10	5.510.766,80	-2.281.000,53	0,00	7.944.584,88	103.094,51	910.665,32
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	4.787.665,11	0,00	0,00	0,00	4.816.870,95	29.205,84	597.000,98
					64.889.168,61	196.068,69	0,10

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	42.629,63	0,00	-7.694,00	0,00	35.381,68	446,05	822,27
BRANCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	15.039.899,57	0,00	0,00	0,00	15.237.603,75	197.704,18	1.225.178,83
					15.272.985,43	198.150,23	0,10

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	1.528.841,28	0,00	0,00	72.177,53	1.438.869,79	-17.793,96	-98.088,89
					1.438.869,79	-17.793,96	-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	3.953.232,42	0,00	0,00	0,00	4.205.109,88	251.877,46	42.659,84

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					4.205.109,88	251.877,46	0,13

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	8.765.482,26	0,00	0,00	0,00	8.422.303,76	-343.178,50	-4.489.245,51
					8.422.303,76	-343.178,50	-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	11.308.674,01	0,00	0,00	0,00	10.942.367,05	-366.306,96	-2.578.719,97
					10.942.367,05	-366.306,96	-0,19

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	740.675,75	0,00	0,00	0,00	738.891,19	-1.784,56	30.220,55
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	3.131.141,97	0,00	0,00	0,00	3.126.997,73	-4.144,24	-29.126,57
					3.865.888,92	-5.928,80	-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	2.072.899,08	0,00	0,00	0,00	0,00	1.842.576,96	-230.322,12	591.611,72
						1.842.576,96	-230.322,12	-0,12

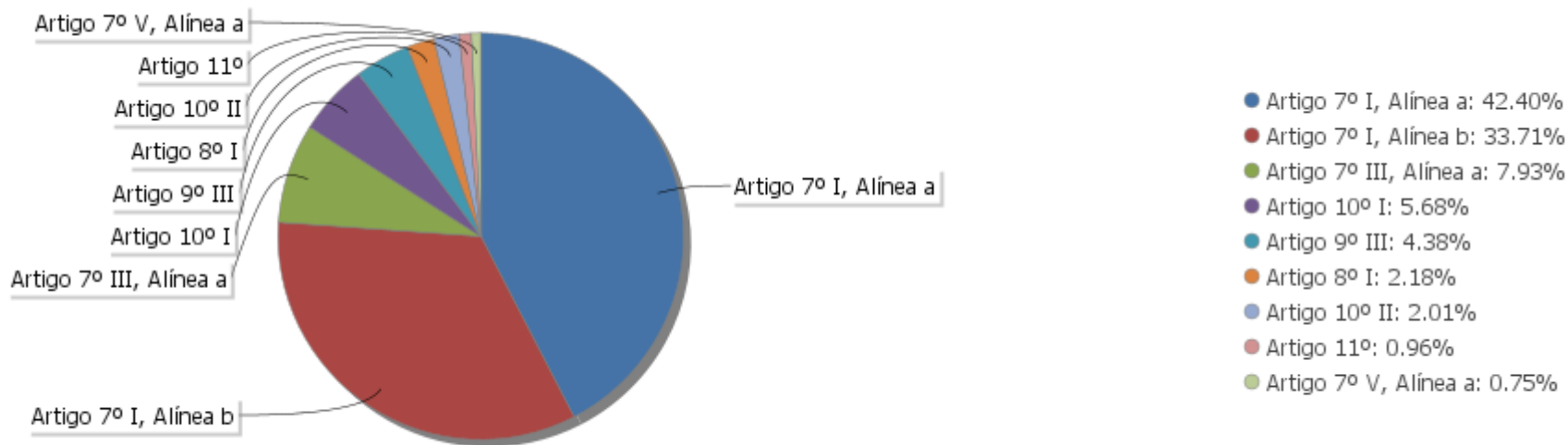
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

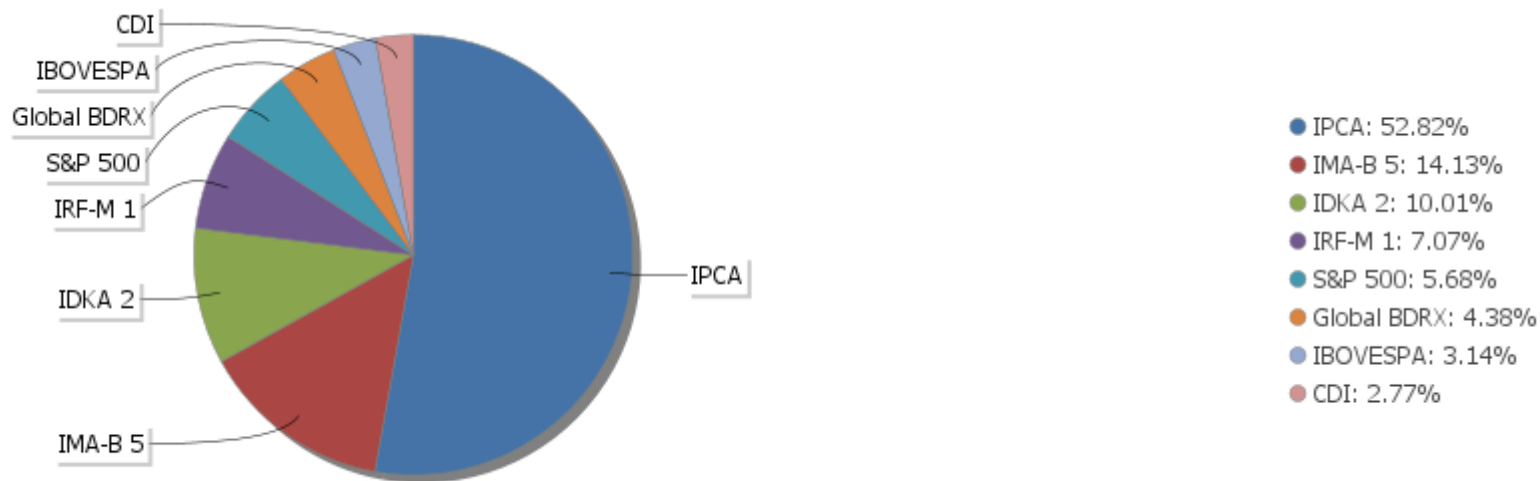
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	108.701.509,42	56,47	108.701.509,42	56,47
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	108.701.509,42	56,47
acima de 365 dias	83.793.382,90	43,53	192.494.892,32	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

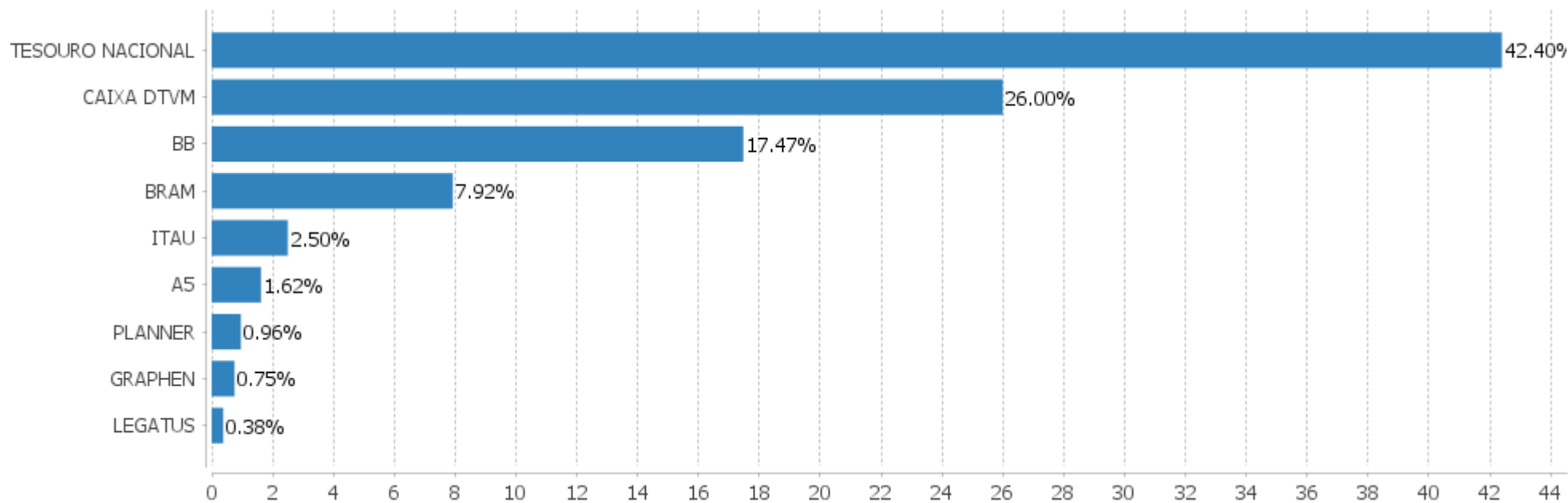


Alocação Por Estratégia



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	1,40	-0,18					0,57
IPCA + 4,95%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,89	1,08	-0,28	0,08					7,81
p.p. indexador	-2,27	-1,43	0,32	-2,43	-0,07	-2,47	1,68	-0,26					-7,24
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**

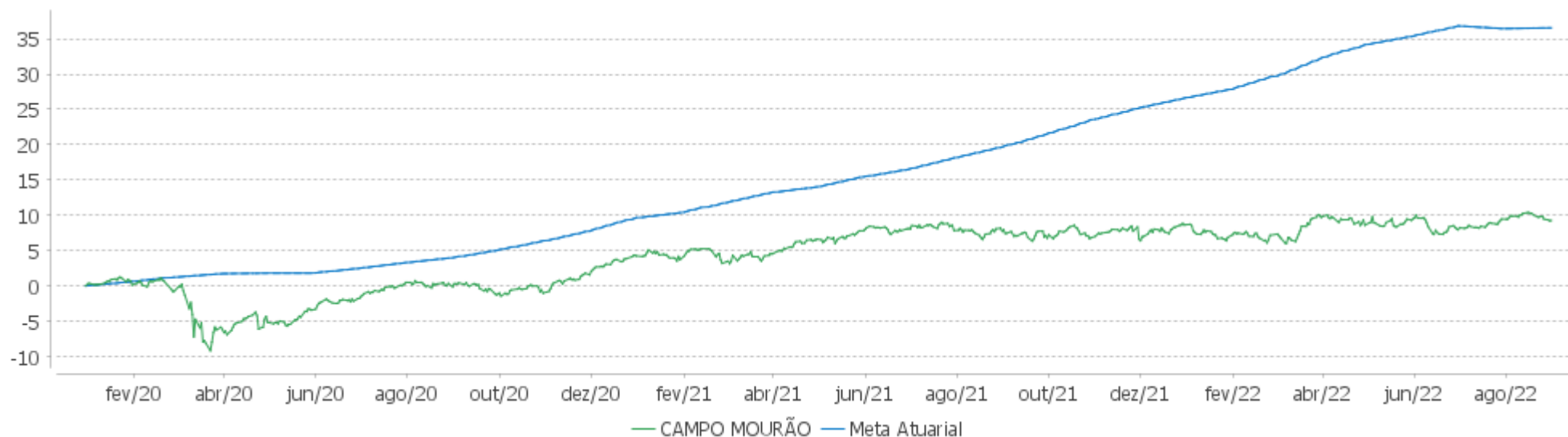
**Relatório**

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	10	31,25	03 meses	-0,20	0,87	-1,07	3,80
Meses abaixo - Meta Atuarial	22	68,75	06 meses	1,98	5,35	-3,37	4,87
			12 meses	1,43	14,29	-12,86	5,02
			24 meses	9,41	32,34	-22,93	4,67
Maior rentabilidade da Carteira	2,64	2020-12	Desde 31/12/2019	9,28	38,40	-29,13	6,35
Menor rentabilidade da Carteira	-5,49	2020-03					

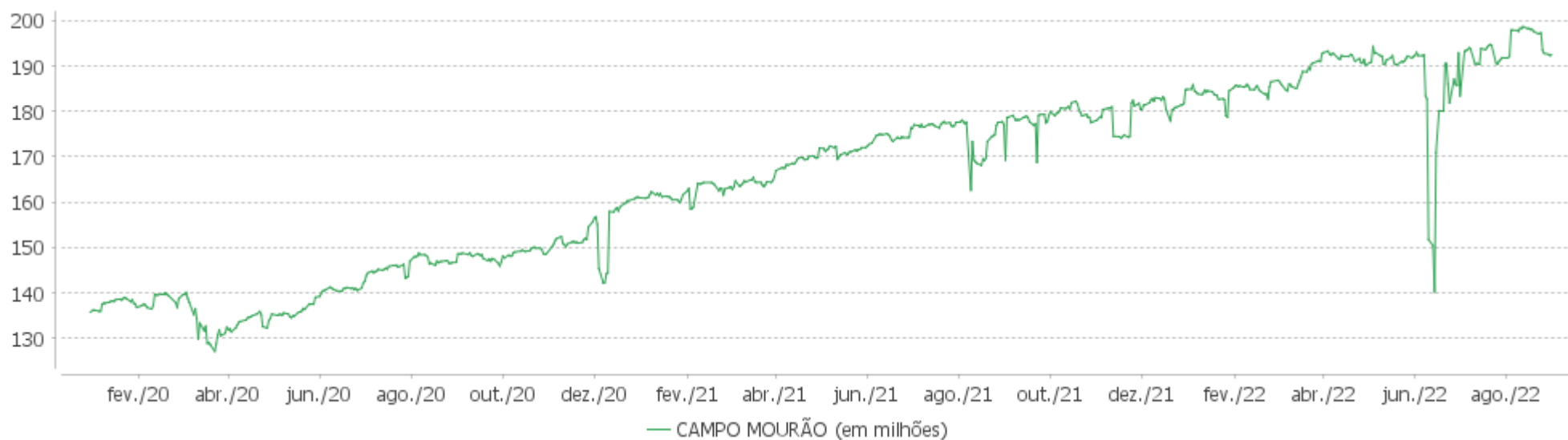


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

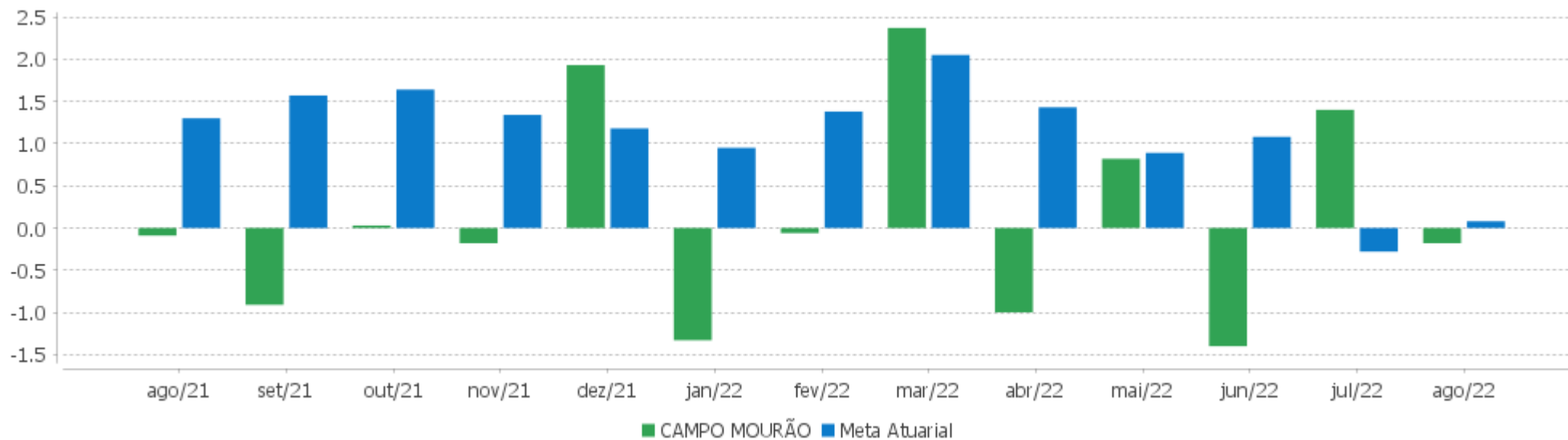


Patrimônio Líquido



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 150840 (5,790000%) Var. IPCA p.p.	-0,03 0,33	5,97 1,57	1,44 1,82	6,59 3,80	12,59 3,86	22,91 3,66	25,74 3,58
NTN-B 150535 (5,750000%) Var. IPCA p.p.	-0,04 0,32	5,93 1,54	1,43 1,81	3,58 0,79	9,38 0,66	19,37 0,12	22,07 -0,09
NTN-B 150840 (5,820000%) Var. IPCA p.p.	-0,03 0,33	5,98 1,58	1,45 1,82	6,61 3,81	12,61 3,88	22,95 3,70	25,78 3,63
NTN-B 150850 (5,820000%) Var. IPCA p.p.	-0,03 0,33	5,99 1,60	1,45 1,82	6,61 3,81	12,62 3,90	23,00 3,75	25,87 3,71
NTN-B 150555 (5,790000%) Var. IPCA p.p.	-0,03 0,33	5,99 1,59	1,44 1,82	3,63 0,83	9,48 0,75	19,57 0,32	22,36 0,20
NTN-B 150555 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	-0,04 0,32	5,98 1,59	1,43 1,81	3,62 0,83	9,47 0,74	19,56 0,31	22,35 0,19
NTN-B 150850 (5,930000%) Var. IPCA p.p.	-0,02 0,34	6,02 1,63	1,48 1,85	6,66 3,87	12,69 3,97	23,10 3,85	26,00 3,84
NTN-B 150545 (5,680000%) Var. IPCA p.p.	-0,04 0,32	5,94 1,55	1,41 1,79	3,60 0,80	9,42 0,69	19,44 0,19	22,18 0,02
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,05 0,05	6,58 -0,04	0,40 0,06	5,38 -0,00	9,75 -0,13	14,69 -0,43	24,92 -0,83
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	-0,04 0,32	6,17 -0,10	0,00 0,07	4,95 0,05	9,27 -0,16	14,82 -0,16	24,78 -1,36
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,20 -0,03	7,22 -0,18	3,20 -0,05	5,79 -0,15	8,79 -0,25	10,79 -0,69	16,07 -1,05
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,11 0,25	5,99 -0,29	-0,18 -0,11	4,77 -0,14	9,08 -0,34	14,35 -0,63	24,46 -1,68
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,01 0,01	6,48 -0,15	0,32 -0,02	5,28 -0,10	9,60 -0,28	14,55 -0,57	24,81 -0,95
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,21 -0,02	7,22 -0,18	3,19 -0,06	5,80 -0,13	8,80 -0,24	10,97 -0,51	16,36 -0,76
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,61 0,97	6,77 2,37	2,21 2,59	5,23 2,44	9,98 1,25	11,78 -7,48	17,08 -5,08
GBX PRIME I FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS % do CDI	-1,16 -99,68	-6,10 -78,80	-2,51 -77,15	-1,94 -31,53	-7,57 -74,18	-5,74 -43,57	-7,31 -41,60
BB PREV RF FLUXO FIC	1,08	7,01	2,99	5,60	9,08	10,75	13,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	92,53	90,63	92,07	90,98	89,02	81,55	78,73
<b>BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA</b> Var. IPCA p.p.	1,31 1,67	5,81 1,41	1,99 2,36	4,85 2,06	7,25 -1,48	7,74 -11,51	14,23 -7,92
<b>FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE</b> Var. IBOVESPA p.p.	6,37 0,21	6,78 2,30	-0,86 0,78	5,71 8,91	1,64 9,44	31,94 21,72	35,98 27,69
<b>FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I</b> Var. Global BDRX p.p.	-3,92 -0,87	-25,19 -0,74	4,51 -0,69	-10,76 -0,68	-16,57 -1,26	-3,06 -3,72	63,70 -5,37
<b>CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP</b> Var. S&P 500 p.p.	-3,24 1,18	-12,18 10,81	-1,75 -6,57	-5,28 3,82	-5,31 6,64	23,21 16,25	44,11 -25,02
<b>W7 FIP MULTIESTRATÉGIA</b> % do CDI	-0,13 -11,34	-0,92 -11,91	-0,31 -9,57	-0,69 -11,24	-1,38 -13,53	1,68 12,77	-0,38 -2,15
<b>FIP LA SHOPPING CENTERS</b> % do CDI	-0,24 -20,64	4,26 55,13	2,06 63,46	1,75 28,50	-70,45 -690,61	-70,98 -538,59	-68,68 -390,98
<b>CARE11</b> Var. IBOVESPA p.p.	-11,11 -17,27	47,29 42,81	-12,63 -10,99	52,81 56,01	12,04 19,83	-8,10 -18,32	-46,98 -55,28
<b>CAMPO MOURÃO</b> Var. IPCA + 4,95% p.p.	-0,18 -0,26	0,57 -7,24	-0,20 -1,07	1,98 -3,37	1,43 -12,68	9,41 -21,92	
CDI	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18	17,57
IBOVESPA	6,16	4,48	-1,64	-3,20	-7,79	10,22	8,29
INPC + 6,00%	0,22	8,80	1,22	6,02	15,36	34,99	47,30
IPCA + 6,00%	0,17	8,53	1,13	5,88	15,25	33,96	45,46

## 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 ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
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	1,23	7,40	3,25	5,94	9,04	11,48	17,12	25,79	34,47
IRF-M 1+	2,60	4,60	3,92	4,62	4,80	1,32	12,10	35,02	42,44
IRF-M TOTAL	2,05	5,49	3,60	4,96	6,17	4,85	13,97	32,97	40,86
IMA-B 5	0,00	6,62	0,35	5,38	9,88	15,12	25,75	43,90	53,48
IMA-B 5+	2,49	2,65	-0,51	4,31	1,44	3,27	8,13	49,44	53,36
IMA-B TOTAL	1,10	4,57	-0,15	4,78	5,54	8,99	16,23	48,22	54,99
IMA-GERAL TOTAL	1,40	6,45	2,32	5,44	7,87	9,89	17,04	35,56	43,86
IDKA 2	-0,36	6,28	-0,07	4,90	9,42	14,98	26,14	42,02	53,43
IDKA 20	5,45	-0,98	-1,32	2,60	-6,74	-6,09	-6,32	50,07	49,07
CDI	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18	17,57	24,95	33,50

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,16	4,48	-1,64	-3,20	-7,79	10,22	8,29	42,84	54,62
IBRX 100	6,15	4,48	-2,00	-3,64	-8,18	10,99	9,74	48,00	58,88
IBRX 50	6,33	4,81	-1,81	-4,31	-7,38	13,10	10,63	42,79	55,02
SMALL CAP	10,90	-6,34	-2,42	-4,48	-22,25	-9,05	-3,57	45,68	42,28
IFIX	5,76	6,11	5,52	8,58	8,23	6,98	12,03	39,12	42,81
Índice Consumo - ICON	6,66		-0,20	-12,18	-31,25	-30,97	-26,99	10,55	-1,44
Índice Dividendos - IDIV	4,27	11,21	-2,58	5,93	4,28	24,51	19,98	80,27	80,79

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	-0,36	4,39	-0,37	2,79	8,73	19,25	22,16	26,35	31,65
INPC	-0,31	4,65	-0,29	2,93	8,83	20,17	23,70	27,76	32,42
IGPM	-0,70	7,63	0,09	3,81	8,59	42,37	60,92	68,88	83,90
SELIC	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18	17,57	24,95	33,51

**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	-4,42	-22,99	4,82	-9,10	-11,94	6,95	69,12	70,71	163,33
MSCI ACWI	-4,03	-24,62	2,86	-11,55	-16,72	-0,77	50,18	46,85	110,90

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	-0,00	7,16	0,64	4,86	13,08	28,96	37,39	47,72	60,02
IPCA + 5,00%	0,08	7,84	0,89	5,37	14,16	31,45	41,39	53,46	67,82
IPCA + 5,50%	0,13	8,19	1,01	5,63	14,71	32,70	43,41	56,39	71,84
IPCA + 5,89%	0,16	8,45	1,11	5,83	15,13	33,68	45,01	58,71	75,02
IPCA + 6,00%	0,17	8,53	1,13	5,88	15,25	33,96	45,46	59,36	75,93
INPC + 4,00%	0,05	7,43	0,72	5,00	13,18	29,95	39,12	49,37	60,95
INPC + 6,00%	0,22	8,80	1,22	6,02	15,36	34,99	47,30	61,15	76,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
206	01/08/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5,00	2,16220000	2,3124593720
211	04/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.668.045,14	0,00	1.286.966,54147808	2,8501480200
213	04/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	153.066,76	0,00	53.704,84582762	2,8501480200
209	04/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.502.254,01	0,00	527.079,29534100	2,8501480200
210	04/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.424,36	0,00	12.078,09550888	2,8501480200
214	10/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	152.976,53	0,00	53.561,81003796	2,8560746900
212	25/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.280.000,53	794.141,14357127	2,8710268300
205	25/08/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.689,00	3.297,18570200	2,3319887610
207	25/08/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.561.000,00	434.232,19704114	3,5948508900
208	25/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.000,00	348,30744100	2,8710268300
<b>Total</b>			<b>5.510.766,80</b>	<b>3.849.694,53</b>		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 2.967.924,67

Value-At-Risk: 1,54%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAMPO MOURÃO	2,43	1,54	1,54	-0,55	-0,18	192.494.892,32	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,47%

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 (5,750000%)	0,20	0,37	-0,00	0,42	-6,17	-0,04	548.916,50	0,29
NTN-B 150545 (5,680000%)	0,20	0,37	-0,00	0,42	-6,20	-0,04	10.080.835,31	5,24
NTN-B 150555 (5,760000%)	0,20	0,37	-0,00	0,42	-6,17	-0,04	40.400.348,91	20,99
NTN-B 150555 (5,790000%)	0,20	0,37	-0,00	0,42	-6,15	-0,03	10.093.163,85	5,24
NTN-B 150840 (5,790000%)	0,20	0,24	-0,00	0,20	-6,15	-0,03	9.260.834,55	4,81
NTN-B 150840 (5,820000%)	0,20	0,24	-0,00	0,20	-6,14	-0,03	487.133,06	0,25
NTN-B 150850 (5,820000%)	0,20	0,24	-0,00	0,20	-6,14	-0,03	4.888.808,10	2,54
NTN-B 150850 (5,930000%)	0,20	0,24	-0,00	0,20	-6,09	-0,02	5.855.581,64	3,04
<b>Sub-total</b>	0,20	0,29	-0,00		-6,16	-0,03	81.615.621,92	42,40

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
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,24	0,20	0,00	0,02	0,16	1,20	5.657.051,31	2,94
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,24	0,20	0,00	0,00	0,18	1,21	7.944.584,88	4,13
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,74	1,10	0,03	0,04	-0,41	0,05	11.700.285,17	6,08
BB PREV RF IDKA2	3,02	1,38	0,03	0,34	-0,40	-0,04	12.449.102,04	6,47
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,01	1,49	0,02	0,44	-0,42	-0,11	6.825.019,65	3,55
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,77	1,10	0,03	0,03	-0,42	0,01	15.496.254,61	8,05
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,09	0,82	0,00	0,84	-0,18	0,61	4.816.870,95	2,50
<b>Sub-total</b>	2,24	0,93	0,12		-0,37	0,33	64.889.168,61	33,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,03	0,00	0,01	-4,18	1,08	35.381,68	0,02
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	2,96	1,07	0,03	1,10	0,05	1,31	15.237.603,75	7,92
<b>Sub-total</b>	2,95	1,07	0,03		0,05	1,31	15.272.985,43	7,93

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GBX PRIME I FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS	3,88	0,08	-0,00	0,08	-0,60	-1,16	1.438.869,79	0,75
<b>Sub-total</b>	3,88	0,08	-0,00		-0,60	-1,16	1.438.869,79	0,75

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 10,82%

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
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	19,03	14,64	0,77	8,42	-0,23	-3,24	10.942.367,05	5,68
<b>Sub-total</b>	19,03	14,64	0,77		-0,23	-3,24	10.942.367,05	5,68

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	0,44	0,03	-0,00	0,03	-2,97	-0,13	3.126.997,73	1,62
FIP LA SHOPPING CENTERS	0,80	0,08	0,00	0,08	-1,76	-0,24	738.891,19	0,38
<b>Sub-total</b>	0,51	0,03	-0,00		-2,60	-0,15	3.865.888,92	2,01

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,06%

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
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	22,60	12,06	0,41	2,87	-0,22	-3,92	8.422.303,76	4,38
<b>Sub-total</b>	22,60	12,06	0,41		-0,22	-3,92	8.422.303,76	4,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,16%

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
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	14,06	8,16	0,12	4,38	0,37	6,37	4.205.109,88	2,18
<b>Sub-total</b>	14,06	8,16	0,12		0,37	6,37	4.205.109,88	2,18

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 35,98%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARE11	28,61	35,98	0,10	36,03	-0,43	-11,11	1.842.576,96	0,96
<b>Sub-total</b>	28,61	35,98	0,10		-0,43	-11,11	1.842.576,96	0,96