



**LDB**  
EMPRESAS

**PORTO FELIZ**  
AGOSTO 2024



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 30.08.2024.

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

81,62%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,069994%)	0,28	0,02	0,56	6,01	5.702.650,21	1,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,569998%)	0,32	0,02	0,68	7,03	1.681.815,25	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,776000%)	2,89	0,02	0,70	3,90	2.234.984,67	0,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,000000%)	0,33	0,02	0,72	7,32	1.569.501,61	0,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,423526%)	0,37	-0,03	0,59	6,25	2.932.154,89	0,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,734998%)	0,43	-0,05	0,61	6,47	11.568.925,65	3,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290003%)	0,38	0,02	0,66	6,84	11.505.245,18	3,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,601000%)	997,10	0,02	0,69	5,49	1.805.708,05	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,635000%)	2,87	0,02	0,69	7,08	1.760.366,17	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,640000%)	2,87	0,02	0,69	7,14	1.786.846,69	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,877000%)	0,40	0,02	0,71	7,24	5.590.534,15	1,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,051500%)	0,41	0,02	0,72	7,36	1.658.102,08	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,120004%)	0,43	0,02	0,65	6,73	11.206.159,05	3,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,171997%)	0,43	0,02	0,65	6,76	11.387.510,07	3,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,481000%)	0,45	0,02	0,68	6,97	5.504.660,24	1,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,792100%)	0,46	0,02	0,70	7,18	21.640.470,76	5,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	6,96	-0,56	1,14	-1,72	9.606.452,75	2,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,582500%)	0,52	0,02	0,68	7,10	1.045.946,19	0,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,850500%)	0,58	0,02	0,71	7,22	5.015.627,99	1,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,145000%)	2,97	0,02	0,73	2,81	1.856.461,56	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (4,689998%)	0,55	0,02	0,61	6,43	2.984.663,06	0,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,669994%)	0,61	0,02	0,69	7,10	11.338.790,64	3,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,900000%)	0,62	0,02	0,71	7,26	5.603.798,82	1,51
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,65</b>	<b>-0,03</b>	<b>0,70</b>	<b>6,23</b>	<b>136.987.375,73</b>	<b>36,87</b>

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,05	-0,27	0,46	1,29	32.644.097,48	8,79	4.414.843.191,53	0,74
BB	BB	BB PREV RF IRF M	2,68	-0,22	0,65	3,37	10.271.996,07	2,76	3.548.363.735,09	0,29
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,40	0,04	0,74	6,13	336.434,24	0,09	8.469.459.153,05	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,76	0,06	0,58	4,74	30.580.936,05	8,23	7.132.951.786,05	0,43
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,05	-0,27	0,50	1,33	16.647.594,86	4,48	3.888.604.125,92	0,43
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	6,12	-0,64	0,78	-0,31	18.323.637,65	4,93	151.802.300,91	12,07
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	1,76	0,06	0,58	4,75	18.370.514,44	4,94	1.589.702.895,96	1,16
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>3,16</b>	<b>-0,19</b>	<b>0,57</b>	<b>2,52</b>	<b>127.175.210,79</b>	<b>34,23</b>		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,05	0,04	0,79	6,16	1.760.779,28	0,47	4.410.336.954,15	0,04
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,08	0,04	0,91	7,44	25.013.539,53	6,73	3.601.057.030,35	0,69
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,08</b>	<b>0,04</b>	<b>0,90</b>	<b>7,29</b>	<b>26.774.318,81</b>	<b>7,21</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CLARITAS	BTG PACTUAL	CLARITAS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LONGO PRAZO	2,39	0,03	0,97	4,26	12.297.359,82	3,31	253.940.442,94	4,84
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea b</b>			<b>2,39</b>	<b>0,03</b>	<b>0,97</b>	<b>4,26</b>	<b>12.297.359,82</b>	<b>3,31</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,61</b>	<b>-0,09</b>	<b>0,68</b>	<b>4,62</b>	<b>303.234.265,15</b>	<b>81,62</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

8,94%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	13,06	0,04	6,46	1,88	21.349.848,30	5,75	671.510.119,38	3,18
PLURAL	BEM	BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	12,58	-0,05	4,92	3,84	5.192.099,50	1,40	468.365.610,05	1,11
CLARITAS	BTG PACTUAL	PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	15,66	-0,51	4,64	2,51	6.666.802,22	1,79	761.723.783,04	0,88
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>14,93</b>	<b>-0,09</b>	<b>5,85</b>	<b>1,19</b>	<b>33.208.750,02</b>	<b>8,94</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>14,93</b>	<b>-0,09</b>	<b>5,85</b>	<b>1,19</b>	<b>33.208.750,02</b>	<b>8,94</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 4,63%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CLARITAS	SANTANDER	PRINCIPAL GLOBAL HIGH YIELD FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3,57	0,01	1,58	5,49	1.054.871,96	0,28	33.807.260,60	3,12
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>3,57</b>	<b>0,01</b>	<b>1,58</b>	<b>5,49</b>	<b>1.054.871,96</b>	<b>0,28</b>		

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	15,12	0,65	0,57	41,02	16.155.611,47	4,35	2.663.493.555,95	0,61
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>15,12</b>	<b>0,65</b>	<b>0,57</b>	<b>41,02</b>	<b>16.155.611,47</b>	<b>4,35</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>14,57</b>	<b>0,61</b>	<b>0,63</b>	<b>39,68</b>	<b>17.210.483,43</b>	<b>4,63</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,81%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12,34	1,02	2,48	21,25	13.643.643,17	3,67	1.941.348.598,98	0,70
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	12,89	0,18	2,60	6,09	4.243.739,01	1,14	290.599.262,12	1,46
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>11,78</b>	<b>0,82</b>	<b>2,51</b>	<b>21,88</b>	<b>17.887.382,18</b>	<b>4,81</b>		
Investimentos Estruturados			11,78	0,82	2,51	21,88	17.887.382,18	4,81		
<b>Total</b>			<b>3,22</b>	<b>-0,01</b>	<b>1,20</b>	<b>5,61</b>	<b>371.540.880,78</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	136.987.375,73	36,87	0,00	35,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	127.175.210,79	34,23	0,00	38,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	26.774.318,81	7,21	0,00	3,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	12.297.359,82	3,31	0,00	0,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>303.234.265,15</b>	<b>81,62</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	33.208.750,02	8,94	0,00	12,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>33.208.750,02</b>	<b>8,94</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	1.054.871,96	0,28	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	16.155.611,47	4,35	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>17.210.483,43</b>	<b>4,63</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	17.887.382,18	4,81	0,00	2,50	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>17.887.382,18</b>	<b>4,81</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>371.540.880,78</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	0,70 80,37	6,23 87,78	2,18 84,25	4,40 84,24	9,53 84,97	961.447,92	8.086.630,34
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,57 66,03	2,52 35,52	1,58 61,23	1,84 35,15	6,25 55,79	749.419,45	3.201.334,30
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,90 103,97	7,29 102,66	2,67 103,15	5,31 101,57	11,49 102,52	222.949,96	1.203.056,21
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,97 112,34	4,26 110,57	3,05 117,97			104.207,63	397.359,82
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,85 -0,69	1,19 -0,17	10,69 -0,69	5,61 0,19	12,38 -5,12	1.835.038,14	-749.271,71
Artigo 9º II % do CDI	1,58 182,26	5,49 129,66	4,43 171,43			16.418,78	54.871,96
Artigo 9º III % do CDI	0,57 65,18	41,02 577,98	13,95 539,52	26,91 514,78	45,66 407,36	90.841,92	4.699.202,86
Artigo 10º I % do CDI	2,51 289,47	21,88 308,29	8,51 329,34	13,40 256,29	31,57 281,64	438.181,53	2.634.459,31
<b>PORTO FELIZ (Total)</b>						<b>4.418.505,33</b>	<b>19.527.643,09</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 (4,423526%)	2.915.033,40	0,00	0,00	0,00	2.932.154,89	17.121,49	175.321,33
NTN-B 150535 (4,734998%)	11.498.358,16	0,00	0,00	0,00	11.568.925,65	70.567,49	714.220,85
NTN-B 150535 (5,290003%)	11.429.881,24	0,00	0,00	0,00	11.505.245,18	75.363,94	748.949,28
NTN-B 150535 (5,601000%)	1.793.416,76	0,00	0,00	0,00	1.805.708,05	12.291,29	95.309,70
NTN-B 150535 (5,635000%)	1.748.333,68	0,00	0,00	0,00	1.760.366,17	12.032,49	118.311,96
NTN-B 150535 (5,640000%)	1.774.626,59	0,00	0,00	0,00	1.786.846,69	12.220,10	121.118,50
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.551.216,13	0,00	0,00	0,00	5.590.534,15	39.318,02	383.983,96
NTN-B 150535 (6,051500%)	1.646.202,66	0,00	0,00	0,00	1.658.102,08	11.899,42	115.646,17
NTN-B 150545	9.497.977,56	0,00	0,00	0,00	9.606.452,75	108.475,19	-178.819,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.966.590,70	0,00	0,00	0,00	2.984.663,06	18.072,36	183.021,55
NTN-B 150555 (5,669994%)	11.260.970,62	0,00	0,00	0,00	11.338.790,64	77.820,02	764.202,73
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.564.283,01	0,00	0,00	0,00	5.603.798,82	39.515,81	385.620,66
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.823.326,39	0,00	0,00	152.839,79	5.702.650,21	32.163,61	333.484,68
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.718.678,66	0,00	0,00	48.480,07	1.681.815,25	11.616,66	114.221,95
NTN-B 150830 (5,776000%)	2.284.226,23	0,00	0,00	65.065,35	2.234.984,67	15.823,79	86.221,91
NTN-B 150830 (6,000000%)	1.604.277,97	0,00	0,00	46.183,64	1.569.501,61	11.407,28	110.791,44
NTN-B 150840 (5,120004%)	11.434.524,84	0,00	0,00	301.469,46	11.206.159,05	73.103,67	728.466,56
NTN-B 150840 (5,171997%)	11.620.690,76	0,00	0,00	307.976,00	11.387.510,07	74.795,31	744.032,75
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.620.669,58	0,00	0,00	153.605,26	5.504.660,24	37.595,92	370.467,89
NTN-B 150840 (5,792100%)	22.109.962,31	0,00	0,00	622.968,85	21.640.470,76	153.477,30	1.499.081,46
NTN-B 150850 (5,582500%)	1.067.803,33	0,00	0,00	29.088,04	1.045.946,19	7.230,90	71.618,50
NTN-B 150850 (5,850500%)	5.124.231,25	0,00	0,00	144.419,56	5.015.627,99	35.816,30	349.234,41
NTN-B 150850 (6,145000%)	1.898.238,92	0,00	0,00	55.496,92	1.856.461,56	13.719,56	52.121,63
	137.953.520,75	0,00	0,00	1.927.592,94	136.987.375,73	961.447,92	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	35.293.842,94	0,00	-2.823.682,25	0,00	32.644.097,48	173.936,79	471.056,76
BB PREV RF IRF M	10.205.478,11	0,00	0,00	0,00	10.271.996,07	66.517,96	333.166,88
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	327.174,11	135.000,00	-128.582,87	0,00	336.434,24	2.843,00	19.883,79
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	173,27
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	30.404.399,16	0,00	0,00	0,00	30.580.936,05	176.536,89	1.382.960,68
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.564.856,73	0,00	0,00	0,00	16.647.594,86	82.738,13	218.170,54
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	18.182.489,84	0,00	0,00	0,00	18.323.637,65	141.147,81	-57.593,65
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	18.264.815,57	0,00	0,00	0,00	18.370.514,44	105.698,87	833.516,03
	129.243.056,46	135.000,00	-2.952.265,12	0,00	127.175.210,79	749.419,45	

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

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	1.647.635,60	6.061.825,73	-5.961.532,07	0,00	1.760.779,28	12.850,02	170.078,13
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	21.743.755,50	3.059.684,09	0,00	0,00	25.013.539,53	210.099,94	1.032.978,08
	23.391.391,10	9.121.509,82	-5.961.532,07	0,00	26.774.318,81	222.949,96	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CLARITAS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LONGO PRAZO	9.293.152,19	2.900.000,00	0,00	0,00	12.297.359,82	104.207,63	397.359,82
	9.293.152,19	2.900.000,00	0,00	0,00	12.297.359,82	104.207,63	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20.054.116,69	0,00	0,00	0,00	21.349.848,30	1.295.731,61	-65.444,18
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	4.948.527,52	0,00	0,00	0,00	5.192.099,50	243.571,98	192.099,50
PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	6.371.067,67	0,00	0,00	0,00	6.666.802,22	295.734,55	204.973,22
	31.373.711,88	0,00	0,00	0,00	33.208.750,02	1.835.038,14	

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
PRINCIPAL GLOBAL HIGH YIELD FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.038.453,18	0,00	0,00	0,00	1.054.871,96	16.418,78	54.871,96
	1.038.453,18	0,00	0,00	0,00	1.054.871,96	16.418,78	

Artigo 9º III (Fundos de 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	16.064.769,55	0,00	0,00	0,00	16.155.611,47	90.841,92	4.699.202,86
	16.064.769,55	0,00	0,00	0,00	16.155.611,47	90.841,92	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13.313.023,99	0,00	0,00	0,00	13.643.643,17	330.619,18	2.390.720,30
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	4.136.176,66	0,00	0,00	0,00	4.243.739,01	107.562,35	243.739,01
	17.449.200,65	0,00	0,00	0,00	17.887.382,18	438.181,53	

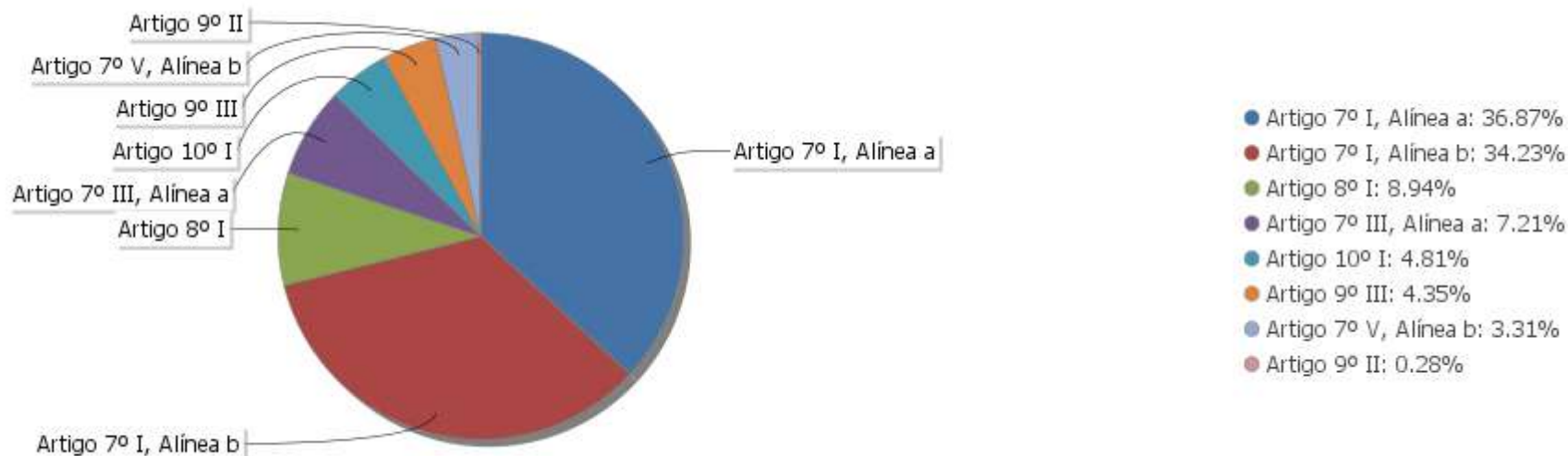
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

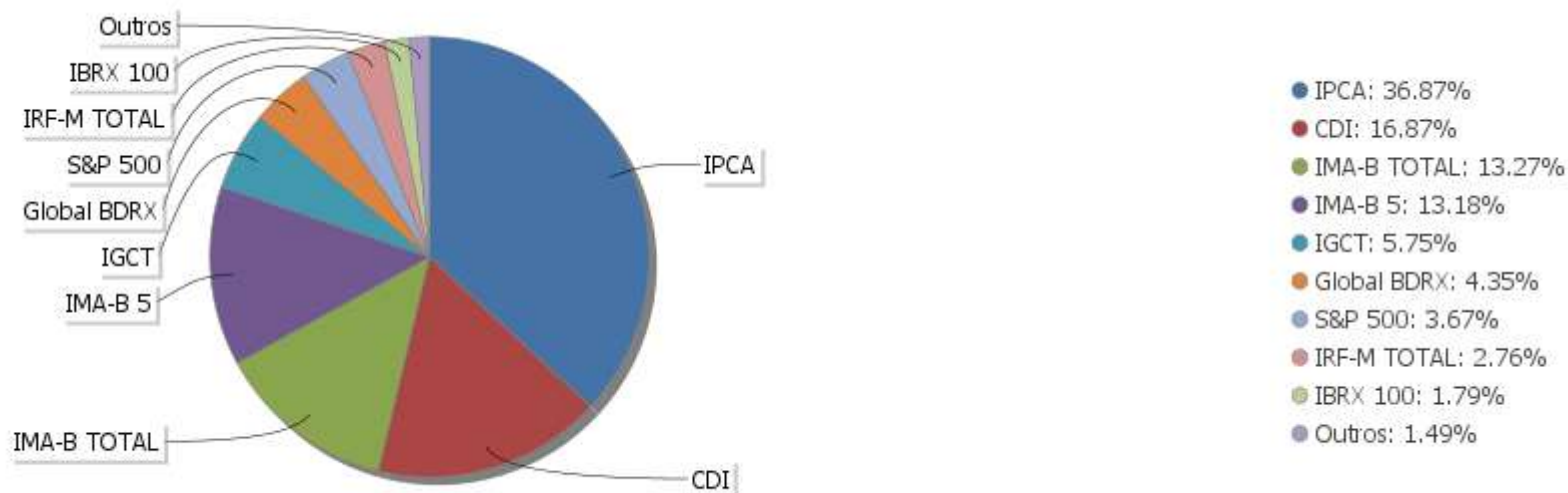
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	223.642.963,82	60,19	60,00	223.642.963,82	60,19	60,00
de 31 dias a 365 dias	6.666.802,22	1,79		230.309.766,04	61,99	60,00
acima de 365 dias	141.231.114,74	38,01	40,00	371.540.880,78	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

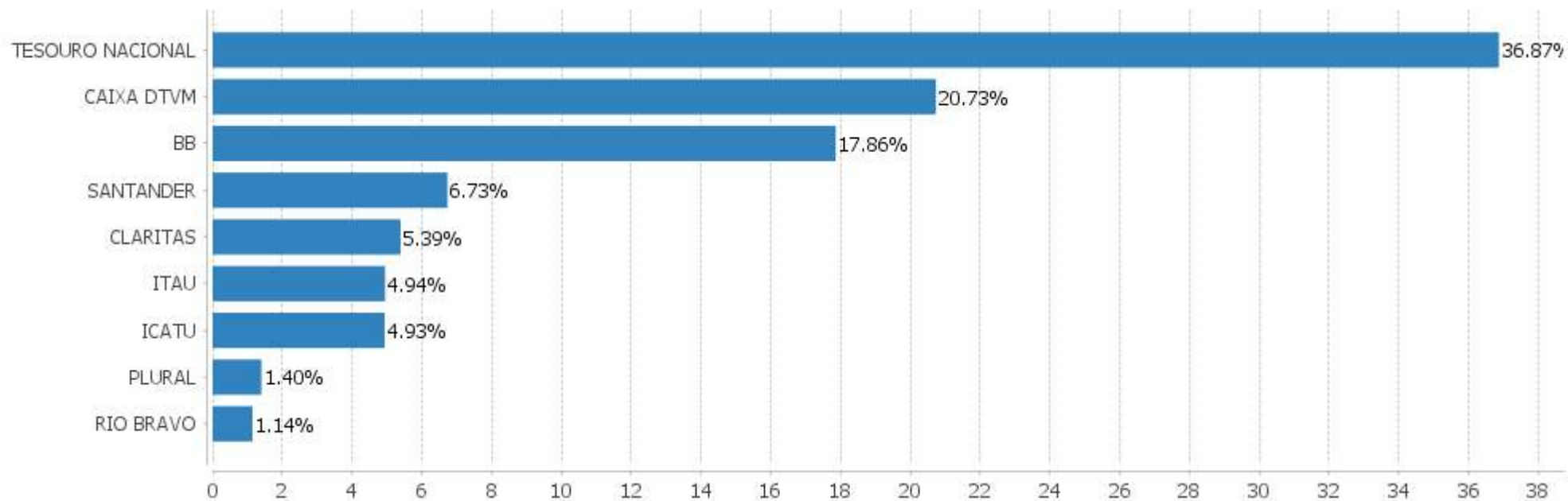


Alocação Por Estratégia



## 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
2024	-0,27	1,20	0,78	-0,56	0,95	0,80	1,38	1,20					5,61
IPCA + 5,16%	0,86	1,21	0,56	0,82	0,88	0,61	0,84	0,42					6,38
p.p. indexador	-1,13	-0,01	0,22	-1,38	0,07	0,19	0,54	0,78					-0,77
2023	1,98	-0,75	0,88	0,98	2,46	2,30	1,35	-0,81	-0,40	-0,87	3,64	2,32	13,77
IPCA + 5,01%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,66	0,33	0,53	0,68	0,65	0,65	0,67	0,95	9,80
p.p. indexador	1,02	-1,94	-0,28	0,01	1,80	1,98	0,82	-1,49	-1,05	-1,52	2,97	1,37	3,97
2022	-0,39	-0,32	3,04	-2,37	0,93	-2,88	2,21	0,90	-0,94	2,70	-0,34	-0,75	1,60
IPCA + 4,88%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,28	0,07	0,11	0,97	0,79	1,04	10,93
p.p. indexador	-1,33	-1,70	1,00	-3,79	0,04	-3,95	2,50	0,82	-1,05	1,72	-1,13	-1,79	-9,33
2021	-0,94	-1,43	0,32	1,05	1,43	0,40	-0,56	-0,85	-1,13	-1,94	1,28	1,64	-0,79
IPCA + 5,42%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,68	1,37	1,22	16,00
p.p. indexador	-1,61	-2,67	-1,09	0,32	0,16	-0,57	-1,99	-2,18	-2,73	-3,62	-0,09	0,43	-16,79
2020	0,26	-0,04	-7,15	1,74	1,95	2,22	3,87	-1,53	-1,57	0,01	2,81	4,49	6,70
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,63
p.p. indexador	-0,45	-0,70	-7,72	1,60	1,88	1,48	2,99	-2,25	-2,69	-1,33	1,46	2,64	-3,92
2019	3,29	0,47	0,58	1,25	2,87	3,03	1,18	-0,30	2,52	2,94	-2,03	1,93	19,09
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	2,46	-0,43	-0,62	0,19	2,23	2,58	0,46	-0,92	2,07	2,30	-3,01	0,29	8,50
2018	2,70	0,63	1,00	0,02	-2,62	-0,18	1,98	-0,44	0,21	5,62	0,80	1,47	11,54
IPCA + 6,00%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	1,90	-0,11	0,42	-0,69	-3,50	-1,93	1,14	-0,88	-0,71	4,66	0,55	0,86	1,62

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	40	50,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	40	50,00
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-7,15	2020-03

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,42	1,88	1,54	2,38
06 meses	4,64	4,21	0,43	2,39
12 meses	10,59	9,52	1,07	3,22
24 meses	20,90	20,24	0,66	4,13
36 meses	21,84	37,34	-15,51	5,17
48 meses	28,06	59,00	-30,93	5,26
60 meses	36,19	72,50	-36,32	7,10
Desde 29/12/2017	71,65	102,13	-30,47	6,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Evolução**

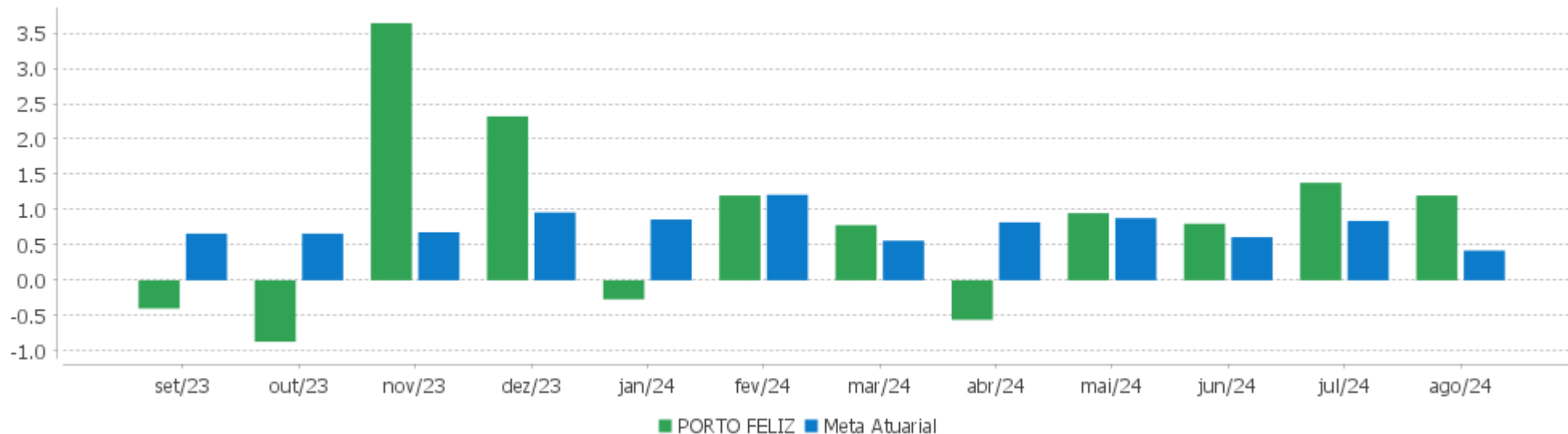


**Patrimônio Líquido**



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
CLARITAS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LONGO PRAZO % do CDI	0,97 112,34	8,24 116,12	3,05 117,97	5,81 111,21	13,19 117,67	29,02 110,44	44,18 112,82
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	1,14 1,16	-1,72 -4,58	1,57 1,00	-0,62 -2,20	2,82 -1,42	19,00 9,96	18,71 0,15
NTN-B 150830 (6,000000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,74	7,32 4,47	2,38 1,81	5,13 3,55	10,67 6,43	18,85 9,81	
NTN-B 150840 (5,120004%) Var. IPCA p.p.	0,65 0,67	6,73 3,87	2,16 1,59	4,68 3,10	9,82 5,58	20,41 11,37	38,60 20,04
NTN-B 150830 (4,069994%) Var. IPCA p.p.	0,56 0,58	6,01 3,16	1,90 1,32	4,15 2,57	8,64 4,40	17,94 8,90	34,39 15,83
NTN-B 150535 (5,640000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,71	7,14 4,29	2,29 1,72	4,94 3,37	7,26 3,02	11,70 2,66	
NTN-B 150850 (6,145000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,75	4,29 1,44	2,42 1,84	5,20 3,62	7,49 3,25		
NTN-B 150535 (5,877000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,73	7,24 4,39	2,35 1,78	5,06 3,48	10,59 6,35	22,13 13,09	37,56 19,01
NTN-B 150535 (5,290003%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,68	6,84 3,99	2,20 1,63	4,77 3,19	9,97 5,73	20,77 11,73	39,23 20,67
NTN-B 150840 (5,792100%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,72	7,18 4,33	2,33 1,76	5,02 3,44	10,53 6,30	21,97 12,93	37,32 18,77
NTN-B 150555 (4,689998%) Var. IPCA p.p.	0,61 0,63	6,43 3,58	2,05 1,48	4,46 2,88	9,44 5,20	19,51 10,47	36,99 18,43
NTN-B 150850 (5,850500%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,73	7,22 4,37	2,34 1,77	5,05 3,47	10,66 6,42	18,74 9,70	
NTN-B 150840 (5,481000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,70	6,97 4,12	2,25 1,68	4,86 3,28	10,20 5,97	21,25 12,21	36,24 17,68
NTN-B 150535 (5,601000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,71	7,05 4,20	2,28 1,71	4,92 3,35	7,10 2,86		
NTN-B 150535 (5,635000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,71	7,08 4,22	2,29 1,72	4,94 3,36	7,26 3,02	11,69 2,65	
NTN-B 150830 (5,776000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,72	4,13 1,28	2,32 1,75	5,01 3,43	7,21 2,97		
NTN-B 150840 (5,171997%)	0,65	6,76	2,17	4,71	9,87	20,53	38,80

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.	0,67	3,91	1,60	3,13	5,64	11,49	20,25
NTN-B 150850 (5,582500%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,70	7,10 4,25	2,28 1,70	4,92 3,34	10,37 6,13	18,25 9,21	
NTN-B 150830 (5,569998%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,70	7,03 4,18	2,27 1,70	4,91 3,33	10,22 5,98	21,37 12,33	40,29 21,73
NTN-B 150555 (5,669994%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,71	7,10 4,25	2,30 1,73	4,96 3,38	10,48 6,25	21,77 12,73	37,04 18,48
NTN-B 150555 (5,900000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,73	7,26 4,40	2,35 1,78	5,08 3,50	10,73 6,49	22,31 13,27	37,81 19,26
NTN-B 150535 (6,051500%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,74	7,36 4,51	2,39 1,82	5,15 3,57	10,77 6,54	19,00 9,96	30,34 11,79
NTN-B 150535 (4,734998%) Var. IPCA p.p.	0,61 0,63	6,47 3,61	2,07 1,49	4,49 2,91	9,38 5,15	19,50 10,46	36,94 18,38
NTN-B 150535 (4,423526%) Var. IPCA p.p.	0,59 0,61	6,25 3,40	1,99 1,42	4,33 2,75	9,05 4,81	18,79 9,75	35,74 17,18
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,50 -0,02	1,33 -0,17	1,56 -0,07	1,26 -0,14	5,08 -0,24	19,27 -0,54	25,72 -0,73
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,58 -0,01	4,74 -0,14	1,86 -0,05	3,45 -0,11	7,91 -0,23	20,66 -0,42	32,43 -0,62
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,58 -0,01	4,75 -0,13	1,86 -0,04	3,47 -0,09	7,94 -0,20	20,64 -0,44	32,33 -0,71
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,74 -0,02	6,13 -0,17	2,27 -0,09	4,45 -0,18	10,09 -0,30	24,84 -0,73	35,82 -1,10
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,46 -0,05	1,29 -0,20	1,54 -0,09	1,24 -0,15	5,04 -0,28	19,17 -0,65	25,43 -1,02
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP % do CDI	0,78 89,48	-0,31 -4,38	0,95 36,83	-0,83 -15,80	5,38 47,99	21,80 82,95	25,21 64,38
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,65 -0,00	3,37 -0,17	1,66 -0,05	2,25 -0,14	8,00 -0,27	23,62 -0,84	31,00 -1,14
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,79 90,50	6,39 90,09	2,33 90,25	4,70 89,98	10,11 90,22	23,82 90,62	35,06 89,52
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,91 104,83	7,44 104,81	2,69 103,90	5,42 103,75	11,71 104,46	27,16 103,34	40,97 104,60
PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA Var. IBRX 100 p.p.	4,64 -1,95	2,51 0,71	9,46 -1,87	4,31 -1,27	12,73 -5,27	15,54 -7,37	13,95 1,11
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	4,92	-1,32	10,26	0,70	12,84	23,24	36,24

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.	-1,62	-2,68	-1,12	-4,71	-4,66	-0,94	21,74
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	6,46 -0,04	1,88 -0,15	11,18 -0,03	5,80 0,05	17,26 -0,68	20,95 -2,67	9,51 -3,53
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	0,57 0,02	41,02 -1,23	13,95 0,21	26,91 -0,81	46,38 -1,62	68,28 -2,86	40,40 -4,54
PRINCIPAL GLOBAL HIGH YIELD FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	1,58 182,26	7,74 109,00	4,43 171,43	6,36 121,73	15,29 136,39	31,94 121,52	27,37 69,90
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA % do CDI	2,60 299,77	6,17 293,27					
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	2,48 0,31	21,25 -17,11	7,95 -7,54	12,81 -12,99	30,89 -13,11	61,90 5,93	53,31 15,97
PORTO FELIZ Var. IPCA + 5,16% p.p.	1,20 0,78	5,61 -0,77	3,42 1,54	4,64 0,43	10,59 1,02	20,90 0,38	21,84 -15,95
CDI	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	39,16
IBOVESPA	6,54	1,36	11,39	5,41	17,51	24,18	14,50
INPC + 6,00%	0,37	6,90	1,89	4,44	9,88	21,17	39,78
IPCA + 6,00%	0,49	6,95	2,09	4,63	10,44	22,43	41,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IRF M	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
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES			D+5 du	D+7 du	-	2,00
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
CLARITAS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+2	D+3	O fundo cobrara 15.00 % do que exceder 100.00 % o índice CDIE. A taxa de performance sera paga no(s) mes (es) de Janeiro e Julho	0,50
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du	-	0,30
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,18
PRINCIPAL 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
PRINCIPAL GLOBAL HIGH YIELD FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+0	D+0	D+1 du	D+5 du		0,87
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	D+0	D+0	D+1	D+2		1,15
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,77	6,30	2,36	4,62	10,39	25,57	36,92	39,98	47,06
IRF-M 1+	0,60	2,39	1,43	1,43	7,39	24,61	30,60	26,26	39,69
IRF-M TOTAL	0,66	3,54	1,70	2,39	8,26	24,46	32,14	30,49	41,85
IMA-B 5	0,59	4,88	1,91	3,56	8,14	21,08	33,04	39,39	52,27
IMA-B 5+	0,77	-1,21	1,69	-0,25	3,11	18,58	20,29	22,46	28,23
IMA-B TOTAL	0,52	1,49	1,63	1,40	5,32	19,81	26,45	30,58	39,25
IMA-GERAL TOTAL	0,79	4,63	2,21	3,49	8,81	23,74	33,48	35,98	44,83
IDKA 2	0,60	4,60	1,53	3,33	7,94	20,67	32,05	38,75	52,22
IDKA 20	0,42	-6,26	1,27	-3,24	-0,28	18,04	10,08	10,85	10,58
CDI	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	39,16	42,92	48,46

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,54	1,36	11,39	5,41	17,51	24,18	14,50	36,87	34,48
IBRX 100	6,60	1,79	11,34	5,58	18,00	22,90	12,85	36,41	34,88
IBRX 50	6,51	3,14	11,66	6,63	19,46	24,91	15,69	41,27	38,19
SMALL CAP	4,51	-9,69	5,65	-3,81	-2,18	-4,07	-25,42	-12,75	-7,50
Índice Consumo - ICON	6,25	-6,83	9,13	1,55	0,43	-15,02	-41,58	-41,33	-37,96
Índice Dividendos - IDIV	6,69	5,00	10,87	7,85	21,94	34,91	40,69	67,98	61,87



### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

#### Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	2,18	38,35	15,49	25,80	44,00	55,98	37,34	66,82	163,79

#### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,86	2,48	0,33	1,00	5,63	14,02	23,41	21,98	27,74

#### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,29	33,98	14,52	24,30	39,63	48,51	23,68	47,36	123,03

#### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,02	2,85	0,57	1,58	4,24	9,04	18,56	30,03	33,20
INPC	-0,14	2,80	0,37	1,40	3,71	7,92	17,44	29,68	33,49
IGPM	0,29	2,00	1,72	2,46	4,26	-3,24	5,07	37,76	55,70
SELIC	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	39,16	42,92	48,46

#### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,32	5,59	1,59	3,62	8,37	17,88	33,30	52,03	61,96
IPCA + 5,00%	0,41	6,27	1,84	4,13	9,41	20,15	37,17	57,93	69,87
IPCA + 5,50%	0,45	6,61	1,97	4,38	9,92	21,29	39,13	60,95	73,94
IPCA + 5,89%	0,48	6,88	2,07	4,58	10,33	22,18	40,67	63,33	77,17
IPCA + 6,00%	0,49	6,95	2,09	4,63	10,44	22,43	41,11	64,01	78,09
INPC + 4,00%	0,20	5,54	1,39	3,44	7,82	16,67	32,04	51,61	62,31
INPC + 6,00%	0,37	6,90	1,89	4,44	9,88	21,17	39,78	63,57	78,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (4,423526%)	2.932.154,89	4,423526	2.556.468,71	6,239600	-375.686,18
NTN-B 150535 (4,734998%)	11.568.925,65	4,734998	10.334.016,52	6,239600	-1.234.909,13
NTN-B 150535 (5,290003%)	11.505.245,18	5,290003	10.714.675,15	6,239600	-790.570,03
NTN-B 150535 (5,601000%)	1.805.708,05	5,601000	1.721.615,14	6,239600	-84.092,91
NTN-B 150535 (5,635000%)	1.760.366,17	5,635000	1.682.684,15	6,239600	-77.682,02
NTN-B 150535 (5,640000%)	1.786.846,69	5,640000	1.708.638,14	6,239600	-78.208,55
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.590.534,15	5,877000	5.441.688,06	6,239600	-148.846,09
NTN-B 150535 (6,051500%)	1.658.102,08	6,051500	1.635.101,82	6,239600	-23.000,26
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.984.663,06	4,689998	2.402.183,59	6,239600	-582.479,47
NTN-B 150555 (5,669994%)	11.338.790,64	5,669994	10.502.073,11	6,239600	-836.717,53
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.603.798,82	5,900000	5.355.758,08	6,239600	-248.040,74
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.702.650,21	4,069994	5.130.125,27	6,260100	-572.524,94
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.681.815,25	5,569998	1.627.251,76	6,260100	-54.563,49
NTN-B 150830 (5,776000%)	2.234.984,67	5,776000	2.183.943,15	6,260100	-51.041,52
NTN-B 150830 (6,000000%)	1.569.501,61	6,000000	1.550.171,41	6,260100	-19.330,20
NTN-B 150840 (5,120004%)	11.206.159,05	5,120004	10.127.686,50	6,130500	-1.078.472,55
NTN-B 150840 (5,171997%)	11.387.510,07	5,171997	10.346.269,67	6,130500	-1.041.240,40
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.504.660,24	5,481000	5.160.277,00	6,130500	-344.383,24
NTN-B 150840 (5,792100%)	21.640.470,76	5,792100	20.928.266,29	6,130500	-712.204,47
NTN-B 150850 (5,582500%)	1.045.946,19	5,582500	959.402,94	6,257400	-86.543,25
NTN-B 150850 (5,850500%)	5.015.627,99	5,850500	4.763.351,42	6,257400	-252.276,57
NTN-B 150850 (6,145000%)	1.856.461,56	6,145000	1.830.439,81	6,257400	-26.021,75

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
253	02/08/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	462,11	160,88106400	2,8723703610
243	06/08/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	5.000,00	1.343,08626000	3,7227690790
252	07/08/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	219.999,04	0,00	76.509,26579100	2,8754561650
251	09/08/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.303.598,79	0,00	800.563,49371000	2,8774716910
239	13/08/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	135.000,00	0,00	36.196,80270100	3,7296111790
256	14/08/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	1.132.091,15	0,00	4.218,32474230	268,3745845000
250	14/08/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.132.091,15	393.022,18479900	2,8804764560
259	15/08/2024	CLARITAS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LONGO PRAZO	2.900.000,00	0,00	69.616,06727137	41,6570500700
249	15/08/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.927.592,94	0,00	668.949,63605600	2,8815217710
248	15/08/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.900.000,00	1.006.412,66333100	2,8815217710
260	20/08/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	1.927.592,94	0,00	7.171,10314900	268,8000577000
247	20/08/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.927.592,94	668.266,74658300	2,8844663450
242	23/08/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	25.462,52	6.807,65730400	3,7402764070
241	28/08/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	86.120,35	23.015,09849700	3,7419066450
240	28/08/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	12.000,00	3.206,92126700	3,7419066450
254	28/08/2024	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	2.823.682,25	350.964,14748000	8,0455005740
246	29/08/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.528.827,80	0,00	528.680,08923000	2,8917824430
245	29/08/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.385,87	479,24421300	2,8917824430
244	30/08/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	81.807,16	0,00	28.279,52509700	2,8928052970
<b>Total</b>			<b>12.156.509,82</b>	<b>8.913.797,19</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.285.388,85

Value-At-Risk: 1,15%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	2,00	0,80	5,00	0,44	-0,10	0,67	303.234.265,15	81,62
Artigo 8º	12,21	5,96	20,00	0,42	0,41	5,85	33.208.750,02	8,94
Artigo 9º	18,41	8,80	20,00	0,09	-0,01	0,63	17.210.483,43	4,63
Artigo 10º	16,54	5,99	20,00	0,20	0,10	2,51	17.887.382,18	4,81
PORTO FELIZ		1,15		1,15			371.540.880,78	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,80%

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 150830 (4,069994%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-1,71	0,56	5.702.650,21	1,53
NTN-B 150830 (5,569998%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-1,02	0,68	1.681.815,25	0,45
NTN-B 150830 (5,776000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,92	0,70	2.234.984,67	0,60
NTN-B 150830 (6,000000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,82	0,72	1.569.501,61	0,42
NTN-B 150535 (4,423526%)	0,33	0,22	0,00	0,22	-0,84	0,59	2.932.154,89	0,79
NTN-B 150535 (4,734998%)	0,42	0,31	0,00	0,31	-0,61	0,61	11.568.925,65	3,11
NTN-B 150535 (5,290003%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-1,15	0,66	11.505.245,18	3,10
NTN-B 150535 (5,601000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-1,01	0,69	1.805.708,05	0,49
NTN-B 150535 (5,635000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,99	0,69	1.760.366,17	0,47
NTN-B 150535 (5,640000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,99	0,69	1.786.846,69	0,48
NTN-B 150535 (5,877000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,88	0,71	5.590.534,15	1,50
NTN-B 150535 (6,051500%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,80	0,72	1.658.102,08	0,45
NTN-B 150840 (5,120004%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-1,23	0,65	11.206.159,05	3,02
NTN-B 150840 (5,171997%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-1,20	0,65	11.387.510,07	3,06
NTN-B 150840 (5,481000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-1,06	0,68	5.504.660,24	1,48
NTN-B 150840 (5,792100%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,92	0,70	21.640.470,76	5,82

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
NTN-B 150545	8,97	3,37	0,05	3,37	0,03	1,14	9.606.452,75	2,59
NTN-B 150850 (5,582500%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-1,01	0,68	1.045.946,19	0,28
NTN-B 150850 (5,850500%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,89	0,71	5.015.627,99	1,35
NTN-B 150850 (6,145000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,76	0,73	1.856.461,56	0,50
NTN-B 150555 (4,689998%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-1,42	0,61	2.984.663,06	0,80
NTN-B 150555 (5,669994%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,97	0,69	11.338.790,64	3,05
NTN-B 150555 (5,900000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,87	0,71	5.603.798,82	1,51
<b>Sub-total</b>	0,75	0,25	0,05		-0,23	0,70	136.987.375,73	36,87

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 IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,10	2,03	0,11	0,04	-0,08	0,46	32.644.097,48	8,79
BB PREV RF IRF M	3,41	1,46	0,03	0,01	-0,06	0,65	10.271.996,07	2,76
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,64	0,29	0,00	0,01	-0,20	0,74	336.434,24	0,09
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,29	1,09	0,05	0,01	-0,13	0,58	30.580.936,05	8,23
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,12	2,06	0,06	0,01	-0,07	0,50	16.647.594,86	4,48
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	7,52	3,20	0,11	3,20	-0,01	0,78	18.323.637,65	4,93
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,28	1,08	0,03	0,01	-0,13	0,58	18.370.514,44	4,94
<b>Sub-total</b>	3,91	1,67	0,39		-0,08	0,57	127.175.210,79	34,23

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	0,01	-0,00	0,01	-4,49	0,79	1.760.779,28	0,47
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,08	0,02	0,00	0,02	0,51	0,91	25.013.539,53	6,73
<b>Sub-total</b>	0,08	0,02	0,00		0,42	0,90	26.774.318,81	7,21

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
CLARITAS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LONGO PRAZO	0,25	0,17	0,00	0,17	0,44	0,97	12.297.359,82	3,31
<b>Sub-total</b>	0,25	0,17	0,00		0,44	0,97	12.297.359,82	3,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável Value-At-Risk: 5,96%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	11,83	5,79	0,25	0,29	0,47	6,46	21.349.848,30	5,75
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	13,17	5,81	0,06	2,28	0,31	4,92	5.192.099,50	1,40
PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	15,46	7,50	0,10	3,67	0,24	4,64	6.666.802,22	1,79
<b>Sub-total</b>	12,21	5,96	0,42		0,41	5,85	33.208.750,02	8,94

Investimentos Estruturados Value-At-Risk: 5,99%

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	19,55	7,04	0,18	6,23	0,08	2,48	13.643.643,17	3,67
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	17,51	5,70	0,02	5,70	0,10	2,60	4.243.739,01	1,14
<b>Sub-total</b>	16,54	5,99	0,20		0,10	2,51	17.887.382,18	4,81

Investimentos no Exterior Value-At-Risk: 8,80%

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
PRINCIPAL GLOBAL HIGH YIELD FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1,91	1,24	0,00	1,24	0,37	1,58	1.054.871,96	0,28
<b>Sub-total</b>	1,91	1,24	0,00		0,37	1,58	1.054.871,96	0,28

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	19,49	9,37	0,09	1,21	-0,02	0,57	16.155.611,47	4,35
<b>Sub-total</b>	19,49	9,37	0,09		-0,02	0,57	16.155.611,47	4,35

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)  
(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)  
(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

- (4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
- (5) Limite Política de Investimentos (%)