



LDB
EMPRESAS

PORTO FELIZ
NOVEMBRO 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 30.11.2022.

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

67,34%

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 150545	9,18	1,30	-1,21	4,61	8.980.414,40	3,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,423526%)	0,66	-0,01	0,98	9,57	2.703.865,69	0,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,734998%)	0,70	-0,03	1,00	9,84	10.632.948,06	3,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290003%)	0,62	0,05	1,04	10,46	10.515.044,63	3,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,877000%)	0,62	0,05	1,09	7,65	5.079.425,63	1,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,051500%)	4,15	0,19	0,36	0,36	1.503.932,63	0,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (4,689998%)	0,62	0,04	1,00	9,89	2.724.677,39	0,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,669994%)	0,62	0,05	1,07	8,78	10.294.708,24	3,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,900000%)	0,62	0,05	1,09	7,67	5.081.912,44	1,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,069994%)	0,62	0,04	0,95	9,29	5.443.359,57	1,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,569998%)	0,62	0,05	1,07	10,13	1.579.121,62	0,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,120004%)	0,62	0,05	1,03	10,30	10.514.904,97	3,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,171997%)	0,62	0,05	1,04	10,35	10.681.859,16	3,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,481000%)	2,82	0,05	1,06	5,98	5.154.620,50	1,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,792100%)	2,91	0,05	1,08	4,13	20.230.780,90	7,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	1,04	0,14	0,85	9,60	111.121.575,83	38,83

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 IRF M	3,65	0,30	-0,69	7,05	232.856,21	0,08	3.947.742.044,30	0,01
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,59	0,31	-0,35	8,59	15.526.195,29	5,43	1.257.075.152,82	1,24
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,49	0,06	0,91	10,45	1.476.804,84	0,52	6.379.149.625,43	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,27	0,73	-0,80	6,33	12.939.969,05	4,52	5.638.875.418,33	0,23
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,34	0,74	-0,83	6,45	14.214.411,39	4,97	3.729.245.028,85	0,38
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,58	0,31	-0,35	8,67	22.251.277,50	7,78	8.271.051.539,34	0,27
BB	BB	BB PREV RF IPCA	1,99	0,07	0,74	9,02	3.088.495,53	1,08	3.695.776.198,86	0,08
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	3,59	0,46	-0,45	7,27	69.730.009,81	24,37		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,10	0,05	0,93	10,07	416.814,95	0,15	3.992.775.504,59	0,01
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,11	0,05	1,05	6,24	11.434.758,27	4,00	2.898.194.569,39	0,39
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	0,11	0,05	1,04	10,55	11.851.573,22	4,14		
		Renda Fixa	2,10	0,25	0,39	8,56	192.703.158,86	67,34		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

18,14%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CLARITAS	SANTANDER	CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	21,66	0,00	0,00	0,00	3.000.000,00	1,05	534.665.881,83	0,56
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	25,95	1,44	-10,64	-5,79	27.203.860,57	9,51	931.946.761,19	2,92
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21,22	1,38	-3,87	5,18	21.708.789,03	7,59	870.125.628,98	2,49
Sub-total Artigo 8º I			23,33	1,41	-7,59	-0,91	51.912.649,60	18,14		
Renda Variável			22,84	1,41	-7,59	-0,91	51.912.649,60	18,14		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,48%

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	26,61	1,74	6,91	-24,94	18.537.161,43	6,48	2.064.871.213,59	0,90
Sub-total Artigo 9º III			26,61	1,74	6,91	-24,94	18.537.161,43	6,48		
Investimentos no Exterior			26,61	1,74	6,91	-24,94	18.537.161,43	6,48		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

8,04%

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	24,12	2,96	6,04	-7,44	23.005.273,62	8,04	1.836.027.505,44	1,25
Sub-total Artigo 10º I			24,12	2,96	6,04	-7,44	23.005.273,62	8,04		
Investimentos Estruturados			24,73	2,96	6,04	-7,44	23.005.273,62	8,04		
Total			6,79	0,75	-0,34	2,37	286.158.243,51	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	111.121.575,83	38,83	0,00	37,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	69.730.009,81	24,37	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	11.851.573,22	4,14	0,00	3,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	192.703.158,86	67,34					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	51.912.649,60	18,14	0,00	20,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	51.912.649,60	18,14					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	18.537.161,43	6,48	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	18.537.161,43	6,48					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	23.005.273,62	8,04	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	23.005.273,62	8,04					15,00
Total		286.158.243,51	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	0,85 83,23	9,60 86,29	1,67 53,21	2,85 43,80	10,47 87,45	935.073,15	8.341.008,74
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,45 -44,42	7,27 65,35	1,99 63,11	2,22 34,16	7,74 64,67	-319.409,88	5.955.902,42
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,04 101,92	10,55 94,87	3,20 101,78	6,40 98,53		146.348,08	858.140,24
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-7,59 -4,53	-0,91 -8,23	-1,77 -4,48	-4,81 -5,83		-4.252.483,93	-469.020,87
Artigo 9º III % do CDI	6,91 676,94	-24,94 -224,19	0,34 10,69	4,86 74,83	-23,66 -197,63	1.198.025,14	-6.159.576,98
Artigo 10º I % do CDI	6,04 592,15	-7,44 -66,88	5,40 171,61	3,55 54,69		1.311.167,27	-1.849.370,70
PORTO FELIZ (Total)						-981.280,17	6.677.082,85

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%)	2.746.621,71	0,00	0,00	69.339,96	2.703.865,69	26.583,94	246.120,73
NTN-B 150535 (4,734998%)	10.806.124,52	0,00	0,00	280.292,98	10.632.948,06	107.116,52	994.040,13
NTN-B 150535 (5,290003%)	10.695.302,89	0,00	0,00	290.617,72	10.515.044,63	110.359,46	1.040.093,17
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.171.418,39	0,00	0,00	147.596,72	5.079.425,63	55.603,96	375.968,82
NTN-B 150535 (6,051500%)	0,00	1.498.523,78	0,00	0,00	1.503.932,63	5.408,85	5.408,85
NTN-B 150545	9.362.645,63	0,00	0,00	262.694,01	8.980.414,40	-119.537,22	410.089,37
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.763.309,23	0,00	0,00	65.937,49	2.724.677,39	27.305,65	254.805,56
NTN-B 150555 (5,669994%)	10.471.952,25	0,00	0,00	288.271,19	10.294.708,24	111.027,18	866.443,85
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.173.208,90	0,00	0,00	147.010,09	5.081.912,44	55.713,63	376.839,16
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.392.072,91	0,00	0,00	0,00	5.443.359,57	51.286,66	475.080,17
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.562.468,27	0,00	0,00	0,00	1.579.121,62	16.653,35	149.159,98
NTN-B 150840 (5,120004%)	10.407.541,56	0,00	0,00	0,00	10.514.904,97	107.363,41	1.007.500,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150840 (5,171997%)	10.572.373,93	0,00	0,00	0,00	10.681.859,16	109.485,23	1.028.083,24
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.100.600,78	0,00	0,00	0,00	5.154.620,50	54.019,72	296.315,60
NTN-B 150840 (5,792100%)	20.014.098,09	0,00	0,00	0,00	20.230.780,90	216.682,81	815.059,92
					111.121.575,83	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	13.044.254,28	0,00	0,00	0,00	12.939.969,05	-104.285,23	855.648,99
BB PREV RF IPCA	3.156.238,38	0,00	-90.720,74	0,00	3.088.495,53	22.977,89	267.845,08
BB PREV RF IRF M	234.473,61	0,00	0,00	0,00	232.856,21	-1.617,40	15.329,03
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.499.202,43	96.000,00	-132.500,00	0,00	1.476.804,84	14.102,41	237.376,14
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	22.329.147,14	0,00	0,00	0,00	22.251.277,50	-77.869,64	1.774.605,23
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	14.333.303,22	0,00	0,00	0,00	14.214.411,39	-118.891,83	961.167,28
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	15.580.021,37	0,00	0,00	0,00	15.526.195,29	-53.826,08	1.228.775,53
					69.730.009,81	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	591.554,21	6.727.283,85	-6.910.135,97	0,00	416.814,95	8.112,86	391.049,83
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	11.965.031,04	2.612.633,40	-3.281.141,39	0,00	11.434.758,27	138.235,22	467.090,41
					11.851.573,22	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	25.720.743,21	0,00	-3.000.000,00	0,00	21.708.789,03	-1.011.954,18	1.202.044,35
BRANDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	30.444.390,32	0,00	0,00	0,00	27.203.860,57	-3.240.529,75	-1.671.065,22
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	0,00	3.000.000,00	0,00	0,00	3.000.000,00	0,00	0,00
					51.912.649,60	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	17.339.136,29	0,00	0,00	0,00	18.537.161,43	1.198.025,14	-6.159.576,98
					18.537.161,43	0,00	0,00

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	21.694.106,35	0,00	0,00	0,00	23.005.273,62	1.311.167,27	-1.849.370,70
					23.005.273,62	0,00	0,00

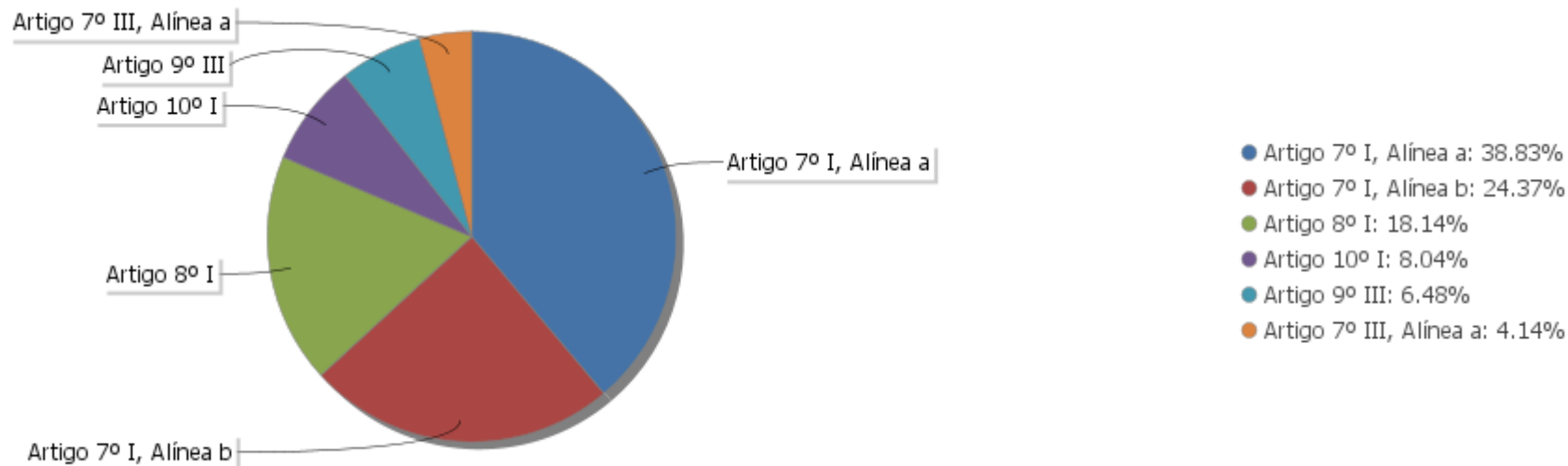
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

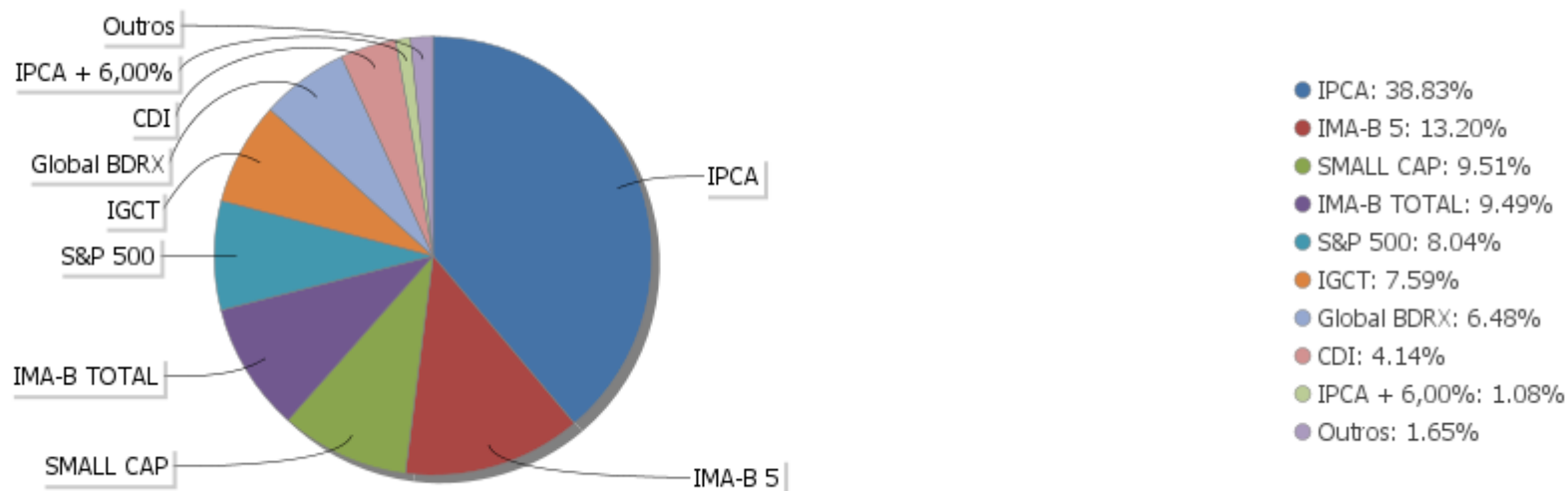
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	168.948.172,15	59,04	168.948.172,15	59,04
de 31 a 365 dias	6.088.495,53	2,13	175.036.667,68	61,17
acima de 365 dias	111.121.575,83	38,83	286.158.243,51	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

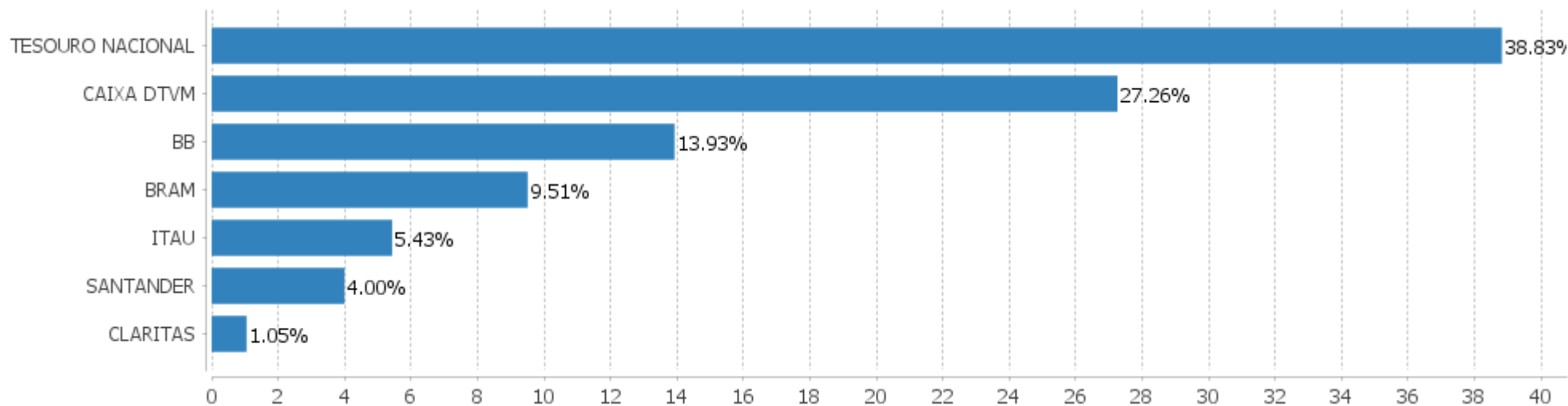


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2022	-0,39	-0,32	3,04	-2,37	0,93	-2,88	2,21	0,90	-0,94	2,70	-0,34		2,37
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		9,79
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		-7,42
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

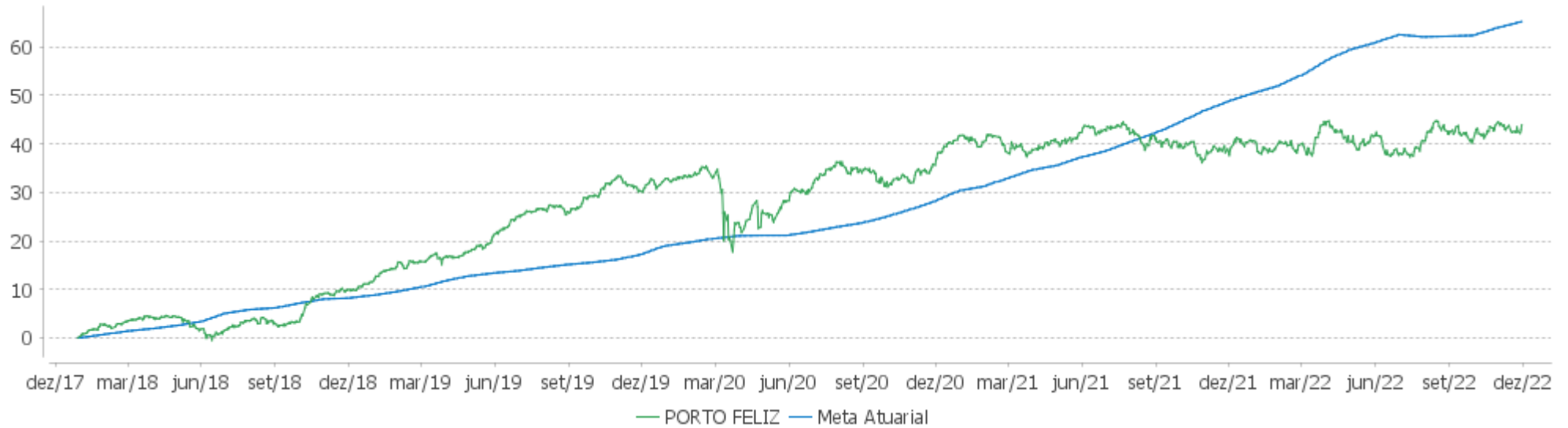
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	28	47,46	03 meses	1,38	1,88	-0,49	6,87
Meses abaixo - Meta Atuarial	31	52,54	06 meses	1,54	2,75	-1,21	6,67
			12 meses	4,05	11,12	-7,07	6,79
			24 meses	6,12	29,72	-23,59	6,25
			36 meses	10,46	43,20	-32,74	8,68
			48 meses	30,95	56,76	-25,81	7,75
			Desde 29/12/2017	43,95	71,26	-27,31	7,26

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-7,15	2020-03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

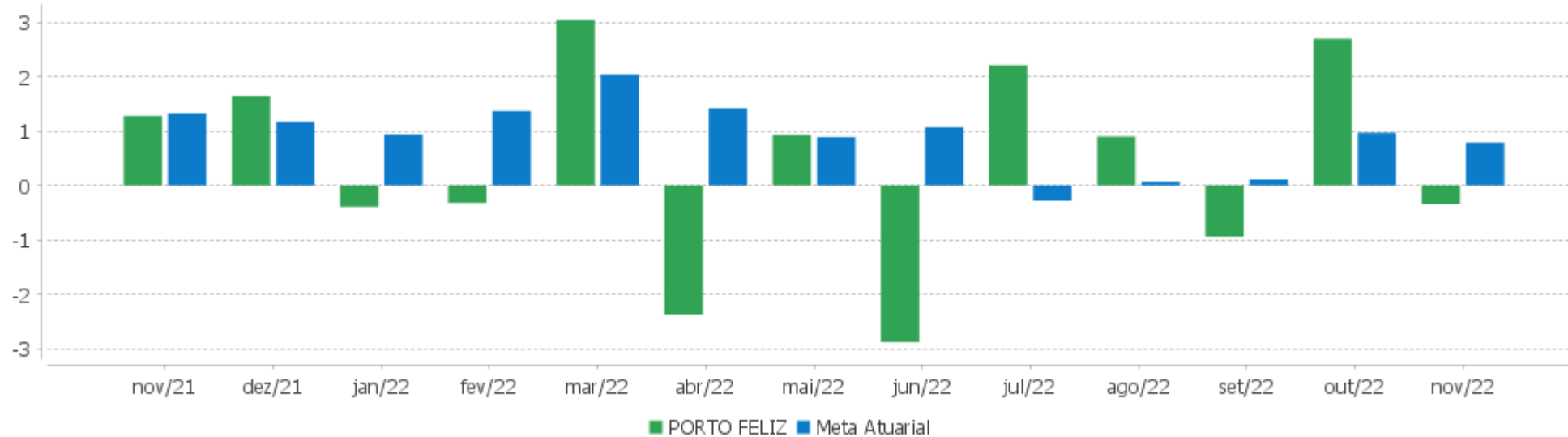


Patrimônio Líquido



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 150545 Var. IPCA p.p.	-1,21 -1,62	4,61 -0,52	2,06 1,35	1,36 1,03	3,14 -2,76	4,22 -13,05	3,51 -18,82
NTN-B 150840 (5,120004%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,62	10,30 5,16	1,60 0,89	2,90 2,56	11,64 5,74	23,34 6,07	28,02 5,69
NTN-B 150830 (4,069994%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,54	9,29 4,16	1,35 0,64	2,38 2,05	10,53 4,63	24,25 6,98	27,95 5,63
NTN-B 150535 (5,290003%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,63	10,46 5,33	1,64 0,93	2,98 2,65	11,82 5,92	26,93 9,66	31,71 9,38
NTN-B 150535 (5,877000%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,68	11,02 5,89	1,78 1,07	3,27 2,93	12,45 6,55	24,52 7,25	29,52 7,19
NTN-B 150840 (5,792100%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,67	7,83 2,69	1,76 1,05	3,22 2,89	9,21 3,31	20,92 3,65	25,76 3,43
NTN-B 150555 (4,689998%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,59	9,89 4,75	1,50 0,79	2,69 2,35	11,19 5,28	25,91 8,64	30,77 8,45
NTN-B 150840 (5,481000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,65	7,64 2,51	1,68 0,97	3,07 2,74	8,99 3,09	20,56 3,28	25,27 2,94
NTN-B 150840 (5,171997%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,63	10,35 5,21	1,61 0,90	2,92 2,59	11,70 5,80	23,43 6,15	28,12 5,80
NTN-B 150555 (5,669994%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,66	10,82 5,69	1,73 1,02	3,17 2,83	12,23 6,33	24,29 7,02	29,30 6,97
NTN-B 150830 (5,569998%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,66	10,73 5,59	1,71 1,00	3,12 2,78	12,12 6,22	23,93 6,66	28,68 6,35
NTN-B 150555 (5,900000%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,68	11,04 5,91	1,78 1,07	3,28 2,95	12,47 6,57	24,60 7,33	29,66 7,33
NTN-B 150535 (6,051500%) Var. IPCA p.p.	-1,81 -2,22	4,87 -0,26	-1,11 -1,82	0,38 0,04	6,24 0,34		
NTN-B 150535 (4,734998%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,59	9,84 4,71	1,51 0,80	2,71 2,38	11,15 5,25	25,68 8,40	30,09 7,77
NTN-B 150535 (4,423526%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,57	9,57 4,44	1,44 0,73	2,56 2,22	10,84 4,94	25,05 7,78	29,27 6,94
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,83 -0,04	6,45 -0,13	1,84 -0,07	1,72 -0,05	6,67 -0,15	9,89 -0,44	13,38 -0,83
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-0,35	8,67	1,95	2,36	9,50	15,42	23,61

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,09	-0,05	0,01	-0,11	-0,39	-0,78
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	-0,35	8,59	1,96	2,28	9,43	15,37	23,68
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,01	-0,17	-0,04	-0,08	-0,18	-0,43	-0,71
BB PREV RF IPCA	0,74	10,35	3,08	3,35	10,97	17,53	27,05
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,14	-0,50	0,94	0,05	-1,29	-14,18	-18,51
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,91	10,45	3,01	6,31	11,39	13,72	17,77
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,26	-0,07	-0,13	-0,30	-0,58	-1,06
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,80	6,33	1,84	1,66	6,54	9,78	13,34
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,25	-0,07	-0,10	-0,27	-0,56	-0,88
BB PREV RF IRF M	-0,69	7,05	1,58	5,19	9,06	6,66	11,97
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,03	-0,19	-0,09	-0,14	-0,21	-0,50	-0,87
BB PREV RF FLUXO FIC	0,93	10,12	2,91	5,99	10,86	13,84	15,92
% do CDI	91,60	90,98	92,42	92,13	90,69	85,41	80,92
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	1,05	11,60	3,25	6,71	12,51	17,51	20,09
% do CDI	102,57	104,29	103,35	103,26	104,46	108,07	102,12
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	-6,63	10,93	-0,78	-4,04	15,99	10,12	18,27
Var. IBRX 100 p.p.	-3,52	4,11	-3,02	-4,25	5,82	6,55	12,92
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-3,87	5,18	1,41	-0,45	8,80	1,19	2,36
Var. IGCT p.p.	-0,16	-1,08	-0,32	-0,49	-1,15	-1,94	-3,06
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	-10,64	-5,79	-4,41	-8,37	-2,12	-7,74	-7,97
Var. SMALL CAP p.p.	0,58	6,64	2,09	0,39	6,98	13,35	9,89
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	6,91	-24,94	0,34	4,86	-23,66	-1,36	48,94
Var. Global BDRX p.p.	-0,18	-0,06	0,91	0,27	-0,06	-2,69	-3,32
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6,04	-7,44	5,40	3,55	-2,29	26,81	40,24
Var. S&P 500 p.p.	-0,08	11,35	-0,06	-6,99	13,55	14,94	-22,57
PORTO FELIZ	-0,34	2,37	1,38	1,54	4,05	6,12	10,46
Var. IPCA + 4,88% p.p.	-1,13	-7,42	-0,49	-1,21	-7,02	-22,82	-30,55
CDI	1,02	11,12	3,15	6,50	11,97	16,20	19,67
IBOVESPA	-3,06	7,31	2,71	1,02	10,37	3,30	3,93
INPC + 6,00%	0,85	10,93	1,96	3,20	12,33	32,06	47,19
IPCA + 6,00%	0,88	10,85	2,14	3,30	12,25	31,71	45,56

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 IPCA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
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
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+31 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+33 (isento de taxa de resgate)	Para informações adicionais, vide o Regulamento	0,70
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
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,18
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	0,94	10,71	3,09	6,43	11,68	14,31	18,83	27,03	35,90
IRF-M 1+	-1,42	5,70	1,06	5,02	8,12	3,49	9,70	26,82	41,73
IRF-M TOTAL	-0,66	7,24	1,66	5,33	9,26	7,16	12,84	27,56	40,85
IMA-B 5	-0,33	8,76	2,00	2,36	9,62	15,81	24,38	40,92	54,10
IMA-B 5+	-1,18	4,54	1,85	1,33	4,19	5,03	5,75	36,89	56,28
IMA-B TOTAL	-0,79	6,58	1,92	1,77	6,82	10,34	14,22	39,94	56,93
IMA-GERAL TOTAL	-0,06	8,82	2,23	4,60	9,76	12,09	16,76	32,09	44,93
IDKA 2	-0,77	8,00	1,63	1,56	8,90	15,34	24,63	39,43	52,89
IDKA 20	-2,10	1,45	2,45	1,09	-0,87	-3,40	-7,85	30,57	55,16
CDI	1,02	11,12	3,15	6,50	11,97	16,20	19,67	26,96	35,17

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,06	7,31	2,71	1,02	10,37	3,30	3,93	25,68	56,29
IBRX 100	-3,11	6,82	2,24	0,20	10,17	3,57	5,35	29,31	60,79
IBRX 50	-2,19	8,48	3,51	1,63	12,57	6,19	7,17	27,14	57,97
SMALL CAP	-11,23	-12,42	-6,49	-8,76	-9,10	-21,09	-17,86	17,77	33,49
Índice Consumo - ICON	-14,29		-9,98	-10,16	-21,20	-38,86	-36,58	-8,99	-11,97
Índice Dividendos - IDIV	0,78	14,50	2,96	0,30	16,33	16,74	16,68	54,99	87,39

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	6,12	-18,79	5,46	10,54	-15,84	11,87	62,81	102,57	150,14

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-4,15	2,23	-3,66	1,66	11,20	2,09	-0,80	24,64	29,56

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,36	-20,71	5,19	8,20	-18,19	1,33	44,64	76,14	102,61

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,41	5,13	0,71	0,33	5,90	17,27	22,33	26,33	31,45
INPC	0,38	5,21	0,53	0,23	5,97	17,59	23,70	27,86	32,41
IGPM	-0,56	4,98	-2,46	-2,38	5,90	24,83	55,45	61,62	77,25
SELIC	1,02	11,12	3,15	6,50	11,97	16,20	19,67	26,96	35,19

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,72	8,95	1,67	2,32	10,14	26,80	37,52	47,70	59,77
IPCA + 5,00%	0,80	9,90	1,91	2,81	11,20	29,24	41,50	53,44	67,57
IPCA + 5,50%	0,84	10,37	2,02	3,05	11,73	30,47	43,52	56,37	71,58
IPCA + 5,89%	0,87	10,75	2,11	3,24	12,14	31,43	45,11	58,69	74,76
IPCA + 6,00%	0,88	10,85	2,14	3,30	12,25	31,71	45,56	59,35	75,66
INPC + 4,00%	0,69	9,02	1,49	2,22	10,21	27,14	39,06	49,49	60,95
INPC + 6,00%	0,85	10,93	1,96	3,20	12,33	32,06	47,19	61,28	76,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
140	07/11/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	148,90	62,39267800	2,3864979900
141	08/11/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	59.111,96	0,00	24.757,81531991	2,3876080840
142	09/11/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	25.909,74	0,00	10.846,75505500	2,3887088690
143	10/11/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.940.553,54	0,00	812.007,59772000	2,3898219000
144	11/11/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.612.633,40	1.092.727,41633600	2,3909287540
145	11/11/2022	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	2.612.633,40	0,00	12.003,77800800	217,6509261000
146	11/11/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	96.000,00	0,00	31.266,92194900	3,0703374050
147	16/11/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	90.720,74	0,00	37.908,78148400	2,3931325790
148	16/11/2022	BB PREV RF IPCA	0,00	90.720,74	31.913,90482200	2,8426712590
149	17/11/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.551.760,15	0,00	648.121,26124424	2,3942435510
150	21/11/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.498.523,77	625.298,53045492	2,3964933500
151	21/11/2022	NTN-B 150535 (6,051500%)	1.498.523,78	0,00	378,00000000	3.964,3486180000
152	24/11/2022	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	0,00	3.000.000,00	1.030.460,65358300	2,9113193110
153	28/11/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	3.000.000,00	0,00	1.248.914,72380700	2,4020855410
154	28/11/2022	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	551.230,71	2.519,48234000	218,7872914000
155	28/11/2022	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.075.043,36	9.484,29566800	218,7872914000
156	28/11/2022	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	654.867,32	2.993,16891700	218,7872914000
157	28/11/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	38.500,00	12.480,59967800	3,0847876700
158	28/11/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	94.000,00	30.472,11349900	3,0847876700
159	29/11/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	59.227,72	0,00	24.645,43549500	2,4031922670
160	30/11/2022	CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	3.000.000,00	0,00	778.395,43744033	3,8540822000
161	30/11/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.798.829,90	1.164.092,03699800	2,4043029340
Total			13.934.441,03	13.414.498,10		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 9.082.752,21

Value-At-Risk: 3,17%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PORTO FELIZ		3,17	3,17			286.158.243,51	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,90%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545		5,20	0,09	5,21			8.980.414,40	3,14
NTN-B 150535 (4,423526%)		0,21	-0,00	0,19			2.703.865,69	0,94
NTN-B 150535 (4,734998%)		0,27	-0,00	0,24			10.632.948,06	3,72
NTN-B 150535 (5,290003%)		0,16	-0,00	0,15			10.515.044,63	3,67
NTN-B 150535 (5,877000%)		0,16	-0,00	0,15			5.079.425,63	1,78
NTN-B 150535 (6,051500%)		0,29	0,00	0,33			1.503.932,63	0,53
NTN-B 150555 (4,689998%)		0,16	-0,00	0,15			2.724.677,39	0,95
NTN-B 150555 (5,669994%)		0,16	-0,00	0,15			10.294.708,24	3,60
NTN-B 150555 (5,900000%)		0,16	-0,00	0,15			5.081.912,44	1,78
NTN-B 150830 (4,069994%)		0,16	-0,00	0,15			5.443.359,57	1,90
NTN-B 150830 (5,569998%)		0,16	-0,00	0,15			1.579.121,62	0,55
NTN-B 150840 (5,120004%)		0,16	-0,00	0,15			10.514.904,97	3,67
NTN-B 150840 (5,171997%)		0,16	-0,00	0,15			10.681.859,16	3,73
NTN-B 150840 (5,481000%)		0,16	-0,00	0,15			5.154.620,50	1,80
NTN-B 150840 (5,792100%)		0,16	-0,00	0,15			20.230.780,90	7,07
Sub-total	1,09	0,42	0,08		-0,16	0,85	111.121.575,83	38,83

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF M		1,51	0,00	0,03			232.856,21	0,08

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI		1,41	0,04	0,01			15.526.195,29	5,43
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,17	0,00	0,00			1.476.804,84	0,52
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,88	0,07	0,07			12.939.969,05	4,52
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,98	0,08	0,07			14.214.411,39	4,97
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,40	0,06	0,03			22.251.277,50	7,78
BB PREV RF IPCA		0,76	0,00	0,73			3.088.495,53	1,08
Sub-total	5,88	1,87	0,25		-0,25	-0,45	69.730.009,81	24,37

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			416.814,95	0,15
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,01	-0,00	0,01			11.434.758,27	4,00
Sub-total	0,02	0,01	-0,00		1,21	1,04	11.851.573,22	4,14

Renda Variável

Value-At-Risk: 12,63%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA		11,92	0,10	4,13			3.000.000,00	1,05
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		14,05	1,13	3,33			27.203.860,57	9,51
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		11,73	0,73	0,20			21.708.789,03	7,59
Sub-total	32,48	12,63	1,96		-0,27	-7,59	51.912.649,60	18,14

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 11,46%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		11,46	0,66	7,67			23.005.273,62	8,04
Sub-total	29,54	11,46	0,66		0,17	6,04	23.005.273,62	8,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 13,82%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		13,82	0,23	1,63			18.537.161,43	6,48
Sub-total	44,46	13,82	0,23		0,13	6,91	18.537.161,43	6,48