



LDB
EMPRESAS

PORTO FELIZ
MAIO 2023



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.05.2023.

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

73,23%

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	9,37	-0,00	4,49	11,63	9.584.826,69	3,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,423526%)	0,55	-0,02	0,94	5,18	2.792.871,97	0,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,734998%)	0,61	-0,04	0,97	5,31	10.991.789,61	3,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290003%)	0,47	0,04	1,02	5,53	10.884.646,57	3,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,877000%)	0,47	0,04	1,06	5,77	5.265.333,38	1,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,051500%)	2,98	0,04	1,08	5,85	1.559.608,34	0,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (4,689998%)	0,47	0,03	0,97	5,29	2.822.026,03	0,91
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,669994%)	0,47	0,04	1,05	5,69	10.672.199,81	3,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,900000%)	0,47	0,04	1,07	5,78	5.269.179,01	1,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,069994%)	0,47	0,03	0,91	5,03	5.610.344,82	1,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,569998%)	0,47	0,04	1,04	5,65	1.635.273,12	0,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,000000%)	4,17	0,04	1,07	2,63	1.521.107,12	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,120004%)	0,47	0,04	1,00	5,47	10.886.156,81	3,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,171997%)	0,47	0,04	1,01	5,49	11.060.083,67	3,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,481000%)	0,47	0,04	1,03	5,61	5.340.157,35	1,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,792100%)	0,47	0,04	1,06	5,74	20.970.479,74	6,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,850500%)	4,09	0,04	0,33	0,33	4.854.533,41	1,57
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,85	0,03	1,29	6,03	121.720.617,45	39,44

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	3,54	0,03	2,17	7,20	253.201,09	0,08	4.005.393.556,18	0,01
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,46	0,00	0,56	5,85	16.586.172,13	5,37	1.457.574.277,07	1,14
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,39	0,04	1,12	5,27	317.090,12	0,10	6.724.495.811,47	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,26	-0,01	2,58	8,70	14.035.246,18	4,55	5.943.377.738,68	0,24
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,34	-0,01	2,53	8,69	15.412.491,87	4,99	3.621.007.048,62	0,43
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,45	0,00	0,63	5,91	23.783.883,39	7,71	8.623.099.025,61	0,28
BB	BB	BB PREV RF IPCA	1,46	0,00	0,64	5,29	0,00	0,00	241.807.690,53	0,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b		3,31	-0,00	1,40	6,96	70.388.084,78	22,80			

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	0,02	0,05	1,04	4,93	2.338.583,88	0,76	3.860.323.166,27	0,06
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,08	0,06	1,19	5,16	31.585.785,87	10,23	3.184.616.150,75	0,99
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a		0,08	0,06	1,18	5,15	33.924.369,75	10,99			
Renda Fixa		1,59	0,02	1,32	6,22	226.033.071,98	73,23			

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

15,70%

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	22,70	-0,36	5,43	-2,42	2.903.579,20	0,94	593.028.799,83	0,49
BRAM	BEM	BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	25,93	0,09	9,65	-2,13	24.868.103,59	8,06	732.883.551,57	3,39
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21,50	-0,47	4,08	-2,17	20.680.104,64	6,70	745.369.833,92	2,77
Sub-total Artigo 8º I			23,30	-0,18	6,97	-2,20	48.451.787,43	15,70		
Renda Variável			23,30	-0,18	6,97	-2,20	48.451.787,43	15,70		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,52%

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	24,59	0,03	5,80	14,00	20.118.740,19	6,52	2.053.133.646,70	0,98
Sub-total Artigo 9º III			24,59	0,03	5,80	14,00	20.118.740,19	6,52		
Investimentos no Exterior			24,59	0,03	5,80	14,00	20.118.740,19	6,52		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,55%

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	20,97	-0,46	1,21	12,93	14.054.284,64	4,55	1.555.010.010,21	0,90
Sub-total Artigo 10º I			20,97	-0,46	1,21	12,93	14.054.284,64	4,55		
Investimentos Estruturados			20,95	-0,46	1,21	12,93	14.054.284,64	4,55		
Total			5,65	-0,03	2,46	5,64	308.657.884,24	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	121.720.617,45	39,44	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	70.388.084,78	22,80	0,00	24,51	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	33.924.369,75	10,99	0,00	5,49	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	226.033.071,98	73,23					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	48.451.787,43	15,70	0,00	10,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	48.451.787,43	15,70					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	20.118.740,19	6,52	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	20.118.740,19	6,52					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	14.054.284,64	4,55	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	14.054.284,64	4,55					15,00
Total		308.657.884,24	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	1,29 115,27	6,03 112,23	4,12 126,79	6,68 101,99	9,72 72,12	1.526.363,61	6.728.653,73
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,40 124,33	6,96 129,55	4,70 144,59	7,47 114,03	9,86 73,14	1.005.417,93	4.844.567,42
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,18 105,26	5,15 95,92	3,22 99,10	6,33 96,65	13,14 97,51	394.842,75	1.355.418,41
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	6,97 3,23	-2,20 -0,93	2,91 -0,33	-4,75 -1,06	-9,34 -6,63	3.213.975,39	-1.123.583,82
Artigo 9º III % do CDI	5,80 516,77	14,00 260,69	8,47 260,42	8,53 130,21	13,81 102,47	1.103.804,13	2.470.160,71
Artigo 10º I % do CDI	1,21 107,86	12,93 240,78	7,66 235,55	7,40 112,88	11,21 83,21	168.248,00	2.175.659,64
PORTO FELIZ (Total)						7.412.651,81	16.450.876,09

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%)	2.838.349,18	0,00	0,00	71.959,28	2.792.871,97	26.482,07	140.858,96
NTN-B 150535 (4,734998%)	11.175.512,15	0,00	0,00	290.881,07	10.991.789,61	107.158,53	567.844,67
NTN-B 150535 (5,290003%)	11.075.101,07	0,00	0,00	301.595,82	10.884.646,57	111.141,32	585.414,15
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.362.139,22	0,00	0,00	153.172,20	5.265.333,38	56.366,36	295.153,95
NTN-B 150535 (6,051500%)	1.588.708,78	0,00	0,00	46.024,72	1.559.608,34	16.924,28	88.477,05
NTN-B 150545	9.437.215,04	0,00	0,00	272.617,30	9.584.826,69	420.228,95	1.023.972,92
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.863.104,48	0,00	0,00	68.428,28	2.822.026,03	27.349,83	144.919,05
NTN-B 150555 (5,669994%)	10.859.009,64	0,00	0,00	299.160,65	10.672.199,81	112.350,82	589.403,81
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.365.240,56	0,00	0,00	152.563,41	5.269.179,01	56.501,86	295.786,06
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.559.593,34	0,00	0,00	0,00	5.610.344,82	50.751,48	270.919,18
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.618.457,87	0,00	0,00	0,00	1.635.273,12	16.815,25	88.182,42
NTN-B 150830 (6,000000%)	1.504.932,54	0,00	0,00	0,00	1.521.107,12	16.174,58	39.050,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150840 (5,120004%)	10.778.233,53	0,00	0,00	0,00	10.886.156,81	107.923,28	568.559,98
NTN-B 150840 (5,171997%)	10.949.964,11	0,00	0,00	0,00	11.060.083,67	110.119,56	579.796,83
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.285.635,73	0,00	0,00	0,00	5.340.157,35	54.521,62	286.138,29
NTN-B 150840 (5,792100%)	20.751.036,10	0,00	0,00	0,00	20.970.479,74	219.443,64	1.148.065,80
NTN-B 150850 (5,850500%)	0,00	4.838.423,23	0,00	0,00	4.854.533,41	16.110,18	16.110,18
					121.720.617,45	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	13.682.774,26	0,00	0,00	0,00	14.035.246,18	352.471,92	1.123.499,13
BB PREV RF IPCA	3.262.282,69	0,00	-3.283.072,08	0,00	0,00	20.789,39	165.082,43
BB PREV RF IRF M	247.812,66	0,00	0,00	0,00	253.201,09	5.388,43	17.007,30
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	215.481,97	216.000,00	-118.539,46	0,00	317.090,12	4.147,61	63.378,47
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	23.634.853,63	0,00	0,00	0,00	23.783.883,39	149.029,76	1.327.436,84
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.031.528,55	0,00	0,00	0,00	15.412.491,87	380.963,32	1.231.747,68
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	16.493.544,63	0,00	0,00	0,00	16.586.172,13	92.627,50	916.415,57
					70.388.084,78	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	1.130.800,62	10.057.723,68	-8.871.423,23	0,00	2.338.583,88	21.482,81	86.936,90
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	29.693.943,03	4.033.000,00	-2.514.517,10	0,00	31.585.785,87	373.359,94	1.268.481,51
					33.924.369,75	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	19.870.014,47	0,00	0,00	0,00	20.680.104,64	810.090,17	-459.319,86
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	23.646.145,16	0,00	-1.032.358,96	0,00	24.868.103,59	2.254.317,39	-592.108,62
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	2.754.011,37	0,00	0,00	0,00	2.903.579,20	149.567,83	-72.155,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					48.451.787,43	0,00	

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	19.014.936,06	0,00	0,00	0,00	20.118.740,19	1.103.804,13	2.470.160,71
					20.118.740,19	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	13.886.036,64	0,00	0,00	0,00	14.054.284,64	168.248,00	2.175.659,64
					14.054.284,64	0,00	

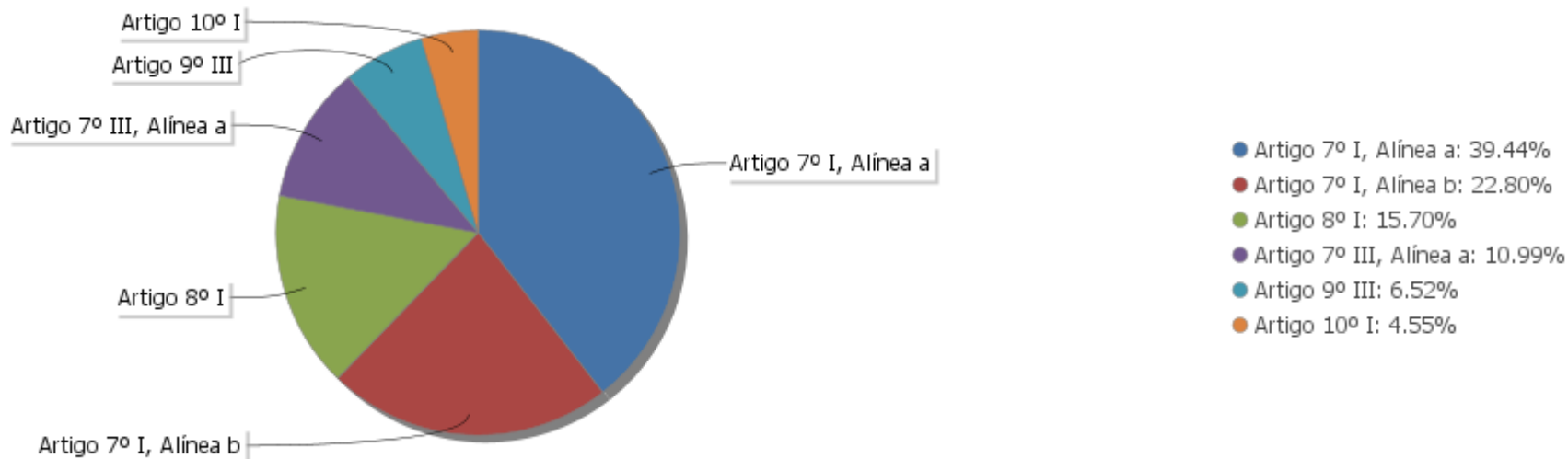
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

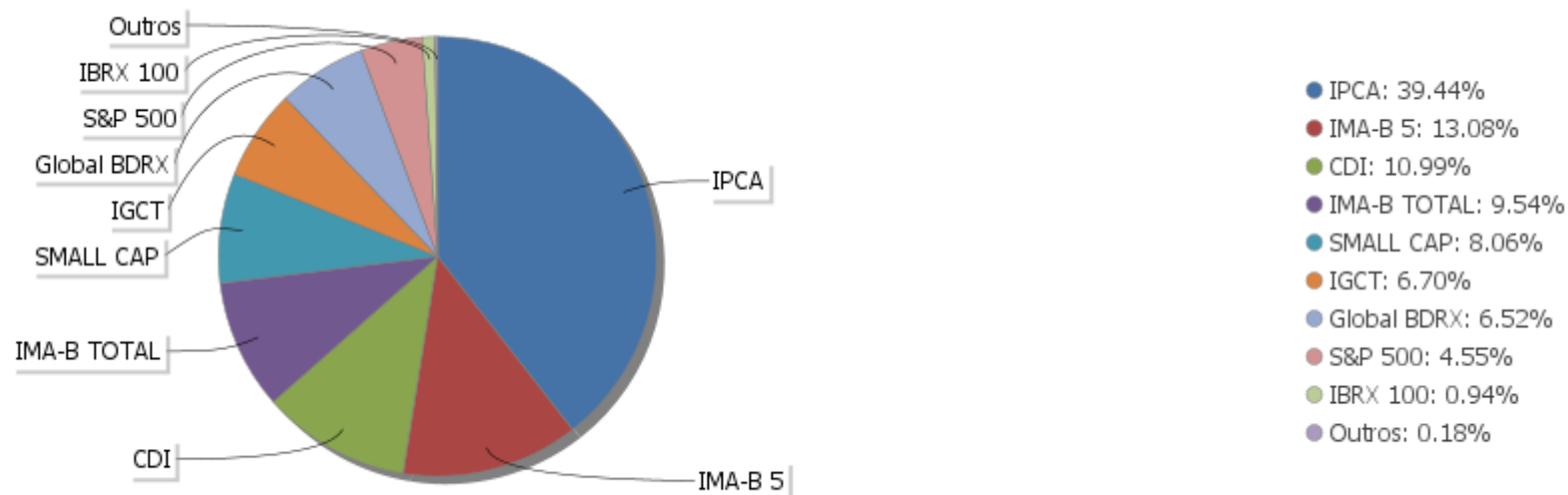
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	184.033.687,59	59,62	184.033.687,59	59,62	
de 31 dias a 365 dias	2.903.579,20	0,94	186.937.266,79	60,56	
acima de 365 dias	121.720.617,45	39,44	308.657.884,24	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

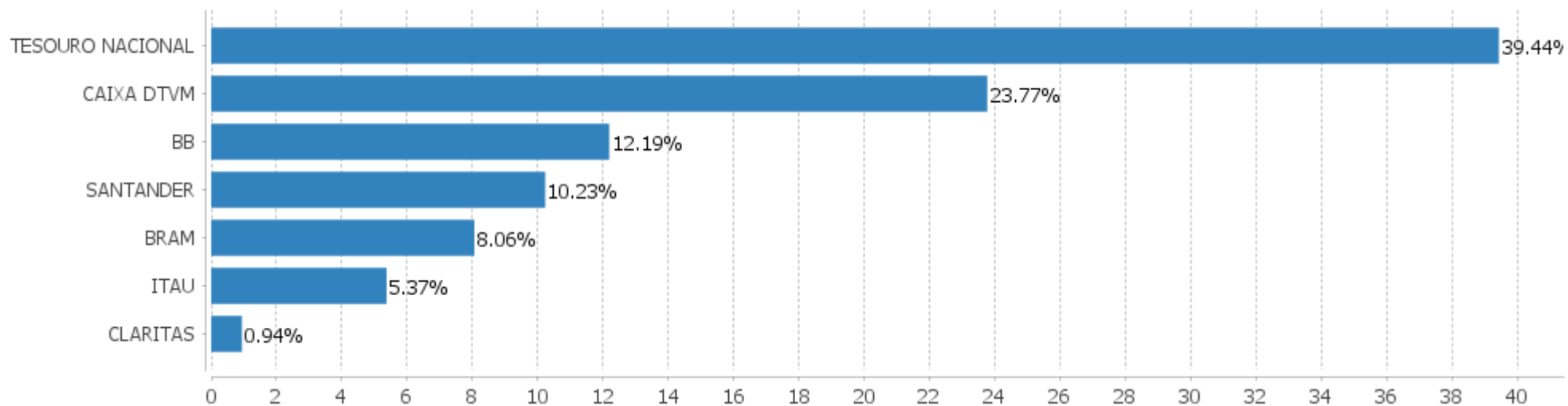


Alocação Por Estratégia



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
2023	1,98	-0,75	0,88	0,98	2,46								5,64
IPCA + 5,01%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,66								5,03
p.p. indexador	1,02	-1,94	-0,28	0,01	1,80								0,61
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	31	47,69
Meses abaixo - Meta Atuarial	34	52,31

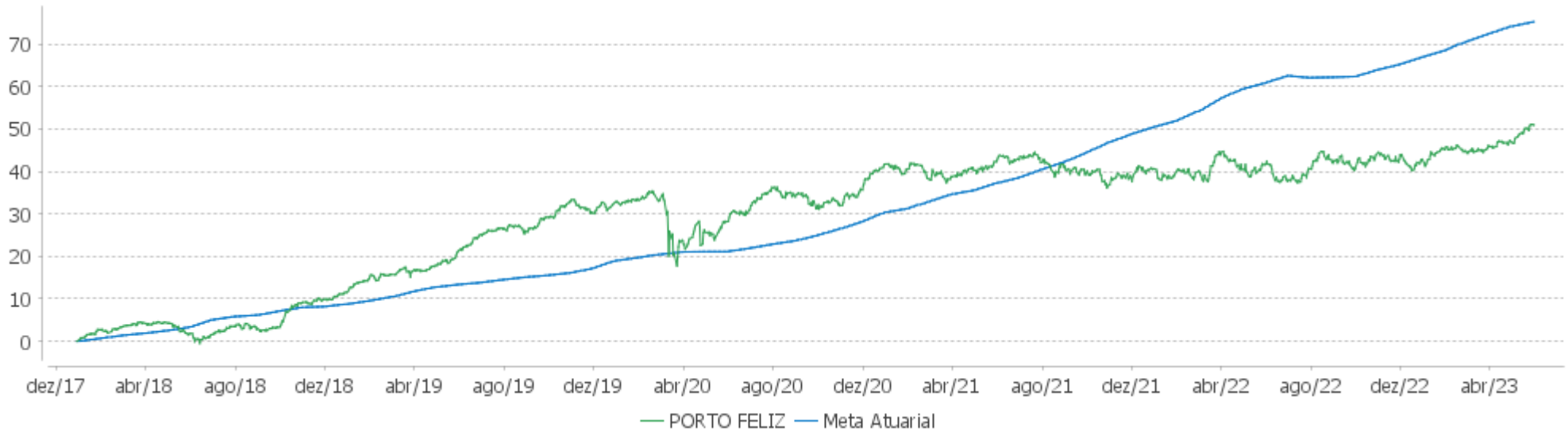
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-7,15	2020-03

Relatório

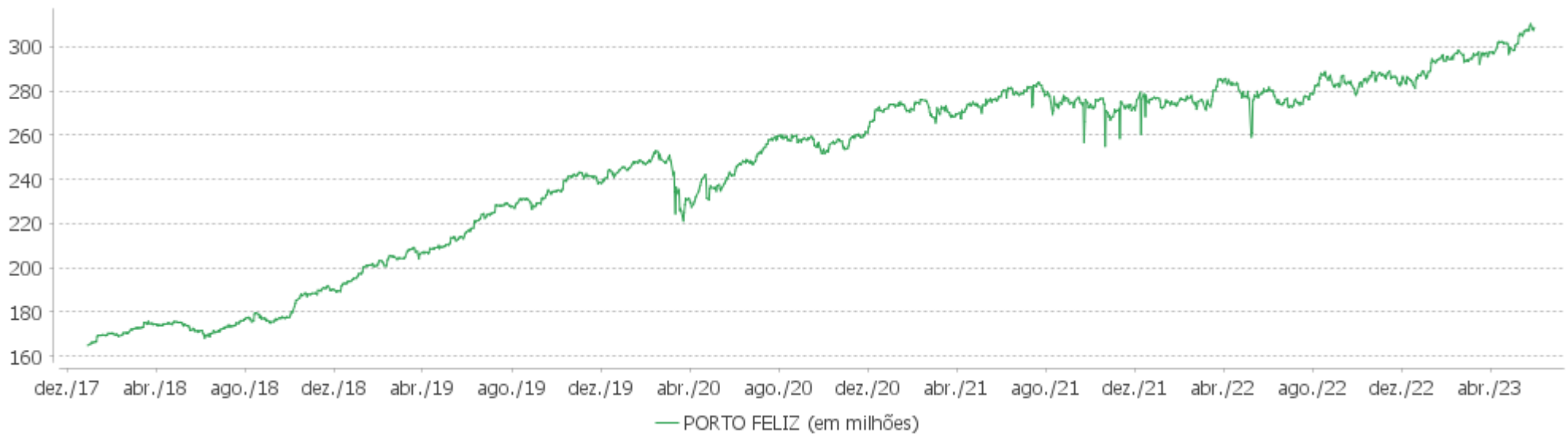
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	4,37	2,81	1,56	3,80
06 meses	4,85	6,12	-1,28	4,41
12 meses	6,46	9,04	-2,58	5,65
24 meses	6,05	28,17	-22,12	6,08
36 meses	17,72	46,34	-28,61	5,95
48 meses	24,45	57,92	-33,46	7,78
60 meses	48,46	75,15	-26,69	7,27
Desde 29/12/2017	50,92	81,75	-30,82	7,05

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

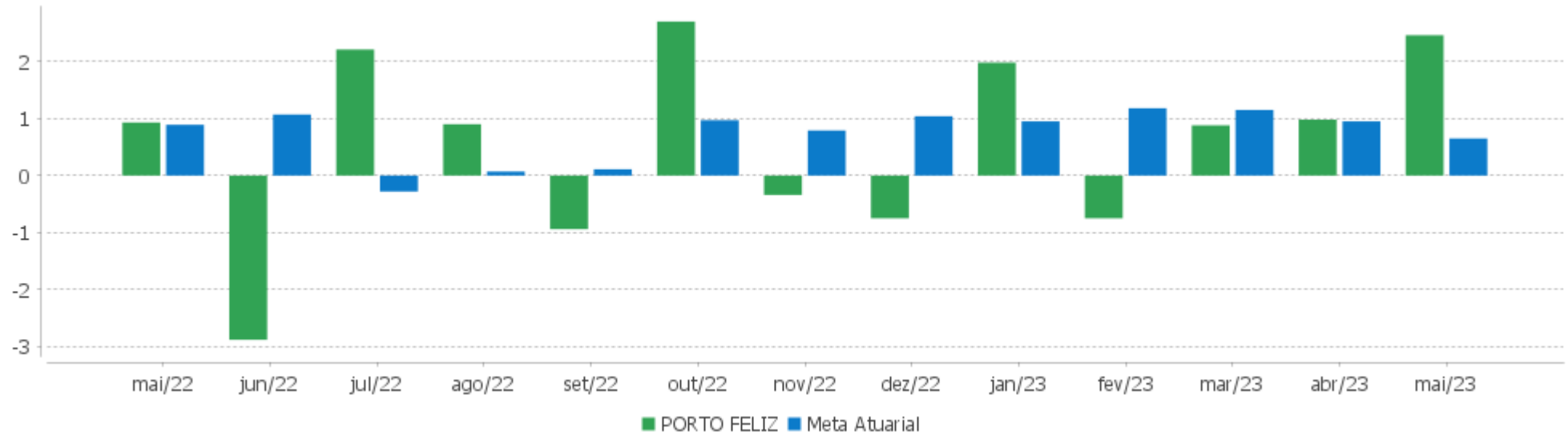


Patrimônio Líquido



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.	4,49 4,26	11,63 8,68	12,78 11,22	9,81 6,21	11,30 7,37	8,63 -7,50	22,31 -3,17
NTN-B 150830 (6,000000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	2,79 -0,16	3,57 2,01	3,69 0,10	4,07 0,13		
NTN-B 150840 (5,120004%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,77	5,47 2,51	3,35 1,80	6,31 2,72	9,39 5,45	25,51 9,38	34,38 8,89
NTN-B 150830 (4,069994%) Var. IPCA p.p.	0,91 0,68	5,03 2,08	3,09 1,54	5,78 2,19	8,30 4,37	26,31 10,18	34,15 8,67
NTN-B 150535 (5,290003%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,79	5,53 2,58	3,39 1,84	6,40 2,80	9,57 5,63	29,28 13,15	38,39 12,90
NTN-B 150535 (5,877000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,83	5,77 2,82	3,54 1,98	6,69 3,10	10,17 6,24	27,02 10,89	36,30 10,82
NTN-B 150840 (5,792100%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,83	5,74 2,79	3,52 1,96	6,65 3,06	10,09 6,15	23,30 7,17	32,30 6,82
NTN-B 150555 (4,689998%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,74	5,29 2,34	3,25 1,69	6,09 2,50	8,94 5,01	27,81 11,69	36,94 11,46
NTN-B 150850 (5,850500%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,83	2,79 -0,16	3,53 1,97	3,68 0,09	4,04 0,11		
NTN-B 150840 (5,481000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,80	5,61 2,66	3,44 1,88	6,49 2,90	9,76 5,83	22,81 6,68	31,65 6,16
NTN-B 150840 (5,171997%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,78	5,49 2,53	3,37 1,81	6,34 2,75	9,44 5,51	25,61 9,48	34,51 9,03
NTN-B 150555 (5,669994%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,82	5,69 2,74	3,49 1,93	6,59 2,99	9,96 6,02	26,65 10,52	35,93 10,44
NTN-B 150830 (5,569998%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,81	5,65 2,70	3,46 1,91	6,54 2,94	9,86 5,92	26,34 10,22	35,34 9,85
NTN-B 150555 (5,900000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,78 2,83	3,54 1,99	6,70 3,11	10,20 6,26	27,09 10,96	36,44 10,95
NTN-B 150535 (4,423526%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,71	5,18 2,23	3,18 1,62	5,96 2,37	8,67 4,74	27,10 10,97	35,51 10,03
NTN-B 150535 (6,051500%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,85	5,85 2,89	3,58 2,02	6,78 3,19	7,18 3,24		
NTN-B 150535 (4,734998%)	0,97	5,31	3,26	6,12	9,00	27,83	36,49

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.	0,74	2,36	1,70	2,53	5,06	11,70	11,01
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,53 0,00	8,69 -0,08	7,37 -0,02	8,43 -0,12	10,29 -0,18	15,07 -0,47	25,33 -0,80
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,63 0,06	5,91 -0,02	3,04 0,02	6,89 -0,04	9,41 -0,03	19,60 -0,30	28,08 -0,68
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,56 -0,01	5,85 -0,08	2,97 -0,05	6,83 -0,10	9,26 -0,18	19,47 -0,42	27,95 -0,81
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,19 0,45	5,87 0,44	3,36 0,31	6,88 0,25	10,46 0,32	21,15 -9,30	30,14 -19,25
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,12 -0,02	5,27 -0,15	3,18 -0,08	6,49 -0,17	13,21 -0,32	20,16 -0,66	22,24 -1,13
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	2,17 -0,02	7,20 -0,14	5,47 -0,07	8,74 -0,19	14,38 -0,35	15,91 -0,66	16,50 -0,90
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,58 0,04	8,70 -0,06	7,35 -0,04	8,46 -0,09	10,27 -0,20	14,95 -0,60	25,18 -0,96
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	1,04 92,96	4,93 91,88	2,98 91,76	6,02 91,84	12,36 91,75	19,92 88,82	21,20 84,44
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	1,19 106,04	5,16 96,19	3,24 99,65	6,36 97,08	13,50 100,16	23,20 103,43	26,17 104,25
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA Var. IBRX 100 p.p.	5,43 1,84	-2,42 -0,34	0,21 -2,15	-4,72 -0,06	-8,57 -4,11	-11,83 4,51	24,43 0,93
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	4,08 -0,12	-2,17 -0,77	2,33 -0,72	-4,74 -0,81	-5,16 -1,27	-18,12 -1,92	19,61 -4,25
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	9,65 -3,89	-2,13 -6,84	3,77 -9,92	-4,69 -6,24	-12,67 -5,33	-28,06 4,18	2,09 -4,80
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	5,80 -0,10	14,00 -0,59	8,47 -0,07	8,53 -1,22	13,81 -0,98	-3,05 -2,88	29,26 -4,63
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	1,21 -0,95	12,31 5,98	7,30 4,28	6,81 8,20	10,60 1,60	16,12 19,29	58,02 29,08
PORTO FELIZ Var. IPCA + 4,88% p.p.	2,46 1,80	5,64 0,61	4,37 1,56	4,85 -1,29	6,46 -2,66	6,05 -21,99	17,72 -27,53
CDI	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10
IBOVESPA	3,74	-1,28	3,24	-3,69	-2,71	-14,17	23,95
INPC + 6,00%	0,87	5,27	3,03	6,53	9,94	30,40	50,49
IPCA + 6,00%	0,74	5,43	3,05	6,63	10,15	30,45	49,38

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	1,14	5,42	3,26	6,67	13,53	20,82	23,37	31,17	40,60
IRF-M 1+	2,85	8,54	6,92	10,30	15,84	14,80	14,48	30,11	50,74
IRF-M TOTAL	2,20	7,34	5,54	8,93	14,73	16,57	17,40	30,67	48,09
IMA-B 5	0,57	5,93	3,02	6,92	9,45	19,90	28,76	40,94	59,58
IMA-B 5+	4,13	11,16	11,29	9,84	11,30	11,03	22,89	28,01	69,69
IMA-B TOTAL	2,53	8,76	7,39	8,55	10,47	15,54	26,13	34,56	66,49
IMA-GERAL TOTAL	1,77	6,78	4,95	7,60	12,55	18,47	23,45	32,82	51,09
IDKA 2	0,29	5,76	2,60	7,07	8,74	18,79	28,85	40,48	57,41
IDKA 20	7,14	15,51	20,12	11,68	12,90	1,60	17,65	14,97	73,96
CDI	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10	31,21	39,57

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,74	-1,28	3,24	-3,69	-2,71	-14,17	23,95	11,65	41,15
IBRX 100	3,59	-2,09	2,36	-4,66	-4,47	-16,34	23,50	12,48	44,21
IBRX 50	2,92	-3,51	0,95	-5,97	-4,44	-15,81	25,71	11,41	38,93
SMALL CAP	13,54	4,71	13,69	1,56	-7,34	-32,24	6,89	5,09	34,10
Índice Consumo - ICON	12,26		6,51	-6,28	-15,80	-46,84	-32,02	-26,79	-9,87
Índice Dividendos - IDIV	0,84	0,48	2,64	-1,14	-0,85	1,55	39,98	32,28	81,33

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	2,16	6,32	3,02	-1,39	9,00	-3,17	28,94	96,40	109,24

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	5,43	5,10	7,30	5,10	6,84	6,99	13,39	18,05	36,10

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,56	4,28	0,55	-1,39	6,70	-11,51	19,15	69,85	72,84

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,23	2,95	1,56	3,59	3,94	16,13	25,48	27,84	33,80
INPC	0,36	2,79	1,54	3,50	3,74	16,08	26,41	29,00	35,17
IGPM	-1,84	-2,58	-2,73	-2,14	-4,47	5,78	44,96	54,39	66,19
SELIC	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10	31,21	39,57

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	4,62	2,56	5,63	8,08	25,59	41,11	49,48	62,68
IPCA + 5,00%	0,66	5,03	2,80	6,13	9,11	28,01	45,21	55,30	70,63
IPCA + 5,50%	0,70	5,23	2,93	6,38	9,63	29,23	47,29	58,27	74,72
IPCA + 5,89%	0,73	5,39	3,02	6,57	10,03	30,18	48,92	60,62	77,96
IPCA + 6,00%	0,74	5,43	3,05	6,63	10,15	30,45	49,38	61,28	78,88
INPC + 4,00%	0,70	4,45	2,54	5,53	7,87	25,54	42,15	50,84	64,35
INPC + 6,00%	0,87	5,27	3,03	6,53	9,94	30,40	50,49	62,75	80,72

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%)	2.792.871,97	4,423526	2.540.811,88	5,552700	-252.060,09
NTN-B 150535 (4,734998%)	10.991.789,61	4,734998	10.270.726,91	5,552700	-721.062,70
NTN-B 150535 (5,290003%)	10.884.646,57	5,290003	10.649.054,23	5,552700	-235.592,34
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.265.333,38	5,877000	5.408.361,01	5,552700	143.027,63
NTN-B 150535 (6,051500%)	1.559.608,34	6,051500	1.625.087,81	5,552700	65.479,47
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.822.026,03	4,689998	2.423.098,08	5,722200	-398.927,95
NTN-B 150555 (5,669994%)	10.672.199,81	5,669994	10.593.508,86	5,722200	-78.690,95
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.269.179,01	5,900000	5.402.387,71	5,722200	133.208,70
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.610.344,82	4,069994	5.189.995,36	5,450000	-420.349,46
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.635.273,12	5,569998	1.646.242,27	5,450000	10.969,15
NTN-B 150830 (6,000000%)	1.521.107,12	6,000000	1.568.262,37	5,450000	47.155,25
NTN-B 150840 (5,120004%)	10.886.156,81	5,120004	10.271.966,75	5,674600	-614.190,06
NTN-B 150840 (5,171997%)	11.060.083,67	5,171997	10.493.663,89	5,674600	-566.419,78
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.340.157,35	5,481000	5.233.790,94	5,674600	-106.366,41
NTN-B 150840 (5,792100%)	20.970.479,74	5,792100	21.226.412,90	5,674600	255.933,16
NTN-B 150850 (5,850500%)	4.854.533,41	5,850500	4.933.751,25	5,726200	79.217,84

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
56	02/05/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	100.000,00	0,00	30.715,88143200	3,2556448110
57	08/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	134.915,21	0,00	53.355,35493800	2,5286161090
58	10/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.752.256,94	0,00	1.087.413,12647900	2,5310131660
59	11/05/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	116.000,00	0,00	35.505,91635800	3,2670611520
60	16/05/2023	BB PREV RF IPCA	0,00	3.283.072,08	1.083.737,93658922	3,0293966550
61	16/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.939.474,80	0,00	1.947.809,42951800	2,5359127670
62	17/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.033.000,00	1.589.621,67015700	2,5370816690
63	17/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	4.033.000,00	0,00	17.409,82766572	231,6507709000
64	18/05/2023	NTN-B 150850 (5,850500%)	4.838.423,23	0,00	1.132,00000000	4.274,2254670000
65	18/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.838.423,23	1.906.207,06202700	2,5382464090
66	18/05/2023	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	0,00	1.032.358,96	113.664,44779640	9,0825142000
67	23/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.032.412,06	0,00	406.188,29275100	2,5417080660
68	25/05/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	29.539,46	8.995,07049100	3,2839609240
69	29/05/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	89.000,00	27.077,53789200	3,2868571860
70	29/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.514.517,10	10.806,83607479	232,6783790000
71	30/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	39.608,85	0,00	15.546,48704100	2,5477685020
72	31/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.159.055,82	0,00	454.712,40681300	2,5489865740
Total			19.145.146,91	15.819.910,83		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.575.015,61

Value-At-Risk: 1,81%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PORTO FELIZ		1,81	1,81			308.657.884,24	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,55%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545		3,94	0,06	3,94			9.584.826,69	3,11
NTN-B 150535 (4,423526%)		0,24	-0,00	0,25			2.792.871,97	0,90
NTN-B 150535 (4,734998%)		0,32	-0,00	0,32			10.991.789,61	3,56
NTN-B 150535 (5,290003%)		0,07	-0,00	0,10			10.884.646,57	3,53
NTN-B 150535 (5,877000%)		0,07	-0,00	0,10			5.265.333,38	1,71
NTN-B 150535 (6,051500%)		0,07	-0,00	0,10			1.559.608,34	0,51
NTN-B 150555 (4,689998%)		0,07	-0,00	0,10			2.822.026,03	0,91
NTN-B 150555 (5,669994%)		0,07	-0,00	0,10			10.672.199,81	3,46
NTN-B 150555 (5,900000%)		0,07	-0,00	0,10			5.269.179,01	1,71
NTN-B 150830 (4,069994%)		0,07	-0,00	0,10			5.610.344,82	1,82
NTN-B 150830 (5,569998%)		0,07	-0,00	0,10			1.635.273,12	0,53
NTN-B 150830 (6,000000%)		0,20	-0,00	0,23			1.521.107,12	0,49
NTN-B 150840 (5,120004%)		0,07	-0,00	0,10			10.886.156,81	3,53
NTN-B 150840 (5,171997%)		0,07	-0,00	0,10			11.060.083,67	3,58
NTN-B 150840 (5,481000%)		0,07	-0,00	0,10			5.340.157,35	1,73
NTN-B 150840 (5,792100%)		0,07	-0,00	0,10			20.970.479,74	6,79
NTN-B 150850 (5,850500%)		0,20	-0,00	0,22			4.854.533,41	1,57
Sub-total	0,62	0,33	0,05		0,28	1,29	121.720.617,45	39,44

Artigo 7º I, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF M		1,39	0,00	0,02			253.201,09	0,08
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI		0,87	0,02	0,01			16.586.172,13	5,37
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,22	0,00	0,01			317.090,12	0,10
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,94	0,04	0,03			14.035.246,18	4,55
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,96	0,05	0,04			15.412.491,87	4,99
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,86	0,02	0,03			23.783.883,39	7,71
BB PREV RF IPCA		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
Sub-total	1,85	1,25	0,13		0,15	1,40	70.388.084,78	22,80

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			2.338.583,88	0,76
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,07	0,00	0,07			31.585.785,87	10,23
Sub-total	0,05	0,06	0,00		1,25	1,18	33.924.369,75	10,99

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,23%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA		8,84	0,07	2,91			2.903.579,20	0,94
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		10,57	0,77	3,33			24.868.103,59	8,06
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		8,24	0,48	0,18			20.680.104,64	6,70
Sub-total	18,91	9,23	1,32		0,31	6,97	48.451.787,43	15,70

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,57%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		7,57	0,10	0,61			20.118.740,19	6,52
Sub-total	17,30	7,57	0,10		0,27	5,80	20.118.740,19	6,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,50%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		7,50	0,19	6,11			14.054.284,64	4,55
Sub-total	12,71	7,50	0,19		0,01	1,21	14.054.284,64	4,55