



LDB
EMPRESAS

PORTO FELIZ
DEZEMBRO 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 29.12.2023.

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

77,16%

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	7,83	0,10	3,91	20,61	10.067.943,65	2,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,423526%)	0,43	0,15	0,83	9,40	2.831.446,68	0,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,734998%)	0,49	0,13	0,86	9,73	11.156.313,50	3,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290003%)	0,36	0,22	0,91	10,31	11.069.014,50	3,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,635000%)	4,02	0,23	0,94	1,27	1.691.165,04	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,640000%)	4,02	0,17	0,85	0,85	1.715.596,52	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,877000%)	0,37	0,23	0,97	10,93	5.365.371,35	1,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,051500%)	0,37	0,24	0,98	11,12	1.590.178,01	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (4,689998%)	0,41	0,30	0,95	9,79	2.872.593,41	0,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,669994%)	0,43	0,33	1,05	10,83	10.884.781,53	3,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,900000%)	0,44	0,34	1,07	11,07	5.376.368,07	1,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,069994%)	0,34	0,16	0,76	8,99	5.671.200,19	1,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,569998%)	0,35	0,19	0,90	10,57	1.663.397,29	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,000000%)	2,94	0,20	0,94	7,67	1.549.976,07	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,120004%)	0,38	0,25	0,92	10,17	11.073.441,98	3,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,171997%)	0,38	0,25	0,93	10,22	11.252.084,72	3,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,481000%)	0,38	0,26	0,96	10,55	5.437.739,70	1,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,792100%)	0,39	0,26	0,99	10,88	21.372.470,46	6,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,582500%)	2,79	0,26	0,97	4,38	1.031.810,08	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,850500%)	2,89	0,32	1,05	5,30	4.951.788,59	1,45
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,74	0,23	1,17	11,18	128.624.681,34	37,72

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				
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	6,28	0,04	2,16	5,34	16.117.049,00	4,73	253.855.773,11	6,35
BB	BB	BB PREV RF IRF M	2,64	0,04	1,46	16,06	6.938.829,19	2,03	4.067.997.534,34	0,17
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	1,96	0,10	1,44	11,92	17.536.998,41	5,14	1.486.929.750,98	1,18
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,36	0,04	0,89	12,88	336.370,75	0,10	7.852.193.725,16	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,45	0,09	2,74	15,77	28.213.271,95	8,27	5.283.374.941,87	0,53
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,45	0,10	2,73	15,86	16.429.424,32	4,82	5.157.397.073,53	0,32
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,96	0,10	1,44	11,96	29.197.975,37	8,56	7.603.591.100,02	0,38
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,01	0,08	2,04	13,75	114.769.918,99	33,66		

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	0,04	0,04	0,82	11,55	4.398.146,94	1,29	4.049.178.389,19	0,11
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,10	0,04	0,94	13,34	15.340.841,26	4,50	2.799.591.858,55	0,55
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,09	0,04	0,92	13,22	19.738.988,20	5,79		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

1,45

0,15

1,52

12,33

263.133.588,53

77,16

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

16,18%

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	18,98	-0,00	5,35	16,34	3.461.829,00	1,02	790.982.185,39	0,44
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	21,66	-0,01	5,76	3,50	26.298.574,88	7,71	751.899.438,06	3,50
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	17,15	-0,00	5,52	20,23	25.415.292,48	7,45	783.566.811,58	3,24
Sub-total Artigo 8º I			18,96	-0,01	5,62	11,37	55.175.696,36	16,18		
Renda Variável			18,96	-0,01	5,62	11,37	55.175.696,36	16,18		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,36%

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	15,18	-0,00	2,40	24,31	11.456.408,61	3,36	1.995.875.754,00	0,57
Sub-total Artigo 9º III			15,18	-0,00	2,40	24,31	11.456.408,61	3,36		
Investimentos no Exterior			15,18	-0,00	2,40	24,31	11.456.408,61	3,36		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,30%

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	13,23	0,04	5,19	34,12	11.252.922,87	3,30	1.635.814.462,49	0,69
Sub-total Artigo 10º I			13,23	0,04	5,19	34,12	11.252.922,87	3,30		
Investimentos Estruturados			13,17	0,04	5,19	34,12	11.252.922,87	3,30		
Total			4,02	0,12	2,32	13,77	341.018.616,37	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	128.624.681,34	37,72	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	114.769.918,99	33,66	0,00	24,51	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	19.738.988,20	5,79	0,00	5,49	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	263.133.588,53	77,16					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	55.175.696,36	16,18	0,00	10,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	55.175.696,36	16,18					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	11.456.408,61	3,36	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	11.456.408,61	3,36					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	11.252.922,87	3,30	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	11.252.922,87	3,30					15,00
Total		341.018.616,37	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	1,17 130,88	11,18 85,66	2,64 92,91	4,14 67,38	11,18 85,66	1.490.088,49	12.647.796,50
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	2,04 227,79	13,75 105,39	4,13 145,60	4,69 76,20	13,75 105,39	2.232.317,62	10.445.355,62
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,92 102,38	13,22 101,34	2,88 101,48	6,46 105,09	13,22 101,34	197.118,36	3.473.778,90
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,62 0,24	11,37 -10,91	12,06 -3,06	5,82 -7,81	11,37 -10,91	2.938.046,51	5.600.325,11
Artigo 9º III % do CDI	2,40 268,04	24,31 186,35	7,12 251,01	8,54 138,92	24,31 186,35	329.988,95	3.990.114,36
Artigo 10º I % do CDI	5,19 579,10	34,12 261,49	12,99 457,71	10,99 178,73	34,12 261,49	555.265,40	4.374.297,87
PORTO FELIZ (Total)						7.742.825,33	40.531.668,36

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%)	2.808.262,42	0,00	0,00	0,00	2.831.446,68	23.184,26	252.115,25
NTN-B 150535 (4,734998%)	11.061.583,40	0,00	0,00	0,00	11.156.313,50	94.730,10	1.026.169,38
NTN-B 150535 (5,290003%)	10.969.246,04	0,00	0,00	0,00	11.069.014,50	99.768,46	1.074.405,20
NTN-B 150535 (5,635000%)	1.675.367,99	0,00	0,00	0,00	1.691.165,04	15.797,05	21.226,93
NTN-B 150535 (5,640000%)	0,00	1.701.139,13	0,00	0,00	1.715.596,52	14.457,39	14.457,39
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.314.026,65	0,00	0,00	0,00	5.365.371,35	51.344,70	549.901,60
NTN-B 150535 (6,051500%)	1.574.699,77	0,00	0,00	0,00	1.590.178,01	15.478,24	165.533,41
NTN-B 150545	9.689.497,64	0,00	0,00	0,00	10.067.943,65	378.446,01	1.782.443,60
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.845.532,87	0,00	0,00	0,00	2.872.593,41	27.060,54	264.601,57
NTN-B 150555 (5,669994%)	10.771.535,15	0,00	0,00	0,00	10.884.781,53	113.246,38	1.104.149,04
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.319.234,68	0,00	0,00	0,00	5.376.368,07	57.133,39	557.069,90
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.628.486,18	0,00	0,00	0,00	5.671.200,19	42.714,01	478.034,97

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.648.618,36	0,00	0,00	0,00	1.663.397,29	14.778,93	162.699,71
NTN-B 150830 (6,000000%)	1.535.609,98	0,00	0,00	0,00	1.549.976,07	14.366,09	112.114,93
NTN-B 150840 (5,120004%)	10.972.127,65	0,00	0,00	0,00	11.073.441,98	101.314,33	1.044.337,12
NTN-B 150840 (5,171997%)	11.148.557,20	0,00	0,00	0,00	11.252.084,72	103.527,52	1.066.516,29
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.386.056,87	0,00	0,00	0,00	5.437.739,70	51.682,83	530.713,59
NTN-B 150840 (5,792100%)	21.162.857,84	0,00	0,00	0,00	21.372.470,46	209.612,62	2.146.208,14
NTN-B 150850 (5,582500%)	1.021.918,05	0,00	0,00	0,00	1.031.810,08	9.892,03	43.530,45
NTN-B 150850 (5,850500%)	4.900.234,98	0,00	0,00	0,00	4.951.788,59	51.553,61	251.568,03
	125.433.453,72	1.701.139,13	0,00	0,00	128.624.681,34	1.490.088,49	

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	27.459.902,95	0,00	0,00	0,00	28.213.271,95	753.369,00	2.444.441,33
BB PREV RF IRF M	2.854.199,47	4.000.000,00	0,00	0,00	6.938.829,19	84.629,72	202.635,40
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	376.341,23	100.000,00	-143.217,42	0,00	336.370,75	3.246,94	90.953,60
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	24.786.644,14	4.000.000,00	0,00	0,00	29.197.975,37	411.331,23	2.741.528,82
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.993.351,20	0,00	0,00	0,00	16.429.424,32	436.073,12	2.248.680,13
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	12.479.820,97	3.343.304,12	0,00	0,00	16.117.049,00	293.923,91	684.792,06
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	17.287.254,71	0,00	0,00	0,00	17.536.998,41	249.743,70	1.867.241,85
	101.237.514,67	11.443.304,12	-143.217,42	0,00	114.769.918,99	2.232.317,62	

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	5.293.489,62	6.124.082,10	-7.055.888,11	0,00	4.398.146,94	36.463,33	236.441,83
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	18.958.589,69	0,00	-3.778.403,46	0,00	15.340.841,26	160.655,03	3.237.337,07
	24.252.079,31	6.124.082,10	-10.834.291,57	0,00	19.738.988,20	197.118,36	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	24.085.809,36	0,00	0,00	0,00	25.415.292,48	1.329.483,12	4.275.867,98
BRANCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	24.865.903,56	0,00	0,00	0,00	26.298.574,88	1.432.671,32	838.362,67
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	3.285.936,93	0,00	0,00	0,00	3.461.829,00	175.892,07	486.094,46
	52.237.649,85	0,00	0,00	0,00	55.175.696,36	2.938.046,51	

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	13.176.917,92	0,00	-2.050.498,26	0,00	11.456.408,61	329.988,95	3.990.114,36
	13.176.917,92	0,00	-2.050.498,26	0,00	11.456.408,61	329.988,95	

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	10.697.657,47	0,00	0,00	0,00	11.252.922,87	555.265,40	4.374.297,87
	10.697.657,47	0,00	0,00	0,00	11.252.922,87	555.265,40	

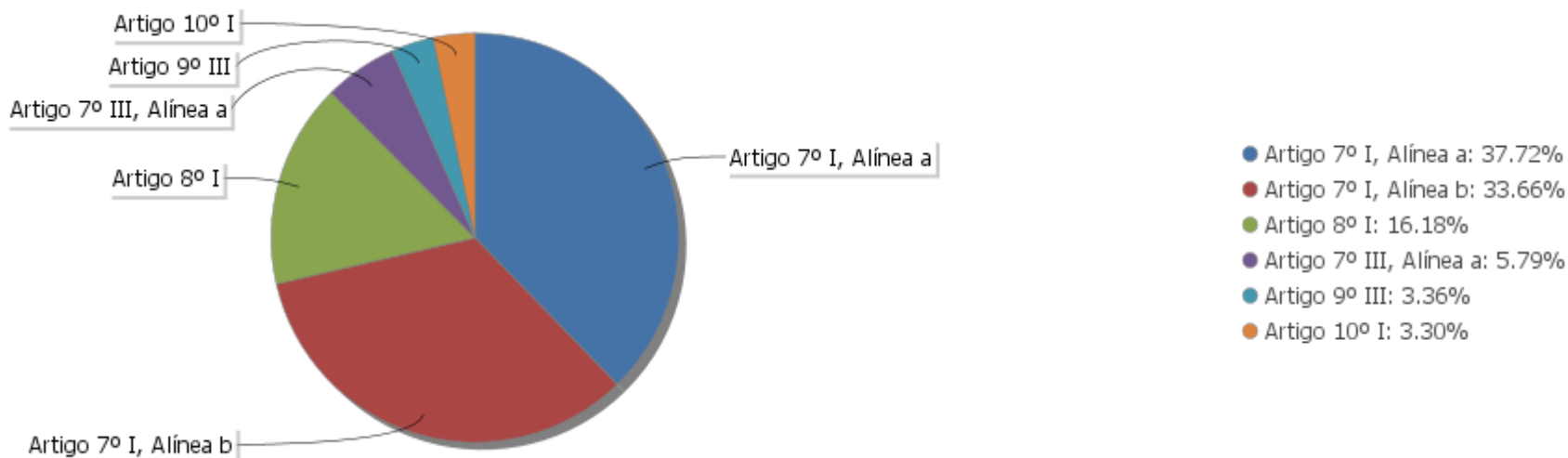
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

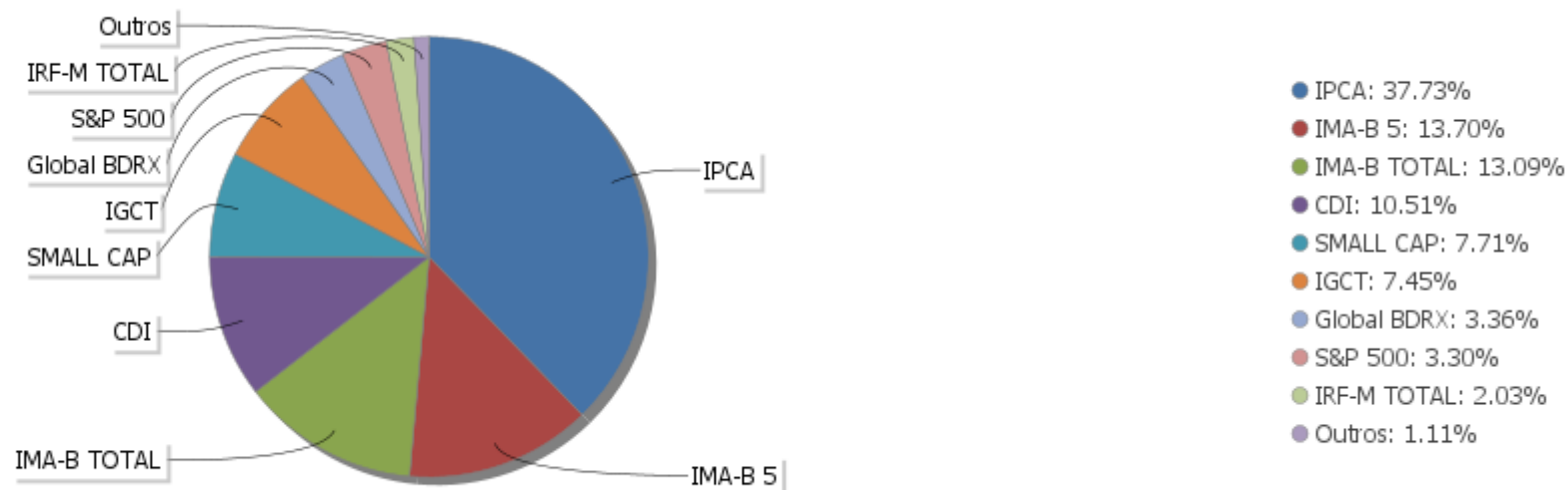
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	208.932.106,03	61,27	208.932.106,03	61,27	
de 31 dias a 365 dias	3.461.829,00	1,02	212.393.935,03	62,28	
acima de 365 dias	128.624.681,34	37,72	341.018.616,37	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

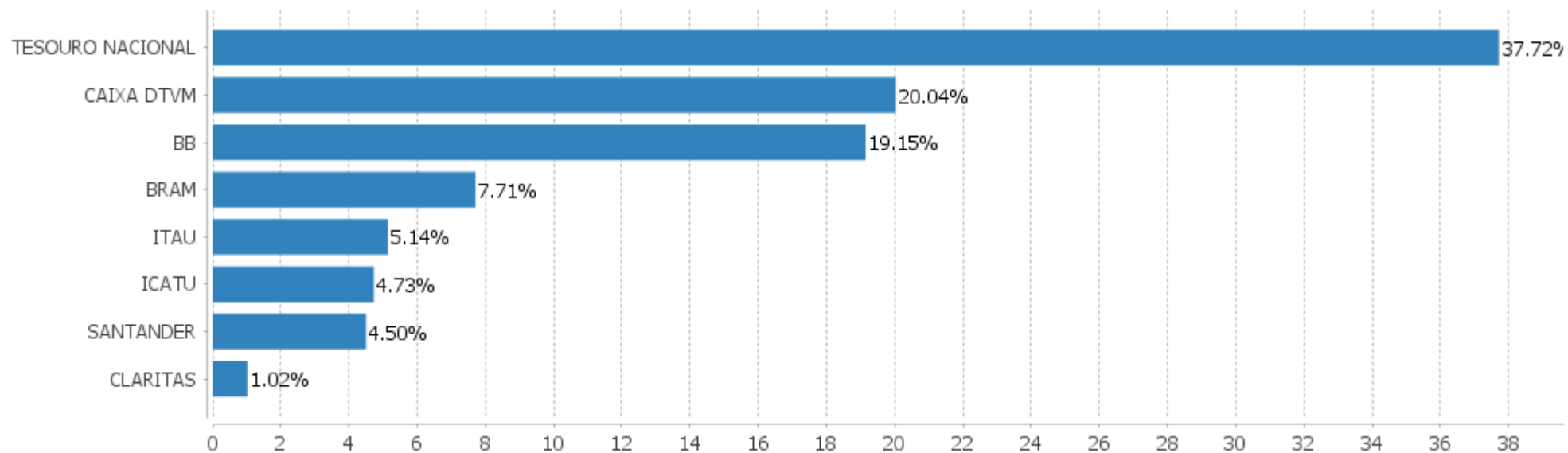


Alocação Por Estratégia



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	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

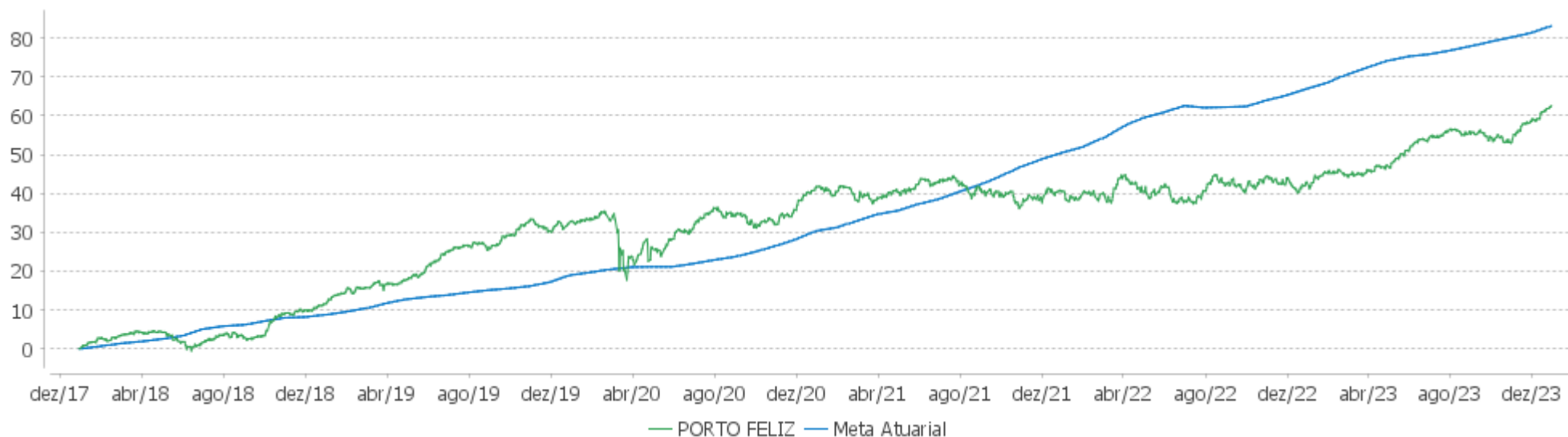
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	35	48,61
Meses abaixo - Meta Atuarial	37	51,39
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-7,15	2020-03

Relatório

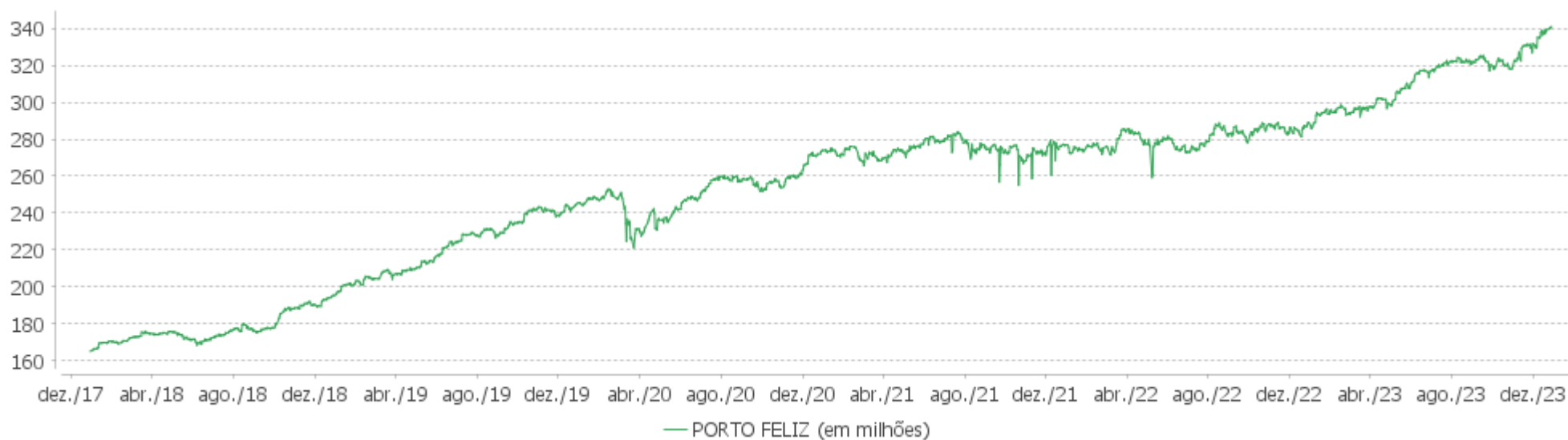
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	5,13	2,29	2,84	4,37
06 meses	5,27	4,20	1,07	3,98
12 meses	13,77	9,80	3,97	4,02
24 meses	15,59	21,80	-6,21	5,56
36 meses	14,67	41,29	-26,61	5,63
48 meses	22,36	56,30	-33,94	7,79
60 meses	45,72	72,85	-27,14	7,19
Desde 29/12/2017	62,54	90,00	-27,46	6,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

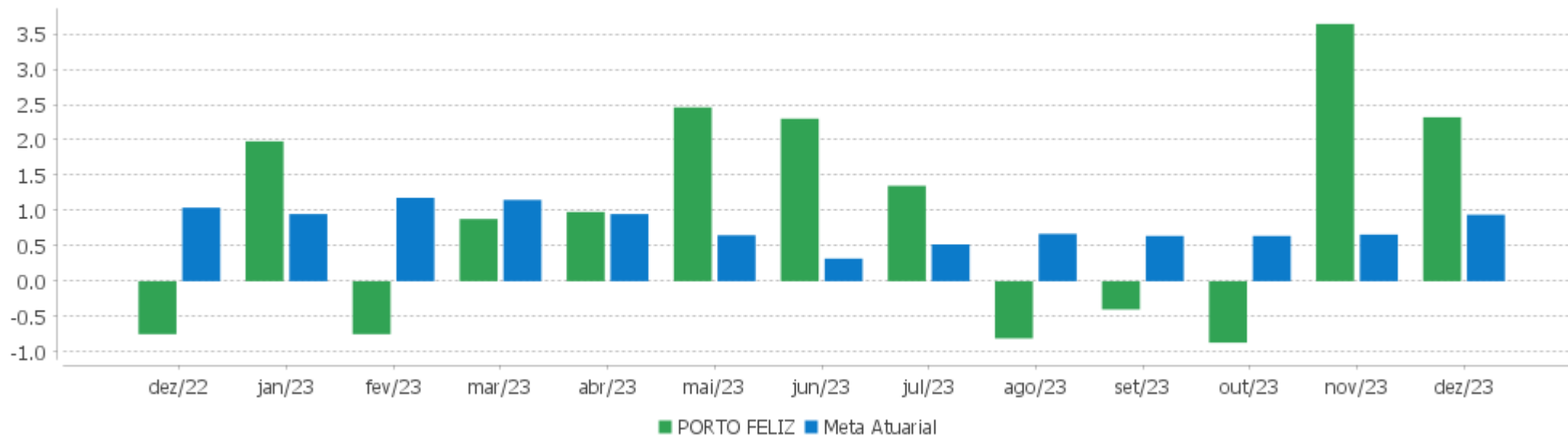


Patrimônio Líquido



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.	3,91 3,35	20,61 15,99	6,72 5,63	4,12 2,42	20,61 15,99	24,11 13,44	14,69 -7,12
NTN-B 150830 (6,000000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,38	7,84 3,21	2,39 1,31	4,41 2,71	7,84 3,21	14,06 3,39	
NTN-B 150840 (5,120004%) Var. IPCA p.p.	0,92 0,36	10,17 5,55	2,24 1,15	4,04 2,33	10,17 5,55	22,48 11,81	34,82 13,01
NTN-B 150830 (4,069994%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,20	8,99 4,37	1,91 0,82	3,43 1,73	8,99 4,37	19,97 9,29	34,35 12,55
NTN-B 150535 (5,640000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,33	4,54 -0,08	-0,57 -1,65	1,31 -0,39	4,54 -0,08		
NTN-B 150535 (5,290003%) Var. IPCA p.p.	0,91 0,35	10,31 5,69	2,25 1,17	4,09 2,39	10,31 5,69	22,84 12,17	38,92 17,12
NTN-B 150535 (5,877000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,41	10,93 6,31	2,40 1,32	4,39 2,69	10,93 6,31	24,22 13,55	37,05 15,24
NTN-B 150840 (5,792100%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,43	10,88 6,26	2,41 1,33	4,38 2,68	10,88 6,26	20,58 9,91	33,02 11,21
NTN-B 150850 (5,850500%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,49	7,89 3,26	2,48 1,40	4,47 2,77	7,89 3,26	14,09 3,41	
NTN-B 150555 (4,689998%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,39	9,79 5,17	2,20 1,11	3,89 2,19	9,79 5,17	21,56 10,89	37,15 15,34
NTN-B 150840 (5,481000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,40	10,55 5,93	2,33 1,25	4,22 2,52	10,55 5,93	19,99 9,31	32,23 10,42
NTN-B 150535 (5,635000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,38	4,60 -0,02	-0,51 -1,60	1,36 -0,34	4,60 -0,02		
NTN-B 150830 (5,569998%) Var. IPCA p.p.	0,90 0,34	10,57 5,94	2,28 1,20	4,19 2,49	10,57 5,94	23,45 12,78	35,95 14,14
NTN-B 150840 (5,171997%) Var. IPCA p.p.	0,93 0,37	10,22 5,60	2,25 1,17	4,06 2,36	10,22 5,60	22,61 11,93	34,97 13,17
NTN-B 150555 (5,669994%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,49	10,83 6,21	2,46 1,37	4,39 2,69	10,83 6,21	23,86 13,19	36,67 14,86
NTN-B 150850 (5,582500%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,41	7,65 3,03	2,36 1,27	4,27 2,57	7,65 3,03		
NTN-B 150555 (5,900000%)	1,07	11,07	2,51	4,51	11,07	24,41	37,31

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.	0,51	6,45	1,43	2,81	6,45	13,73	15,51
NTN-B 150535 (4,734998%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,30	9,73 5,11	2,11 1,03	3,81 2,11	9,73 5,11	21,46 10,79	36,82 15,02
NTN-B 150535 (6,051500%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,42	11,12 6,50	2,45 1,36	4,48 2,78	11,12 6,50	17,56 6,89	
NTN-B 150535 (4,423526%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,27	9,40 4,78	2,03 0,95	3,65 1,95	9,40 4,78	20,76 10,09	35,74 13,93
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,73 -0,02	15,86 -0,20	4,71 -0,05	4,15 -0,06	15,86 -0,20	23,03 -0,41	21,15 -0,73
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,44 -0,02	11,96 -0,16	2,92 -0,05	4,64 -0,11	11,96 -0,16	22,79 -0,30	28,09 -0,63
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,44 -0,02	11,92 -0,21	2,92 -0,05	4,65 -0,10	11,92 -0,21	22,66 -0,43	28,00 -0,72
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,89 -0,03	12,88 -0,36	2,80 -0,09	6,00 -0,16	12,88 -0,36	26,12 -0,73	29,46 -1,12
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,46 -0,02	16,06 -0,45	4,33 -0,05	6,05 -0,24	16,06 -0,45	26,02 -0,77	23,15 -1,12
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,74 -0,01	15,77 -0,28	4,71 -0,04	4,04 -0,17	15,77 -0,28	22,83 -0,62	20,97 -0,92
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP % do CDI	2,16 241,02	20,89 160,08	6,59 232,35	6,57 106,82	20,89 160,08	26,24 97,05	14,43 44,24
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,82 91,56	11,93 91,44	2,58 90,82	5,62 91,31	11,93 91,44	24,53 90,75	28,60 87,69
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,94 105,16	13,34 102,25	2,93 103,08	6,55 106,52	13,34 102,25	27,93 103,31	34,33 105,25
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA Var. IBRX 100 p.p.	5,35 -0,13	16,34 -4,94	11,17 -3,78	10,08 -3,69	16,34 -4,94	26,02 -0,13	16,90 4,85
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	5,52 -0,16	20,23 -2,01	14,07 -0,43	12,88 -0,82	20,23 -2,01	23,14 -3,41	8,94 -3,93
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	5,76 -1,29	3,50 -13,62	10,29 -1,19	-0,68 -4,09	3,50 -13,62	-5,04 -4,52	-14,38 2,25
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	2,59 -0,25	24,92 -1,41	7,65 -0,12	9,07 -0,65	24,92 -1,41	-10,73 -1,62	16,51 -4,97
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	5,19 2,76	33,22 17,95	12,99 5,45	10,86 3,19	33,22 17,95	17,27 30,45	55,76 37,46
PORTO FELIZ	2,32	13,77	5,13	5,27	13,77	15,59	14,67

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 4,88% p.p.	1,37	3,97	2,84	1,07	3,97	-6,36	-26,24
CDI	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62
IBOVESPA	5,38	22,28	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74
INPC + 6,00%	1,02	9,85	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97
IPCA + 6,00%	1,03	10,82	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91

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
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
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
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	0,91	13,25	2,89	6,16	13,25	26,86	30,57	35,59	44,75
IRF-M 1+	1,73	18,52	5,05	6,37	18,52	27,30	20,95	31,18	49,86
IRF-M TOTAL	1,48	16,51	4,38	6,28	16,51	26,79	24,26	32,58	48,53
IMA-B 5	1,46	12,13	2,97	4,75	12,13	23,09	28,71	39,06	57,35
IMA-B 5+	3,94	19,28	6,42	3,80	19,28	23,21	15,14	21,47	58,36
IMA-B TOTAL	2,75	16,05	4,76	4,21	16,05	23,45	21,89	29,69	59,46
IMA-GERAL TOTAL	1,63	14,80	3,81	5,67	14,80	25,89	27,10	33,88	51,04
IDKA 2	1,45	12,13	2,89	5,00	12,13	22,60	28,70	39,79	56,32
IDKA 20	6,58	27,13	10,28	3,92	27,13	24,70	6,62	8,97	57,20
CDI	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,38	22,28	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74	16,03	52,68
IBRX 100	5,48	21,27	14,95	13,77	21,27	26,15	12,05	15,97	54,69
IBRX 50	5,31	20,06	14,43	14,39	20,06	26,93	13,55	17,66	51,96
SMALL CAP	7,05	17,12	11,48	3,40	17,12	-0,52	-16,63	-17,18	31,02
Índice Consumo - ICON	5,98	6,98	12,32	-1,29	6,98	-20,15	-40,99	-40,51	-7,65
Índice Dividendos - IDIV	6,90	26,84	14,61	16,04	26,84	42,88	33,72	32,38	92,17

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	2,43	15,27	7,54	7,67	15,27	-13,18	18,31	77,33	137,73

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,25	15,50	2,86	4,95	15,50	18,06	15,37	3,56	40,82

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,70	11,43	7,01	6,95	11,43	-16,44	4,80	54,48	99,34

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	4,62	1,08	1,70	4,62	10,67	21,81	27,31	32,79
INPC	0,55	3,71	0,77	0,99	3,71	9,86	21,02	27,61	33,33
IGPM	0,74	-3,18	1,84	1,34	-3,18	2,10	20,25	48,08	58,89
SELIC	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	8,75	2,05	3,70	8,75	19,63	36,91	48,80	61,44
IPCA + 5,00%	0,95	9,79	2,28	4,19	9,79	21,92	40,87	54,57	69,32
IPCA + 5,50%	0,99	10,30	2,40	4,44	10,30	23,08	42,88	57,51	73,37
IPCA + 5,89%	1,02	10,71	2,49	4,63	10,71	23,98	44,46	59,84	76,59
IPCA + 6,00%	1,03	10,82	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91	60,50	77,50
INPC + 4,00%	0,86	7,80	1,73	2,98	7,80	18,75	36,03	49,15	62,09
INPC + 6,00%	1,02	9,85	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97	60,89	78,22

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%)	2.831.446,68	4,423526	2.629.874,42	5,342800	-201.572,26
NTN-B 150535 (4,734998%)	11.156.313,50	4,734998	10.630.744,52	5,342800	-525.568,98
NTN-B 150535 (5,290003%)	11.069.014,50	5,290003	11.022.333,26	5,342800	-46.681,24
NTN-B 150535 (5,635000%)	1.691.165,04	5,635000	1.731.000,26	5,342800	39.835,22
NTN-B 150535 (5,640000%)	1.715.596,52	5,640000	1.757.699,49	5,342800	42.102,97
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.365.371,35	5,877000	5.597.939,14	5,342800	232.567,79
NTN-B 150535 (6,051500%)	1.590.178,01	6,051500	1.682.051,66	5,342800	91.873,65
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.872.593,41	4,689998	2.560.254,56	5,472400	-312.338,85
NTN-B 150555 (5,669994%)	10.884.781,53	5,669994	11.193.141,36	5,472400	308.359,83
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.376.368,07	5,900000	5.708.183,20	5,472400	331.815,13
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.671.200,19	4,069994	5.339.858,52	5,220000	-331.341,67
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.663.397,29	5,569998	1.693.778,16	5,220000	30.380,87
NTN-B 150830 (6,000000%)	1.549.976,07	6,000000	1.613.546,57	5,220000	63.570,50
NTN-B 150840 (5,120004%)	11.073.441,98	5,120004	10.780.327,78	5,381900	-293.114,20
NTN-B 150840 (5,171997%)	11.252.084,72	5,171997	11.012.996,74	5,381900	-239.087,98
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.437.739,70	5,481000	5.492.811,96	5,381900	55.072,26
NTN-B 150840 (5,792100%)	21.372.470,46	5,792100	22.276.910,96	5,381900	904.440,50
NTN-B 150850 (5,582500%)	1.031.810,08	5,582500	1.047.423,18	5,471800	15.613,10
NTN-B 150850 (5,850500%)	4.951.788,59	5,850500	5.200.364,23	5,471800	248.575,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
190	01/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.627.245,80	603.126,80743100	2,6980160390
199	01/12/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.000.000,00	0,00	980.441,89987000	4,0797930000
205	01/12/2023	NTN-B 150535 (5,640000%)	1.701.139,13	0,00	395,00000000	4.306,6813490000
197	05/12/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	38.833,50	11.091,31082900	3,5012543240
186	05/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	37.275,15	0,00	13.804,21087300	2,7002738760
203	05/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	212.073,84	851,45435579	249,0724706000
202	05/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.054.889,19	4.235,27011018	249,0724706000
184	06/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	34.655,77	0,00	12.828,93524424	2,7013753940
196	07/12/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	3.000,00	856,00492300	3,5046527430
185	07/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	158.782,49	0,00	58.753,45512100	2,7025217440
183	08/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.402.841,78	0,00	1.628.455,38541800	2,7036919890
189	11/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	132.709,41	49.063,81767700	2,7048325280
193	12/12/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	100.000,00	0,00	28.494,52042700	3,5094466760
188	12/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.000.000,00	1.478.233,98701300	2,7059315610
191	12/12/2023	BB PREV RF IRF M	4.000.000,00	0,00	534.008,70895700	7,4905145420
187	15/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.127,04	1.154,19526200	2,7092816120
198	15/12/2023	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,00	2.050.498,26	337.119,18174432	6,0824134936
195	18/12/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	10.000,00	2.843,98953600	3,5161873390
182	18/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.292.805,86	476.989,80859148	2,7103427300
200	18/12/2023	ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	743.304,12	0,00	269.777,32877646	2,7552505000
206	18/12/2023	ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	2.600.000,00	0,00	943.652,85479487	2,7552505000
194	19/12/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	67.756,44	19.263,12853900	3,5174161800
204	19/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.511.440,43	10.035,35858960	250,2591619000
192	20/12/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	23.627,48	6.714,96645100	3,5186296420
181	20/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.269.705,58	0,00	468.102,14962873	2,7124540680
180	21/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	42.906,54	0,00	15.811,99434673	2,7135438490
179	22/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	177.914,79	0,00	65.540,36630197	2,7145833940
Total			19.268.525,35	13.028.007,25		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 7.189.394,62

Value-At-Risk: 2,11%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PORTO FELIZ		2,11		2,11			341.018.616,37	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,96%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545		4,06	0,09	4,05			10.067.943,65	2,95
NTN-B 150535 (4,423526%)		0,18	0,00	0,17			2.831.446,68	0,83
NTN-B 150535 (4,734998%)		0,18	0,00	0,18			11.156.313,50	3,27
NTN-B 150535 (5,290003%)		0,08	0,00	0,08			11.069.014,50	3,25
NTN-B 150535 (5,635000%)		0,15	-0,00	0,16			1.691.165,04	0,50
NTN-B 150535 (5,640000%)		0,16	-0,00	0,17			1.715.596,52	0,50
NTN-B 150535 (5,877000%)		0,08	0,00	0,08			5.365.371,35	1,57
NTN-B 150535 (6,051500%)		0,08	0,00	0,08			1.590.178,01	0,47
NTN-B 150555 (4,689998%)		0,08	0,00	0,09			2.872.593,41	0,84
NTN-B 150555 (5,669994%)		0,08	0,00	0,09			10.884.781,53	3,19
NTN-B 150555 (5,900000%)		0,08	0,00	0,09			5.376.368,07	1,58
NTN-B 150830 (4,069994%)		0,07	0,00	0,08			5.671.200,19	1,66
NTN-B 150830 (5,569998%)		0,08	0,00	0,08			1.663.397,29	0,49
NTN-B 150830 (6,000000%)		0,08	0,00	0,08			1.549.976,07	0,45
NTN-B 150840 (5,120004%)		0,08	0,00	0,08			11.073.441,98	3,25
NTN-B 150840 (5,171997%)		0,08	0,00	0,08			11.252.084,72	3,30
NTN-B 150840 (5,481000%)		0,08	0,00	0,09			5.437.739,70	1,59
NTN-B 150840 (5,792100%)		0,08	0,00	0,09			21.372.470,46	6,27
NTN-B 150850 (5,582500%)		0,08	0,00	0,09			1.031.810,08	0,30
NTN-B 150850 (5,850500%)		0,08	0,00	0,09			4.951.788,59	1,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,78	0,33	0,09		0,36	1,17	128.624.681,34	37,72

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP		3,41	0,13	3,41			16.117.049,00	4,73
BB PREV RF IRF M		1,35	0,02	0,03			6.938.829,19	2,03
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI		1,24	0,05	0,00			17.536.998,41	5,14
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,09	0,00	0,01			336.370,75	0,10
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,21	0,15	0,02			28.213.271,95	8,27
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,20	0,08	0,03			16.429.424,32	4,82
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,24	0,08	0,01			29.197.975,37	8,56
Sub-total	1,97	1,85	0,51		0,58	2,04	114.769.918,99	33,66

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			4.398.146,94	1,29
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,03	-0,00	0,03			15.340.841,26	4,50
Sub-total	0,04	0,03	-0,00		0,59	0,92	19.738.988,20	5,79

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,56%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA		9,31	0,09	3,40			3.461.829,00	1,02
BRANCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		10,28	0,74	2,70			26.298.574,88	7,71
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		7,18	0,50	0,21			25.415.292,48	7,45
Sub-total	15,48	8,56	1,33		0,31	5,62	55.175.696,36	16,18

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,24%

Artigo 9º III

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,24	0,03	0,59			11.456.408,61	3,36
Sub-total	8,39	6,24	0,03		0,18	2,40	11.456.408,61	3,36

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 6,36%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,36	0,14	5,46			11.252.922,87	3,30
Sub-total	8,89	6,36	0,14		0,48	5,19	11.252.922,87	3,30

(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 (%)

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

(5) Limite Política de Investimentos (%)