



LDB
EMPRESAS

PORTO FELIZ
JANEIRO 2024



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.01.2024.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

77,87%

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	7,20	0,32	-1,58	-1,58	9.908.422,41	2,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,423526%)	0,40	0,09	0,92	0,92	2.857.540,52	0,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,734998%)	0,46	0,08	0,95	0,95	11.262.077,62	3,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290003%)	0,37	0,16	0,99	0,99	11.179.022,77	3,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,635000%)	4,02	0,17	1,02	1,02	1.708.461,14	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,640000%)	4,02	0,17	1,08	1,08	1.734.130,21	0,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,877000%)	0,39	0,18	1,04	1,04	5.421.326,90	1,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,051500%)	0,39	0,18	1,06	1,06	1.606.993,29	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (4,689998%)	0,49	0,25	0,94	0,94	2.899.696,00	0,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,669994%)	0,52	0,28	1,03	1,03	10.996.415,47	3,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,900000%)	0,53	0,28	1,04	1,04	5.432.539,27	1,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,069994%)	0,32	0,10	0,89	0,89	5.721.740,59	1,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,569998%)	0,34	0,13	1,02	1,02	1.680.319,46	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,000000%)	2,94	0,14	1,05	1,05	1.566.299,13	0,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,120004%)	0,41	0,19	0,98	0,98	11.181.919,12	3,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,171997%)	0,41	0,19	0,98	0,98	11.362.810,38	3,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,481000%)	0,42	0,20	1,01	1,01	5.492.655,64	1,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,792100%)	0,43	0,21	1,04	1,04	21.593.849,93	6,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,582500%)	2,80	0,26	1,08	1,08	1.042.907,58	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,850500%)	2,91	0,26	1,04	1,04	5.003.322,70	1,47
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,70	0,20	0,80	0,80	129.652.450,13	38,00

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	5,69	0,34	0,43	0,43	16.186.995,43	4,74	272.735.023,87	5,94
BB	BB	BB PREV RF IRF M	2,43	0,17	0,66	0,66	10.002.182,65	2,93	4.127.932.079,70	0,24
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	1,87	0,11	0,66	0,66	17.653.056,46	5,17	1.491.138.811,56	1,18
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,33	0,05	0,86	0,86	114.457,94	0,03	7.961.364.534,06	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,17	0,20	-0,48	-0,48	31.740.671,70	9,30	5.251.127.483,30	0,60
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,15	0,20	-0,47	-0,47	16.352.985,71	4,79	5.008.664.499,36	0,33
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,86	0,11	0,66	0,66	29.391.816,51	8,61	7.718.818.121,25	0,38
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,88	0,18	0,19	0,19	121.442.166,40	35,59		

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	0,05	0,04	0,91	0,91	1.706.390,55	0,50	4.198.417.498,27	0,04
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,09	0,05	1,04	1,04	12.891.073,19	3,78	2.799.993.446,09	0,46
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,09	0,05	1,02	1,02	14.597.463,74	4,28		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

1,39

0,18

0,55

0,55

265.692.080,27

77,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

15,27%

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	18,34	0,80	-3,21	-3,21	3.350.838,43	0,98	787.639.589,62	0,43
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	20,86	1,57	-6,88	-6,88	24.488.254,54	7,18	671.967.360,08	3,64
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	16,40	0,33	-4,56	-4,56	24.256.611,28	7,11	747.907.484,79	3,24
Sub-total Artigo 8º I			18,14	0,94	-5,58	-5,58	52.095.704,25	15,27		
Renda Variável			18,14	0,94	-5,58	-5,58	52.095.704,25	15,27		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,51%

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	14,62	-1,12	4,56	4,56	11.978.917,11	3,51	2.108.221.544,73	0,57
Sub-total Artigo 9º III			14,62	-1,12	4,56	4,56	11.978.917,11	3,51		
Investimentos no Exterior			14,62	-1,12	4,56	4,56	11.978.917,11	3,51		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,35%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12,77	-1,62	1,69	1,69	11.442.570,13	3,35	1.668.294.580,56	0,69
Sub-total Artigo 10º I			12,77	-1,62	1,69	1,69	11.442.570,13	3,35		
Investimentos Estruturados			12,72	-1,62	1,69	1,69	11.442.570,13	3,35		
Total			3,84	0,19	-0,27	-0,27	341.209.271,76	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	129.652.450,13	38,00					100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	121.442.166,40	35,59					100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	14.597.463,74	4,28					60,00
	Total Renda Fixa	265.692.080,27	77,87					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	52.095.704,25	15,27					30,00
	Total Renda Variável	52.095.704,25	15,27					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	11.978.917,11	3,51					10,00
	Total Investimentos no Exterior	11.978.917,11	3,51					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	11.442.570,13	3,35					10,00
	Total Investimentos Estruturados	11.442.570,13	3,35					15,00
Total		341.209.271,76	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	0,80 82,66	0,80 82,66	2,87 102,42	4,46 73,89	11,07 86,03	1.027.768,79	1.027.768,79
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,19 19,74	0,19 19,74	4,81 171,56	3,97 65,70	13,03 101,20	247.803,34	247.803,34
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,02 105,15	1,02 105,15	2,89 102,96	6,35 105,13	13,18 102,40	186.375,38	186.375,38
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-5,58 -0,79	-5,58 -0,79	12,17 -0,75	-3,22 -7,98	1,55 -11,08	-3.079.992,11	-3.079.992,11
Artigo 9º III % do CDI	4,56 471,80	4,56 471,80	13,60 484,53	11,14 184,50	24,60 191,14	522.508,50	522.508,50
Artigo 10º I % do CDI	1,69 174,34	1,69 174,34	16,97 604,52	8,90 147,34	28,02 217,70	189.647,26	189.647,26
PORTO FELIZ (Total)						-905.888,84	-905.888,84

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%)	2.831.446,68	0,00	0,00	0,00	2.857.540,52	26.093,84	26.093,84
NTN-B 150535 (4,734998%)	11.156.313,50	0,00	0,00	0,00	11.262.077,62	105.764,12	105.764,12
NTN-B 150535 (5,290003%)	11.069.014,50	0,00	0,00	0,00	11.179.022,77	110.008,27	110.008,27
NTN-B 150535 (5,635000%)	1.691.165,04	0,00	0,00	0,00	1.708.461,14	17.296,10	17.296,10
NTN-B 150535 (5,640000%)	1.715.596,52	0,00	0,00	0,00	1.734.130,21	18.533,69	18.533,69
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.365.371,35	0,00	0,00	0,00	5.421.326,90	55.955,55	55.955,55
NTN-B 150535 (6,051500%)	1.590.178,01	0,00	0,00	0,00	1.606.993,29	16.815,28	16.815,28
NTN-B 150545	10.067.943,65	0,00	0,00	0,00	9.908.422,41	-159.521,24	-159.521,24
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.872.593,41	0,00	0,00	0,00	2.899.696,00	27.102,59	27.102,59
NTN-B 150555 (5,669994%)	10.884.781,53	0,00	0,00	0,00	10.996.415,47	111.633,94	111.633,94
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.376.368,07	0,00	0,00	0,00	5.432.539,27	56.171,20	56.171,20
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.671.200,19	0,00	0,00	0,00	5.721.740,59	50.540,40	50.540,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.663.397,29	0,00	0,00	0,00	1.680.319,46	16.922,17	16.922,17
NTN-B 150830 (6,000000%)	1.549.976,07	0,00	0,00	0,00	1.566.299,13	16.323,06	16.323,06
NTN-B 150840 (5,120004%)	11.073.441,98	0,00	0,00	0,00	11.181.919,12	108.477,14	108.477,14
NTN-B 150840 (5,171997%)	11.252.084,72	0,00	0,00	0,00	11.362.810,38	110.725,66	110.725,66
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.437.739,70	0,00	0,00	0,00	5.492.655,64	54.915,94	54.915,94
NTN-B 150840 (5,792100%)	21.372.470,46	0,00	0,00	0,00	21.593.849,93	221.379,47	221.379,47
NTN-B 150850 (5,582500%)	1.031.810,08	0,00	0,00	0,00	1.042.907,58	11.097,50	11.097,50
NTN-B 150850 (5,850500%)	4.951.788,59	0,00	0,00	0,00	5.003.322,70	51.534,11	51.534,11
	128.624.681,34	0,00	0,00	0,00	129.652.450,13	1.027.768,79	

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	28.213.271,95	3.648.900,00	0,00	0,00	31.740.671,70	-121.500,25	-121.500,25
BB PREV RF IRF M	6.938.829,19	3.000.000,00	0,00	0,00	10.002.182,65	63.353,46	63.353,46
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	336.370,75	0,00	-224.455,93	0,00	114.457,94	2.543,12	2.543,12
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	29.197.975,37	0,00	0,00	0,00	29.391.816,51	193.841,14	193.841,14
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.429.424,32	0,00	0,00	0,00	16.352.985,71	-76.438,61	-76.438,61
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	16.117.049,00	0,00	0,00	0,00	16.186.995,43	69.946,43	69.946,43
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	17.536.998,41	0,00	0,00	0,00	17.653.056,46	116.058,05	116.058,05
	114.769.918,99	6.648.900,00	-224.455,93	0,00	121.442.166,40	247.803,34	

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	4.398.146,94	3.929.727,33	-6.650.840,51	0,00	1.706.390,55	29.356,79	29.356,79
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	15.340.841,26	0,00	-2.606.786,66	0,00	12.891.073,19	157.018,59	157.018,59
	19.738.988,20	3.929.727,33	-9.257.627,17	0,00	14.597.463,74	186.375,38	

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	25.415.292,48	0,00	0,00	0,00	24.256.611,28	-1.158.681,20	-1.158.681,20
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	26.298.574,88	0,00	0,00	0,00	24.488.254,54	-1.810.320,34	-1.810.320,34
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	3.461.829,00	0,00	0,00	0,00	3.350.838,43	-110.990,57	-110.990,57
	55.175.696,36	0,00	0,00	0,00	52.095.704,25	-3.079.992,11	

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	11.456.408,61	0,00	0,00	0,00	11.978.917,11	522.508,50	522.508,50
	11.456.408,61	0,00	0,00	0,00	11.978.917,11	522.508,50	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11.252.922,87	0,00	0,00	0,00	11.442.570,13	189.647,26	189.647,26
	11.252.922,87	0,00	0,00	0,00	11.442.570,13	189.647,26	

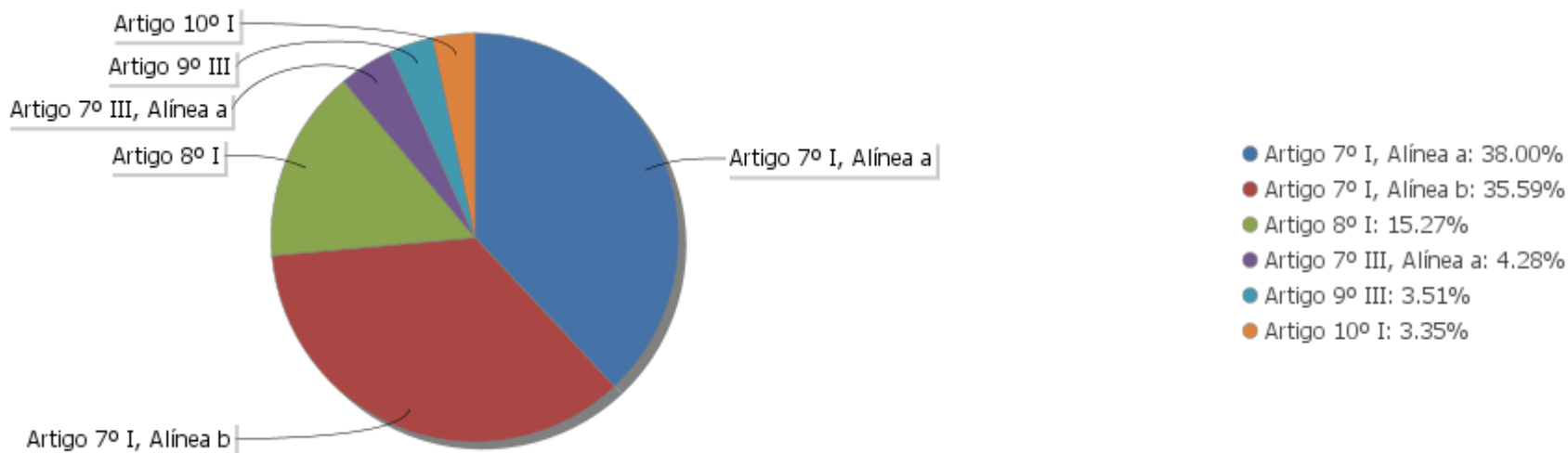
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

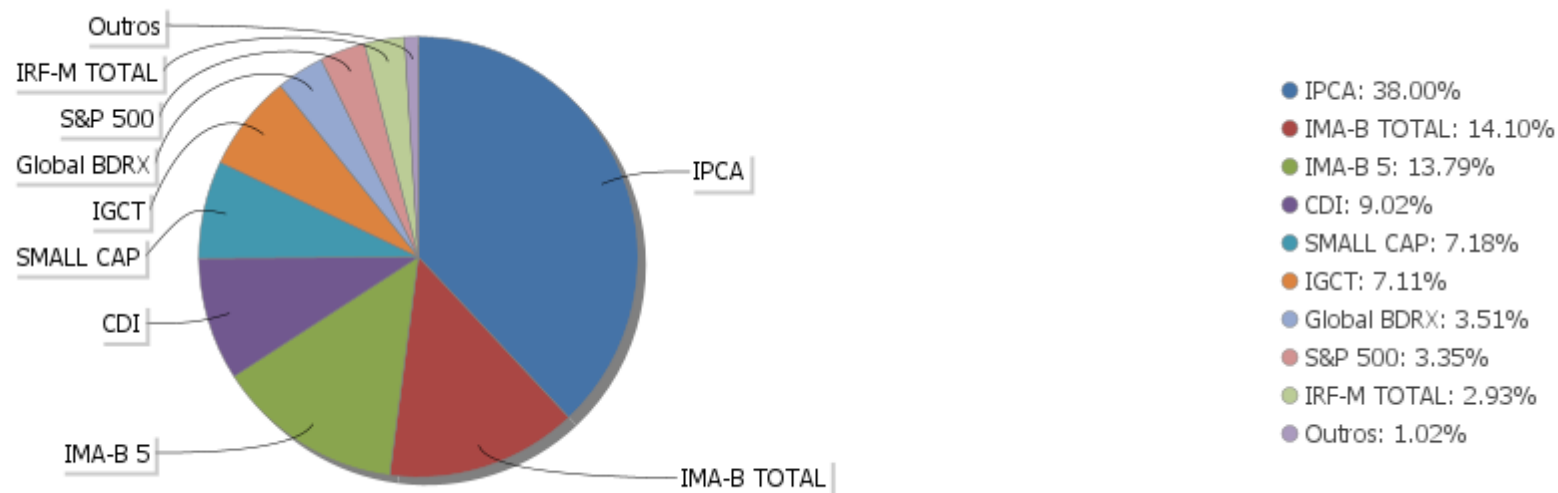
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	208.205.983,20	61,02		208.205.983,20	61,02	
de 31 dias a 365 dias	3.350.838,43	0,98		211.556.821,63	62,00	
acima de 365 dias	129.652.450,13	38,00		341.209.271,76	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

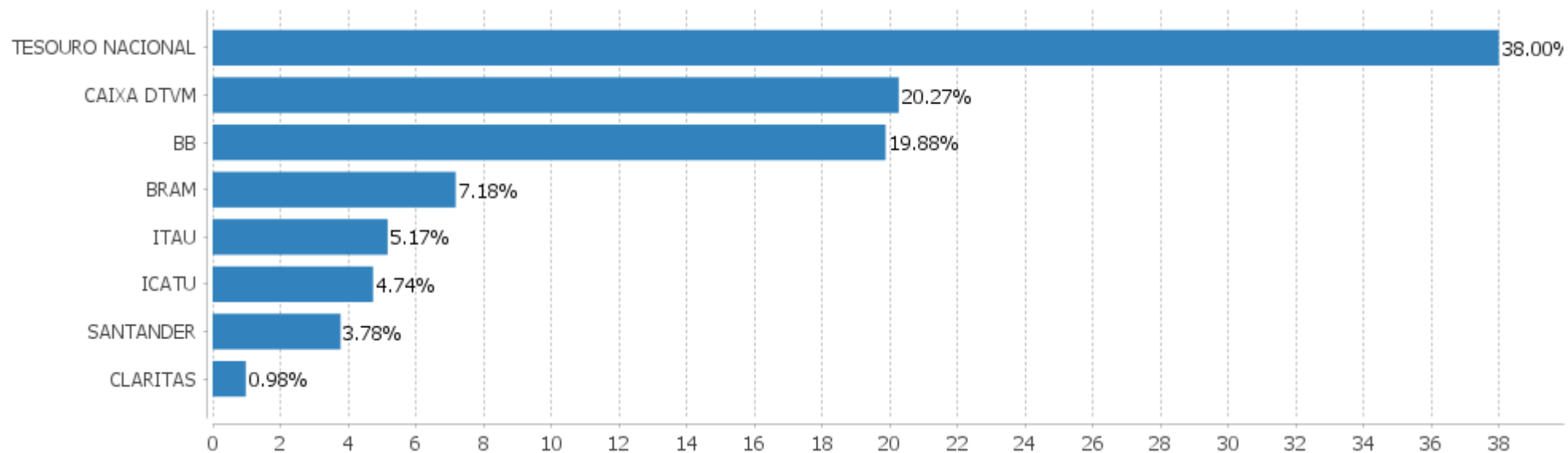


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2024	-0,27												-0,27
IPCA + 4,88%	0,84												0,84
p.p. indexador	-1,11												-1,11
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

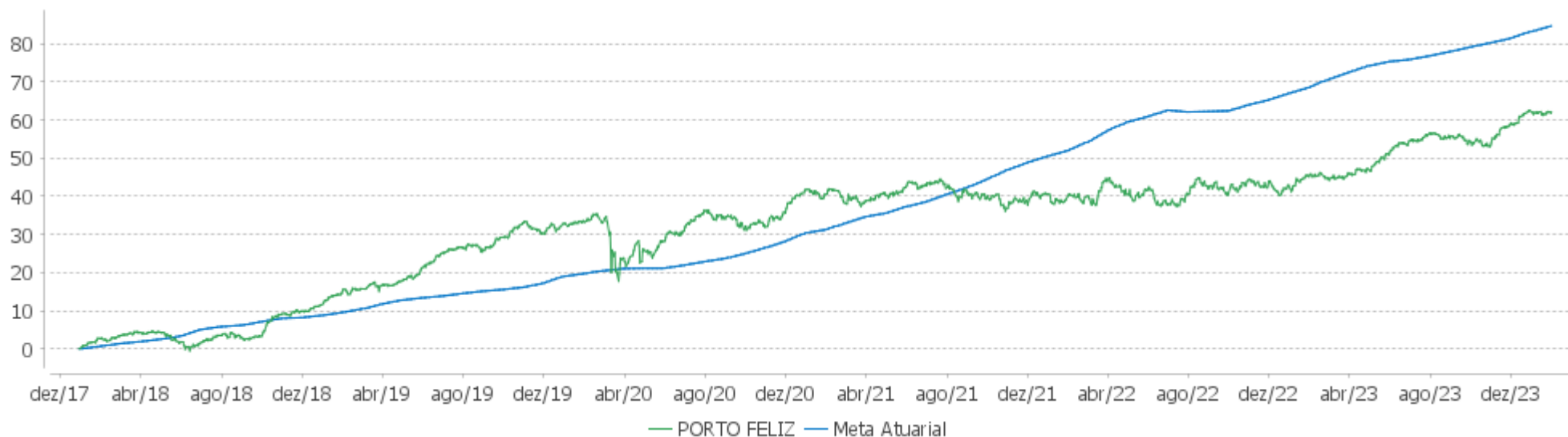
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	35	47,95
Meses abaixo - Meta Atuarial	38	52,05
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-7,15	2020-03

Relatório

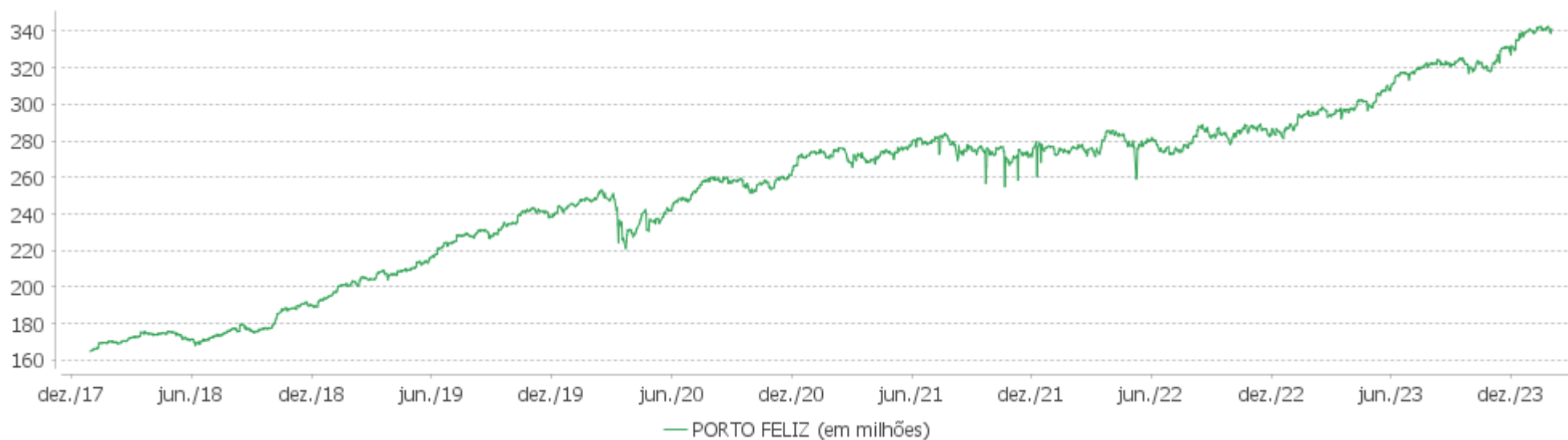
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	5,77	2,48	3,29	3,81
06 meses	3,59	4,52	-0,93	3,95
12 meses	11,26	9,67	1,59	3,84
24 meses	15,73	21,67	-5,95	5,45
36 meses	15,45	41,52	-26,07	5,58
48 meses	21,72	56,50	-34,78	7,79
60 meses	40,69	72,86	-32,17	7,18
Desde 29/12/2017	62,10	91,59	-29,49	6,77

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

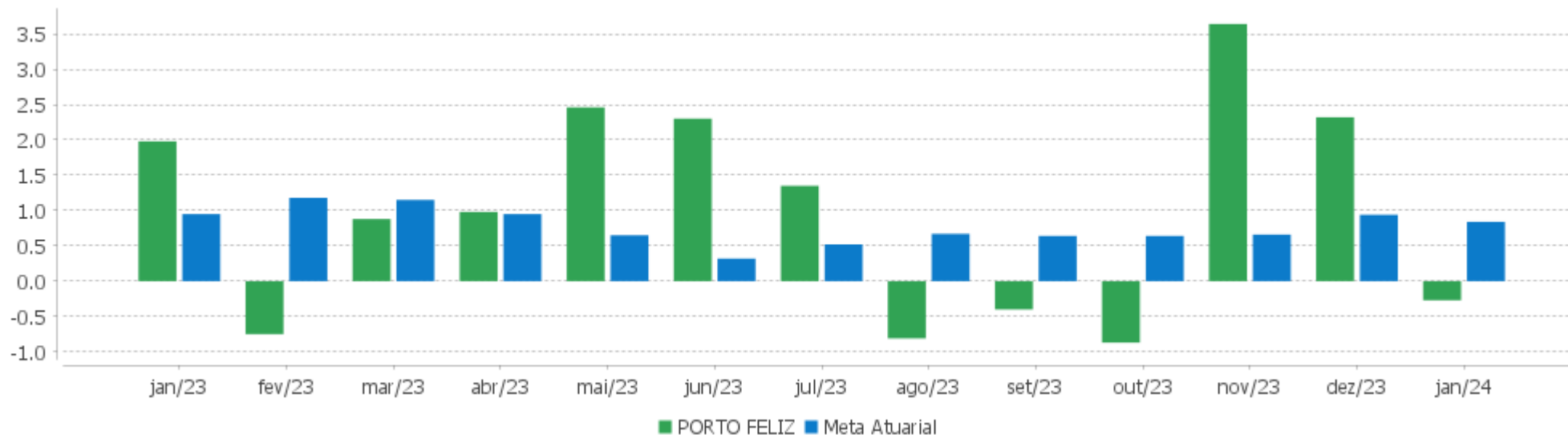


Patrimônio Líquido



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.	-1,58 -2,00	-1,58 -2,00	5,82 4,55	1,37 -0,64	21,15 16,64	23,95 13,41	14,66 -7,36
NTN-B 150830 (6,000000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,63	1,05 0,63	2,72 1,45	5,00 2,99	7,68 3,17	13,94 3,40	
NTN-B 150840 (5,120004%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,56	0,98 0,56	2,56 1,30	4,62 2,61	10,01 5,50	22,35 11,81	34,45 12,43
NTN-B 150830 (4,069994%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,47	0,89 0,47	2,23 0,96	4,00 2,00	8,83 4,32	19,83 9,29	33,97 11,96
NTN-B 150535 (5,640000%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,66	1,08 0,66	-0,19 -1,46	1,93 -0,07	4,45 -0,06		
NTN-B 150535 (5,290003%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,57	0,99 0,57	2,58 1,31	4,67 2,67	10,15 5,65	22,71 12,17	38,54 16,53
NTN-B 150535 (5,877000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,62	1,04 0,62	2,73 1,46	4,98 2,97	10,77 6,27	24,09 13,55	36,68 14,67
NTN-B 150840 (5,792100%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,62	1,04 0,62	2,74 1,48	4,97 2,96	10,72 6,21	20,46 9,92	32,66 10,65
NTN-B 150555 (4,689998%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,52	0,94 0,52	2,52 1,26	4,46 2,46	9,63 5,12	21,43 10,89	36,77 14,76
NTN-B 150850 (5,850500%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,62	1,04 0,62	2,81 1,55	5,05 3,05	7,73 3,22	13,97 3,43	
NTN-B 150840 (5,481000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,59	1,01 0,59	2,66 1,39	4,80 2,80	10,39 5,88	19,86 9,32	31,87 9,86
NTN-B 150535 (5,635000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,60	1,02 0,60	-0,19 -1,46	1,93 -0,08	4,45 -0,06		
NTN-B 150830 (5,569998%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,60	1,02 0,60	2,61 1,34	4,78 2,77	10,41 5,90	23,32 12,78	35,58 13,56
NTN-B 150850 (5,582500%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,66	1,08 0,66	2,74 1,48	4,91 2,91	7,56 3,05	13,73 3,19	
NTN-B 150555 (5,669994%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,61	1,03 0,61	2,78 1,52	4,98 2,97	10,67 6,16	23,73 13,19	36,30 14,29
NTN-B 150840 (5,171997%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,56	0,98 0,56	2,58 1,31	4,64 2,64	10,06 5,56	22,47 11,93	34,60 12,59
NTN-B 150555 (5,900000%)	1,04	1,04	2,84	5,10	10,92	24,28	36,94

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.	0,62	0,62	1,58	3,09	6,41	13,74	14,93
NTN-B 150535 (6,051500%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,64	1,06 0,64	2,78 1,51	5,07 3,06	10,96 6,45	17,44 6,90	
NTN-B 150535 (4,423526%) Var. IPCA p.p.	0,92 0,50	0,92 0,50	2,35 1,09	4,22 2,22	9,24 4,74	20,63 10,09	35,36 13,34
NTN-B 150535 (4,734998%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,53	0,95 0,53	2,43 1,17	4,39 2,38	9,57 5,07	21,33 10,79	36,45 14,43
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,47 -0,02	-0,47 -0,02	4,92 -0,06	2,84 -0,07	15,36 -0,18	23,40 -0,40	21,65 -0,73
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,66 -0,01	0,66 -0,01	3,94 -0,06	4,34 -0,10	11,18 -0,15	23,49 -0,30	28,83 -0,62
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,66 -0,02	0,66 -0,02	3,94 -0,05	4,34 -0,10	11,12 -0,21	23,35 -0,44	28,74 -0,71
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,86 0,03	0,86 0,03	2,74 -0,03	5,80 -0,12	12,67 -0,28	26,44 -0,68	30,53 -1,07
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,48 -0,03	-0,48 -0,03	4,91 -0,06	2,78 -0,13	15,23 -0,30	23,18 -0,62	21,43 -0,94
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,66 -0,01	0,66 -0,01	4,64 -0,04	5,92 -0,13	15,88 -0,43	27,01 -0,72	24,96 -1,15
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP % do CDI	0,43 44,89	0,43 44,89	7,56 269,48	6,26 103,63	21,16 164,39	28,54 104,44	17,23 51,13
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,88 91,04	0,88 91,04	2,55 91,03	5,51 91,20	11,76 91,36	24,82 90,80	29,63 87,93
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	1,04 107,65	1,04 107,65	2,95 105,27	6,45 106,83	13,33 103,56	28,24 103,32	35,48 105,28
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA Var. IBRX 100 p.p.	-3,21 1,30	-3,21 1,30	13,47 0,28	2,02 -3,14	7,42 -4,46	14,37 1,65	15,04 4,71
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	-4,56 -0,05	-4,56 -0,05	12,95 -0,36	4,14 -0,73	10,74 -1,91	10,15 -2,97	6,99 -3,75
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	-6,88 -0,33	-6,88 -0,33	11,22 -1,28	-10,14 -3,84	-6,75 -13,09	-14,94 -4,84	-18,08 1,24
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	4,56 -0,22	4,56 -0,22	14,15 -0,56	11,69 -0,89	25,21 -1,61	3,42 -2,20	15,15 -4,80
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	1,69 -2,26	1,69 -2,26	16,97 3,80	8,77 -1,55	27,16 11,70	25,92 26,70	58,47 40,45
PORTO FELIZ	-0,27	-0,27	5,77	3,59	11,26	15,73	15,45

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.	-1,11	-1,11	3,31	-0,88	1,71	-5,80	-25,23
CDI	0,97	0,97	2,81	6,04	12,87	27,33	33,70
IBOVESPA	-4,79	-4,79	12,91	4,76	12,63	13,92	11,02
INPC + 6,00%	1,08	1,08	2,69	4,67	9,97	23,23	44,47
IPCA + 6,00%	0,93	0,93	2,73	5,02	10,70	24,12	45,22

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	0,83	0,83	2,77	5,92	12,95	27,12	31,60	36,12	45,12
IRF-M 1+	0,60	0,60	5,55	6,14	18,37	28,70	23,39	30,51	48,22
IRF-M TOTAL	0,67	0,67	4,68	6,05	16,31	27,74	26,10	32,31	47,48
IMA-B 5	0,68	0,68	3,99	4,44	11,33	23,79	29,45	39,23	56,02
IMA-B 5+	-1,47	-1,47	5,89	1,54	19,03	23,38	15,40	19,65	46,36
IMA-B TOTAL	-0,45	-0,45	4,97	2,91	15,53	23,80	22,38	28,77	52,10
IMA-GERAL TOTAL	0,47	0,47	3,98	5,14	14,53	26,21	28,00	33,76	48,90
IDKA 2	0,81	0,81	4,15	4,81	11,43	23,53	29,55	40,17	55,62
IDKA 20	-3,34	-3,34	7,85	-0,30	28,79	24,16	6,04	6,79	36,82
CDI	0,97	0,97	2,81	6,04	12,87	27,33	33,70	37,09	45,03

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-4,79	-4,79	12,91	4,76	12,63	13,92	11,02	12,30	31,17
IBRX 100	-4,51	-4,51	13,20	5,15	11,88	12,72	10,34	12,15	33,43
IBRX 50	-4,15	-4,15	13,07	5,74	11,32	13,01	11,95	14,94	31,89
SMALL CAP	-6,55	-6,55	12,50	-6,30	6,34	-10,11	-19,32	-22,95	11,91
Índice Consumo - ICON	-8,33	-8,33	13,01	-11,48	-4,76	-28,41	-45,21	-47,39	-24,62
Índice Dividendos - IDIV	-3,51	-3,51	14,18	8,88	15,58	28,28	35,93	29,79	64,85

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	3,94	3,94	13,17	10,31	15,47	-0,78	18,02	74,30	143,07

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,67	0,67	5,63	4,26	18,16	20,04	15,77	8,33	38,34

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,86	2,86	12,43	7,98	9,50	-5,80	2,83	51,79	101,82

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,42	0,42	1,27	2,01	4,51	10,54	22,01	27,58	32,93
INPC	0,57	0,57	1,22	1,66	3,82	9,75	21,38	28,10	33,61
IGPM	0,07	0,07	1,41	2,15	-3,32	0,35	17,32	47,48	59,00
SELIC	0,97	0,97	2,80	6,04	12,87	27,33	33,70	37,09	45,03

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,76	0,76	2,25	4,03	8,64	19,51	37,19	49,11	61,60
IPCA + 5,00%	0,85	0,85	2,49	4,53	9,67	21,80	41,17	54,89	69,49
IPCA + 5,50%	0,89	0,89	2,61	4,77	10,18	22,96	43,18	57,84	73,54
IPCA + 5,89%	0,92	0,92	2,70	4,97	10,59	23,86	44,77	60,18	76,76
IPCA + 6,00%	0,93	0,93	2,73	5,02	10,70	24,12	45,22	60,84	77,68
INPC + 4,00%	0,91	0,91	2,21	3,67	7,92	18,65	36,48	49,72	62,43
INPC + 6,00%	1,08	1,08	2,69	4,67	9,97	23,23	44,47	61,50	78,60

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%)	2.857.540,52	4,423526	2.598.692,21	5,620000	-258.848,31
NTN-B 150535 (4,734998%)	11.262.077,62	4,734998	10.504.696,62	5,620000	-757.381,00
NTN-B 150535 (5,290003%)	11.179.022,77	5,290003	10.891.642,33	5,620000	-287.380,44
NTN-B 150535 (5,635000%)	1.708.461,14	5,635000	1.710.475,93	5,620000	2.014,79
NTN-B 150535 (5,640000%)	1.734.130,21	5,640000	1.736.858,59	5,620000	2.728,38
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.421.326,90	5,877000	5.531.564,82	5,620000	110.237,92
NTN-B 150535 (6,051500%)	1.606.993,29	6,051500	1.662.107,71	5,620000	55.114,42
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.899.696,00	4,689998	2.507.979,54	5,690800	-391.716,46
NTN-B 150555 (5,669994%)	10.996.415,47	5,669994	10.964.600,96	5,690800	-31.814,51
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.432.539,27	5,900000	5.591.634,11	5,690800	159.094,84
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.721.740,59	4,069994	5.322.147,16	5,478300	-399.593,43
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.680.319,46	5,569998	1.688.160,20	5,478300	7.840,74
NTN-B 150830 (6,000000%)	1.566.299,13	6,000000	1.608.194,72	5,478300	41.895,59
NTN-B 150840 (5,120004%)	11.181.919,12	5,120004	10.604.016,72	5,645100	-577.902,40
NTN-B 150840 (5,171997%)	11.362.810,38	5,171997	10.832.880,40	5,645100	-529.929,98
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.492.655,64	5,481000	5.402.977,63	5,645100	-89.678,01
NTN-B 150840 (5,792100%)	21.593.849,93	5,792100	21.912.574,56	5,645100	318.724,63
NTN-B 150850 (5,582500%)	1.042.907,58	5,582500	1.026.927,03	5,702500	-15.980,55
NTN-B 150850 (5,850500%)	5.003.322,70	5,850500	5.098.602,64	5,702500	95.279,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
217	08/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	68.491,03	0,00	25.139,65308654	2,7244222410
216	09/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.153.053,17	0,00	789.961,71022098	2,7255158600
227	10/01/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	15.000,00	4.243,51614300	3,5348045100
214	18/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.000.000,00	1.097.631,83483900	2,7331568790
213	18/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.100.000,00	768.342,28438740	2,7331568790
212	18/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	805.900,00	294.860,49856562	2,7331568790
215	18/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	743.000,00	271.846,81776183	2,7331568790
219	18/01/2024	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	2.100.000,00	0,00	267.722,02071800	7,8439569310
218	18/01/2024	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	805.900,00	0,00	102.741,51261782	7,8439569310
221	18/01/2024	BB PREV RF IRF M	3.000.000,00	0,00	395.977,41961400	7,5761895790
220	18/01/2024	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	743.000,00	0,00	94.722,60066391	7,8439569310
226	22/01/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	10.000,00	2.819,06113700	3,5472802870
225	25/01/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	46.571,76	13.111,38895689	3,5520081170
224	26/01/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	78.431,57	22.066,49357847	3,5543286350
211	26/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	108.593,39	0,00	39.637,40250600	2,7396696840
223	29/01/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	73.952,60	20.800,32380700	3,5553581130
210	29/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.940,51	0,00	708,02330400	2,7407431200
209	29/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.940,51	708,02330400	2,7407431200
229	29/01/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.492.911,29	5.891,26607400	253,4109429000
228	29/01/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.113.875,37	4.395,52987500	253,4109429000
222	30/01/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	500,00	140,59121200	3,5564100610
208	30/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	41.519,11	0,00	15.142,96572875	2,7418083580
207	31/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.556.130,12	0,00	567.331,58139400	2,7428935230
Total			10.578.627,33	9.482.083,10		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 6.924.486,45

Value-At-Risk: 2,03%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,32	0,97		0,62	-0,33	0,53	265.692.080,27	77,87
Artigo 8º	15,32	8,34		1,21	-0,43	-5,58	52.095.704,25	15,27
Artigo 9º	11,95	5,80		0,05	0,30	4,56	11.978.917,11	3,51
Artigo 10º	10,86	6,50		0,15	0,07	1,69	11.442.570,13	3,35
PORTO FELIZ		2,03		2,03			341.209.271,76	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,97%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545		3,44	0,08	3,43			9.908.422,41	2,90
NTN-B 150535 (4,423526%)		0,23	-0,00	0,22			2.857.540,52	0,84
NTN-B 150535 (4,734998%)		0,19	-0,00	0,19			11.262.077,62	3,30
NTN-B 150535 (5,290003%)		0,09	0,00	0,10			11.179.022,77	3,28
NTN-B 150535 (5,635000%)		0,17	-0,00	0,17			1.708.461,14	0,50
NTN-B 150535 (5,640000%)		0,17	-0,00	0,17			1.734.130,21	0,51
NTN-B 150535 (5,877000%)		0,10	0,00	0,10			5.421.326,90	1,59
NTN-B 150535 (6,051500%)		0,10	0,00	0,10			1.606.993,29	0,47
NTN-B 150555 (4,689998%)		0,10	0,00	0,10			2.899.696,00	0,85
NTN-B 150555 (5,669994%)		0,10	0,00	0,10			10.996.415,47	3,22
NTN-B 150555 (5,900000%)		0,10	0,00	0,10			5.432.539,27	1,59
NTN-B 150830 (4,069994%)		0,09	0,00	0,09			5.721.740,59	1,68
NTN-B 150830 (5,569998%)		0,09	0,00	0,10			1.680.319,46	0,49
NTN-B 150830 (6,000000%)		0,09	0,00	0,10			1.566.299,13	0,46
NTN-B 150840 (5,120004%)		0,10	0,00	0,10			11.181.919,12	3,28
NTN-B 150840 (5,171997%)		0,10	0,00	0,10			11.362.810,38	3,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (5,481000%)		0,10	0,00	0,10			5.492.655,64	1,61
NTN-B 150840 (5,792100%)		0,10	0,00	0,10			21.593.849,93	6,33
NTN-B 150850 (5,582500%)		0,10	0,00	0,10			1.042.907,58	0,31
NTN-B 150850 (5,850500%)		0,10	0,00	0,10			5.003.322,70	1,47
Sub-total	0,84	0,28	0,08		-0,20	0,80	129.652.450,13	38,00

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		3,46	0,13	3,46			16.186.995,43	4,74
BB PREV RF IRF M		1,48	0,03	0,04			10.002.182,65	2,93
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI		1,23	0,05	0,00			17.653.056,46	5,17
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,11	0,00	0,03			114.457,94	0,03
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,18	0,16	0,02			31.740.671,70	9,30
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,16	0,08	0,03			16.352.985,71	4,79
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,23	0,08	0,01			29.391.816,51	8,61
Sub-total	1,99	1,85	0,54		-0,39	0,19	121.442.166,40	35,59

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			1.706.390,55	0,50
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,02	-0,00	0,02			12.891.073,19	3,78
Sub-total	0,07	0,02	-0,00		0,74	1,02	14.597.463,74	4,28

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,34%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA		8,23	0,08	2,95			3.350.838,43	0,98
BRANCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		10,36	0,68	2,62			24.488.254,54	7,18
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		6,81	0,45	0,16			24.256.611,28	7,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	15,32	8,34	1,21		-0,43	-5,58	52.095.704,25	15,27

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,80%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		5,80	0,05	0,61			11.978.917,11	3,51
Sub-total	11,95	5,80	0,05		0,30	4,56	11.978.917,11	3,51

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 6,50%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,50	0,15	5,35			11.442.570,13	3,35
Sub-total	10,86	6,50	0,15		0,07	1,69	11.442.570,13	3,35

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

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

(5) Limite Política de Investimentos (%)