



**LDB**  
EMPRESAS

**PORTO FELIZ**  
FEVEREIRO 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 29.02.2024.

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

77,58%

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	6,78	0,15	0,48	-1,11	9.956.378,05	2,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,423526%)	0,42	0,00	0,91	1,84	2.883.624,96	0,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,734998%)	0,48	-0,02	0,94	1,89	11.367.458,98	3,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290003%)	0,42	0,06	0,98	1,98	11.288.040,84	3,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,601000%)	997,10	0,06	0,54	0,54	1.770.151,62	0,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,635000%)	4,02	0,06	1,00	2,03	1.725.548,54	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,640000%)	4,02	0,06	1,00	2,09	1.751.480,53	0,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,877000%)	0,44	0,06	1,02	2,07	5.476.491,81	1,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,051500%)	0,45	0,06	1,03	2,10	1.623.546,25	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (4,689998%)	0,58	0,06	0,93	1,88	2.926.714,96	0,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,669994%)	0,63	0,06	1,00	2,04	11.106.674,17	3,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,900000%)	0,64	0,06	1,02	2,07	5.487.909,23	1,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,069994%)	0,34	0,05	0,89	1,79	5.622.465,38	1,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,569998%)	0,37	0,06	1,00	2,02	1.649.439,18	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,000000%)	0,38	0,06	1,03	2,09	1.537.017,47	0,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,120004%)	0,47	0,06	0,96	1,95	10.993.610,37	3,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,171997%)	0,47	0,06	0,97	1,96	11.170.268,42	3,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,481000%)	0,49	0,06	0,99	2,01	5.396.149,66	1,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,792100%)	0,50	0,06	1,01	2,06	21.200.476,17	6,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,582500%)	0,55	0,06	1,00	2,08	1.024.734,34	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,850500%)	0,61	0,06	1,02	2,07	4.912.309,65	1,42
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,71</b>	<b>0,06</b>	<b>0,94</b>	<b>1,75</b>	<b>130.870.490,58</b>	<b>37,77</b>

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,05	0,03	0,23	0,23	2.407,87	0,00	153.351.333.928,81	0,00
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	5,36	0,29	0,09	0,52	17.336.852,86	5,00	270.893.999,97	6,40
BB	BB	BB PREV RF IRF M	2,31	0,16	0,44	1,10	10.045.979,84	2,90	4.190.498.364,43	0,24
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	1,75	0,10	0,58	1,24	17.755.088,90	5,12	1.502.463.249,65	1,18
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,29	0,05	0,74	1,61	281.074,44	0,08	8.089.813.404,09	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,96	0,13	0,53	0,05	34.526.711,19	9,96	5.326.196.241,75	0,65
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,94	0,13	0,54	0,07	16.441.021,17	4,74	5.024.622.442,53	0,33
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,74	0,10	0,58	1,24	29.561.321,59	8,53	7.766.523.482,49	0,38
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,78</b>	<b>0,14</b>	<b>0,48</b>	<b>0,67</b>	<b>125.950.457,86</b>	<b>36,35</b>		

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	0,46	1,38	1.595.054,63	0,46	4.488.445.035,86	0,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,09	0,04	0,86	1,91	10.413.548,86	3,01	2.774.133.845,40	0,38
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,08</b>	<b>0,04</b>	<b>0,85</b>	<b>1,88</b>	<b>12.008.603,49</b>	<b>3,47</b>		
Renda Fixa			1,35	0,10	0,72	1,28	268.829.551,93	77,58		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

15,26%

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	18,03	-0,41	1,52	-1,73	3.401.834,47	0,98	792.636.802,40	0,43
BRAM	BEM	BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	20,78	-0,41	2,05	-4,97	24.990.386,07	7,21	682.523.497,01	3,66
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	16,03	-0,68	0,89	-3,71	24.473.589,88	7,06	755.342.037,32	3,24
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>17,91</b>	<b>-0,54</b>	<b>1,48</b>	<b>-4,19</b>	<b>52.865.810,42</b>	<b>15,26</b>		
Renda Variável			17,91	-0,54	1,48	-4,19	52.865.810,42	15,26		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,67%

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	14,40	0,95	6,27	11,12	12.729.959,16	3,67	2.238.336.630,68	0,57
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>14,40</b>	<b>0,95</b>	<b>6,27</b>	<b>11,12</b>	<b>12.729.959,16</b>	<b>3,67</b>		
Investimentos no Exterior			14,40	0,95	6,27	11,12	12.729.959,16	3,67		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,49%

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	12,39	0,61	5,70	7,48	12.094.551,73	3,49	1.780.767.536,84	0,68
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>12,39</b>	<b>0,61</b>	<b>5,70</b>	<b>7,48</b>	<b>12.094.551,73</b>	<b>3,49</b>		
Investimentos Estruturados			12,35	0,61	5,70	7,48	12.094.551,73	3,49		
Total			3,71	0,05	1,20	0,93	346.519.873,24	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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	130.870.490,58	37,77	0,00	35,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	125.950.457,86	36,35	0,00	38,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	12.008.603,49	3,47	0,00	3,00	60,00	0,00	60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>268.829.551,93</b>	<b>77,58</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	52.865.810,42	15,26	0,00	12,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>52.865.810,42</b>	<b>15,26</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	12.729.959,16	3,67	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>12.729.959,16</b>	<b>3,67</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	12.094.551,73	3,49	0,00	2,50	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>12.094.551,73</b>	<b>3,49</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>346.519.873,24</b>	<b>100,00</b>					

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades por Artigo**

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,94 117,54	1,75 98,47	2,94 109,45	4,91 86,29	11,09 87,03	1.221.331,71	2.249.100,50
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,48 59,77	0,67 37,78	2,73 101,41	4,34 76,29	12,10 94,96	595.380,82	843.184,16
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,85 106,16	1,88 105,64	2,81 104,57	5,87 103,27	13,23 103,83	116.259,05	302.634,43
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,48 0,49	-4,19 -0,34	1,20 -0,12	6,42 -5,06	12,28 -10,67	770.106,17	-2.309.885,94
Artigo 9º III % do CDI	6,27 781,75	11,12 625,77	13,79 512,74	14,78 259,93	31,43 246,66	751.042,05	1.273.550,55
Artigo 10º I % do CDI	5,70 710,45	7,48 421,02	13,06 485,66	16,03 281,90	37,42 293,67	651.981,60	841.628,86
<b>PORTO FELIZ (Total)</b>						<b>4.106.101,40</b>	<b>3.200.212,56</b>

**RESULTADO POR ATIVO**

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (4,423526%)	2.857.540,52	0,00	0,00	0,00	2.883.624,96	26.084,44	52.178,28
NTN-B 150535 (4,734998%)	11.262.077,62	0,00	0,00	0,00	11.367.458,98	105.381,36	211.145,48
NTN-B 150535 (5,290003%)	11.179.022,77	0,00	0,00	0,00	11.288.040,84	109.018,07	219.026,34
NTN-B 150535 (5,601000%)	0,00	1.760.645,42	0,00	0,00	1.770.151,62	9.506,20	9.506,20
NTN-B 150535 (5,635000%)	1.708.461,14	0,00	0,00	0,00	1.725.548,54	17.087,40	34.383,50
NTN-B 150535 (5,640000%)	1.734.130,21	0,00	0,00	0,00	1.751.480,53	17.350,32	35.884,01
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.421.326,90	0,00	0,00	0,00	5.476.491,81	55.164,91	111.120,46
NTN-B 150535 (6,051500%)	1.606.993,29	0,00	0,00	0,00	1.623.546,25	16.552,96	33.368,24
NTN-B 150545	9.908.422,41	0,00	0,00	0,00	9.956.378,05	47.955,64	-111.565,60
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.899.696,00	0,00	0,00	0,00	2.926.714,96	27.018,96	54.121,55
NTN-B 150555 (5,669994%)	10.996.415,47	0,00	0,00	0,00	11.106.674,17	110.258,70	221.892,64
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.432.539,27	0,00	0,00	0,00	5.487.909,23	55.369,96	111.541,16

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.721.740,59	0,00	0,00	149.194,87	5.622.465,38	49.919,66	100.460,06
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.680.319,46	0,00	0,00	47.323,92	1.649.439,18	16.443,64	33.365,81
NTN-B 150830 (6,000000%)	1.566.299,13	0,00	0,00	45.082,26	1.537.017,47	15.800,60	32.123,66
NTN-B 150840 (5,120004%)	11.181.919,12	0,00	0,00	294.280,03	10.993.610,37	105.971,28	214.448,42
NTN-B 150840 (5,171997%)	11.362.810,38	0,00	0,00	300.631,40	11.170.268,42	108.089,44	218.815,10
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.492.655,64	0,00	0,00	149.942,09	5.396.149,66	53.436,11	108.352,05
NTN-B 150840 (5,792100%)	21.593.849,93	0,00	0,00	608.112,31	21.200.476,17	214.738,55	436.118,02
NTN-B 150850 (5,582500%)	1.042.907,58	0,00	0,00	28.394,35	1.024.734,34	10.221,11	21.318,61
NTN-B 150850 (5,850500%)	5.003.322,70	0,00	0,00	140.975,45	4.912.309,65	49.962,40	101.496,51
	129.652.450,13	1.760.645,42	0,00	1.763.936,68	130.870.490,58	1.221.331,71	

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	31.740.671,70	2.613.854,00	0,00	0,00	34.526.711,19	172.185,49	50.685,24
BB PREV RF IRF M	10.002.182,65	0,00	0,00	0,00	10.045.979,84	43.797,19	107.150,65
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	114.457,94	280.000,00	-115.439,47	0,00	281.074,44	2.055,97	4.599,09
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	2.404,96	0,00	0,00	2.407,87	2,91	2,91
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	29.391.816,51	0,00	0,00	0,00	29.561.321,59	169.505,08	363.346,22
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.352.985,71	0,00	0,00	0,00	16.441.021,17	88.035,46	11.596,85
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	16.186.995,43	1.132.091,15	0,00	0,00	17.336.852,86	17.766,28	87.712,71
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	17.653.056,46	0,00	0,00	0,00	17.755.088,90	102.032,44	218.090,49
	121.442.166,40	4.028.350,11	-115.439,47	0,00	125.950.457,86	595.380,82	

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	1.706.390,55	3.627.161,23	-3.745.945,15	0,00	1.595.054,63	7.448,00	36.804,79
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	12.891.073,19	0,00	-2.586.335,38	0,00	10.413.548,86	108.811,05	265.829,64
	14.597.463,74	3.627.161,23	-6.332.280,53	0,00	12.008.603,49	116.259,05	

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

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	24.256.611,28	0,00	0,00	0,00	24.473.589,88	216.978,60	-941.702,60
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	24.488.254,54	0,00	0,00	0,00	24.990.386,07	502.131,53	-1.308.188,81
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	3.350.838,43	0,00	0,00	0,00	3.401.834,47	50.996,04	-59.994,53
	52.095.704,25	0,00	0,00	0,00	52.865.810,42	770.106,17	

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	11.978.917,11	0,00	0,00	0,00	12.729.959,16	751.042,05	1.273.550,55
	11.978.917,11	0,00	0,00	0,00	12.729.959,16	751.042,05	

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	11.442.570,13	0,00	0,00	0,00	12.094.551,73	651.981,60	841.628,86
	11.442.570,13	0,00	0,00	0,00	12.094.551,73	651.981,60	

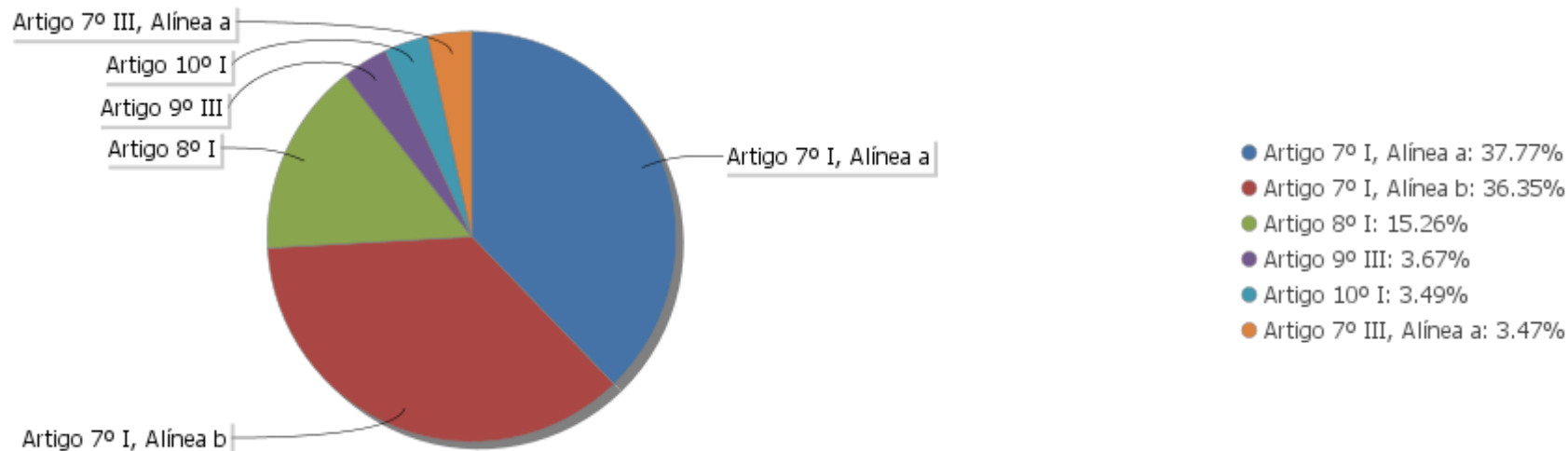
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

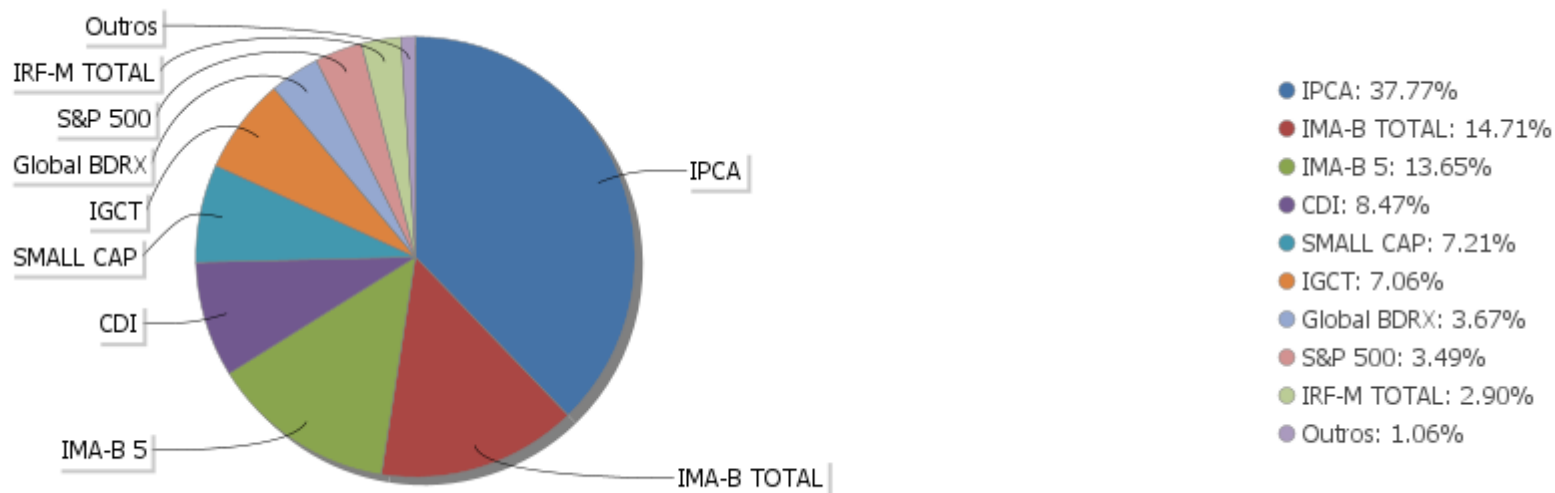
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	212.247.548,19	61,25	60,00	212.247.548,19	61,25	60,00
de 31 dias a 365 dias	3.401.834,47	0,98		215.649.382,66	62,23	60,00
acima de 365 dias	130.870.490,58	37,77	40,00	346.519.873,24	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

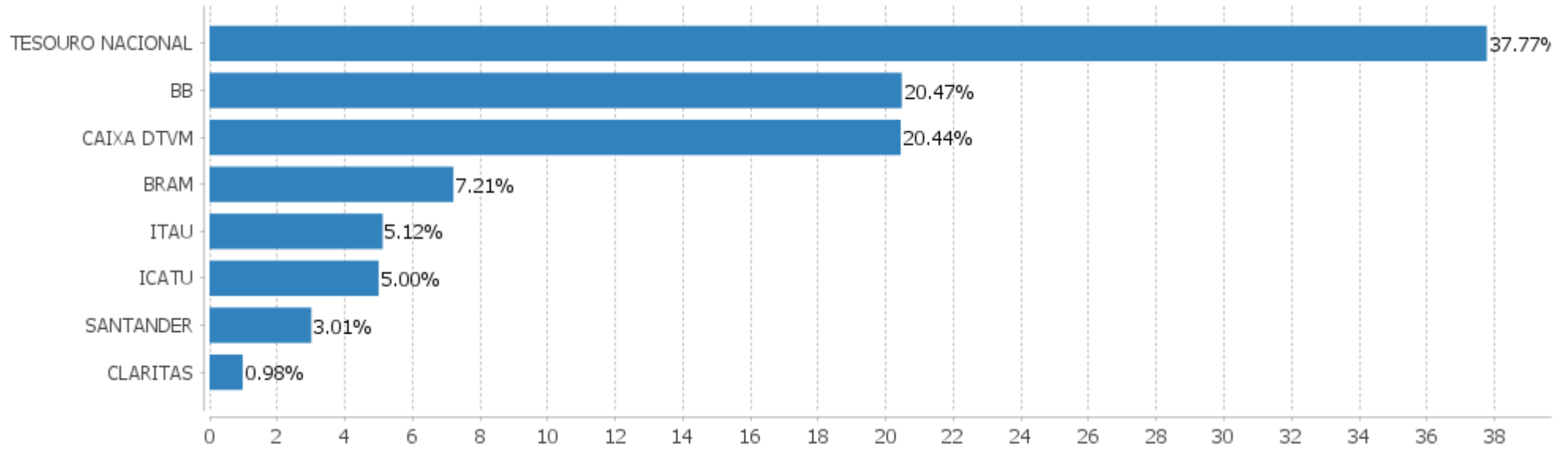


Alocação Por Estratégia



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2024	-0,27	1,20											0,93
IPCA + 4,86%	0,84	1,19											2,04
p.p. indexador	-1,10	0,01											-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	36	48,65
Meses abaixo - Meta Atuarial	38	51,35
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-7,15	2020-03

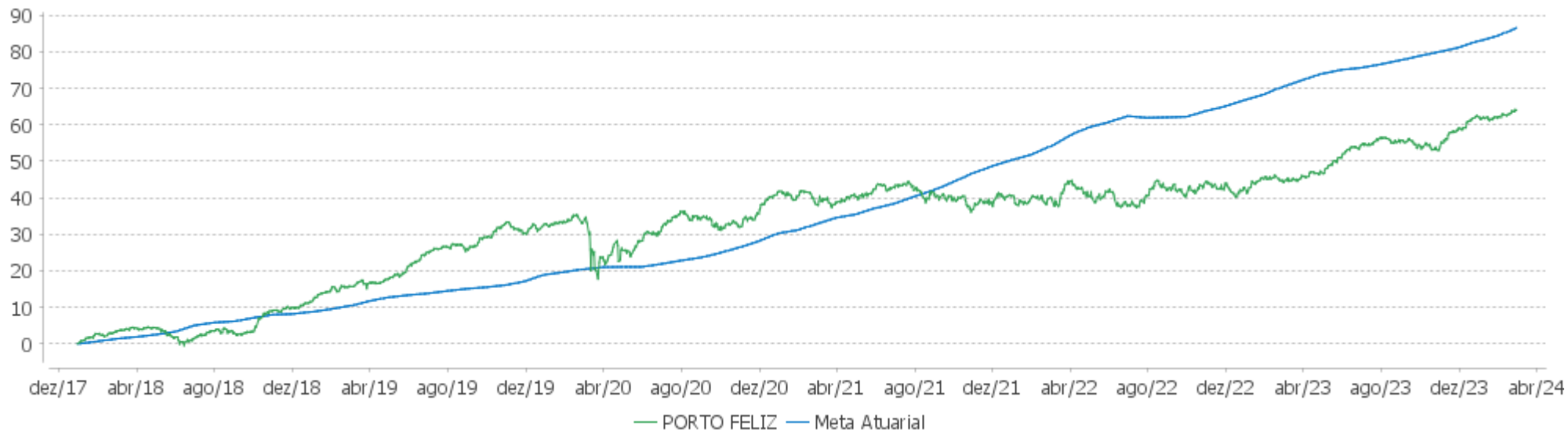
Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,27	3,01	0,27	3,06
06 meses	5,69	5,05	0,64	3,91
12 meses	13,44	9,66	3,78	3,71
24 meses	17,49	21,45	-3,96	5,37
36 meses	18,53	41,45	-22,92	5,53
48 meses	23,23	57,32	-34,09	7,76
60 meses	41,71	73,37	-31,66	7,18
Desde 29/12/2017	64,05	93,87	-29,83	6,73

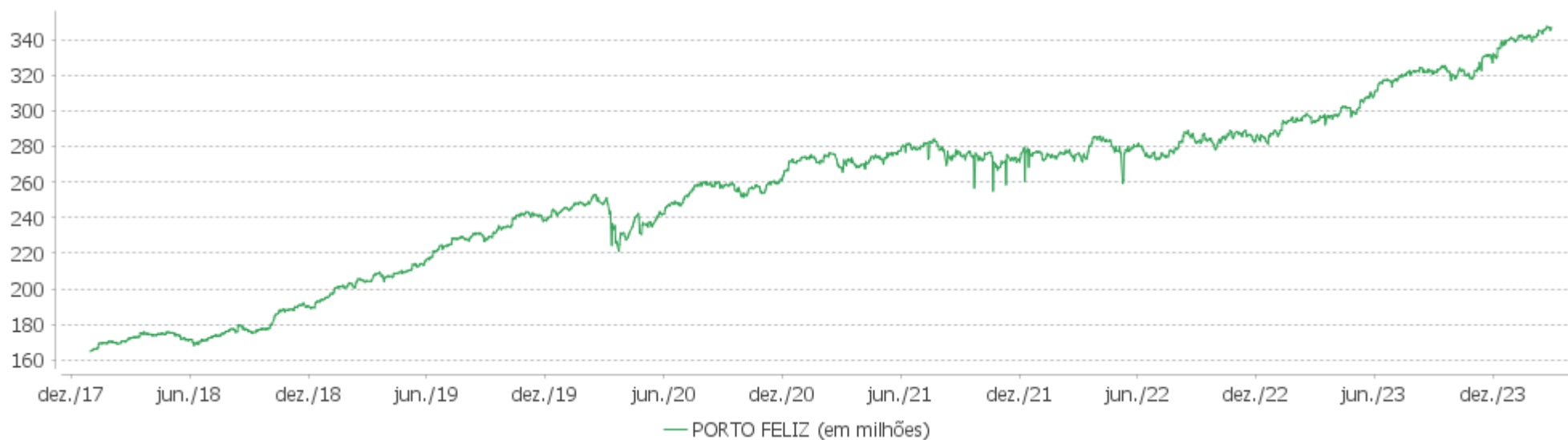


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

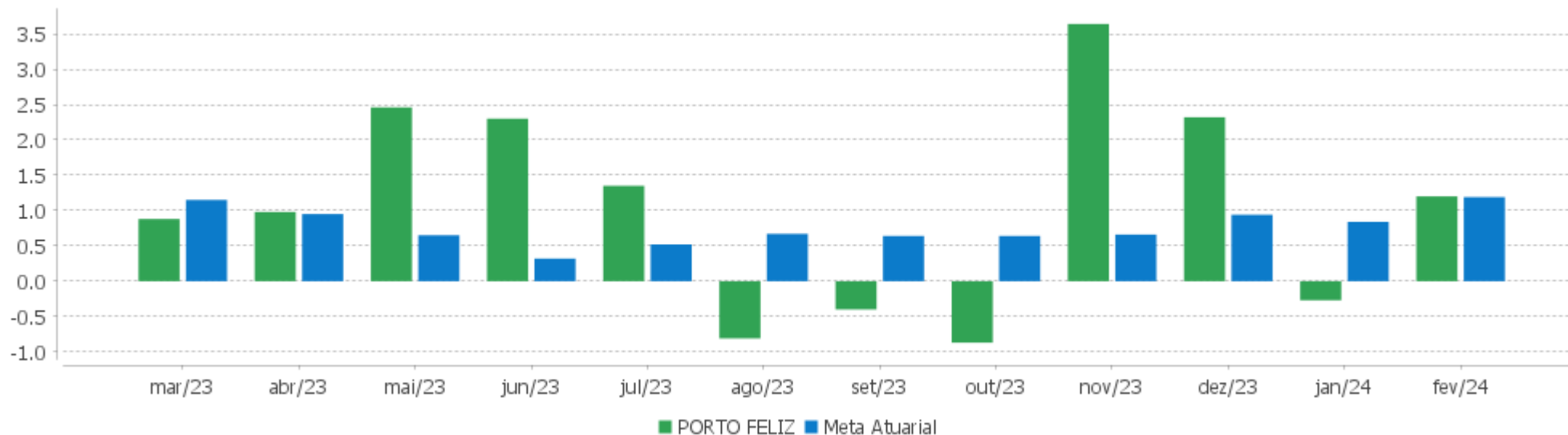


Patrimônio Líquido



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.	0,48 -0,35	-1,11 -2,36	2,75 0,93	3,47 0,85	20,50 16,00	24,34 13,99	17,41 -4,57
NTN-B 150830 (6,000000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,20	2,09 0,84	3,05 1,22	5,28 2,66	10,92 6,43	17,17 6,83	
NTN-B 150840 (5,120004%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,13	1,95 0,70	2,89 1,07	4,91 2,29	10,07 5,57	22,22 11,87	38,36 16,39
NTN-B 150830 (4,069994%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,06	1,79 0,53	2,56 0,74	4,31 1,70	8,89 4,39	19,70 9,36	37,75 15,77
NTN-B 150535 (5,640000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,09 0,84	3,00 1,18	2,21 -0,41	4,51 0,01		
NTN-B 150535 (5,290003%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,15	1,98 0,73	2,91 1,09	4,96 2,35	10,22 5,72	22,58 12,23	38,88 16,90
NTN-B 150535 (5,877000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,07 0,82	3,06 1,24	5,26 2,64	10,84 6,34	23,95 13,61	37,01 15,03
NTN-B 150840 (5,792100%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,06 0,80	3,07 1,25	5,25 2,63	10,78 6,29	23,79 13,45	36,82 14,84
NTN-B 150555 (4,689998%) Var. IPCA p.p.	0,93 0,10	1,88 0,63	2,85 1,03	4,76 2,15	9,69 5,19	21,30 10,95	37,09 15,12
NTN-B 150850 (5,850500%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,07 0,81	3,14 1,32	5,34 2,72	10,91 6,41	17,13 6,79	
NTN-B 150840 (5,481000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,16	2,01 0,76	2,99 1,17	5,09 2,47	10,45 5,96	23,06 12,72	35,87 13,89
NTN-B 150535 (5,601000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,03 0,77	2,85 1,03	2,07 -0,55	4,36 -0,14		
NTN-B 150535 (5,635000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,03 0,78	3,00 1,17	2,21 -0,41	4,51 0,01		
NTN-B 150555 (5,669994%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,04 0,79	3,11 1,29	5,26 2,65	10,73 6,24	23,60 13,25	36,63 14,65
NTN-B 150840 (5,171997%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,14	1,96 0,71	2,91 1,09	4,93 2,32	10,12 5,63	22,34 11,99	38,55 16,57
NTN-B 150850 (5,582500%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,08 0,83	3,07 1,25	5,20 2,58	10,62 6,12	16,77 6,42	
NTN-B 150830 (5,569998%)	1,00	2,02	2,94	5,06	10,47	23,18	39,79

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.	0,17	0,77	1,12	2,44	5,97	12,84	17,82
NTN-B 150555 (5,900000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,07 0,82	3,17 1,35	5,38 2,76	10,98 6,48	24,14 13,79	37,28 15,30
NTN-B 150535 (6,051500%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,20	2,10 0,84	3,10 1,28	5,35 2,73	11,02 6,53	17,31 6,96	
NTN-B 150535 (4,734998%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,11	1,89 0,64	2,77 0,94	4,68 2,07	9,63 5,13	21,19 10,85	36,77 14,79
NTN-B 150535 (4,423526%) Var. IPCA p.p.	0,91 0,08	1,84 0,59	2,68 0,86	4,53 1,91	9,30 4,80	20,50 10,15	35,68 13,70
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,54 -0,01	0,07 -0,03	2,80 -0,05	3,78 -0,09	14,54 -0,16	23,41 -0,40	24,22 -0,73
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,58 -0,02	1,24 -0,03	2,70 -0,06	4,32 -0,11	10,29 -0,15	22,91 -0,30	30,38 -0,62
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI % do CDI	0,61 75,71	1,35 76,02	2,05 76,08	4,37 76,79	9,87 77,47	20,99 76,61	
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,58 -0,02	1,24 -0,03	2,71 -0,05	4,33 -0,10	10,23 -0,21	22,77 -0,44	30,28 -0,72
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,74 -0,02	1,61 0,01	2,51 -0,02	5,40 -0,11	12,42 -0,28	26,44 -0,70	31,50 -1,06
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,44 -0,02	1,10 -0,03	2,57 -0,05	5,62 -0,12	15,44 -0,41	26,85 -0,73	27,01 -1,18
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,53 -0,02	0,05 -0,05	2,79 -0,06	3,75 -0,12	14,39 -0,31	23,18 -0,63	23,98 -0,97
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP % do CDI	0,09 10,66	0,52 29,26	2,69 100,10	6,26 110,08	21,08 165,43	28,13 102,69	20,71 59,86
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,73 90,72	1,61 90,86	2,45 91,05	5,17 90,89	11,62 91,22	24,88 90,81	30,51 88,21
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,86 107,46	1,91 107,60	2,87 106,82	5,96 104,88	13,39 105,10	28,29 103,26	36,50 105,52
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA Var. IBRX 100 p.p.	1,52 0,56	-1,73 1,86	3,53 1,83	8,07 -3,69	17,40 -4,83	13,64 1,47	18,66 3,27
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	0,89 -0,15	-3,71 -0,19	1,61 -0,36	10,84 -0,69	21,10 -2,16	10,25 -2,96	11,61 -4,08
BRANDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	2,05 1,58	-4,97 1,14	0,50 -0,01	2,21 0,51	4,28 -15,12	-11,93 -7,20	-15,75 1,67
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	6,27	11,12	13,99	15,34	32,07	18,33	18,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Global BDRX p.p.	-0,03	-0,26	-0,55	-0,54	-1,21	-2,16	-4,51
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	5,70 -0,11	7,48 -2,50	13,06 0,41	16,03 1,56	36,81 13,97	35,94 23,24	63,10 42,61
PORTO FELIZ Var. IPCA + 4,86% p.p.	1,20 0,01	0,93 -1,11	3,27 0,28	5,69 0,69	13,44 3,91	17,49 -3,77	18,53 -22,06
CDI	0,80	1,78	2,69	5,69	12,74	27,40	34,59
IBOVESPA	0,99	-3,85	1,33	11,47	22,96	14,03	17,25
INPC + 6,00%	1,25	2,35	3,39	5,21	10,04	23,00	44,49
IPCA + 6,00%	1,27	2,22	3,27	5,55	10,71	23,90	45,21

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
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		
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	0,76	1,61	2,53	5,52	12,71	27,14	32,56	36,64	45,55
IRF-M 1+	0,34	0,94	2,69	5,87	17,85	28,53	26,35	29,91	48,38
IRF-M TOTAL	0,46	1,13	2,63	5,74	15,85	27,58	28,20	32,06	47,72
IMA-B 5	0,59	1,28	2,76	4,42	10,44	23,21	31,00	39,16	56,09
IMA-B 5+	0,51	-0,96	2,94	3,37	18,26	24,00	18,75	19,88	46,30
IMA-B TOTAL	0,55	0,10	2,85	3,87	14,70	23,81	24,95	28,90	52,10
IMA-GERAL TOTAL	0,64	1,11	2,75	5,15	14,09	26,08	29,72	34,01	49,13
IDKA 2	0,42	1,23	2,70	4,46	10,12	22,51	30,72	39,80	55,45
IDKA 20	0,22	-3,13	3,25	3,06	28,07	25,16	9,21	7,12	36,25
CDI	0,80	1,78	2,69	5,69	12,74	27,40	34,59	37,78	45,48

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,99	-3,85	1,33	11,47	22,96	14,03	17,25	23,85	34,98
IBRX 100	0,96	-3,59	1,70	11,76	22,23	12,17	15,38	23,37	37,13
IBRX 50	0,91	-3,27	1,87	12,03	21,50	12,09	17,44	26,99	35,38
SMALL CAP	0,47	-6,11	0,51	1,70	19,40	-4,74	-17,42	-15,61	14,52
Índice Consumo - ICON	0,09	-8,26	-2,77	-1,10	5,65	-26,51	-42,10	-41,50	-21,16
Índice Dividendos - IDIV	0,91	-2,64	4,09	13,07	26,16	32,52	44,70	39,59	69,79

**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	5,80	9,98	12,65	14,47	22,83	12,70	20,50	91,09	143,96

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,79	1,47	5,77	4,58	19,64	22,58	16,40	13,37	38,01

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	4,79	7,79	10,70	12,33	15,81	5,67	4,39	64,46	101,55

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,83	1,25	1,82	2,62	4,50	10,34	21,98	28,32	33,45
INPC	0,81	1,38	1,94	2,28	3,86	9,54	21,37	28,92	33,97
IGPM	-0,52	-0,45	0,29	1,76	-3,76	-1,97	13,83	46,78	56,79
SELIC	0,80	1,78	2,69	5,68	12,74	27,39	34,59	37,78	45,47

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,13	1,90	2,79	4,58	8,64	19,29	37,17	49,99	62,22
IPCA + 5,00%	1,20	2,06	3,03	5,07	9,68	21,58	41,15	55,82	70,13
IPCA + 5,50%	1,24	2,14	3,15	5,31	10,20	22,74	43,17	58,79	74,20
IPCA + 5,89%	1,27	2,20	3,24	5,50	10,60	23,64	44,76	61,14	77,43
IPCA + 6,00%	1,27	2,22	3,27	5,55	10,71	23,90	45,21	61,81	78,34
INPC + 4,00%	1,11	2,03	2,91	4,24	7,98	18,43	36,48	50,70	62,84
INPC + 6,00%	1,25	2,35	3,39	5,21	10,04	23,00	44,49	62,57	79,03



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%)	2.883.624,96	4,423526	2.614.461,79	5,670000	-269.163,17
NTN-B 150535 (4,734998%)	11.367.458,98	4,734998	10.568.442,04	5,670000	-799.016,94
NTN-B 150535 (5,290003%)	11.288.040,84	5,290003	10.957.735,85	5,670000	-330.304,99
NTN-B 150535 (5,601000%)	1.770.151,62	5,601000	1.760.669,71	5,670000	-9.481,91
NTN-B 150535 (5,635000%)	1.725.548,54	5,635000	1.720.855,57	5,670000	-4.692,97
NTN-B 150535 (5,640000%)	1.751.480,53	5,640000	1.747.398,33	5,670000	-4.082,20
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.476.491,81	5,877000	5.565.131,89	5,670000	88.640,08
NTN-B 150535 (6,051500%)	1.623.546,25	6,051500	1.672.193,84	5,670000	48.647,59
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.926.714,96	4,689998	2.516.279,32	5,739200	-410.435,64
NTN-B 150555 (5,669994%)	11.106.674,17	5,669994	11.000.886,62	5,739200	-105.787,55
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.487.909,23	5,900000	5.610.138,76	5,739200	122.229,53
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.622.465,38	4,069994	5.205.433,71	5,550000	-417.031,67
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.649.439,18	5,569998	1.651.139,24	5,550000	1.700,06
NTN-B 150830 (6,000000%)	1.537.017,47	6,000000	1.572.927,39	5,550000	35.909,92
NTN-B 150840 (5,120004%)	10.993.610,37	5,120004	10.370.957,99	5,685800	-622.652,38
NTN-B 150840 (5,171997%)	11.170.268,42	5,171997	10.594.791,63	5,685800	-575.476,79
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.396.149,66	5,481000	5.284.229,13	5,685800	-111.920,53
NTN-B 150840 (5,792100%)	21.200.476,17	5,792100	21.430.972,46	5,685800	230.496,29
NTN-B 150850 (5,582500%)	1.024.734,34	5,582500	1.003.088,88	5,745000	-21.645,46
NTN-B 150850 (5,850500%)	4.912.309,65	5,850500	4.980.248,30	5,745000	67.938,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
11	02/02/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,52	0,00	0,42184000	1,2326928540
25	05/02/2024	ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	1.132.091,15	0,00	407.215,95844372	2,7800756000
34	05/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.132.091,15	412.259,30314000	2,7460657440
16	06/02/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	6.231,60	1.748,44869000	3,5640737040
29	07/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	65.368,24	0,00	23.786,34578900	2,7481413320
15	09/02/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	280.000,00	0,00	78.486,99344500	3,5674700700
30	09/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.964.018,68	0,00	714.122,75814300	2,7502535910
10	15/02/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,52	0,00	0,42090300	1,2354370940
28	16/02/2024	NTN-B 150535 (5,601000%)	1.760.645,42	0,00	398,00000000	4.423,7322110553
31	16/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3.291,23	0,00	1.195,32384100	2,7534211960
24	19/02/2024	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	2.613.854,00	0,00	330.640,88448500	7,9054167910
35	19/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.613.854,00	948.958,21808300	2,7544458230
9	20/02/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	47,76	0,00	38,62162500	1,2366128870
8	21/02/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	604,96	0,00	489,05165100	1,2370063540
7	22/02/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	589,04	0,00	476,02946300	1,2374023980
14	23/02/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	23.365,69	6.529,62270000	3,5784134970
6	23/02/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	286,56	0,00	231,50796800	1,2377975670
5	26/02/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	79,60	0,00	64,28732300	1,2381912200
13	27/02/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	72.842,18	20.337,22908800	3,5817160580
4	27/02/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	191,04	0,00	154,24150400	1,2385771280
27	27/02/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	509.841,90	1.994,48287346	255,6261108000
26	27/02/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.076.493,48	8.123,16657912	255,6261108000
12	28/02/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	13.000,00	3.628,44599600	3,5828010160
3	28/02/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	477,60	0,00	385,48059200	1,2389728810
32	28/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.484.374,17	0,00	537.468,56469300	2,7617878840
2	29/02/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	127,36	0,00	102,76228600	1,2393651860
33	29/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	110.108,91	0,00	39.853,36099600	2,7628512940
<b>Total</b>			<b>9.416.156,76</b>	<b>6.447.720,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 6.361.652,74

Value-At-Risk: 1,84%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,06	0,79	5,00	0,48	-0,08	0,72	268.829.551,93	77,58
Artigo 8º	15,02	8,14	20,00	1,18	0,05	1,48	52.865.810,42	15,26
Artigo 9º	18,21	5,75	20,00	0,04	0,30	6,27	12.729.959,16	3,67
Artigo 10º	11,03	6,52	20,00	0,14	0,44	5,70	12.094.551,73	3,49
PORTO FELIZ		1,84		1,84			346.519.873,24	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,79%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545	2,82	2,65	0,05	2,65	-0,11	0,48	9.956.378,05	2,87
NTN-B 150535 (4,423526%)	0,58	0,21	-0,00	0,20	0,19	0,91	2.883.624,96	0,83
NTN-B 150535 (4,734998%)	0,61	0,18	-0,00	0,18	0,22	0,94	11.367.458,98	3,28
NTN-B 150535 (5,290003%)	0,76	0,11	-0,00	0,13	0,23	0,98	11.288.040,84	3,26
NTN-B 150535 (5,601000%)	3.708,52	0,22	-0,00	0,24	0,00	1,00	1.770.151,62	0,51
NTN-B 150535 (5,635000%)	0,80	0,21	-0,00	0,22	0,25	1,00	1.725.548,54	0,50
NTN-B 150535 (5,640000%)	0,80	0,21	-0,00	0,22	0,25	1,00	1.751.480,53	0,51
NTN-B 150535 (5,877000%)	0,82	0,11	-0,00	0,13	0,26	1,02	5.476.491,81	1,58
NTN-B 150535 (6,051500%)	0,84	0,11	-0,00	0,13	0,27	1,03	1.623.546,25	0,47
NTN-B 150555 (4,689998%)	1,21	0,11	-0,00	0,14	0,11	0,93	2.926.714,96	0,84
NTN-B 150555 (5,669994%)	1,34	0,11	-0,00	0,14	0,15	1,00	11.106.674,17	3,21
NTN-B 150555 (5,900000%)	1,37	0,11	0,00	0,14	0,16	1,02	5.487.909,23	1,58
NTN-B 150830 (4,069994%)	0,47	0,11	-0,00	0,12	0,18	0,89	5.622.465,38	1,62
NTN-B 150830 (5,569998%)	0,59	0,11	-0,00	0,12	0,33	1,00	1.649.439,18	0,48
NTN-B 150830 (6,000000%)	0,62	0,11	-0,00	0,12	0,36	1,03	1.537.017,47	0,44
NTN-B 150840 (5,120004%)	0,90	0,11	-0,00	0,13	0,18	0,96	10.993.610,37	3,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (5,171997%)	0,90	0,11	-0,00	0,13	0,18	0,97	11.170.268,42	3,22
NTN-B 150840 (5,481000%)	0,94	0,11	-0,00	0,13	0,20	0,99	5.396.149,66	1,56
NTN-B 150840 (5,792100%)	0,98	0,11	-0,00	0,13	0,21	1,01	21.200.476,17	6,12
NTN-B 150850 (5,582500%)	1,24	0,11	-0,00	0,14	0,16	1,00	1.024.734,34	0,30
NTN-B 150850 (5,850500%)	1,28	0,11	-0,00	0,14	0,17	1,02	4.912.309,65	1,42
<b>Sub-total</b>	0,80	0,22	0,05		0,18	0,94	130.870.490,58	37,77

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,01	0,01	0,00	0,00	-23,34	0,61	2.407,87	0,00
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	3,25	2,68	0,10	2,68	-0,22	0,09	17.336.852,86	5,00
BB PREV RF IRF M	1,57	1,16	0,03	0,03	-0,23	0,44	10.045.979,84	2,90
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	0,86	0,94	0,04	0,00	-0,26	0,58	17.755.088,90	5,12
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,19	0,10	0,00	0,02	-0,33	0,74	281.074,44	0,08
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,66	1,81	0,14	0,01	-0,16	0,53	34.526.711,19	9,96
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,66	1,81	0,06	0,01	-0,16	0,54	16.441.021,17	4,74
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,85	0,94	0,06	0,01	-0,26	0,58	29.561.321,59	8,53
<b>Sub-total</b>	1,43	1,48	0,42		-0,22	0,48	125.950.457,86	36,35

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,01	0,00	0,01	-4,76	0,73	1.595.054,63	0,46
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,07	0,02	-0,00	0,02	0,87	0,86	10.413.548,86	3,01
<b>Sub-total</b>	0,06	0,02	0,00		0,82	0,85	12.008.603,49	3,47

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,14%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	14,06	7,37	0,07	2,70	0,05	1,52	3.401.834,47	0,98

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	17,12	10,16	0,68	2,54	0,07	2,05	24.990.386,07	7,21
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	14,45	6,75	0,43	0,25	0,01	0,89	24.473.589,88	7,06
<b>Sub-total</b>	<b>15,02</b>	<b>8,14</b>	<b>1,18</b>		<b>0,05</b>	<b>1,48</b>	<b>52.865.810,42</b>	<b>15,26</b>

**Investimentos no Exterior**

Value-At-Risk: 5,75%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,21	5,75	0,04	0,48	0,30	6,27	12.729.959,16	3,67
<b>Sub-total</b>	<b>18,21</b>	<b>5,75</b>	<b>0,04</b>		<b>0,30</b>	<b>6,27</b>	<b>12.729.959,16</b>	<b>3,67</b>

**Investimentos Estruturados**

Value-At-Risk: 6,52%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11,03	6,52	0,14	4,93	0,44	5,70	12.094.551,73	3,49
<b>Sub-total</b>	<b>11,03</b>	<b>6,52</b>	<b>0,14</b>		<b>0,44</b>	<b>5,70</b>	<b>12.094.551,73</b>	<b>3,49</b>

(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 (%)