



LDB
EMPRESAS

PORTO FELIZ
MARÇO 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 28.03.2024.

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

83,87%

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	6,67	-0,07	-0,70	-1,80	9.886.745,31	2,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,423526%)	0,41	-0,02	0,90	2,76	2.909.535,61	0,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,734998%)	0,47	-0,04	0,92	2,83	11.472.329,16	3,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290003%)	0,41	0,03	0,96	2,96	11.396.878,53	3,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,601000%)	1.003,17	0,03	0,99	1,53	1.787.637,47	0,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,635000%)	4,04	0,03	0,99	3,04	1.742.636,88	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,640000%)	4,04	0,03	0,99	3,10	1.768.833,71	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,877000%)	0,43	0,03	1,01	3,10	5.531.737,63	1,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,051500%)	0,44	0,03	1,02	3,14	1.640.138,95	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (4,689998%)	0,58	0,03	0,92	2,82	2.953.594,15	0,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,669994%)	0,63	0,03	0,99	3,05	11.216.976,64	3,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,900000%)	0,64	0,03	1,01	3,11	5.543.363,71	1,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,069994%)	0,33	0,03	0,87	2,67	5.671.430,20	1,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,569998%)	0,36	0,03	0,99	3,03	1.665.694,91	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,000000%)	0,37	0,03	1,02	3,13	1.552.664,86	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%)	0,46	0,03	0,95	2,92	11.098.179,02	3,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,171997%)	0,46	0,03	0,96	2,93	11.276.974,92	3,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,481000%)	0,48	0,03	0,98	3,01	5.448.961,78	1,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,792100%)	0,49	0,03	1,00	3,08	21.412.982,77	6,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,582500%)	0,55	0,03	0,99	3,09	1.034.842,28	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,850500%)	0,60	0,03	1,01	3,09	4.961.762,37	1,42
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,69	0,02	0,84	2,61	131.973.900,86	37,66

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	0,63	0,86	9.401,51	0,00	159.829.680.659,32	0,00
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	5,18	0,00	0,04	0,56	17.344.037,50	4,95	286.627.961,42	6,05
BB	BB	BB PREV RF IRF M	2,20	0,02	0,50	1,61	10.096.556,94	2,88	4.229.973.113,40	0,24
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	1,69	0,08	0,75	2,01	17.888.980,41	5,10	1.549.129.506,23	1,15
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,24	0,04	0,80	2,43	299.284,07	0,09	8.304.571.205,30	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,90	-0,00	0,06	0,11	43.357.451,72	12,37	5.324.825.927,52	0,81
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,88	-0,00	0,06	0,13	16.450.330,96	4,69	5.029.824.301,86	0,33
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,68	0,08	0,75	2,01	29.783.826,55	8,50	7.792.392.111,13	0,38
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,75	0,03	0,36	1,03	135.229.869,66	38,59		

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	0,06	0,04	0,75	2,14	18.897.343,55	5,39	4.354.660.093,34	0,43

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	2,79	7.850.646,38	2,24	2.837.635.942,66	0,28
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,09	0,04	0,84	2,73	26.747.989,93	7,63		
Renda Fixa			1,34	0,02	0,61	1,90	293.951.760,45	83,87		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

8,80%

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	17,15	0,39	1,54	-0,22	6.489.297,36	1,85	802.077.391,84	0,81
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	20,52	0,00	0,91	-4,11	0,00	0,00	652.744.629,19	0,00
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	15,43	0,35	-0,50	-4,18	24.352.299,26	6,95	755.856.831,55	3,22
Sub-total Artigo 8º I			17,41	0,36	0,41	-3,80	30.841.596,62	8,80		
Renda Variável			17,41	0,36	0,41	-3,80	30.841.596,62	8,80		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,76%

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	14,00	0,35	3,48	14,98	13.172.692,49	3,76	2.280.222.056,45	0,58
Sub-total Artigo 9º III			14,00	0,35	3,48	14,98	13.172.692,49	3,76		
Investimentos no Exterior			13,99	0,35	3,48	14,98	13.172.692,49	3,76		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,57%

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	11,49	0,14	3,39	11,13	12.505.103,45	3,57	1.864.604.527,50	0,67
Sub-total Artigo 10º I			11,49	0,14	3,39	11,13	12.505.103,45	3,57		
Investimentos Estruturados			11,48	0,14	3,39	11,13	12.505.103,45	3,57		
Total			3,65	0,07	0,78	1,72	350.471.153,01	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	131.973.900,86	37,66	0,00	35,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	135.229.869,66	38,59	0,00	38,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	26.747.989,93	7,63	0,00	3,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	293.951.760,45	83,87					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	30.841.596,62	8,80	0,00	12,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	30.841.596,62	8,80					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	13.172.692,49	3,76	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	13.172.692,49	3,76					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	12.505.103,45	3,57	0,00	2,50	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	12.505.103,45	3,57					15,00
Total		350.471.153,01	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	0,84 101,16	2,61 99,33	2,61 99,33	5,31 95,95	10,23 82,73	1.103.410,29	3.352.510,78
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,36 42,64	1,03 39,20	1,03 39,20	5,20 93,97	10,39 84,02	457.892,64	1.301.076,80
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,84 100,72	2,73 104,08	2,73 104,08	5,69 102,77	12,91 104,44	122.212,96	424.847,39
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	0,41 1,11	-3,80 0,73	-3,80 0,73	7,80 -2,10	17,70 -8,04	193.460,83	-2.116.425,11
Artigo 9º III % do CDI	3,48 417,27	14,98 570,76	14,98 570,76	23,17 418,47	31,80 257,20	442.733,33	1.716.283,88
Artigo 10º I % do CDI	3,39 407,27	11,13 423,95	11,13 423,95	25,56 461,66	36,20 292,86	410.551,72	1.252.180,58
PORTO FELIZ (Total)						2.730.261,77	5.930.474,32

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%)	2.883.624,96	0,00	0,00	0,00	2.909.535,61	25.910,65	78.088,93
NTN-B 150535 (4,734998%)	11.367.458,98	0,00	0,00	0,00	11.472.329,16	104.870,18	316.015,66
NTN-B 150535 (5,290003%)	11.288.040,84	0,00	0,00	0,00	11.396.878,53	108.837,69	327.864,03
NTN-B 150535 (5,601000%)	1.770.151,62	0,00	0,00	0,00	1.787.637,47	17.485,85	26.992,05
NTN-B 150535 (5,635000%)	1.725.548,54	0,00	0,00	0,00	1.742.636,88	17.088,34	51.471,84
NTN-B 150535 (5,640000%)	1.751.480,53	0,00	0,00	0,00	1.768.833,71	17.353,18	53.237,19
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.476.491,81	0,00	0,00	0,00	5.531.737,63	55.245,82	166.366,28
NTN-B 150535 (6,051500%)	1.623.546,25	0,00	0,00	0,00	1.640.138,95	16.592,70	49.960,94
NTN-B 150545	9.956.378,04	0,00	0,00	0,00	9.886.745,31	-69.632,73	-181.198,34
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.926.714,96	0,00	0,00	0,00	2.953.594,15	26.879,19	81.000,74
NTN-B 150555 (5,669994%)	11.106.674,17	0,00	0,00	0,00	11.216.976,64	110.302,47	332.195,11
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.487.909,23	0,00	0,00	0,00	5.543.363,71	55.454,48	166.995,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.622.465,38	0,00	0,00	0,00	5.671.430,20	48.964,82	149.424,88
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.649.439,18	0,00	0,00	0,00	1.665.694,91	16.255,73	49.621,54
NTN-B 150830 (6,000000%)	1.537.017,47	0,00	0,00	0,00	1.552.664,86	15.647,39	47.771,05
NTN-B 150840 (5,120004%)	10.993.610,37	0,00	0,00	0,00	11.098.179,02	104.568,65	319.017,07
NTN-B 150840 (5,171997%)	11.170.268,42	0,00	0,00	0,00	11.276.974,92	106.706,50	325.521,60
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.396.149,66	0,00	0,00	0,00	5.448.961,78	52.812,12	161.164,17
NTN-B 150840 (5,792100%)	21.200.476,17	0,00	0,00	0,00	21.412.982,77	212.506,60	648.624,62
NTN-B 150850 (5,582500%)	1.024.734,34	0,00	0,00	0,00	1.034.842,28	10.107,94	31.426,55
NTN-B 150850 (5,850500%)	4.912.309,65	0,00	0,00	0,00	4.961.762,37	49.452,72	150.949,23
	130.870.490,57	0,00	0,00	0,00	131.973.900,86	1.103.410,29	

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	34.526.711,19	8.799.091,15	0,00	0,00	43.357.451,72	31.649,38	82.334,62
BB PREV RF IRF M	10.045.979,84	0,00	0,00	0,00	10.096.556,94	50.577,10	157.727,75
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	281.074,44	136.500,00	-121.029,03	0,00	299.284,07	2.738,66	7.337,75
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	2.407,87	6.957,04	0,00	0,00	9.401,51	36,60	39,51
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	29.561.321,59	0,00	0,00	0,00	29.783.826,55	222.504,96	585.851,18
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.441.021,17	0,00	0,00	0,00	16.450.330,96	9.309,79	20.906,64
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	17.336.852,86	0,00	0,00	0,00	17.344.037,50	7.184,64	94.897,35
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	17.755.088,90	0,00	0,00	0,00	17.888.980,41	133.891,51	351.982,00
	125.950.457,86	8.942.548,19	-121.029,03	0,00	135.229.869,66	457.892,64	

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	1.595.054,63	21.246.035,22	-3.978.100,33	0,00	18.897.343,55	34.354,03	71.158,82
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	10.413.548,86	0,00	-2.650.761,41	0,00	7.850.646,38	87.858,93	353.688,57
	12.008.603,49	21.246.035,22	-6.628.861,74	0,00	26.747.989,93	122.212,96	

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	24.473.589,88	0,00	0,00	0,00	24.352.299,26	-121.290,62	-1.062.993,22
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	24.990.386,07	0,00	-25.217.674,63	0,00	0,00	227.288,56	-1.080.900,25
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	3.401.834,47	3.000.000,00	0,00	0,00	6.489.297,36	87.462,89	27.468,36
	52.865.810,42	3.000.000,00	-25.217.674,63	0,00	30.841.596,62	193.460,83	

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	12.729.959,16	0,00	0,00	0,00	13.172.692,49	442.733,33	1.716.283,88
	12.729.959,16	0,00	0,00	0,00	13.172.692,49	442.733,33	

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	12.094.551,73	0,00	0,00	0,00	12.505.103,45	410.551,72	1.252.180,58
	12.094.551,73	0,00	0,00	0,00	12.505.103,45	410.551,72	

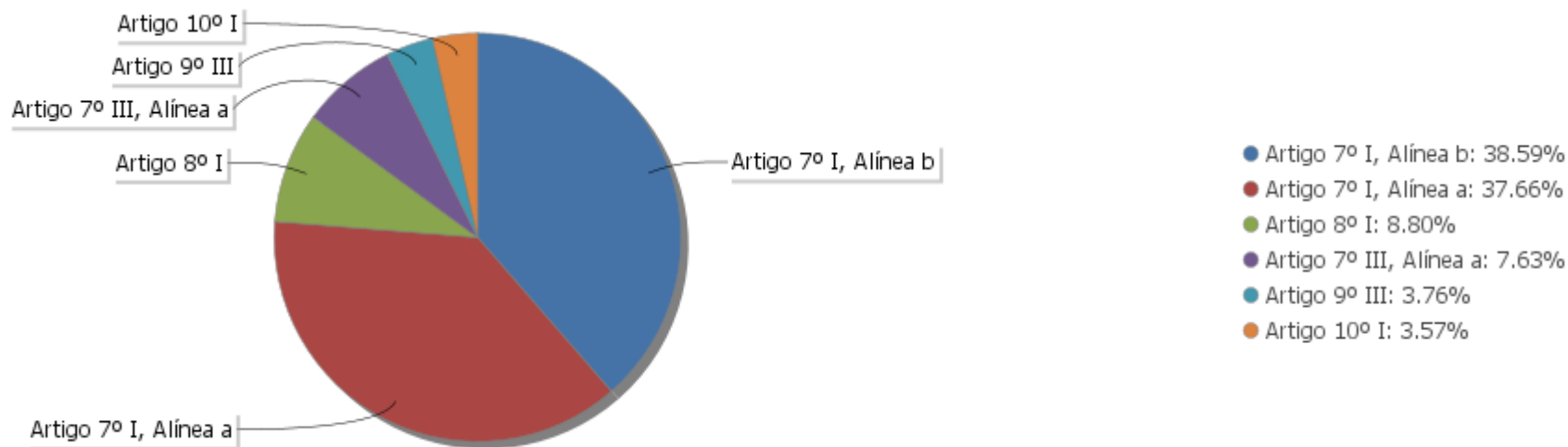
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

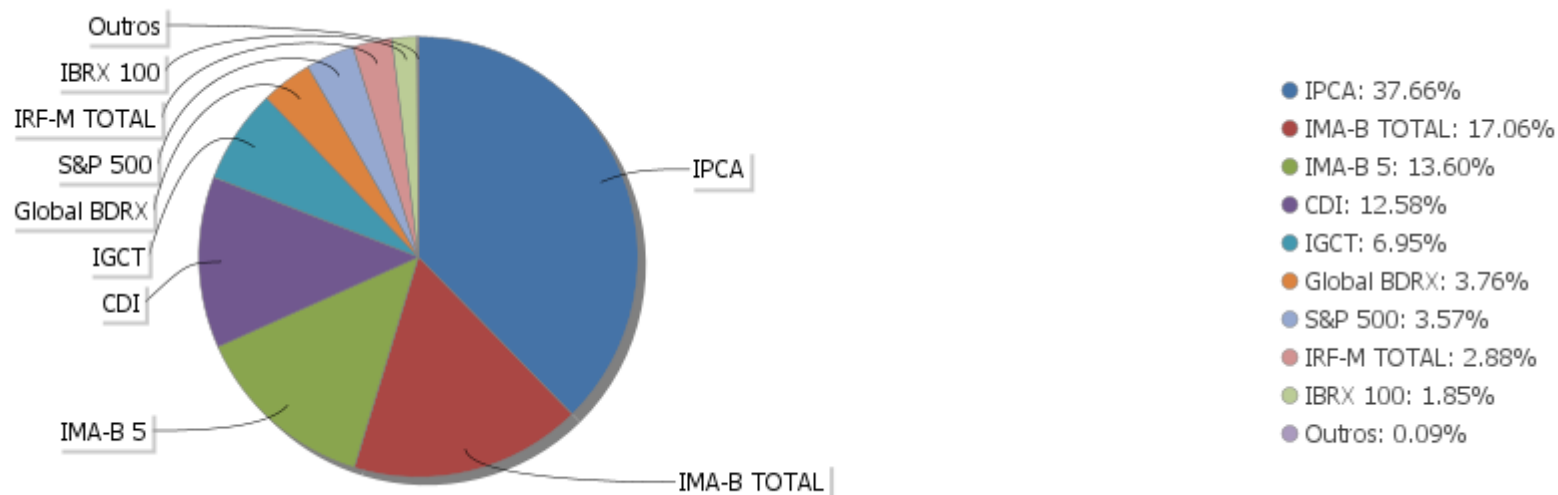
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	212.007.954,79	60,49	60,00	212.007.954,79	60,49	60,00
de 31 dias a 365 dias	6.489.297,36	1,85		218.497.252,15	62,34	60,00
acima de 365 dias	131.973.900,86	37,66	40,00	350.471.153,01	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

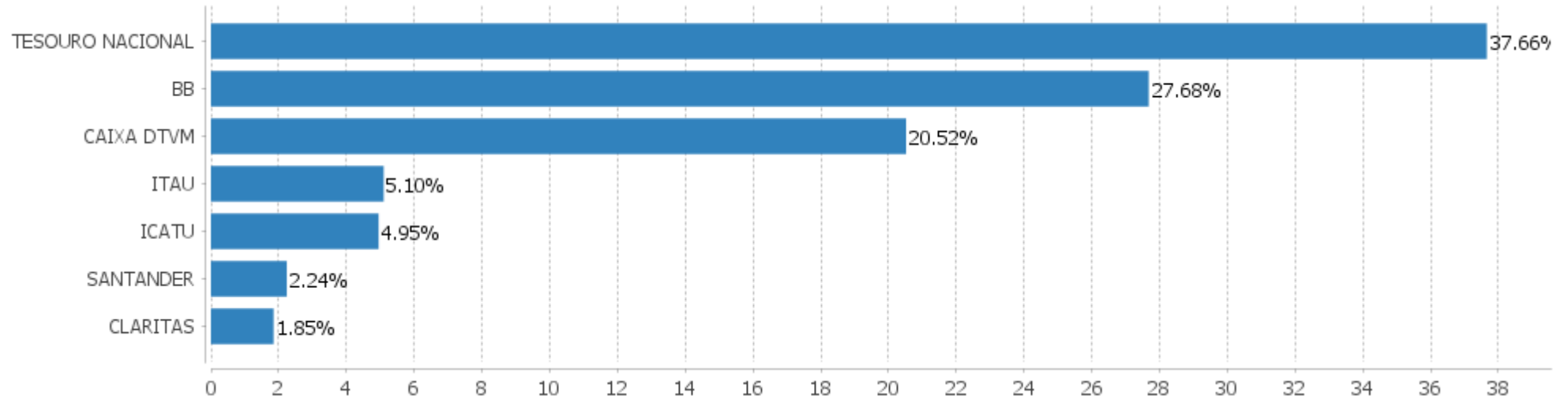


Alocação Por Estratégia



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	0,78										1,72
IPCA + 4,86%	0,84	1,19	0,54										2,59
p.p. indexador	-1,10	0,01	0,25										-0,87
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	37	49,33
Meses abaixo - Meta Atuarial	38	50,67

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

Relatório

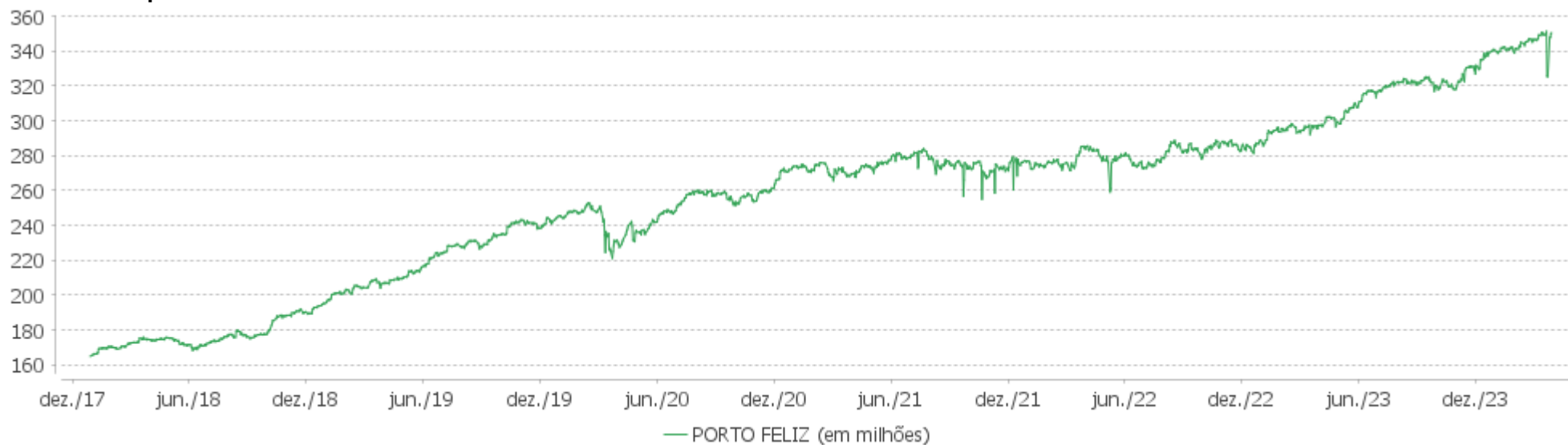
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,72	2,59	-0,87	2,80
06 meses	6,94	4,93	2,01	3,68
12 meses	13,33	8,99	4,34	3,65
24 meses	14,92	19,66	-4,74	5,10
36 meses	19,07	40,22	-21,15	5,44
48 meses	33,77	57,27	-23,51	5,99
60 meses	42,00	72,25	-30,24	7,14
Desde 29/12/2017	65,33	94,91	-29,58	6,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

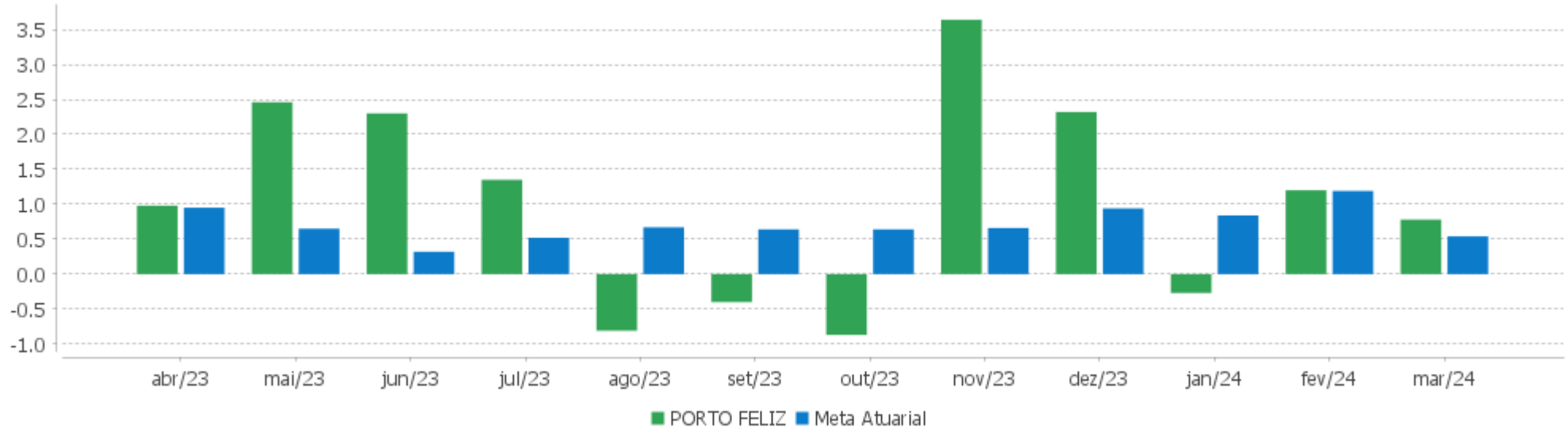


Patrimônio Líquido



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.	-0,70 -0,86	-1,80 -3,22	-1,80 -3,22	4,80 2,28	15,07 11,14	19,48 10,72	17,89 -3,16
NTN-B 150830 (6,000000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,86	3,13 1,71	3,13 1,71	5,59 3,08	10,40 6,48	16,30 7,54	
NTN-B 150840 (5,120004%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,79	2,92 1,51	2,92 1,51	5,23 2,71	9,56 5,64	21,31 12,55	37,44 16,39
NTN-B 150830 (4,069994%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,71	2,67 1,26	2,67 1,26	4,63 2,11	8,40 4,47	18,83 10,07	36,84 15,79
NTN-B 150535 (5,640000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,10 1,69	3,10 1,69	2,52 0,00	4,02 0,10		
NTN-B 150535 (5,290003%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,80	2,96 1,55	2,96 1,55	5,28 2,77	9,71 5,78	21,67 12,91	37,94 16,89
NTN-B 150535 (5,877000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,10 1,69	3,10 1,69	5,58 3,06	10,32 6,39	23,03 14,27	36,08 15,03
NTN-B 150840 (5,792100%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,08 1,67	3,08 1,67	5,57 3,05	10,27 6,34	22,87 14,11	35,89 14,84
NTN-B 150555 (4,689998%) Var. IPCA p.p.	0,92 0,76	2,82 1,40	2,82 1,40	5,08 2,57	9,19 5,26	20,40 11,65	36,18 15,13
NTN-B 150850 (5,850500%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,09 1,68	3,09 1,68	5,66 3,14	10,39 6,46	16,26 7,50	
NTN-B 150840 (5,481000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,82	3,01 1,59	3,01 1,59	5,41 2,90	9,94 6,02	22,15 13,39	34,95 13,90
NTN-B 150535 (5,601000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,04 1,62	3,04 1,62	2,38 -0,14	3,88 -0,05		
NTN-B 150535 (5,635000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,04 1,63	3,04 1,63	2,52 0,00	4,02 0,10		
NTN-B 150555 (5,669994%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,05 1,64	3,05 1,64	5,58 3,07	10,22 6,29	22,68 13,92	35,70 14,66
NTN-B 150830 (5,569998%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,03 1,61	3,03 1,61	5,38 2,87	9,96 6,03	22,27 13,51	38,85 17,80
NTN-B 150850 (5,582500%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,09 1,67	3,09 1,67	5,52 3,00	10,11 6,18	15,90 7,14	
NTN-B 150840 (5,171997%)	0,96	2,93	2,93	5,25	9,62	21,43	37,62

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.	0,80	1,52	1,52	2,74	5,69	12,67	16,57
NTN-B 150555 (5,900000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,11 1,69	3,11 1,69	5,70 3,18	10,46 6,53	23,21 14,45	36,34 15,29
NTN-B 150535 (4,423526%) Var. IPCA p.p.	0,90 0,74	2,76 1,34	2,76 1,34	4,84 2,33	8,81 4,88	19,68 10,92	34,78 13,73
NTN-B 150535 (6,051500%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,86	3,14 1,73	3,14 1,73	5,66 3,15	10,50 6,58	16,43 7,67	
NTN-B 150535 (4,734998%) Var. IPCA p.p.	0,92 0,76	2,83 1,42	2,83 1,42	5,00 2,49	9,13 5,21	20,40 11,64	35,86 14,81
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,06 -0,02	0,13 -0,05	0,13 -0,05	4,84 -0,10	11,64 -0,17	19,81 -0,40	24,88 -0,74
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,75 -0,02	2,01 -0,05	2,01 -0,05	4,98 -0,10	9,48 -0,15	20,72 -0,29	30,95 -0,60
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI % do CDI	0,63 75,05	1,98 75,60	1,98 75,60	4,22 76,21	9,54 77,14	20,85 76,41	
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,75 -0,02	2,01 -0,05	2,01 -0,05	4,99 -0,10	9,42 -0,20	20,58 -0,43	30,83 -0,72
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,80 -0,04	2,43 -0,03	2,43 -0,03	5,30 -0,12	11,98 -0,29	26,36 -0,72	32,53 -1,08
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,06 -0,02	0,11 -0,07	0,11 -0,07	4,82 -0,12	11,56 -0,25	19,65 -0,56	24,65 -0,97
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP % do CDI	0,04 4,97	0,56 21,39	0,56 21,39	7,19 129,89	17,09 138,24	26,63 97,59	23,85 67,28
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,50 -0,04	1,61 -0,07	1,61 -0,07	6,00 -0,12	13,61 -0,42	26,42 -0,78	28,75 -1,23
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,75 90,51	2,38 90,70	2,38 90,70	5,02 90,65	11,27 91,14	24,78 90,83	31,36 88,48
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,86 103,63	2,79 106,36	2,79 106,36	5,80 104,72	13,09 105,91	28,17 103,25	37,34 105,36
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA Var. IBRX 100 p.p.	1,54 2,27	-0,22 4,07	-0,22 4,07	10,92 0,91	26,51 1,34	7,53 2,44	16,47 8,45
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	-0,50 -0,06	-4,18 -0,25	-4,18 -0,25	9,30 -0,69	24,86 -1,96	3,40 -2,75	5,04 -3,82
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	-0,11 -2,26	-5,08 -0,99	-5,08 -0,99	4,69 -2,24	9,20 -14,94	-19,36 -8,80	-18,39 0,94
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	3,48	14,98	14,98	23,77	32,44	27,69	18,24

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.	-0,57	-0,90	-0,90	-1,11	-2,21	-2,86	-5,60
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	3,39 0,03	11,13 -2,55	11,13 -2,55	25,56 3,31	36,04 10,29	34,42 12,11	62,08 46,10
PORTO FELIZ Var. IPCA + 4,86% p.p.	0,78 0,25	1,72 -0,87	1,72 -0,87	6,94 2,04	13,33 4,46	14,92 -4,55	19,07 -20,36
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00

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		
BRANCO 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	0,84	2,46	2,46	5,42	12,28	27,08	33,61	36,96	46,08
IRF-M 1+	0,43	1,37	1,37	6,49	15,26	28,03	28,76	31,09	48,08
IRF-M TOTAL	0,54	1,68	1,68	6,13	14,03	27,20	29,99	32,91	47,66
IMA-B 5	0,77	2,06	2,06	5,09	9,62	21,01	31,56	42,74	56,07
IMA-B 5+	-0,55	-1,51	-1,51	4,82	13,38	19,08	19,49	33,85	44,87
IMA-B TOTAL	0,08	0,18	0,18	4,94	11,81	20,21	25,62	38,67	51,35
IMA-GERAL TOTAL	0,52	1,64	1,64	5,51	12,59	24,78	30,91	37,43	49,07
IDKA 2	0,99	2,24	2,24	5,19	9,48	20,66	31,64	42,92	55,95
IDKA 20	-1,51	-4,59	-4,59	5,22	18,67	18,54	9,63	26,29	33,79
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84	75,44	34,26
IBRX 100	-0,73	-4,29	-4,29	10,02	25,18	5,09	8,02	75,18	36,28
IBRX 50	-0,81	-4,06	-4,06	9,78	24,88	5,45	9,81	80,89	34,52
SMALL CAP	2,15	-4,09	-4,09	6,93	24,13	-10,57	-19,33	32,77	16,87
Índice Consumo - ICON	1,26	-7,10	-7,10	4,34	13,75	-29,62	-42,70	-13,51	-19,55
Índice Dividendos - IDIV	-1,20	-3,81	-3,81	10,25	27,20	19,02	32,90	85,19	70,79

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	3,37	13,68	13,68	22,26	25,75	22,31	15,98	95,38	137,68

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,43	2,92	2,92	5,87	23,44	22,60	19,72	36,65	37,26

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,14	11,17	11,17	18,97	19,08	16,07	2,01	70,15	97,45

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,16	1,42	1,42	2,51	3,93	8,76	21,05	28,43	32,67
INPC	0,19	1,58	1,58	2,36	3,40	7,91	20,56	28,93	33,20
IGPM	-0,47	-0,91	-0,91	0,91	-4,26	-4,10	10,07	44,30	54,12
SELIC	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,47	2,38	2,38	4,48	8,00	17,54	36,06	50,08	61,29
IPCA + 5,00%	0,55	2,62	2,62	4,96	9,02	19,79	39,99	55,90	69,16
IPCA + 5,50%	0,59	2,74	2,74	5,21	9,53	20,92	41,99	58,87	73,21
IPCA + 5,89%	0,62	2,83	2,83	5,39	9,92	21,81	43,56	61,21	76,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00	61,88	77,34
INPC + 4,00%	0,50	2,55	2,55	4,32	7,45	16,62	35,51	50,66	61,93
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43	62,51	78,04

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%)	2.909.535,61	4,423526	2.604.733,98	5,847100	-304.801,63
NTN-B 150535 (4,734998%)	11.472.329,16	4,734998	10.529.119,28	5,847100	-943.209,88
NTN-B 150535 (5,290003%)	11.396.878,53	5,290003	10.916.964,61	5,847100	-479.913,92
NTN-B 150535 (5,601000%)	1.787.637,47	5,601000	1.754.118,66	5,847100	-33.518,81
NTN-B 150535 (5,635000%)	1.742.636,88	5,635000	1.714.452,66	5,847100	-28.184,22
NTN-B 150535 (5,640000%)	1.768.833,71	5,640000	1.740.896,66	5,847100	-27.937,05
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.531.737,63	5,877000	5.544.425,31	5,847100	12.687,68
NTN-B 150535 (6,051500%)	1.640.138,95	6,051500	1.665.971,99	5,847100	25.833,04
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.953.594,15	4,689998	2.494.864,75	5,874700	-458.729,40
NTN-B 150555 (5,669994%)	11.216.976,64	5,669994	10.907.264,55	5,874700	-309.712,09
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.543.363,71	5,900000	5.562.394,17	5,874700	19.030,46
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.671.430,20	4,069994	5.206.313,36	5,739900	-465.116,84
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.665.694,91	5,569998	1.651.418,26	5,739900	-14.276,65
NTN-B 150830 (6,000000%)	1.552.664,86	6,000000	1.573.193,19	5,739900	20.528,33
NTN-B 150840 (5,120004%)	11.098.179,02	5,120004	10.294.272,13	5,857500	-803.906,89
NTN-B 150840 (5,171997%)	11.276.974,92	5,171997	10.516.450,67	5,857500	-760.524,25
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.448.961,78	5,481000	5.245.156,01	5,857500	-203.805,77
NTN-B 150840 (5,792100%)	21.412.982,77	5,792100	21.272.505,65	5,857500	-140.477,12
NTN-B 150850 (5,582500%)	1.034.842,28	5,582500	995.073,85	5,883900	-39.768,43
NTN-B 150850 (5,850500%)	4.961.762,37	5,850500	4.940.454,36	5,883900	-21.308,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
96	01/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3.182,38	0,00	1.151,38146600	2,7639666720
95	01/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.182,38	1.151,38146700	2,7639666720
110	01/03/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	206,96	0,00	166,93569000	1,2397588500
62	01/03/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	10.000,00	2.788,34520256	3,5863565210
94	04/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.182,38	1.150,94151300	2,7650232130
109	04/03/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	270,64	0,00	218,23140600	1,2401514720
108	05/03/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	191,04	0,00	153,99670300	1,2405460370
61	05/03/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	2.000,00	557,10291600	3,5900009520
107	06/03/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	525,36	0,00	423,35753700	1,2409369220
93	07/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	70.389,51	0,00	25.428,40601100	2,7681448050
92	07/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	163,57	59,09011700	2,7681448050
106	07/03/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	270,64	0,00	218,02673800	1,2413156390
91	08/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.294.234,68	0,00	828.477,13931600	2,7692190540
105	08/03/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	238,80	0,00	192,31488500	1,2417135550
90	11/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	152.495,03	55.047,34161400	2,7702523960
104	11/03/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	206,96	0,00	166,62000000	1,2421077870
60	11/03/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	136.500,00	0,00	37.958,81780300	3,5960024020
103	12/03/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	159,20	0,00	128,12831400	1,2425044400
102	13/03/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	636,80	0,00	512,35083400	1,2428983360
116	14/03/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	350,24	0,00	281,70289400	1,2432957090
115	15/03/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	636,80	0,00	512,02471600	1,2436899620
114	18/03/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	764,16	0,00	614,23520900	1,2440836800
113	19/03/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	1.623,84	0,00	1.304,83742800	1,2444768710
89	20/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.132.091,15	407.573,91530800	2,77763339640
88	20/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.667.000,00	960.169,71082800	2,77763339640
112	20/03/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	334,32	0,00	268,55825700	1,2448695610
78	20/03/2024	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	2.667.000,00	0,00	336.741,29484100	7,9200265630
56	20/03/2024	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	1.132.091,15	0,00	142.940,32235800	7,9200265630

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
111	21/03/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	143,28	0,00	115,06105900	1,2452518770
79	21/03/2024	BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	0,00	25.217.674,63	2.664.094,78213590	9,4657573000
101	22/03/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	127,36	0,00	102,24569300	1,2456270340
87	25/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	17.217.674,63	0,00	6.191.811,25434700	2,7807169700
86	25/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	17.639,37	6.343,46112500	2,7807169700
100	25/03/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	127,36	0,00	102,21514100	1,2459993540
59	25/03/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	10.500,00	2.908,76493200	3,6097794920
58	25/03/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	23.603,88	6.538,87032500	3,6097794920
77	25/03/2024	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5.000.000,00	0,00	632.512,13265228	7,9049867060
99	26/03/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	15,92	0,00	12,77308300	1,2463709400
57	26/03/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	74.925,15	20.751,29414100	3,6106254140
81	26/03/2024	CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	3.000.000,00	0,00	694.792,68354401	4,3178347700
82	26/03/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.650.761,41	10.279,90555502	257,8585373000
85	27/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.591.976,82	0,00	572.098,93678300	2,7826949460
84	27/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.346,45	843,22933200	2,7826949460
98	27/03/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	127,36	0,00	102,15409400	1,2467439630
83	28/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	68.577,20	0,00	24.635,32350000	2,7836939100
Total			33.188.583,41	31.967.565,40		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.551.213,45

Value-At-Risk: 1,01%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,95	0,52	5,00	0,35	-0,23	0,62	293.951.760,45	83,87
Artigo 8º	12,48	5,94	20,00	0,46	-0,03	0,41	30.841.596,62	8,80
Artigo 9º	12,38	5,51	20,00	0,07	0,21	3,48	13.172.692,49	3,76
Artigo 10º	9,64	5,09	20,00	0,13	0,27	3,39	12.505.103,45	3,57
PORTO FELIZ		1,01		1,01			350.471.153,01	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,52%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545	3,62	2,25	0,05	2,25	-0,42	-0,70	9.886.745,31	2,82
NTN-B 150535 (4,423526%)	0,42	0,21	-0,00	0,22	0,16	0,90	2.909.535,61	0,83
NTN-B 150535 (4,734998%)	0,50	0,19	-0,00	0,20	0,18	0,92	11.472.329,16	3,27
NTN-B 150535 (5,290003%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,51	0,96	11.396.878,53	3,25
NTN-B 150535 (5,601000%)	0,26	0,27	0,00	0,28	0,60	0,99	1.787.637,47	0,51
NTN-B 150535 (5,635000%)	0,26	0,28	-0,00	0,29	0,61	0,99	1.742.636,88	0,50
NTN-B 150535 (5,640000%)	0,26	0,28	-0,00	0,29	0,62	0,99	1.768.833,71	0,50
NTN-B 150535 (5,877000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,69	1,01	5.531.737,63	1,58
NTN-B 150535 (6,051500%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,74	1,02	1.640.138,95	0,47
NTN-B 150555 (4,689998%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,33	0,92	2.953.594,15	0,84
NTN-B 150555 (5,669994%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,63	0,99	11.216.976,64	3,20
NTN-B 150555 (5,900000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,69	1,01	5.543.363,71	1,58
NTN-B 150830 (4,069994%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,15	0,87	5.671.430,20	1,62
NTN-B 150830 (5,569998%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,60	0,99	1.665.694,91	0,48
NTN-B 150830 (6,000000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,72	1,02	1.552.664,86	0,44
NTN-B 150840 (5,120004%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,46	0,95	11.098.179,02	3,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (5,171997%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,48	0,96	11.276.974,92	3,22
NTN-B 150840 (5,481000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,57	0,98	5.448.961,78	1,55
NTN-B 150840 (5,792100%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,66	1,00	21.412.982,77	6,11
NTN-B 150850 (5,582500%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,60	0,99	1.034.842,28	0,30
NTN-B 150850 (5,850500%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,68	1,01	4.961.762,37	1,42
Sub-total	0,37	0,21	0,04		0,03	0,84	131.973.900,86	37,66

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,01	0,01	0,00	0,00	-15,97	0,63	9.401,51	0,00
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	3,21	1,86	0,07	1,86	-0,25	0,04	17.344.037,50	4,95
BB PREV RF IRF M	1,51	0,84	0,02	0,01	-0,22	0,50	10.096.556,94	2,88
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	0,93	0,54	0,02	0,00	-0,09	0,75	17.888.980,41	5,10
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,18	0,10	0,00	0,02	-0,16	0,80	299.284,07	0,09
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,29	1,22	0,12	0,01	-0,34	0,06	43.357.451,72	12,37
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,28	1,22	0,05	0,01	-0,34	0,06	16.450.330,96	4,69
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,93	0,53	0,03	0,01	-0,09	0,75	29.783.826,55	8,50
Sub-total	1,69	0,97	0,30		-0,28	0,36	135.229.869,66	38,59

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,01	0,00	0,01	-3,99	0,75	18.897.343,55	5,39
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,04	0,02	0,00	0,02	0,75	0,86	7.850.646,38	2,24
Sub-total	0,05	0,01	0,00		0,13	0,84	26.747.989,93	7,63

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,94%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	11,52	6,72	0,11	2,62	0,06	1,54	6.489.297,36	1,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	16,46	NaN	0,00	NaN	-0,06	-0,11	0,00	0,00
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	11,02	5,82	0,36	0,30	-0,12	-0,50	24.352.299,26	6,95
Sub-total	12,48	5,94	0,46		-0,03	0,41	30.841.596,62	8,80

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,51%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	12,38	5,51	0,07	0,56	0,21	3,48	13.172.692,49	3,76
Sub-total	12,38	5,51	0,07		0,21	3,48	13.172.692,49	3,76

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,09%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	9,64	5,09	0,13	4,20	0,27	3,39	12.505.103,45	3,57
Sub-total	9,64	5,09	0,13		0,27	3,39	12.505.103,45	3,57

(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 (%)