



LDB
EMPRESAS

PORTO FELIZ
ABRIL 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 30.04.2024.

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

82,44%

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	6,62	-1,16	-2,96	-4,70	9.594.411,17	2,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,423526%)	0,41	-0,02	0,61	3,39	2.927.413,84	0,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,734998%)	0,46	-0,04	0,64	3,49	11.545.855,39	3,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290003%)	0,41	0,04	0,69	3,67	11.475.133,29	3,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,601000%)	995,11	0,04	0,71	2,26	1.800.375,39	0,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,635000%)	4,01	0,04	0,72	3,78	1.755.104,21	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,640000%)	4,01	0,04	0,72	3,84	1.781.495,10	0,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,877000%)	0,43	0,04	0,74	3,86	5.572.423,82	1,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,051500%)	0,44	0,04	0,75	3,92	1.652.439,84	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (4,689998%)	0,57	0,03	0,64	3,47	2.972.388,92	0,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,669994%)	0,62	0,04	0,72	3,79	11.297.545,39	3,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,900000%)	0,63	0,04	0,74	3,87	5.584.239,37	1,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,069994%)	0,32	0,03	0,58	3,27	5.704.566,40	1,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,569998%)	0,35	0,04	0,71	3,76	1.677.520,68	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,776000%)	4,08	0,04	0,66	0,66	2.228.419,44	0,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,000000%)	0,36	0,04	0,75	3,90	1.564.243,84	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,120004%)	0,46	0,04	0,67	3,61	11.172.807,92	3,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,171997%)	0,46	0,04	0,68	3,63	11.353.288,14	3,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,481000%)	0,47	0,04	0,70	3,73	5.487.243,11	1,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,792100%)	0,49	0,04	0,73	3,83	21.568.960,22	6,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,582500%)	0,54	0,04	0,71	3,82	1.042.200,59	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,850500%)	0,60	0,04	0,73	3,85	4.998.147,99	1,43
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,69	-0,06	0,42	3,04	134.756.224,06	38,56

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	0,06	0,03	0,66	1,52	11.395,80	0,00	155.418.856.358,15	0,00
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	5,29	-0,75	-2,22	-1,67	18.074.011,91	5,17	232.845.220,27	7,76
BB	BB	BB PREV RF IRF M	2,29	-0,34	-0,56	1,04	10.040.469,86	2,87	4.126.258.083,34	0,24
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	1,75	-0,17	-0,22	1,79	17.850.083,34	5,11	1.562.879.428,83	1,14
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,32	-0,05	0,56	3,01	279.850,18	0,08	8.334.507.355,54	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,91	-0,62	-1,63	-1,53	42.649.638,77	12,20	5.056.024.851,42	0,84
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,89	-0,62	-1,64	-1,51	16.181.235,59	4,63	4.738.343.434,12	0,34
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,74	-0,17	-0,22	1,78	29.718.132,67	8,50	7.735.992.731,60	0,38
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,85	-0,46	-1,13	-0,11	134.804.818,12	38,57		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,80	2,96	1.650.773,92	0,47	4.150.521.759,60	0,04
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,10	0,04	0,94	3,76	7.873.354,30	2,25	2.900.137.907,64	0,27
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,10	0,04	0,89	3,65	9.524.128,22	2,73		

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CLARITAS	BTG PACTUAL	CLARITAS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LONGO PRAZO	0,35	0,05	0,27	0,27	9.023.854,85	2,58	215.454.691,02	4,19
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			0,35	0,05	0,27	0,27	9.023.854,85	2,58		
Renda Fixa			1,41	-0,24	-0,28	1,62	288.109.025,25	82,44		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

10,03%

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	16,65	-1,46	-3,66	-3,87	6.252.041,22	1,79	772.950.746,72	0,81
PLURAL	BEM	BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	13,02	-1,10	-3,66	-3,66	4.817.056,61	1,38	351.422.131,03	1,37
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	14,78	-1,17	-1,50	-5,62	23.986.256,61	6,86	712.088.894,91	3,37
Sub-total Artigo 8º I			16,69	-1,21	-2,28	-5,99	35.055.354,44	10,03		
Renda Variável			16,69	-1,21	-2,28	-5,99	35.055.354,44	10,03		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,09%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CLARITAS	SANTANDER	PRINCIPAL GLOBAL HIGH YIELD FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3,84	-0,09	-0,12	-0,12	998.809,91	0,29	31.863.656,53	3,13
Sub-total Artigo 9º II			3,84	-0,09	-0,12	-0,12	998.809,91	0,29		

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	14,13	0,14	0,80	15,90	13.278.302,03	3,80	2.311.782.090,34	0,57
Sub-total Artigo 9º III			14,13	0,14	0,80	15,90	13.278.302,03	3,80		

Investimentos no Exterior			14,01	0,12	0,78	15,88	14.277.111,94	4,09		
----------------------------------	--	--	--------------	-------------	-------------	--------------	----------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,44%

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	11,65	-1,42	-3,80	6,90	12.029.390,99	3,44	1.805.438.252,39	0,67
Sub-total Artigo 10º I			11,65	-1,42	-3,80	6,90	12.029.390,99	3,44		
Investimentos Estruturados			11,64	-1,42	-3,80	6,90	12.029.390,99	3,44		
Total			3,59	-0,36	-0,56	1,15	349.470.882,62	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	134.756.224,06	38,56	0,00	35,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	134.804.818,12	38,57	0,00	38,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	9.524.128,22	2,73	0,00	3,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	9.023.854,85	2,58	0,00	0,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	288.109.025,25	82,44					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	35.055.354,44	10,03	0,00	12,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	35.055.354,44	10,03					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	998.809,91	0,29	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	13.278.302,03	3,80	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	14.277.111,94	4,09					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	12.029.390,99	3,44	0,00	2,50	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	12.029.390,99	3,44					15,00
Total		349.470.882,62	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	0,42 47,82	3,04 86,06	2,23 87,48	5,16 95,24	9,45 76,63	568.495,09	3.921.005,87
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-1,13 -127,21	-0,11 -3,16	-0,30 -11,86	4,50 82,97	7,72 62,61	-1.537.782,82	-236.706,02
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,89 100,62	3,65 103,22	2,61 102,44	5,57 102,75	12,93 104,85	136.135,25	560.983,22
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,27 65,87	0,27 65,87				23.854,85	23.854,85
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-2,28 -0,58	-5,99 0,16	-0,44 0,99	11,68 0,38	14,51 -6,07	-786.242,18	-2.902.667,29
Artigo 9º II % do CDI	-0,12 -15,54	-0,12 -15,54				-1.190,09	-1.190,09
Artigo 9º III % do CDI	0,80 90,34	15,90 449,81	10,85 426,36	25,92 478,06	33,73 273,60	105.609,54	1.821.893,42
Artigo 10º I % do CDI	-3,80 -428,67	6,90 195,17	5,13 201,58	22,97 423,54	28,50 231,17	-475.712,46	776.468,12
PORTO FELIZ (Total)						-1.966.832,82	3.963.642,08

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%)	2.909.535,61	0,00	0,00	0,00	2.927.413,84	17.878,23	95.967,16
NTN-B 150535 (4,734998%)	11.472.329,16	0,00	0,00	0,00	11.545.855,39	73.526,23	389.541,89
NTN-B 150535 (5,290003%)	11.396.878,53	0,00	0,00	0,00	11.475.133,29	78.254,76	406.118,79
NTN-B 150535 (5,601000%)	1.787.637,47	0,00	0,00	0,00	1.800.375,39	12.737,92	39.729,97
NTN-B 150535 (5,635000%)	1.742.636,88	0,00	0,00	0,00	1.755.104,21	12.467,33	63.939,17
NTN-B 150535 (5,640000%)	1.768.833,71	0,00	0,00	0,00	1.781.495,10	12.661,39	65.898,58
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.531.737,63	0,00	0,00	0,00	5.572.423,82	40.686,19	207.052,47
NTN-B 150535 (6,051500%)	1.640.138,95	0,00	0,00	0,00	1.652.439,84	12.300,89	62.261,83
NTN-B 150545	9.886.745,31	0,00	0,00	0,00	9.594.411,17	-292.334,14	-473.532,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.953.594,15	0,00	0,00	0,00	2.972.388,92	18.794,77	99.795,51
NTN-B 150555 (5,669994%)	11.216.976,64	0,00	0,00	0,00	11.297.545,39	80.568,75	412.763,86
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.543.363,71	0,00	0,00	0,00	5.584.239,37	40.875,66	207.871,30
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.671.430,20	0,00	0,00	0,00	5.704.566,40	33.136,20	182.561,08
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.665.694,91	0,00	0,00	0,00	1.677.520,68	11.825,77	61.447,31
NTN-B 150830 (5,776000%)	0,00	2.213.828,11	0,00	0,00	2.228.419,44	14.591,33	14.591,33
NTN-B 150830 (6,000000%)	1.552.664,86	0,00	0,00	0,00	1.564.243,84	11.578,98	59.350,03
NTN-B 150840 (5,120004%)	11.098.179,02	0,00	0,00	0,00	11.172.807,92	74.628,90	393.645,97
NTN-B 150840 (5,171997%)	11.276.974,92	0,00	0,00	0,00	11.353.288,14	76.313,22	401.834,82
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.448.961,78	0,00	0,00	0,00	5.487.243,11	38.281,33	199.445,50
NTN-B 150840 (5,792100%)	21.412.982,77	0,00	0,00	0,00	21.568.960,22	155.977,45	804.602,07
NTN-B 150850 (5,582500%)	1.034.842,28	0,00	0,00	0,00	1.042.200,59	7.358,31	38.784,86
NTN-B 150850 (5,850500%)	4.961.762,37	0,00	0,00	0,00	4.998.147,99	36.385,62	187.334,85
	131.973.900,86	2.213.828,11	0,00	0,00	134.756.224,06	568.495,09	

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	43.357.451,72	0,00	0,00	0,00	42.649.638,77	-707.812,95	-625.478,33
BB PREV RF IRF M	10.096.556,94	0,00	0,00	0,00	10.040.469,86	-56.087,08	101.640,67
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	299.284,07	139.000,00	-160.286,19	0,00	279.850,18	1.852,30	9.190,05
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	9.401,51	1.926,32	0,00	0,00	11.395,80	67,97	107,48
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	29.783.826,55	0,00	0,00	0,00	29.718.132,67	-65.693,88	520.157,30
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.450.330,96	0,00	0,00	0,00	16.181.235,59	-269.095,37	-248.188,73
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	17.344.037,50	1.132.091,15	0,00	0,00	18.074.011,91	-402.116,74	-307.219,39
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	17.888.980,41	0,00	0,00	0,00	17.850.083,34	-38.897,07	313.084,93
	135.229.869,66	1.273.017,47	-160.286,19	0,00	134.804.818,12	-1.537.782,82	

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	18.897.344,13	3.893.239,19	-21.195.082,83	0,00	1.650.773,92	55.273,43	126.432,83
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	7.850.646,38	2.849.000,00	-2.907.153,90	0,00	7.873.354,30	80.861,82	434.550,39
	26.747.990,51	6.742.239,19	-24.102.236,73	0,00	9.524.128,22	136.135,25	

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CLARITAS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LONGO PRAZO	0,00	9.000.000,00	0,00	0,00	9.023.854,85	23.854,85	23.854,85
	0,00	9.000.000,00	0,00	0,00	9.023.854,85	23.854,85	

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	24.352.299,26	0,00	0,00	0,00	23.986.256,61	-366.042,65	-1.429.035,87
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	0,00	5.000.000,00	0,00	0,00	4.817.056,61	-182.943,39	-182.943,39
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	6.489.297,36	0,00	0,00	0,00	6.252.041,22	-237.256,14	-209.787,78
	30.841.596,62	5.000.000,00	0,00	0,00	35.055.354,44	-786.242,18	

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
PRINCIPAL GLOBAL HIGH YIELD FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	0,00	1.000.000,00	0,00	0,00	998.809,91	-1.190,09	-1.190,09
	0,00	1.000.000,00	0,00	0,00	998.809,91	-1.190,09	

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	13.172.692,49	0,00	0,00	0,00	13.278.302,03	105.609,54	1.821.893,42
	13.172.692,49	0,00	0,00	0,00	13.278.302,03	105.609,54	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12.505.103,45	0,00	0,00	0,00	12.029.390,99	-475.712,46	776.468,12
	12.505.103,45	0,00	0,00	0,00	12.029.390,99	-475.712,46	

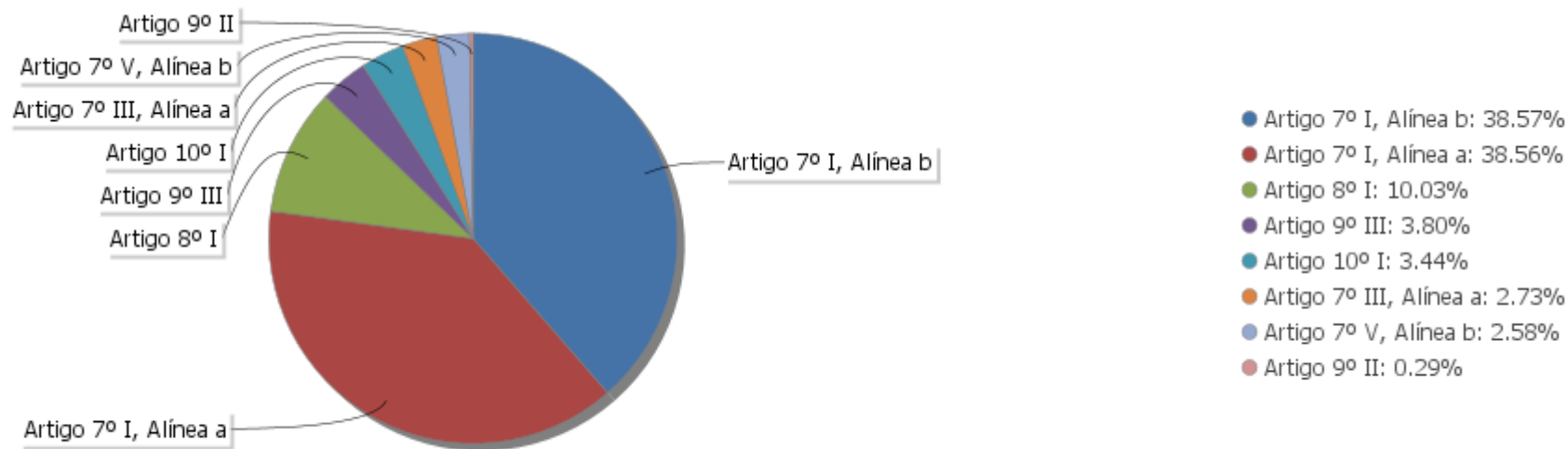
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

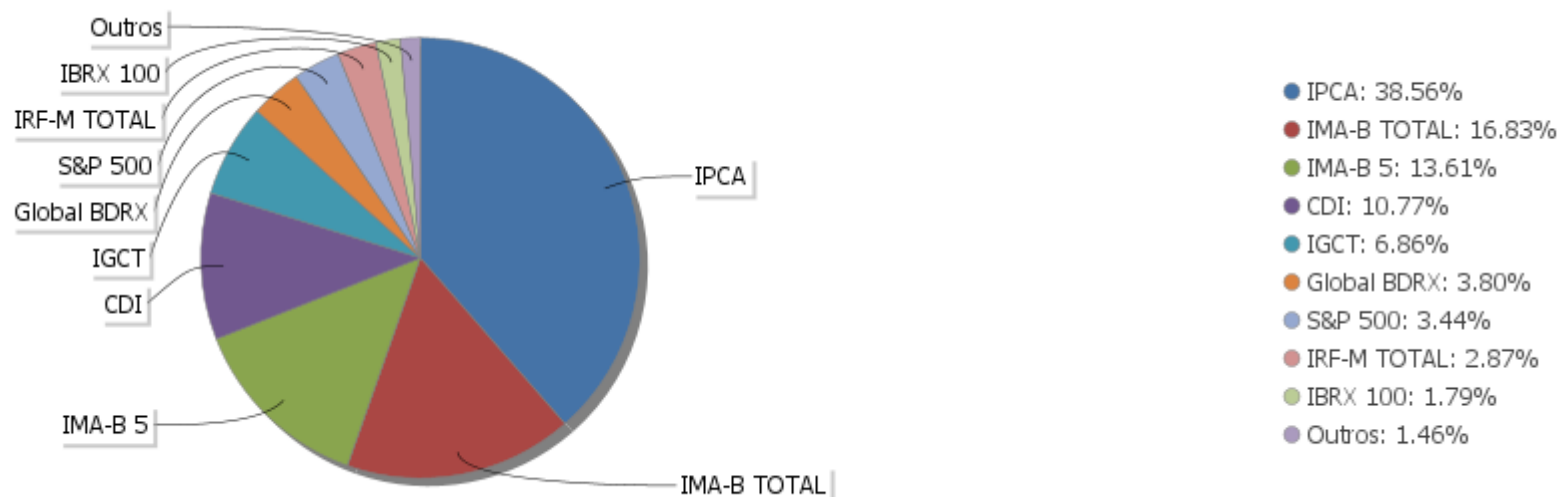
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	208.462.617,34	59,65	60,00	208.462.617,34	59,65	60,00
de 31 dias a 365 dias	6.252.041,22	1,79		214.714.658,56	61,44	60,00
acima de 365 dias	134.756.224,06	38,56	40,00	349.470.882,62	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

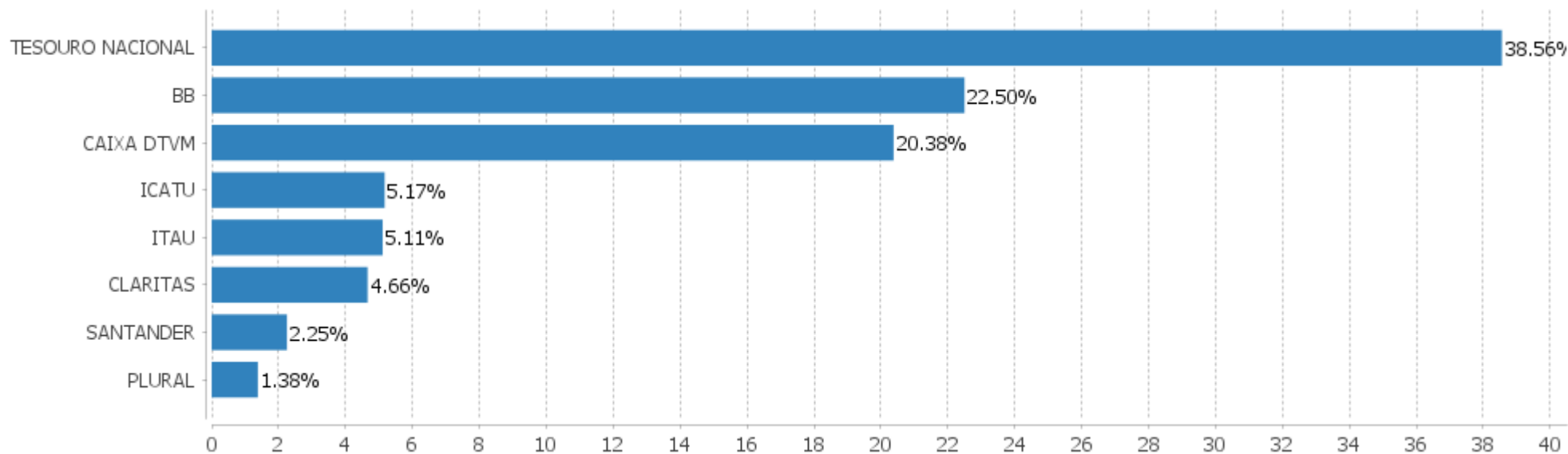


Alocação Por Estratégia



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	-0,56									1,15
IPCA + 5,16%	0,86	1,21	0,56	0,82									3,50
p.p. indexador	-1,13	-0,01	0,22	-1,38									-2,35
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	47,37
Meses abaixo - Meta Atuarial	40	52,63

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

Relatório

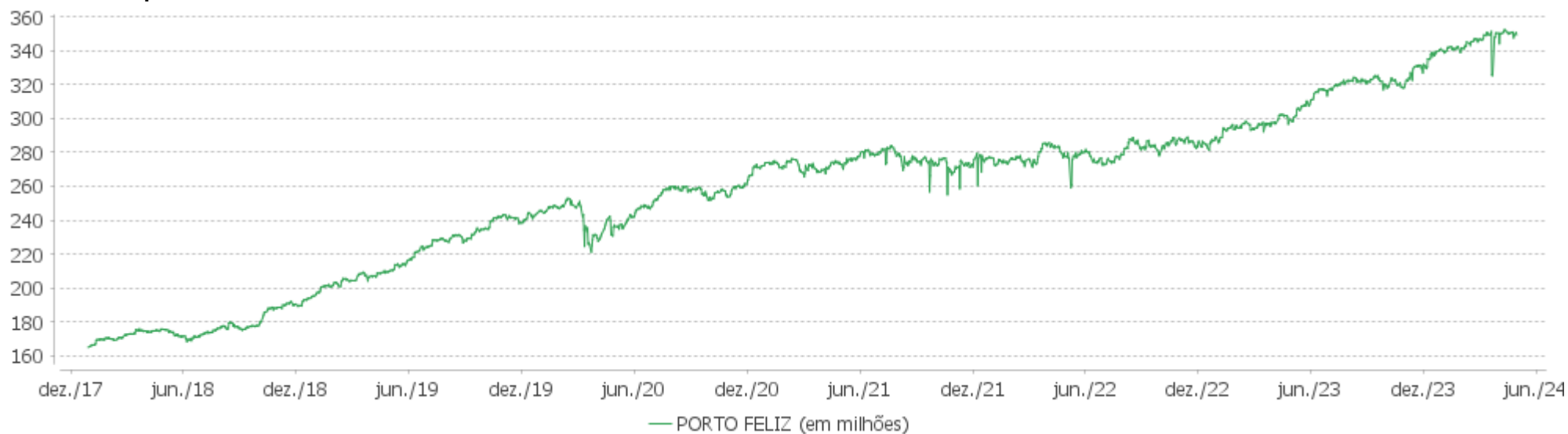
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,42	2,62	-1,19	2,62
06 meses	7,27	5,19	2,09	3,31
12 meses	11,61	8,91	2,70	3,59
24 meses	17,05	19,03	-1,98	4,90
36 meses	17,18	40,45	-23,27	5,40
48 meses	30,75	58,45	-27,71	5,52
60 meses	39,46	71,96	-32,50	7,14
Desde 29/12/2017	64,41	96,65	-32,24	6,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

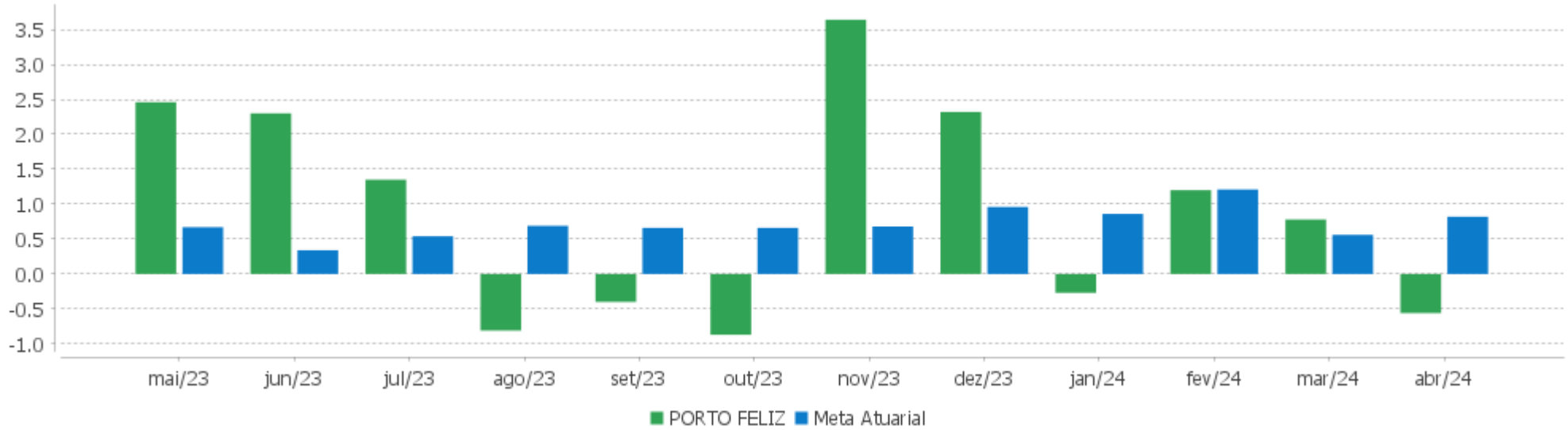


Patrimônio Líquido



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
CLARITAS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LONGO PRAZO % do CDI	0,76 85,23	4,09 115,67	2,83 111,20	6,27 115,60	14,79 119,94	30,09 110,00	41,61 114,44
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	-2,96 -3,34	-4,70 -6,50	-3,17 -4,54	2,46 -0,19	7,59 3,90	16,09 8,06	13,95 -7,18
NTN-B 150830 (6,000000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,37	3,90 2,10	2,82 1,44	5,61 2,95	10,17 6,48	15,10 7,08	
NTN-B 150840 (5,120004%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,29	3,61 1,81	2,61 1,23	5,24 2,58	9,32 5,63	20,05 12,03	37,13 15,99
NTN-B 150830 (4,069994%) Var. IPCA p.p.	0,58 0,20	3,27 1,47	2,36 0,98	4,64 1,98	8,14 4,45	17,58 9,55	36,52 15,39
NTN-B 150535 (5,640000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,34	3,84 2,04	2,73 1,36	2,53 -0,12	3,80 0,11		
NTN-B 150535 (5,290003%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,31	3,67 1,87	2,65 1,27	5,29 2,64	9,46 5,78	20,41 12,38	37,63 16,50
NTN-B 150535 (5,877000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,36	3,86 2,06	2,79 1,41	5,59 2,94	10,08 6,40	21,76 13,74	35,78 14,65
NTN-B 150840 (5,792100%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,35	3,83 2,03	2,77 1,39	5,58 2,93	10,03 6,34	21,61 13,58	35,59 14,46
NTN-B 150555 (4,689998%) Var. IPCA p.p.	0,64 0,26	3,47 1,67	2,51 1,13	5,09 2,43	8,94 5,25	19,15 11,12	35,87 14,74
NTN-B 150850 (5,850500%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,35	3,85 2,05	2,78 1,41	5,67 3,01	10,15 6,46	15,06 7,03	
NTN-B 150535 (5,601000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,33	3,77 1,97	2,72 1,35	2,39 -0,26	3,65 -0,04		
NTN-B 150840 (5,481000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,32	3,73 1,93	2,69 1,32	5,42 2,77	9,70 6,01	20,89 12,86	34,65 13,51
NTN-B 150535 (5,635000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,34	3,78 1,98	2,73 1,36	2,53 -0,13	3,80 0,11		
NTN-B 150830 (5,776000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,35	0,88 -0,92	-0,15 -1,52	2,41 -0,24	3,70 0,01		
NTN-B 150850 (5,582500%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,33	3,82 2,02	2,72 1,34	5,53 2,88	9,87 6,18	14,70 6,67	
NTN-B 150840 (5,171997%)	0,68	3,63	2,62	5,27	9,37	20,17	37,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,30	1,83	1,25	2,61	5,68	12,15	16,18
NTN-B 150555 (5,669994%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,34	3,79 1,99	2,74 1,36	5,60 2,94	9,98 6,29	21,41 13,38	35,40 14,27
NTN-B 150830 (5,569998%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,33	3,76 1,96	2,71 1,34	5,40 2,74	9,72 6,03	21,01 12,98	38,54 17,41
NTN-B 150555 (5,900000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,36	3,87 2,07	2,79 1,42	5,72 3,06	10,22 6,54	21,94 13,92	36,04 14,91
NTN-B 150535 (4,423526%) Var. IPCA p.p.	0,61 0,23	3,39 1,59	2,45 1,07	4,85 2,20	8,55 4,86	18,43 10,40	34,47 13,34
NTN-B 150535 (6,051500%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,37	3,92 2,11	2,83 1,45	5,68 3,02	10,27 6,58	15,24 7,21	
NTN-B 150535 (4,734998%) Var. IPCA p.p.	0,64 0,26	3,49 1,69	2,52 1,14	5,01 2,36	8,88 5,19	19,14 11,12	35,55 14,42
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,64 -0,02	-1,51 -0,07	-1,05 -0,05	3,81 -0,11	7,65 -0,18	16,91 -0,38	22,07 -0,73
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,22 -0,02	1,78 -0,07	1,11 -0,05	5,09 -0,11	8,28 -0,15	18,63 -0,28	29,55 -0,60
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI % do CDI	0,66 74,45	2,66 75,19	1,91 74,89	4,10 75,56	9,46 76,73	20,89 76,37	
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-0,22 -0,01	1,79 -0,06	1,12 -0,05	5,10 -0,10	8,22 -0,20	18,49 -0,42	29,44 -0,71
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,56 -0,02	3,01 -0,05	2,12 -0,08	4,92 -0,11	11,69 -0,28	26,19 -0,68	32,95 -1,06
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,63 -0,02	-1,53 -0,09	-1,05 -0,05	3,81 -0,11	7,58 -0,24	16,76 -0,54	21,83 -0,97
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,56 -0,03	1,04 -0,10	0,38 -0,09	5,04 -0,13	11,78 -0,42	25,85 -0,84	27,00 -1,22
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP % do CDI	-2,22 -249,91	-1,67 -47,20	-2,09 -82,29	5,31 97,96	12,40 100,59	25,51 93,28	19,29 53,04
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,80 90,06	3,20 90,48	2,30 90,35	4,91 90,59	11,23 91,09	24,87 90,93	32,27 88,73
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,94 106,12	3,76 106,34	2,69 105,78	5,73 105,59	13,16 106,73	28,31 103,52	38,26 105,22
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA Var. IBRX 100 p.p.	-3,66 -2,32	-3,87 1,70	-0,69 0,43	12,70 0,76	20,84 -0,33	9,37 -5,98	7,95 4,32
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	-4,44	-8,45	-5,67	5,84	14,24	23,11	23,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-2,74	-2,29	-4,24	-5,46	-6,34	6,38	17,45
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	-1,50 0,07	-5,62 -0,18	-1,11 -0,14	11,70 -0,51	20,72 -1,43	13,22 -2,89	0,21 -3,50
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	0,80 0,23	15,90 -0,64	10,85 -0,38	26,54 -1,06	34,38 -1,69	38,14 -2,99	18,46 -4,88
PRINCIPAL GLOBAL HIGH YIELD FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	-0,41 -46,47	2,01 56,84	1,20 47,11	10,53 194,29	13,81 112,00	23,89 87,35	23,86 65,61
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-3,80 -3,01	6,90 -5,88	5,13 -3,37	22,97 0,18	28,34 3,44	41,61 13,48	47,95 32,68
PORTO FELIZ Var. IPCA + 5,16% p.p.	-0,56 -1,38	1,15 -2,35	1,42 -1,19	7,27 2,06	11,61 2,59	17,05 -2,36	17,18 -23,61
CDI	0,89	3,54	2,54	5,42	12,33	27,35	36,36
IBOVESPA	-1,70	-6,16	-1,43	11,30	20,58	16,73	5,91
INPC + 6,00%	0,88	3,93	2,82	5,58	9,40	20,38	43,48
IPCA + 6,00%	0,89	3,77	2,82	5,62	9,88	21,32	44,17

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		
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES			D+5 du	D+7 du	-	2,00
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
CLARITAS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+2	D+3	O fundo cobrará 15.00 % do que exceder 100.00 % o índice CDIE. A taxa de performance sera paga no(s) mes (es) de Janeiro e Julho	0,50
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
PRINCIPAL GLOBAL HIGH YIELD FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+0	D+0	D+1 du	D+5 du		0,87
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	0,58	3,05	2,20	5,03	11,97	26,87	34,02	37,14	46,19
IRF-M 1+	-1,02	0,33	-0,26	5,27	12,67	27,40	26,02	27,83	45,63
IRF-M TOTAL	-0,52	1,14	0,47	5,18	12,20	26,69	28,23	30,71	46,00
IMA-B 5	-0,20	1,85	1,16	5,20	8,42	18,91	30,15	41,76	54,05
IMA-B 5+	-2,91	-4,38	-2,95	2,77	6,84	15,52	15,49	27,38	38,18
IMA-B TOTAL	-1,61	-1,44	-1,00	3,93	7,83	17,30	22,80	34,66	46,69
IMA-GERAL TOTAL	-0,22	1,41	0,94	4,96	10,96	23,84	29,96	35,96	47,48
IDKA 2	-0,29	1,94	1,12	5,32	8,39	18,52	29,51	41,70	53,91
IDKA 20	-4,90	-9,27	-6,13	1,23	7,00	14,11	3,87	18,01	24,63
CDI	0,89	3,54	2,54	5,42	12,33	27,35	36,36	39,29	46,54

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-1,70	-6,16	-1,43	11,30	20,58	16,73	5,91	56,42	30,69
IBRX 100	-1,34	-5,57	-1,11	11,93	21,16	15,35	3,64	56,75	33,05
IBRX 50	-0,62	-4,66	-0,53	12,46	22,10	17,11	6,05	62,71	32,79
SMALL CAP	-7,76	-11,53	-5,32	6,51	12,36	-9,98	-28,71	11,14	6,04
Índice Consumo - ICON	-5,98	-12,66	-4,71	7,68	6,01	-22,89	-46,53	-30,89	-30,19
Índice Dividendos - IDIV	-0,56	-4,35	-0,87	13,19	21,76	24,83	29,53	77,48	64,74

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	-0,79	12,78	8,50	22,79	24,91	28,13	15,27	64,77	124,09

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,77	2,12	1,45	7,16	18,32	20,22	18,20	29,89	34,82

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,00	11,18	8,09	21,53	19,47	21,69	3,18	47,40	88,97

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,38	1,80	1,38	2,66	3,69	8,03	21,13	29,32	32,42
INPC	0,37	1,95	1,38	2,62	3,23	7,19	20,55	29,70	32,89
IGPM	0,31	-0,60	-0,68	0,73	-3,04	-5,14	8,77	43,59	53,19
SELIC	0,89	3,54	2,54	5,42	12,33	27,35	36,36	39,29	46,54

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,72	3,12	2,34	4,64	7,82	16,81	36,19	51,17	61,01
IPCA + 5,00%	0,81	3,45	2,58	5,13	8,85	19,05	40,14	57,04	68,88
IPCA + 5,50%	0,85	3,61	2,70	5,38	9,37	20,19	42,15	60,03	72,92
IPCA + 5,89%	0,88	3,74	2,79	5,57	9,77	21,07	43,72	62,40	76,13
IPCA + 6,00%	0,89	3,77	2,82	5,62	9,88	21,32	44,17	63,07	77,05
INPC + 4,00%	0,71	3,28	2,34	4,60	7,35	15,90	35,54	51,62	61,59
INPC + 6,00%	0,88	3,93	2,82	5,58	9,40	20,38	43,48	63,56	77,68

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%)	2.927.413,84	4,423526	2.538.074,65	6,287800	-389.339,19
NTN-B 150535 (4,734998%)	11.545.855,39	4,734998	10.259.662,20	6,287800	-1.286.193,19
NTN-B 150535 (5,290003%)	11.475.133,29	5,290003	10.637.581,95	6,287800	-837.551,34
NTN-B 150535 (5,601000%)	1.800.375,39	5,601000	1.709.227,94	6,287800	-91.147,45
NTN-B 150535 (5,635000%)	1.755.104,21	5,635000	1.670.577,06	6,287800	-84.527,15
NTN-B 150535 (5,640000%)	1.781.495,10	5,640000	1.696.344,32	6,287800	-85.150,78
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.572.423,82	5,877000	5.402.534,55	6,287800	-169.889,27
NTN-B 150535 (6,051500%)	1.652.439,84	6,051500	1.623.337,09	6,287800	-29.102,75
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.972.388,92	4,689998	2.402.567,73	6,213500	-569.821,19
NTN-B 150555 (5,669994%)	11.297.545,39	5,669994	10.503.752,52	6,213500	-793.792,87
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.584.239,37	5,900000	5.356.614,53	6,213500	-227.624,84
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.704.566,40	4,069994	5.117.173,41	6,233700	-587.392,99
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.677.520,68	5,569998	1.623.143,49	6,233700	-54.377,19
NTN-B 150830 (5,776000%)	2.228.419,44	5,776000	2.178.429,42	6,233700	-49.990,02
NTN-B 150830 (6,000000%)	1.564.243,84	6,000000	1.546.257,75	6,233700	-17.986,09
NTN-B 150840 (5,120004%)	11.172.807,92	5,120004	10.013.900,09	6,210300	-1.158.907,83
NTN-B 150840 (5,171997%)	11.353.288,14	5,171997	10.230.027,44	6,210300	-1.123.260,70
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.487.243,11	5,481000	5.102.300,35	6,210300	-384.942,76
NTN-B 150840 (5,792100%)	21.568.960,22	5,792100	20.693.133,39	6,210300	-875.826,83
NTN-B 150850 (5,582500%)	1.042.200,59	5,582500	959.146,14	6,233000	-83.054,45
NTN-B 150850 (5,850500%)	4.998.147,99	5,850500	4.762.076,47	6,233000	-236.071,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
138	01/04/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	15,92	0,00	12,76161500	1,2474909450
137	02/04/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	47,76	0,00	38,27329400	1,2478674990
173	02/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.000.000,00	1.794.853,78632100	2,7857422360
172	02/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.000.000,00	358.970,75726400	2,7857422360
171	02/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.213.828,11	794.699,55310000	2,7857422360
174	02/04/2024	NTN-B 150830 (5,776000%)	2.213.828,11	0,00	510,00000000	4.340,8394370000
183	03/04/2024	PRINCIPAL GLOBAL HIGH YIELD FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.000.000,00	0,00	353.691,03350186	2,8273264100
136	03/04/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	175,12	0,00	140,29358600	1,2482395240
160	03/04/2024	BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	5.000.000,00	0,00	1.802.952,11773850	2,7732295000
135	04/04/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	79,60	0,00	63,75076900	1,2486123790
170	04/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	163,57	58,67452000	2,7877518370
143	04/04/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	20.000,00	5.528,20391290	3,6178115560
167	05/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	70.031,07	0,00	25.112,00055400	2,7887491420
134	08/04/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	47,76	0,00	38,22753000	1,2493613610
124	08/04/2024	ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	1.132.091,15	0,00	408.439,09743380	2,7717502000
169	08/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.132.091,15	405.803,03871100	2,7897552310
133	09/04/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	47,76	0,00	38,21612400	1,2497342570
132	10/04/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	95,52	0,00	76,40931200	1,2501093970
166	10/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.173.610,83	0,00	778.579,40391200	2,7917651290
131	11/04/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	79,60	0,00	63,65535500	1,2504839450
130	12/04/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	63,68	0,00	50,90888300	1,2508622350
142	12/04/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	139.000,00	0,00	38.362,52861780	3,6233273720
129	15/04/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	31,84	0,00	25,44684100	1,2512358520
184	16/04/2024	CLARITAS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LONGO PRAZO	9.000.000,00	0,00	224.206,97186905	40,1414814400
168	16/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.000.000,00	3.219.085,36711900	2,7958252030
128	17/04/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	191,04	0,00	152,58965200	1,2519852840
157	17/04/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	2.849.000,00	0,00	10.979,58636800	259,4815419000
165	17/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.849.000,00	1.018.647,90377200	2,7968447090

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
127	18/04/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	95,52	0,00	76,27195200	1,2523607530
126	19/04/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	302,48	0,00	241,45521000	1,2527375130
164	19/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3.016,70	0,00	1.077,82781400	2,7988700610
125	22/04/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	652,72	0,00	520,87970600	1,2531108270
158	25/04/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	51.152,59	196,65056800	260,1192085000
141	25/04/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	101.348,61	27.923,11682372	3,6295593590
140	25/04/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	23.937,58	6.595,17523500	3,6295593590
159	25/04/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.856.001,31	10.979,58636800	260,1192085000
163	26/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	486.739,15	0,00	173.591,44480100	2,8039351280
139	26/04/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	15.000,00	4.128,01352000	3,6337090290
162	29/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.044.222,96	0,00	372.281,56863100	2,8049279040
161	30/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	115.618,48	0,00	41.204,86505300	2,8059424500
Total			25.229.084,77	24.262.522,92		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.645.424,15

Value-At-Risk: 1,04%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,74	0,54	5,00	0,34	-0,40	-0,29	288.109.025,25	82,44
Artigo 8º	13,35	6,16	20,00	0,55	-0,24	-2,28	35.055.354,44	10,03
Artigo 9º	16,54	5,48	20,00	0,03	-0,01	0,74	14.277.111,94	4,09
Artigo 10º	12,85	5,80	20,00	0,13	-0,36	-3,80	12.029.390,99	3,44
PORTO FELIZ		1,04		1,04			349.470.882,62	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,54%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545	5,74	2,05	0,04	2,04	-0,67	-2,96	9.594.411,17	2,75
NTN-B 150535 (4,423526%)	0,32	0,19	0,00	0,20	-0,85	0,61	2.927.413,84	0,84
NTN-B 150535 (4,734998%)	0,40	0,19	0,00	0,21	-0,62	0,64	11.545.855,39	3,30
NTN-B 150535 (5,290003%)	0,21	0,15	0,00	0,17	-0,94	0,69	11.475.133,29	3,28
NTN-B 150535 (5,601000%)	0,21	0,14	0,00	0,17	-0,82	0,71	1.800.375,39	0,52
NTN-B 150535 (5,635000%)	0,21	0,15	0,00	0,17	-0,80	0,72	1.755.104,21	0,50
NTN-B 150535 (5,640000%)	0,21	0,15	0,00	0,17	-0,80	0,72	1.781.495,10	0,51
NTN-B 150535 (5,877000%)	0,21	0,15	0,00	0,17	-0,71	0,74	5.572.423,82	1,59
NTN-B 150535 (6,051500%)	0,21	0,15	0,00	0,17	-0,64	0,75	1.652.439,84	0,47
NTN-B 150555 (4,689998%)	0,21	0,15	0,00	0,17	-1,17	0,64	2.972.388,92	0,85
NTN-B 150555 (5,669994%)	0,21	0,15	0,00	0,17	-0,79	0,72	11.297.545,39	3,23
NTN-B 150555 (5,900000%)	0,21	0,15	0,00	0,17	-0,70	0,74	5.584.239,37	1,60
NTN-B 150830 (4,069994%)	0,21	0,16	0,00	0,17	-1,42	0,58	5.704.566,40	1,63
NTN-B 150830 (5,569998%)	0,21	0,16	0,00	0,17	-0,83	0,71	1.677.520,68	0,48
NTN-B 150830 (5,776000%)	0,21	0,21	-0,00	0,25	-0,75	0,73	2.228.419,44	0,64
NTN-B 150830 (6,000000%)	0,21	0,16	0,00	0,17	-0,66	0,75	1.564.243,84	0,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (5,120004%)	0,21	0,15	0,00	0,17	-1,01	0,67	11.172.807,92	3,20
NTN-B 150840 (5,171997%)	0,21	0,15	0,00	0,17	-0,99	0,68	11.353.288,14	3,25
NTN-B 150840 (5,481000%)	0,21	0,15	0,00	0,17	-0,86	0,70	5.487.243,11	1,57
NTN-B 150840 (5,792100%)	0,21	0,15	0,00	0,17	-0,74	0,73	21.568.960,22	6,17
NTN-B 150850 (5,582500%)	0,21	0,15	0,00	0,17	-0,82	0,71	1.042.200,59	0,30
NTN-B 150850 (5,850500%)	0,21	0,15	0,00	0,17	-0,72	0,73	4.998.147,99	1,43
Sub-total	0,53	0,21	0,04		-0,88	0,42	134.756.224,06	38,56

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	0,00	0,01	0,00	0,00	-107,65	0,66	11.395,80	0,00
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	6,58	1,94	0,07	1,94	-0,47	-2,22	18.074.011,91	5,17
BB PREV RF IRF M	3,01	0,92	0,02	0,01	-0,48	-0,56	10.040.469,86	2,87
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	1,94	0,53	0,02	0,00	-0,57	-0,22	17.850.083,34	5,11
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,69	0,13	0,00	0,07	-0,47	0,56	279.850,18	0,08
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,47	1,24	0,12	0,02	-0,73	-1,63	42.649.638,77	12,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,47	1,23	0,04	0,01	-0,73	-1,64	16.181.235,59	4,63
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,94	0,53	0,03	0,01	-0,57	-0,22	29.718.132,67	8,50
Sub-total	3,12	0,99	0,29		-0,65	-1,13	134.804.818,12	38,57

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	0,02	0,00	0,01	-12,72	0,80	1.650.773,92	0,47
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,09	0,03	0,00	0,03	0,61	0,94	7.873.354,30	2,25
Sub-total	0,07	0,03	0,00		0,08	0,89	9.524.128,22	2,73

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CLARITAS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LONGO PRAZO	0,66	0,11	0,00	0,11	-0,20	0,76	9.023.854,85	2,58
Sub-total	0,97	0,11	0,00		-0,14	0,27	9.023.854,85	2,58

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável Value-At-Risk: 6,16%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	15,17	6,85	0,11	2,63	-0,30	-3,66	6.252.041,22	1,79
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	13,76	5,67	0,07	1,87	-0,39	-4,44	4.817.056,61	1,38
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	13,05	6,21	0,37	0,18	-0,18	-1,50	23.986.256,61	6,86
Sub-total	13,35	6,16	0,55		-0,24	-2,28	35.055.354,44	10,03

Investimentos no Exterior Value-At-Risk: 5,48%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PRINCIPAL GLOBAL HIGH YIELD FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3,51	1,65	0,00	1,64	-0,37	-0,41	998.809,91	0,29
Sub-total	3,61	1,65	0,00		-0,24	-0,12	998.809,91	0,29

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,51	5,88	0,03	0,72	-0,00	0,80	13.278.302,03	3,80
Sub-total	17,51	5,88	0,03		-0,00	0,80	13.278.302,03	3,80

Investimentos Estruturados Value-At-Risk: 5,80%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12,85	5,80	0,13	4,39	-0,36	-3,80	12.029.390,99	3,44
Sub-total	12,85	5,80	0,13		-0,36	-3,80	12.029.390,99	3,44

(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 (%)