



LDB
EMPRESAS

PORTO FELIZ
MAIO 2024



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.05.2024.

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

82,53%

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 150830 (4,069994%)	0,31	0,03	0,74	4,04	5.746.846,35	1,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,569998%)	0,34	0,04	0,86	4,65	1.691.970,58	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,776000%)	4,08	0,04	0,88	1,54	2.247.981,08	0,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,000000%)	0,35	0,04	0,90	4,83	1.578.252,77	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,423526%)	0,39	-0,02	0,77	4,18	2.875.053,73	0,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,734998%)	0,45	-0,03	0,79	4,31	11.334.849,51	3,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290003%)	0,40	0,04	0,84	4,54	11.257.357,76	3,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,601000%)	997,10	0,04	0,86	3,14	1.765.457,27	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,635000%)	2,87	0,04	0,87	4,68	1.720.983,78	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,640000%)	2,87	0,04	0,87	4,74	1.746.850,70	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,877000%)	0,42	0,04	0,89	4,78	5.462.241,08	1,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,051500%)	0,43	0,04	0,90	4,85	1.619.362,88	0,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,120004%)	0,45	0,04	0,83	4,47	11.265.042,35	3,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,171997%)	0,45	0,04	0,83	4,49	11.447.483,38	3,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,481000%)	0,47	0,04	0,85	4,62	5.534.118,45	1,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,792100%)	0,48	0,04	0,88	4,74	21.758.559,27	6,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	6,51	0,40	1,53	-3,25	9.457.774,35	2,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,582500%)	0,54	0,04	0,86	4,72	1.051.188,42	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,850500%)	0,59	0,04	0,88	4,77	5.042.316,14	1,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,145000%)	4,20	0,04	0,39	0,39	1.867.009,27	0,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (4,689998%)	0,57	0,04	0,79	4,29	2.924.664,16	0,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,669994%)	0,62	0,04	0,87	4,69	11.084.179,20	3,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,900000%)	0,63	0,04	0,89	4,79	5.474.895,47	1,54
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,66	0,06	0,90	3,97	135.954.437,95	38,35

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 PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,87	0,24	1,31	-0,24	40.467.995,84	11,42	4.952.904.793,10	0,82
BB	BB	BB PREV RF IRF M	2,36	0,20	0,64	1,69	10.104.450,79	2,85	4.105.804.160,54	0,25
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,33	0,06	0,74	3,77	290.490,69	0,08	8.483.707.239,73	0,00
BB	BB	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,06	0,03	0,62	2,15	5.799,37	0,00	158.250.869.199,97	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,73	0,10	1,03	2,83	30.023.543,99	8,47	7.617.915.472,63	0,39
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,85	0,24	1,30	-0,23	16.391.594,15	4,62	4.414.746.482,17	0,37
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	5,44	0,40	0,42	-1,25	18.150.823,33	5,12	218.398.294,56	8,31
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	1,73	0,10	1,03	2,84	18.034.279,40	5,09	1.577.510.449,17	1,14
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,88	0,21	1,04	0,92	133.468.977,56	37,65		

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	0,07	0,03	0,74	3,72	1.643.717,65	0,46	4.168.595.178,55	0,04
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,10	0,04	0,84	4,63	12.390.396,15	3,50	2.945.417.915,81	0,42
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,10	0,04	0,82	4,50	14.034.113,80	3,96		

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	0,36	0,04	0,91	1,18	9.106.040,99	2,57	230.002.887,74	3,96
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			0,36	0,04	0,91	1,18	9.106.040,99	2,57		
Renda Fixa			1,43	0,13	0,96	2,59	292.563.570,30	82,53		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

9,62%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	14,18	-0,43	-2,91	-8,37	23.288.272,62	6,57	653.465.942,04	3,56
PLURAL	BEM	BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	12,91	-0,63	-2,25	-5,82	4.708.763,01	1,33	355.018.350,43	1,33
CLARITAS	SANTANDER	CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	16,03	-0,85	-2,58	-6,36	6.090.464,57	1,72	746.160.315,08	0,82
Sub-total Artigo 8º I			16,03	-0,53	-2,76	-8,59	34.087.500,20	9,62		
Renda Variável			16,03	-0,53	-2,76	-8,59	34.087.500,20	9,62		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,28%

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	3,83	0,25	1,13	1,01	1.010.110,35	0,28	31.445.605,19	3,21
Sub-total Artigo 9º II			3,83	0,25	1,13	1,01	1.010.110,35	0,28		

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	13,53	-0,46	6,78	23,76	14.178.326,31	4,00	2.462.872.316,84	0,58
Sub-total Artigo 9º III			13,53	-0,46	6,78	23,76	14.178.326,31	4,00		
Investimentos no Exterior			13,35	-0,41	6,38	23,27	15.188.436,66	4,28		

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	11,35	0,16	5,07	12,32	12.638.955,21	3,57	1.884.343.751,95	0,67
Sub-total Artigo 10º I			11,35	0,16	5,07	12,32	12.638.955,21	3,57		
Investimentos Estruturados			11,34	0,16	5,07	12,32	12.638.955,21	3,57		
Total			3,41	0,04	0,95	2,12	354.478.462,37	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	135.954.437,95	38,35	0,00	35,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	133.468.977,56	37,65	0,00	38,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	14.034.113,80	3,96	0,00	3,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	9.106.040,99	2,57	0,00	0,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	292.563.570,30	82,53					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	34.087.500,20	9,62	0,00	12,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	34.087.500,20	9,62					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	1.010.110,35	0,28	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	14.178.326,31	4,00	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	15.188.436,66	4,28					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	12.638.955,21	3,57	0,00	2,50	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	12.638.955,21	3,57					15,00
Total		354.478.462,37	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,90 107,47	3,97 90,16	2,18 84,55	5,19 97,21	9,02 75,10	1.205.093,75	5.126.099,62
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,04 124,36	0,92 21,00	0,25 9,73	2,98 55,95	7,34 61,10	1.396.804,61	1.160.098,59
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,82 98,43	4,50 102,30	2,57 99,94	5,46 102,33	12,52 104,30	96.144,55	657.127,77
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,91 109,29	1,18 95,09				82.186,14	106.040,99
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-2,76 0,28	-8,59 0,42	-4,60 0,77	-3,45 0,66	4,10 -8,61	-967.854,24	-3.870.521,53
Artigo 9º II % do CDI	1,13 135,77	1,01 62,97				11.300,44	10.110,35
Artigo 9º III % do CDI	6,78 813,37	23,76 540,19	11,38 441,67	26,73 501,17	34,96 291,19	900.024,28	2.721.917,70
Artigo 10º I % do CDI	5,07 608,07	12,32 280,04	4,50 174,73	18,15 340,21	33,39 278,14	609.564,22	1.386.032,34
PORTO FELIZ (Total)						3.333.263,75	7.296.905,83

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%)	2.927.413,84	0,00	0,00	74.613,12	2.875.053,73	22.253,01	118.220,17
NTN-B 150535 (4,734998%)	11.545.855,39	0,00	0,00	301.608,70	11.334.849,51	90.602,82	480.144,71
NTN-B 150535 (5,290003%)	11.475.133,29	0,00	0,00	312.718,60	11.257.357,76	94.943,07	501.061,86
NTN-B 150535 (5,601000%)	1.800.375,39	0,00	0,00	50.247,07	1.765.457,27	15.328,95	55.058,92
NTN-B 150535 (5,635000%)	1.755.104,21	0,00	0,00	49.110,83	1.720.983,78	14.990,40	78.929,57
NTN-B 150535 (5,640000%)	1.781.495,10	0,00	0,00	49.868,33	1.746.850,70	15.223,93	81.122,51
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.572.423,82	0,00	0,00	158.821,16	5.462.241,08	48.638,42	255.690,89
NTN-B 150535 (6,051500%)	1.652.439,84	0,00	0,00	47.722,10	1.619.362,88	14.645,14	76.906,97
NTN-B 150545	9.594.411,17	0,00	0,00	282.671,36	9.457.774,35	146.034,54	-327.497,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.972.388,92	0,00	0,00	70.951,90	2.924.664,16	23.227,14	123.022,65
NTN-B 150555 (5,669994%)	11.297.545,39	0,00	0,00	310.193,62	11.084.179,20	96.827,43	509.591,29
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.584.239,37	0,00	0,00	158.189,91	5.474.895,47	48.846,01	256.717,31
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.704.566,40	0,00	0,00	0,00	5.746.846,35	42.279,95	224.841,03
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.677.520,68	0,00	0,00	0,00	1.691.970,58	14.449,90	75.897,21
NTN-B 150830 (5,776000%)	2.228.419,44	0,00	0,00	0,00	2.247.981,08	19.561,64	34.152,97
NTN-B 150830 (6,000000%)	1.564.243,84	0,00	0,00	0,00	1.578.252,77	14.008,93	73.358,96
NTN-B 150840 (5,120004%)	11.172.807,92	0,00	0,00	0,00	11.265.042,35	92.234,43	485.880,40
NTN-B 150840 (5,171997%)	11.353.288,14	0,00	0,00	0,00	11.447.483,38	94.195,24	496.030,06
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.487.243,11	0,00	0,00	0,00	5.534.118,45	46.875,34	246.320,84
NTN-B 150840 (5,792100%)	21.568.960,22	0,00	0,00	0,00	21.758.559,27	189.599,05	994.201,12
NTN-B 150850 (5,582500%)	1.042.200,59	0,00	0,00	0,00	1.051.188,42	8.987,83	47.772,69
NTN-B 150850 (5,850500%)	4.998.147,99	0,00	0,00	0,00	5.042.316,14	44.168,15	231.503,00
NTN-B 150850 (6,145000%)	0,00	1.859.836,84	0,00	0,00	1.867.009,27	7.172,42	7.172,42
	134.756.224,06	1.859.836,84	0,00	1.866.716,70	135.954.437,95	1.205.093,75	

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	42.649.638,77	0,00	-2.735.110,94	0,00	40.467.995,84	553.468,01	-72.010,32
BB PREV RF IRF M	10.040.469,86	0,00	0,00	0,00	10.104.450,79	63.980,93	165.621,60
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	279.850,18	135.000,00	-126.890,59	0,00	290.490,69	2.531,10	11.721,15
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	11.395,80	0,00	-5.643,64	0,00	5.799,37	47,21	154,69
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	29.718.132,67	0,00	0,00	0,00	30.023.543,99	305.411,32	825.568,62
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.181.235,59	0,00	0,00	0,00	16.391.594,15	210.358,56	-37.830,17
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	18.074.011,91	0,00	0,00	0,00	18.150.823,33	76.811,42	-230.407,97
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	17.850.083,34	0,00	0,00	0,00	18.034.279,40	184.196,06	497.280,99
	134.804.818,12	135.000,00	-2.867.645,17	0,00	133.468.977,56	1.396.804,61	

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	1.650.773,92	6.274.625,13	-6.297.875,25	0,00	1.643.717,65	16.193,85	142.626,68
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	7.873.354,30	4.437.091,15	0,00	0,00	12.390.396,15	79.950,70	514.501,09
	9.524.128,22	10.711.716,28	-6.297.875,25	0,00	14.034.113,80	96.144,55	

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	9.023.854,85	0,00	0,00	0,00	9.106.040,99	82.186,14	106.040,99
	9.023.854,85	0,00	0,00	0,00	9.106.040,99	82.186,14	

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	23.986.256,61	0,00	0,00	0,00	23.288.272,62	-697.983,99	-2.127.019,86
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	4.817.056,61	0,00	0,00	0,00	4.708.763,01	-108.293,60	-291.236,99
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	6.252.041,22	0,00	0,00	0,00	6.090.464,57	-161.576,65	-371.364,43
	35.055.354,44	0,00	0,00	0,00	34.087.500,20	-967.854,24	

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	998.809,91	0,00	0,00	0,00	1.010.110,35	11.300,44	10.110,35
	998.809,91	0,00	0,00	0,00	1.010.110,35	11.300,44	

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	13.278.302,03	0,00	0,00	0,00	14.178.326,31	900.024,28	2.721.917,70
	13.278.302,03	0,00	0,00	0,00	14.178.326,31	900.024,28	

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	12.029.390,99	0,00	0,00	0,00	12.638.955,21	609.564,22	1.386.032,34
	12.029.390,99	0,00	0,00	0,00	12.638.955,21	609.564,22	

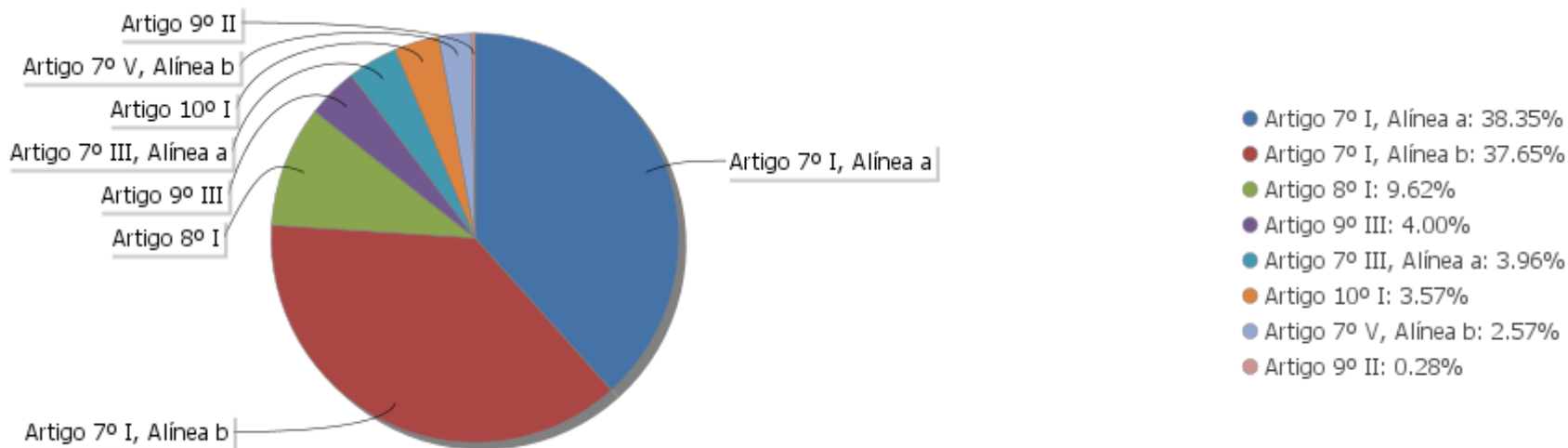
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

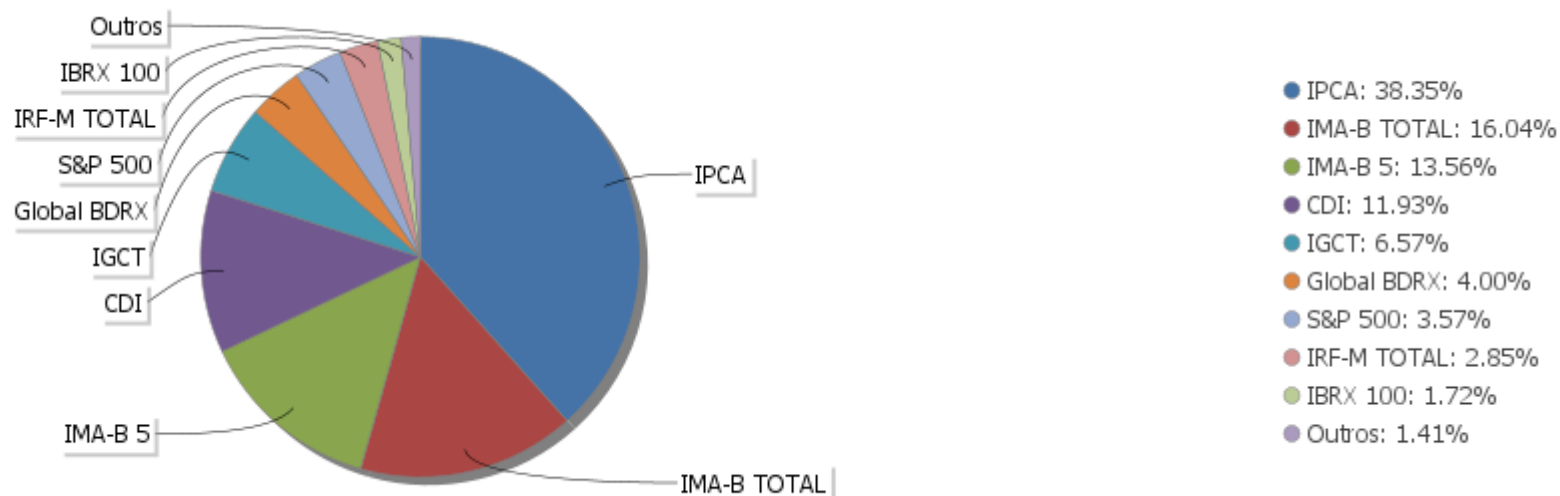
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	212.433.559,85	59,93	60,00	212.433.559,85	59,93	60,00
de 31 dias a 365 dias	6.090.464,57	1,72		218.524.024,42	61,65	60,00
acima de 365 dias	135.954.437,95	38,35	40,00	354.478.462,37	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

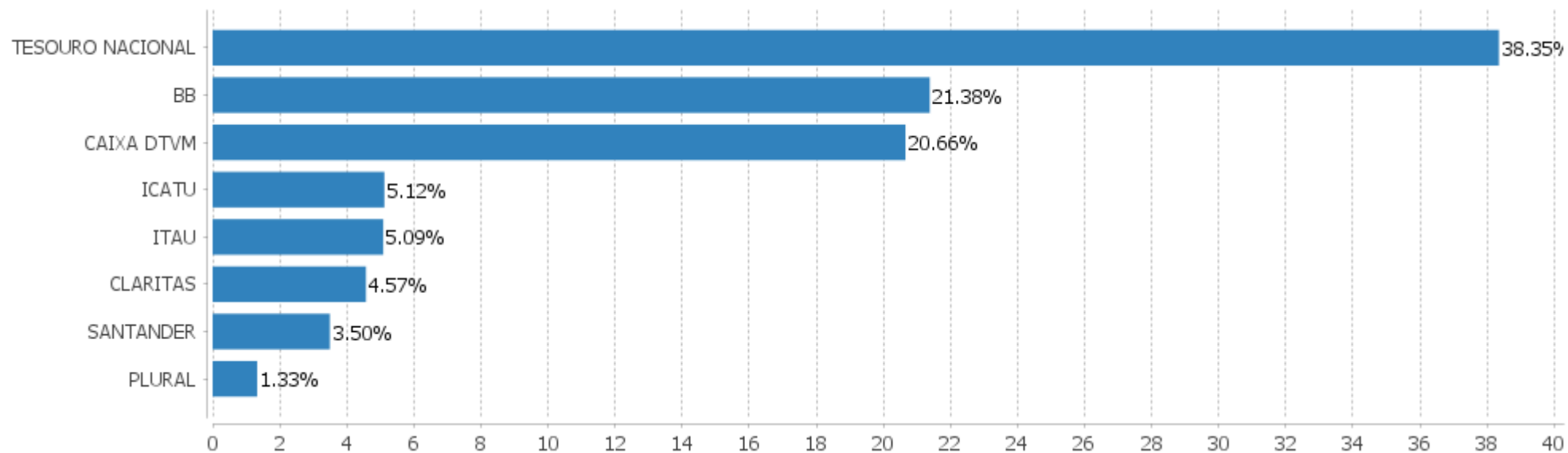


Alocação Por Estratégia



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	0,95								2,12
IPCA + 5,16%	0,86	1,21	0,56	0,82	0,88								4,41
p.p. indexador	-1,13	-0,01	0,22	-1,38	0,07								-2,30
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

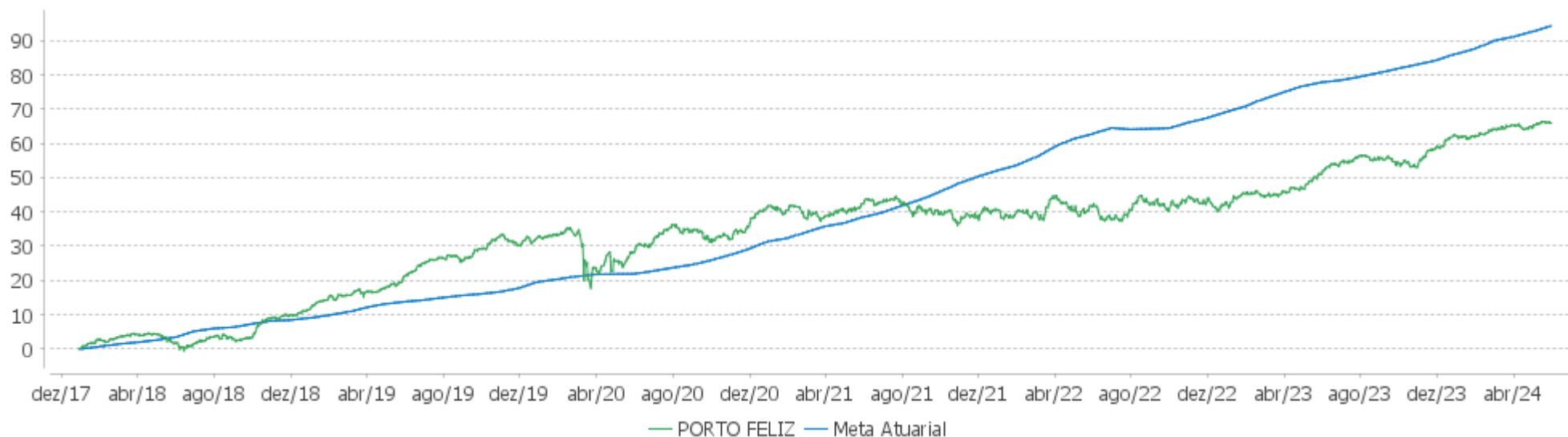
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	37	48,05
Meses abaixo - Meta Atuarial	40	51,95
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-7,15	2020-03

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,18	2,28	-1,11	2,40
06 meses	4,49	5,41	-0,92	2,75
12 meses	9,97	9,15	0,82	3,41
24 meses	17,08	19,02	-1,95	4,66
36 meses	16,62	39,90	-23,28	5,35
48 meses	29,46	59,73	-30,27	5,43
60 meses	36,86	72,37	-35,51	7,13
Desde 29/12/2017	65,97	98,39	-32,41	6,62

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

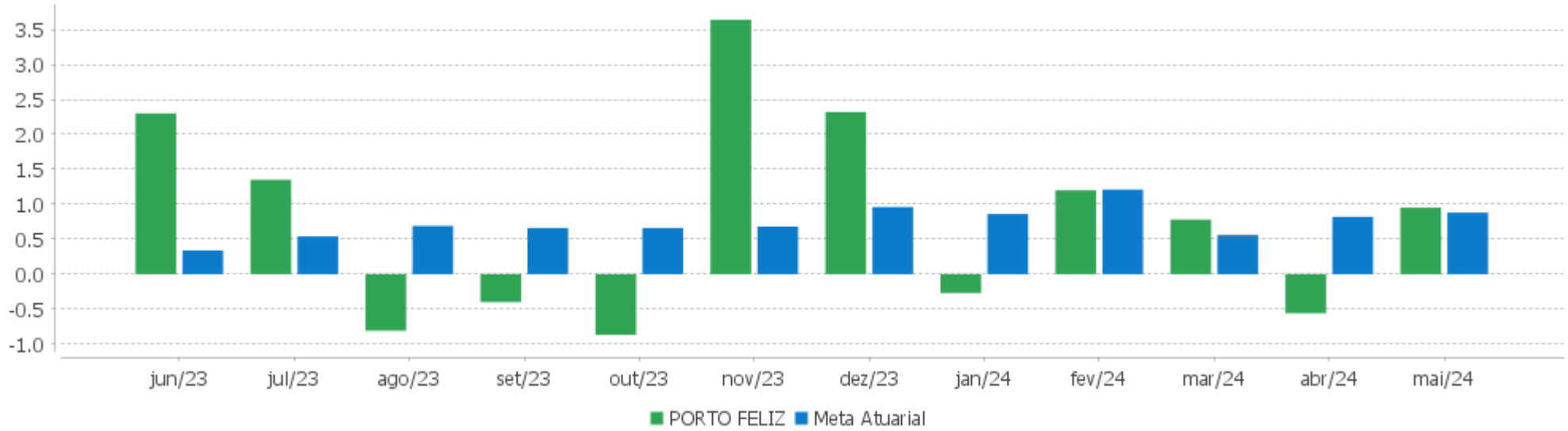


Patrimônio Líquido



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	0,91 109,29	5,04 114,53	2,68 104,12	6,02 112,86	14,23 118,54	29,84 110,12	42,32 113,96
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	1,53 1,07	-3,25 -5,51	-2,16 -3,16	0,53 -2,31	4,54 0,61	16,35 8,34	13,56 -7,13
NTN-B 150830 (6,000000%) Var. IPCA p.p.	0,90 0,44	4,83 2,56	2,68 1,68	5,81 2,97	9,97 6,05	14,45 6,43	
NTN-B 150840 (5,120004%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,37	4,47 2,20	2,47 1,47	5,43 2,59	9,13 5,20	19,37 11,36	36,96 16,27
NTN-B 150830 (4,069994%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,28	4,04 1,77	2,21 1,21	4,83 1,98	7,95 4,03	16,92 8,90	36,35 15,67
NTN-B 150535 (5,640000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,41	4,74 2,47	2,60 1,59	5,67 2,83	6,58 2,66		
NTN-B 150850 (6,145000%) Var. IPCA p.p.	0,91 0,45	1,83 -0,43	2,72 1,71	2,70 -0,14	3,70 -0,22		
NTN-B 150535 (5,290003%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,38	4,54 2,27	2,51 1,51	5,49 2,65	9,27 5,35	19,73 11,71	41,27 20,58
NTN-B 150535 (5,877000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,43	4,78 2,51	2,65 1,65	5,79 2,95	9,89 5,96	21,07 13,05	39,58 18,89
NTN-B 150840 (5,792100%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,42	4,74 2,48	2,63 1,63	5,78 2,94	9,84 5,91	20,91 12,90	35,43 14,74
NTN-B 150850 (5,850500%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,42	4,77 2,50	2,65 1,64	5,87 3,03	9,96 6,03	14,41 6,39	
NTN-B 150555 (4,689998%) Var. IPCA p.p.	0,79 0,33	4,29 2,02	2,36 1,36	5,28 2,44	8,75 4,82	18,48 10,46	39,00 18,31
NTN-B 150535 (5,601000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,40	4,67 2,40	2,59 1,58	5,51 2,67	6,42 2,49		
NTN-B 150840 (5,481000%) Var. IPCA p.p.	0,85 0,39	4,62 2,35	2,56 1,55	5,62 2,78	9,51 5,58	20,20 12,18	34,49 13,80
NTN-B 150535 (5,635000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,41	4,68 2,41	2,59 1,59	5,67 2,83	6,58 2,65		
NTN-B 150830 (5,776000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,42	1,77 -0,50	2,63 1,63	2,61 -0,24	3,51 -0,41		
NTN-B 150830 (5,569998%)	0,86	4,65	2,58	5,59	9,52	20,32	38,38

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.	0,40	2,38	1,58	2,75	5,60	12,30	17,69
NTN-B 150850 (5,582500%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,40	4,72 2,45	2,58 1,58	5,73 2,89	9,67 5,75	14,05 6,03	
NTN-B 150840 (5,171997%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,37	4,49 2,22	2,48 1,48	5,46 2,62	9,18 5,26	19,49 11,48	37,15 16,46
NTN-B 150555 (5,669994%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,41	4,69 2,43	2,60 1,60	5,80 2,95	9,79 5,86	20,72 12,70	39,05 18,36
NTN-B 150555 (5,900000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,43	4,79 2,52	2,66 1,66	5,91 3,07	10,03 6,10	21,25 13,23	39,83 19,14
NTN-B 150535 (4,734998%) Var. IPCA p.p.	0,79 0,33	4,31 2,04	2,38 1,37	5,21 2,36	8,69 4,77	18,47 10,46	38,94 18,25
NTN-B 150535 (4,423526%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,31	4,18 1,92	2,30 1,30	5,04 2,20	8,36 4,44	17,76 9,74	37,73 17,04
NTN-B 150535 (6,051500%) Var. IPCA p.p.	0,90 0,44	4,85 2,58	2,70 1,69	5,88 3,04	10,07 6,15	17,98 9,96	
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,30 -0,03	-0,23 -0,10	-0,30 -0,07	2,49 -0,13	6,35 -0,21	17,30 -0,42	22,38 -0,75
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	2,83 -0,09	1,56 -0,06	4,31 -0,12	8,70 -0,23	18,94 -0,29	30,01 -0,61
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI % do CDI	0,62 73,97	3,29 74,82	1,91 74,33	4,00 74,98	9,15 76,25	20,67 76,28	
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	2,84 -0,08	1,57 -0,05	4,32 -0,10	8,73 -0,21	18,80 -0,42	29,91 -0,71
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,74 -0,03	3,77 -0,08	2,13 -0,08	4,69 -0,11	11,27 -0,29	25,97 -0,68	33,71 -1,09
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,64 -0,02	1,69 -0,12	0,58 -0,09	3,17 -0,15	10,09 -0,41	25,93 -0,86	27,61 -1,20
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,31 -0,02	-0,24 -0,11	-0,29 -0,06	2,49 -0,12	6,25 -0,31	17,16 -0,56	22,13 -1,00
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP % do CDI	0,42 51,00	-1,25 -28,44	-1,76 -68,38	0,88 16,54	8,77 73,02	25,98 95,85	19,55 52,64
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,75 89,44	3,97 90,22	2,32 89,93	4,82 90,39	10,90 90,80	24,61 90,82	33,00 88,86
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,84 100,46	4,63 105,23	2,67 103,49	5,61 105,26	12,76 106,30	27,98 103,26	38,93 104,83
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	-2,58	-6,36	-4,70	-1,34	11,65	2,08	-1,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBRX 100 p.p.	0,59	2,22	0,46	2,22	-1,59	-6,11	3,70
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	-2,25	-10,51	-8,67	-6,74	8,57	14,95	14,77
Var. IBOVESPA p.p.	0,79	-1,50	-3,30	-2,63	-4,13	5,30	18,03
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-2,91	-8,37	-4,84	-3,31	12,61	6,80	-7,79
Var. IGCT p.p.	0,07	-0,11	0,07	-0,27	-1,12	-2,51	-3,10
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	6,78	23,76	11,38	26,96	35,62	54,35	31,48
Var. Global BDRX p.p.	-0,54	-1,31	-0,92	-1,66	-2,28	-3,94	-6,18
PRINCIPAL GLOBAL HIGH YIELD FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1,13	3,16	1,85	7,10	15,38	24,60	24,77
% do CDI	135,77	71,93	71,81	133,14	128,13	90,76	66,70
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,07	12,32	4,50	18,15	33,23	47,36	54,71
Var. S&P 500 p.p.	-1,15	-7,47	-4,42	-4,56	3,36	5,79	28,95
PORTO FELIZ	0,95	2,12	1,18	4,49	9,97	17,08	16,62
Var. IPCA + 5,16% p.p.	0,07	-2,30	-1,11	-0,93	0,73	-2,30	-23,65
CDI	0,83	4,40	2,58	5,33	12,01	27,10	37,13
IBOVESPA	-3,04	-9,01	-5,37	-4,11	12,70	9,65	-3,26
INPC + 6,00%	0,95	4,91	2,51	5,98	9,49	20,37	42,77
IPCA + 6,00%	0,95	4,76	2,49	5,83	10,11	21,28	43,64

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	0,78	3,85	2,21	4,80	11,56	26,65	34,79	37,63	46,34
IRF-M 1+	0,60	0,94	-0,00	2,69	10,22	27,67	26,53	26,17	43,40
IRF-M TOTAL	0,66	1,81	0,67	3,32	10,51	26,78	28,81	29,73	44,40
IMA-B 5	1,05	2,92	1,62	4,42	8,94	19,23	30,62	40,27	53,54
IMA-B 5+	1,59	-2,85	-1,91	0,98	4,24	16,02	15,73	28,10	33,44
IMA-B TOTAL	1,33	-0,13	-0,23	2,62	6,56	17,72	23,13	34,41	43,39
IMA-GERAL TOTAL	0,95	2,37	1,25	4,04	10,06	23,87	30,39	35,87	46,18
IDKA 2	1,07	3,03	1,78	4,53	9,23	18,78	29,76	40,74	53,45
IDKA 20	2,01	-7,44	-4,45	-1,34	1,87	15,01	3,51	19,85	17,13
CDI	0,83	4,40	2,58	5,33	12,01	27,10	37,13	40,12	46,96

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,04	-9,01	-5,37	-4,11	12,70	9,65	-3,26	39,70	25,83
IBRX 100	-3,18	-8,57	-5,17	-3,56	13,24	8,19	-5,26	39,86	27,37
IBRX 50	-3,11	-7,63	-4,50	-2,72	14,94	9,84	-3,24	44,50	28,06
SMALL CAP	-3,38	-14,52	-8,96	-8,50	-4,39	-11,41	-35,21	2,20	0,47
Índice Consumo - ICON	-2,26	-14,63	-6,94	-9,52	-7,70	-22,28	-50,93	-37,26	-32,43
Índice Dividendos - IDIV	-0,99	-5,29	-2,73	1,24	19,55	18,54	21,40	67,35	58,14

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	6,22	19,79	8,92	22,70	29,87	41,57	25,76	67,46	155,07

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,02	2,14	0,66	6,48	12,24	19,92	20,09	27,27	32,50

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	5,22	16,99	8,53	20,14	25,00	33,38	10,61	48,94	112,32

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,46	2,27	1,00	2,84	3,93	8,02	20,69	30,41	32,86
INPC	0,46	2,42	1,02	2,99	3,34	7,20	19,96	30,63	33,31
IGPM	0,89	0,28	0,73	1,02	-0,34	-4,79	5,42	44,47	53,87
SELIC	0,83	4,40	2,58	5,33	12,00	27,10	37,13	40,12	46,96

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,79	3,94	2,00	4,85	8,05	16,78	35,69	52,47	61,52
IPCA + 5,00%	0,87	4,35	2,24	5,34	9,08	19,02	39,63	58,39	69,40
IPCA + 5,50%	0,91	4,55	2,36	5,59	9,60	20,15	41,63	61,42	73,46
IPCA + 5,89%	0,94	4,71	2,46	5,78	10,00	21,03	43,20	63,81	76,67
IPCA + 6,00%	0,95	4,76	2,49	5,83	10,11	21,28	43,64	64,49	77,59
INPC + 4,00%	0,79	4,09	2,02	4,99	7,44	15,90	34,87	52,72	62,06
INPC + 6,00%	0,95	4,91	2,51	5,98	9,49	20,37	42,77	64,76	78,19

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%)	2.875.053,73	4,423526	2.506.899,41	6,180600	-368.154,32
NTN-B 150535 (4,734998%)	11.334.849,51	4,734998	10.133.642,49	6,180600	-1.201.207,02
NTN-B 150535 (5,290003%)	11.257.357,76	5,290003	10.506.920,24	6,180600	-750.437,52
NTN-B 150535 (5,601000%)	1.765.457,27	5,601000	1.688.233,45	6,180600	-77.223,82
NTN-B 150535 (5,635000%)	1.720.983,78	5,635000	1.650.057,32	6,180600	-70.926,46
NTN-B 150535 (5,640000%)	1.746.850,70	5,640000	1.675.508,07	6,180600	-71.342,63
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.462.241,08	5,877000	5.336.175,07	6,180600	-126.066,01
NTN-B 150535 (6,051500%)	1.619.362,88	6,051500	1.603.397,60	6,180600	-15.965,28
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.924.664,16	4,689998	2.370.131,19	6,160200	-554.532,97
NTN-B 150555 (5,669994%)	11.084.179,20	5,669994	10.361.943,65	6,160200	-722.235,55
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.474.895,47	5,900000	5.284.296,05	6,160200	-190.599,42
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.746.846,35	4,069994	5.189.155,68	6,133600	-557.690,67
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.691.970,58	5,569998	1.645.975,93	6,133600	-45.994,65
NTN-B 150830 (5,776000%)	2.247.981,08	5,776000	2.209.072,95	6,133600	-38.908,13
NTN-B 150830 (6,000000%)	1.578.252,77	6,000000	1.568.008,65	6,133600	-10.244,12
NTN-B 150840 (5,120004%)	11.265.042,35	5,120004	10.174.861,95	6,140000	-1.090.180,40
NTN-B 150840 (5,171997%)	11.447.483,38	5,171997	10.394.463,29	6,140000	-1.053.020,09
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.534.118,45	5,481000	5.184.313,92	6,140000	-349.804,53
NTN-B 150840 (5,792100%)	21.758.559,27	5,792100	21.025.751,56	6,140000	-732.807,71
NTN-B 150850 (5,582500%)	1.051.188,42	5,582500	974.528,18	6,178200	-76.660,24
NTN-B 150850 (5,850500%)	5.042.316,14	5,850500	4.838.446,94	6,178200	-203.869,20
NTN-B 150850 (6,145000%)	1.867.009,27	6,145000	1.859.297,19	6,178200	-7.712,08

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
195	08/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	181.542,26	0,00	64.582,36973600	2,8110188700
194	10/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.583.307,51	0,00	918.333,11684500	2,8130396940
185	10/05/2024	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	5.643,64	4.486,33763900	1,2579614940
203	13/05/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	135.000,00	0,00	37.037,80427300	3,6449244940
193	15/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.866.716,69	0,00	662.894,80350800	2,8160074270
197	17/05/2024	NTN-B 150850 (6,145000%)	1.859.836,84	0,00	435,00000000	4.275,4870070000
192	17/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.859.836,85	659.989,96459800	2,8179774690
191	20/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.132.091,15	401.596,79112200	2,8189745910
190	20/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.305.000,00	1.172.412,12835100	2,8189745910
198	20/05/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	3.305.000,00	0,00	12.621,99831618	261,8444336000
199	20/05/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	1.132.091,15	0,00	4.323,52574556	261,8444336000
202	24/05/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	28.308,95	7.745,09140500	3,6550827510
201	27/05/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	88.581,64	24.221,00156500	3,6572244860
200	27/05/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	10.000,00	2.734,31396900	3,6572244860
189	27/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	428.242,69	0,00	151.650,26073900	2,8238836380
196	27/05/2024	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	2.735.110,94	346.907,85616800	7,8842577110
188	28/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.101.376,36	0,00	389.882,06045600	2,8248962230
187	28/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	947,25	335,32205200	2,8248962230
186	29/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	113.439,62	0,00	40.143,01020700	2,8258872320
Total			12.706.553,12	9.165.520,42		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.573.496,90

Value-At-Risk: 1,01%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,24	0,56	5,00	0,36	0,10	0,96	292.563.570,30	82,53
Artigo 8º	10,21	6,24	20,00	0,52	-0,35	-2,76	34.087.500,20	9,62
Artigo 9º	9,06	5,27	20,00	0,02	0,61	6,40	15.188.436,66	4,28
Artigo 10º	8,53	5,13	20,00	0,11	0,50	5,07	12.638.955,21	3,57
PORTO FELIZ		1,01		1,01			354.478.462,37	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,56%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150830 (4,069994%)	0,14	0,13	0,00	0,15	-0,67	0,74	5.746.846,35	1,62
NTN-B 150830 (5,569998%)	0,14	0,13	0,00	0,15	0,20	0,86	1.691.970,58	0,48
NTN-B 150830 (5,776000%)	0,14	0,21	-0,00	0,25	0,32	0,88	2.247.981,08	0,63
NTN-B 150830 (6,000000%)	0,14	0,13	0,00	0,15	0,45	0,90	1.578.252,77	0,45
NTN-B 150535 (4,423526%)	0,29	0,19	0,00	0,20	-0,22	0,77	2.875.053,73	0,81
NTN-B 150535 (4,734998%)	0,38	0,20	0,00	0,22	-0,11	0,79	11.334.849,51	3,20
NTN-B 150535 (5,290003%)	0,14	0,13	-0,00	0,15	0,04	0,84	11.257.357,76	3,18
NTN-B 150535 (5,601000%)	0,14	0,13	0,00	0,16	0,22	0,86	1.765.457,27	0,50
NTN-B 150535 (5,635000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,24	0,87	1.720.983,78	0,49
NTN-B 150535 (5,640000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,25	0,87	1.746.850,70	0,49
NTN-B 150535 (5,877000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,38	0,89	5.462.241,08	1,54
NTN-B 150535 (6,051500%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,48	0,90	1.619.362,88	0,46
NTN-B 150840 (5,120004%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	-0,06	0,83	11.265.042,35	3,18
NTN-B 150840 (5,171997%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	-0,03	0,83	11.447.483,38	3,23
NTN-B 150840 (5,481000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,15	0,85	5.534.118,45	1,56
NTN-B 150840 (5,792100%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,33	0,88	21.758.559,27	6,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545	4,72	1,98	0,04	1,97	0,15	1,53	9.457.774,35	2,67
NTN-B 150850 (5,582500%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,21	0,86	1.051.188,42	0,30
NTN-B 150850 (5,850500%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,37	0,88	5.042.316,14	1,42
NTN-B 150850 (6,145000%)	0,14	0,22	-0,00	0,25	0,54	0,91	1.867.009,27	0,53
NTN-B 150555 (4,689998%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	-0,31	0,79	2.924.664,16	0,83
NTN-B 150555 (5,669994%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,26	0,87	11.084.179,20	3,13
NTN-B 150555 (5,900000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,40	0,89	5.474.895,47	1,54
Sub-total	0,32	0,18	0,04		0,20	0,90	135.954.437,95	38,35

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,70	1,18	0,10	0,02	0,17	1,31	40.467.995,84	11,42
BB PREV RF IRF M	2,79	1,29	0,03	0,02	-0,07	0,64	10.104.450,79	2,85
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,37	0,18	0,00	0,01	-0,24	0,74	290.490,69	0,08
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,01	0,01	0,00	0,00	-23,93	0,62	5.799,37	0,00
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,15	0,57	0,03	0,00	0,17	1,03	30.023.543,99	8,47
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,70	1,18	0,04	0,01	0,17	1,30	16.391.594,15	4,62
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	6,46	2,69	0,10	2,69	-0,06	0,42	18.150.823,33	5,12
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	1,15	0,57	0,02	0,00	0,17	1,03	18.034.279,40	5,09
Sub-total	2,37	1,08	0,32		0,09	1,04	133.468.977,56	37,65

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	0,01	0,00	0,01	-6,27	0,75	1.643.717,65	0,46
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,03	0,04	0,00	0,03	0,12	0,84	12.390.396,15	3,50
Sub-total	0,03	0,03	0,00		-0,51	0,82	14.034.113,80	3,96

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	0,33	0,12	0,00	0,12	0,24	0,91	9.106.040,99	2,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,33	0,12	0,00		0,24	0,91	9.106.040,99	2,57

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,24%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	9,62	6,29	0,35	0,33	-0,39	-2,91	23.288.272,62	6,57
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	11,62	6,40	0,07	2,10	-0,27	-2,25	4.708.763,01	1,33
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	13,09	6,66	0,10	2,87	-0,26	-2,58	6.090.464,57	1,72
Sub-total	10,21	6,24	0,52		-0,35	-2,76	34.087.500,20	9,62

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,27%

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	2,81	1,52	0,00	1,52	0,11	1,13	1.010.110,35	0,28
Sub-total	2,81	1,52	0,00		0,11	1,13	1.010.110,35	0,28

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	9,51	5,64	0,02	0,82	0,63	6,78	14.178.326,31	4,00
Sub-total	9,51	5,64	0,02		0,63	6,78	14.178.326,31	4,00

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,13%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	8,53	5,13	0,11	3,87	0,50	5,07	12.638.955,21	3,57
Sub-total	8,53	5,13	0,11		0,50	5,07	12.638.955,21	3,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

- (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 (%)