



**LDB**  
EMPRESAS

**PORTO FELIZ**  
DEZEMBRO 2022



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 30.12.2022.

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

68,81%

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	9,25	0,04	-1,64	2,90	8.833.471,07	3,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,423526%)	0,67	-0,02	0,74	10,38	2.723.972,29	0,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,734998%)	0,71	-0,04	0,77	10,69	10.714.826,01	3,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290003%)	0,62	0,04	0,82	11,36	10.600.828,24	3,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,877000%)	0,62	0,04	0,86	8,58	5.123.351,63	1,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,051500%)	4,17	0,04	0,88	1,24	1.517.156,01	0,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (4,689998%)	0,62	0,04	0,77	10,73	2.745.535,26	0,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,669994%)	0,62	0,04	0,85	9,70	10.381.956,65	3,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,900000%)	0,62	0,04	0,87	8,60	5.125.956,36	1,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,069994%)	0,62	0,04	0,71	10,07	5.482.186,57	1,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,569998%)	0,62	0,04	0,84	11,06	1.592.373,80	0,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,120004%)	0,62	0,04	0,80	11,18	10.599.186,22	3,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,171997%)	0,62	0,04	0,81	11,24	10.767.953,69	3,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,481000%)	2,82	0,04	0,83	6,86	5.197.494,99	1,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,792100%)	2,91	0,04	0,86	5,02	20.404.301,78	7,06

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
	<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>	<b>0,97</b>	<b>0,03</b>	<b>0,62</b>	<b>10,28</b>	<b>111.810.550,57</b>	<b>38,69</b>

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF IRF M	3,68	0,05	1,43	8,58	236.193,79	0,08	4.012.099.701,11	0,01
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,61	0,04	0,92	9,60	15.669.756,56	5,42	1.261.404.429,16	1,24
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,48	0,05	1,16	11,73	1.532.097,03	0,53	6.516.931.621,39	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,32	0,04	-0,22	6,09	12.911.747,05	4,47	6.078.064.149,48	0,21
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,40	0,04	-0,24	6,19	14.180.744,19	4,91	3.466.339.701,42	0,41
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,60	0,04	0,92	9,67	22.456.446,55	7,77	7.960.289.495,76	0,28
BB	BB	BB PREV RF IPCA	1,93	0,04	0,95	10,06	3.117.989,65	1,08	3.745.902.538,43	0,08
		<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>	<b>3,57</b>	<b>0,04</b>	<b>0,48</b>	<b>7,79</b>	<b>70.104.974,82</b>	<b>24,26</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,08	0,05	0,99	11,16	584.197,20	0,20	3.841.990.026,28	0,02
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,09	0,05	1,14	7,45	16.364.333,90	5,66	2.966.118.233,61	0,55
		<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>	<b>0,11</b>	<b>0,05</b>	<b>1,13</b>	<b>11,80</b>	<b>16.948.531,10</b>	<b>5,86</b>		
		<b>Renda Fixa</b>	<b>1,98</b>	<b>0,04</b>	<b>0,61</b>	<b>9,22</b>	<b>198.864.056,49</b>	<b>68,81</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

17,51%

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	22,01	-0,00	-0,81	-0,81	2.975.734,54	1,03	548.029.386,77	0,54
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	26,41	-0,00	-2,61	-8,25	26.492.571,17	9,17	893.768.575,50	2,96
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21,38	-0,01	-2,62	2,43	21.139.424,50	7,31	844.496.837,07	2,50
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>23,42</b>	<b>-0,00</b>	<b>-2,61</b>	<b>-3,50</b>	<b>50.607.730,21</b>	<b>17,51</b>		
Renda Variável			23,42	-0,00	-2,61	-3,50	50.607.730,21	17,51		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,11%

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	26,84	-0,00	-4,79	-28,54	17.648.579,48	6,11	1.938.590.167,99	0,91
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>26,84</b>	<b>-0,00</b>	<b>-4,79</b>	<b>-28,54</b>	<b>17.648.579,48</b>	<b>6,11</b>		
Investimentos no Exterior			26,84	-0,00	-4,79	-28,54	17.648.579,48	6,11		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,57%

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	24,18	0,05	-4,90	-11,97	21.878.625,00	7,57	1.723.160.287,50	1,27
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>24,18</b>	<b>0,05</b>	<b>-4,90</b>	<b>-11,97</b>	<b>21.878.625,00</b>	<b>7,57</b>		
Investimentos Estruturados			24,18	0,05	-4,90	-11,97	21.878.625,00	7,57		
<b>Total</b>			<b>6,73</b>	<b>0,03</b>	<b>-0,75</b>	<b>1,60</b>	<b>288.998.991,18</b>	<b>100,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	111.810.550,57	38,69	0,00	37,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	70.104.974,82	24,26	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	16.948.531,10	5,86	0,00	3,00	60,00	0,00	60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>198.864.056,49</b>	<b>68,81</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	50.607.730,21	17,51	0,00	20,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>50.607.730,21</b>	<b>17,51</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	17.648.579,48	6,11	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>17.648.579,48</b>	<b>6,11</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	21.878.625,00	7,57	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>21.878.625,00</b>	<b>7,57</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>288.998.991,18</b>	<b>100,00</b>					



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**
**Rentabilidades por Artigo**

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,62 55,20	10,28 83,08	1,98 61,99	2,72 41,16	10,28 83,08	688.974,74	9.029.983,48
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,48 42,98	7,79 62,94	1,63 51,02	2,64 39,96	7,79 62,94	337.175,43	6.293.077,85
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,13 100,17	11,80 95,35	3,24 101,22	6,59 99,62	11,80 95,35	168.930,19	1.027.070,43
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-2,61 -0,16	-3,50 -8,19	-3,58 -3,31	7,38 -3,98	-3,50 -8,19	-1.304.919,39	-1.773.940,26
Artigo 9º III % do CDI	-4,79 -426,73	-28,54 -230,65	3,52 110,00	-0,98 -14,87	-28,54 -230,65	-888.581,95	-7.048.158,93
Artigo 10º I % do CDI	-4,90 -435,97	-11,97 -96,77	9,70 303,23	6,79 102,67	-11,97 -96,77	-1.126.648,62	-2.976.019,32
<b>PORTO FELIZ (Total)</b>						<b>-2.125.069,60</b>	<b>4.552.013,25</b>

**RESULTADO POR ATIVO**

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (4,423526%)	2.703.865,69	0,00	0,00	0,00	2.723.972,29	20.106,60	266.227,33
NTN-B 150535 (4,734998%)	10.632.948,06	0,00	0,00	0,00	10.714.826,01	81.877,95	1.075.918,08
NTN-B 150535 (5,290003%)	10.515.044,63	0,00	0,00	0,00	10.600.828,24	85.783,61	1.125.876,78
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.079.425,63	0,00	0,00	0,00	5.123.351,63	43.926,00	419.894,82
NTN-B 150535 (6,051500%)	1.503.932,63	0,00	0,00	0,00	1.517.156,01	13.223,38	18.632,23
NTN-B 150545	8.980.414,40	0,00	0,00	0,00	8.833.471,07	-146.943,33	263.146,04
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.724.677,39	0,00	0,00	0,00	2.745.535,26	20.857,87	275.663,43
NTN-B 150555 (5,669994%)	10.294.708,24	0,00	0,00	0,00	10.381.956,65	87.248,41	953.692,26
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.081.912,44	0,00	0,00	0,00	5.125.956,36	44.043,92	420.883,08
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.443.359,57	0,00	0,00	0,00	5.482.186,57	38.827,00	513.907,17
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.579.121,62	0,00	0,00	0,00	1.592.373,80	13.252,18	162.412,16
NTN-B 150840 (5,120004%)	10.514.904,97	0,00	0,00	0,00	10.599.186,22	84.281,25	1.091.781,44

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150840 (5,171997%)	10.681.859,16	0,00	0,00	0,00	10.767.953,69	86.094,53	1.114.177,77
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.154.620,50	0,00	0,00	0,00	5.197.494,99	42.874,49	339.190,09
NTN-B 150840 (5,792100%)	20.230.780,90	0,00	0,00	0,00	20.404.301,78	173.520,88	988.580,80
					111.810.550,57	0,00	0,00

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	12.939.969,05	0,00	0,00	0,00	12.911.747,05	-28.222,00	827.426,99
BB PREV RF IPCA	3.088.495,53	0,00	0,00	0,00	3.117.989,65	29.494,12	297.339,20
BB PREV RF IRF M	232.856,21	0,00	0,00	0,00	236.193,79	3.337,58	18.666,61
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.476.804,84	104.000,00	-66.210,42	0,00	1.532.097,03	17.502,61	254.878,75
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	22.251.277,50	0,00	0,00	0,00	22.456.446,55	205.169,05	1.979.774,28
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	14.214.411,39	0,00	0,00	0,00	14.180.744,19	-33.667,20	927.500,08
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	15.526.195,29	0,00	0,00	0,00	15.669.756,56	143.561,27	1.372.336,80
					70.104.974,82	0,00	0,00

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	416.814,95	4.896.047,17	-4.747.691,85	0,00	584.197,20	19.026,93	410.076,76
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	11.434.758,27	4.779.672,37	0,00	0,00	16.364.333,90	149.903,26	616.993,67
					16.948.531,10	0,00	0,00

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	21.708.789,03	0,00	0,00	0,00	21.139.424,50	-569.364,53	632.679,82
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	27.203.860,57	0,00	0,00	0,00	26.492.571,17	-711.289,40	-2.382.354,62
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	0,00	3.000.000,00	0,00	0,00	2.975.734,54	-24.265,46	-24.265,46
					50.607.730,21	0,00	0,00

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

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	18.537.161,43	0,00	0,00	0,00	17.648.579,48	-888.581,95	-7.048.158,93
					17.648.579,48	0,00	0,00

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	23.005.273,62	0,00	0,00	0,00	21.878.625,00	-1.126.648,62	-2.976.019,32
					21.878.625,00	0,00	0,00

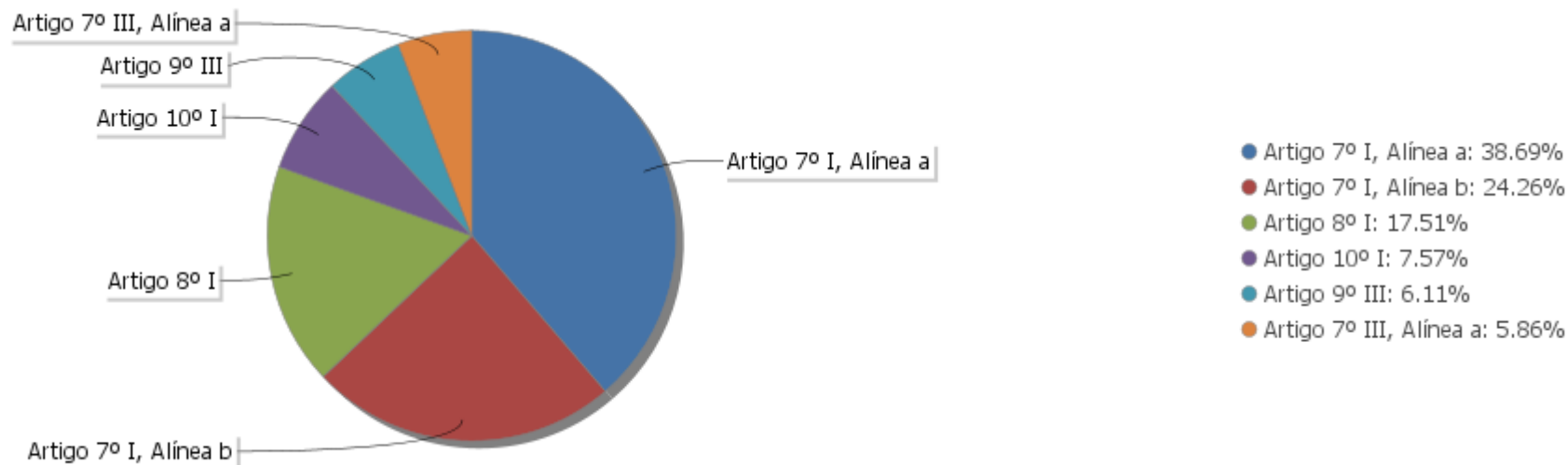
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

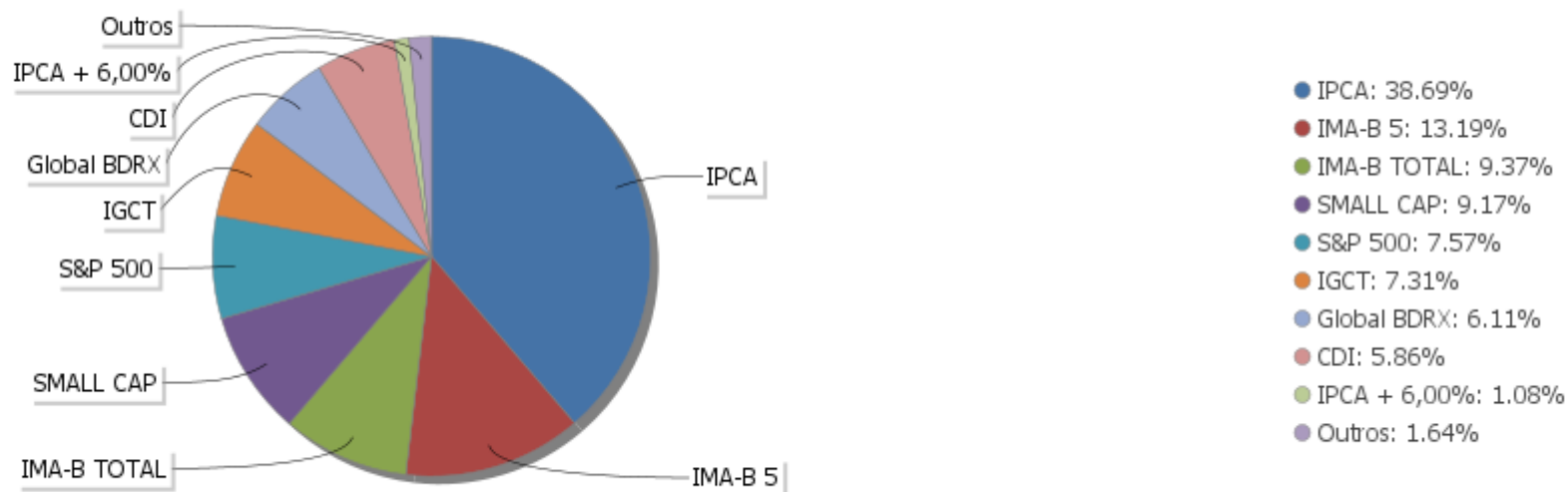
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	171.094.716,42	59,20	171.094.716,42	59,20
de 31 a 365 dias	6.093.724,19	2,11	177.188.440,61	61,31
acima de 365 dias	111.810.550,57	38,69	288.998.991,18	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

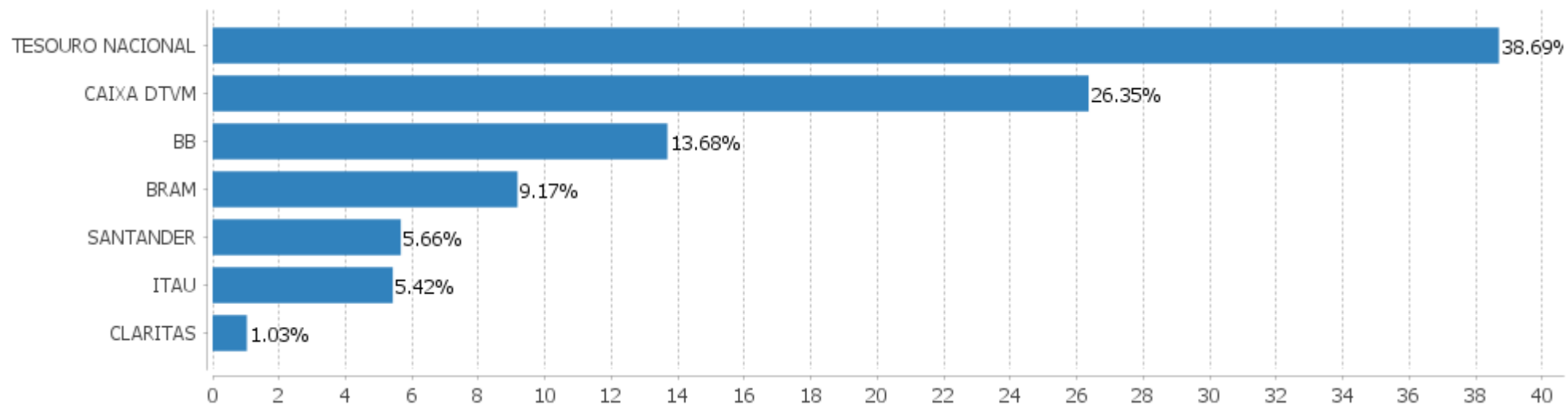


Alocação Por Estratégia



## 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
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	28	46,67
Meses abaixo - Meta Atuarial	32	53,33

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

Relatório

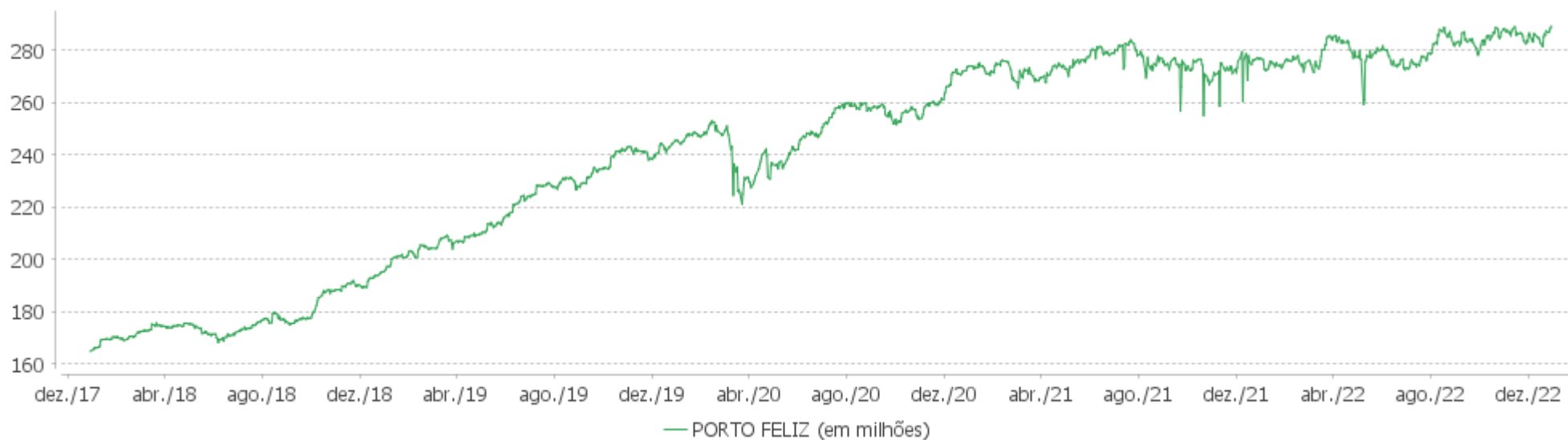
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,57	2,83	-1,25	6,38
06 meses	3,77	2,72	1,05	6,36
12 meses	1,60	10,93	-9,33	6,73
24 meses	0,80	28,68	-27,88	6,26
36 meses	7,55	42,35	-34,80	8,68
48 meses	28,08	57,43	-29,35	7,77
60 meses	42,87	73,04	-30,18	7,23
Desde 29/12/2017	42,87	73,04	-30,18	7,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



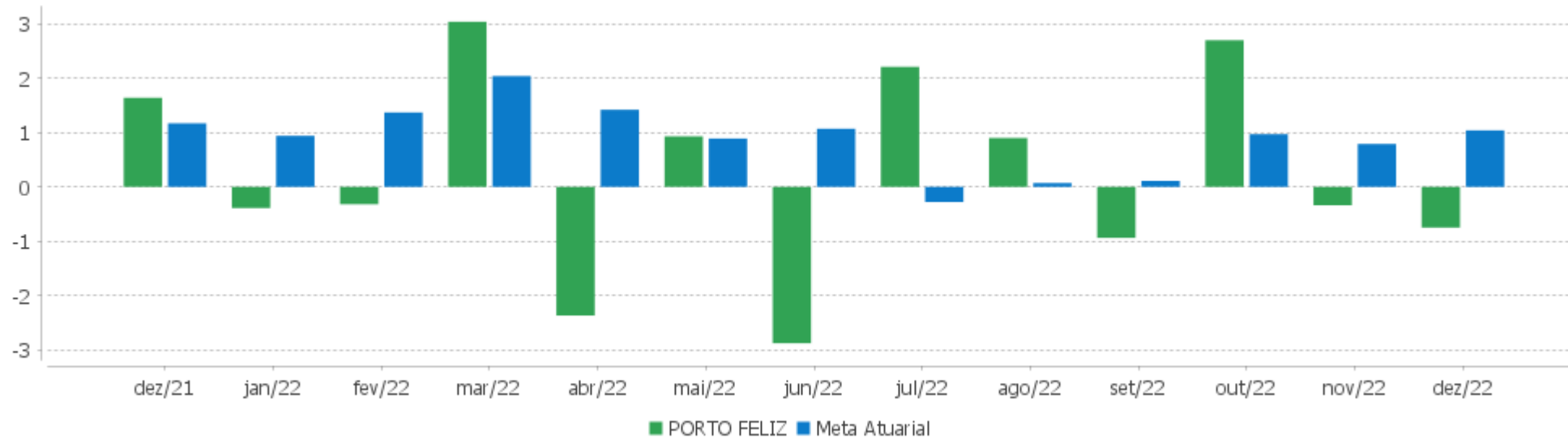
Patrimônio Líquido





EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	-1,64 -2,26	2,90 -2,88	-2,43 -4,06	1,35 1,07	2,90 -2,88	-4,91 -21,34	-1,22 -22,91
NTN-B 150840 (5,120004%) Var. IPCA p.p.	0,80 0,18	11,18 5,40	2,34 0,72	2,75 2,47	11,18 5,40	22,37 5,95	27,43 5,74
NTN-B 150830 (4,069994%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,09	10,07 4,29	2,09 0,46	2,24 1,95	10,07 4,29	23,27 6,85	27,36 5,67
NTN-B 150535 (5,877000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,24	11,98 6,19	2,53 0,90	3,13 2,84	11,98 6,19	23,54 7,11	28,93 7,24
NTN-B 150535 (5,290003%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,20	11,36 5,57	2,39 0,76	2,84 2,55	11,36 5,57	25,94 9,51	31,11 9,42
NTN-B 150840 (5,792100%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,24	8,75 2,97	2,51 0,88	3,08 2,80	8,75 2,97	19,97 3,54	25,19 3,50
NTN-B 150555 (4,689998%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,15	10,73 4,94	2,24 0,61	2,54 2,26	10,73 4,94	24,92 8,50	30,17 8,48
NTN-B 150840 (5,481000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,21	8,54 2,75	2,43 0,80	2,93 2,65	8,54 2,75	19,61 3,18	24,70 3,01
NTN-B 150830 (5,569998%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,22	11,65 5,87	2,45 0,82	2,98 2,69	11,65 5,87	22,95 6,53	28,09 6,40
NTN-B 150555 (5,669994%) Var. IPCA p.p.	0,85 0,23	11,76 5,97	2,48 0,85	3,02 2,74	11,76 5,97	23,31 6,89	28,70 7,02
NTN-B 150840 (5,171997%) Var. IPCA p.p.	0,81 0,19	11,24 5,45	2,36 0,73	2,78 2,50	11,24 5,45	22,46 6,03	27,54 5,85
NTN-B 150555 (5,900000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,25	12,00 6,22	2,53 0,90	3,14 2,85	12,00 6,22	23,62 7,19	29,07 7,38
NTN-B 150535 (4,423526%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,12	10,38 4,60	2,18 0,55	2,41 2,13	10,38 4,60	24,07 7,64	28,67 6,98
NTN-B 150535 (4,734998%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,15	10,69 4,90	2,25 0,62	2,57 2,28	10,69 4,90	24,69 8,26	29,50 7,81
NTN-B 150535 (6,051500%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,26	5,80 0,01	-0,38 -2,01	0,24 -0,04	5,80 0,01		
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,24 -0,04	6,19 -0,17	0,10 -0,13	1,86 -0,07	6,19 -0,17	4,57 -0,45	10,91 -0,84
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,92	9,67	2,46	2,96	9,67	14,40	23,26

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,11	-0,07	-0,01	-0,11	-0,40	-0,76
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	0,92	9,60	2,49	2,90	9,60	14,37	23,32
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,18	-0,05	-0,08	-0,18	-0,43	-0,71
BB PREV RF IPCA	0,95	11,41	3,98	4,00	11,41	16,36	26,43
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,18	-0,70	0,88	0,73	-0,70	-14,40	-18,41
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1,16	11,73	3,09	6,56	11,73	14,68	18,66
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,29	-0,07	-0,14	-0,29	-0,62	-1,07
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,22	6,09	0,17	1,80	6,09	4,49	10,90
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,28	-0,07	-0,14	-0,28	-0,54	-0,85
BB PREV RF IRF M	1,43	8,58	1,63	6,34	8,58	6,10	12,89
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,04	-0,24	-0,11	-0,15	-0,24	-0,55	-0,91
BB PREV RF FLUXO FIC	1,03	11,26	2,95	6,09	11,26	14,89	16,78
% do CDI	92,01	91,00	92,16	92,12	91,00	86,04	81,63
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	1,14	12,87	3,27	6,79	12,87	18,52	21,01
% do CDI	101,28	104,03	102,22	102,67	104,03	106,98	102,17
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	-2,35	8,32	-3,96	8,53	8,32	0,49	5,71
Var. IBRX 100 p.p.	0,27	4,31	-3,57	-1,80	4,31	8,09	10,09
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-2,62	2,43	-1,12	9,89	2,43	-9,39	-7,32
Var. IGCT p.p.	-0,06	-1,11	-0,42	-0,66	-1,11	-1,72	-2,72
BRANCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	-2,61	-8,25	-5,64	5,28	-8,25	-17,28	-18,85
Var. SMALL CAP p.p.	0,40	6,81	1,97	-0,48	6,81	11,54	10,44
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-4,79	-28,54	3,52	-0,98	-28,54	-6,74	44,34
Var. Global BDRX p.p.	-0,58	-0,49	-0,42	-0,37	-0,49	-2,90	-3,76
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-4,90	-11,97	9,70	6,79	-11,97	16,92	30,01
Var. S&P 500 p.p.	2,36	12,71	6,36	5,75	12,71	14,29	-23,83
PORTO FELIZ	-0,75	1,60	1,57	3,77	1,60	0,80	7,55
Var. IPCA + 4,88% p.p.	-1,79	-9,33	-1,25	1,05	-9,33	-27,22	-32,75
CDI	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56
IBOVESPA	-2,45	4,69	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11
INPC + 6,00%	1,20	12,26	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46
IPCA + 6,00%	1,13	12,11	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83

## 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 IPCA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
BB PREV RF IRF M	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+31 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+33 (isento de taxa de resgate)	Para informações adicionais, vide o Regulamento	0,70
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
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	1,18	12,02	3,16	6,70	12,02	15,30	19,73	27,82	36,73
IRF-M 1+	1,62	7,41	1,10	6,63	7,41	2,06	10,68	26,44	41,95
IRF-M TOTAL	1,48	8,82	1,74	6,49	8,82	6,66	13,80	27,49	41,17
IMA-B 5	0,94	9,78	2,53	2,98	9,78	14,79	24,02	40,34	54,18
IMA-B 5+	-1,19	3,30	-1,72	1,24	3,30	-3,47	1,84	32,76	53,22
IMA-B TOTAL	-0,19	6,37	0,23	1,94	6,37	5,02	11,75	37,40	55,34
IMA-GERAL TOTAL	0,77	9,66	1,73	4,95	9,66	10,71	16,62	31,57	44,78
IDKA 2	1,24	9,34	2,25	2,34	9,34	14,78	24,67	39,41	53,01
IDKA 20	-3,32	-1,92	-5,66	0,71	-1,92	-16,13	-14,29	23,65	48,88
CDI	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,96

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,45	4,69	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11	24,86	43,63
IBRX 100	-2,63	4,02	-0,39	10,33	4,02	-7,61	-4,37	27,56	47,23
IBRX 50	-2,55	5,72	0,38	12,12	5,72	-5,43	-2,00	26,57	44,96
SMALL CAP	-3,01	-15,06	-7,61	5,76	-15,06	-28,82	-29,28	11,87	20,97
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	-1,61	12,65	3,15	7,71	12,65	5,43	4,37	51,51	75,68

**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	-7,26	-24,68	3,34	1,04	-24,68	2,63	53,84	106,24	126,51

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,00	2,22	-4,14	2,56	2,22	-0,11	-10,33	21,92	28,78

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-5,43	-25,01	5,58	1,05	-25,01	-5,95	38,64	78,90	86,12

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,62	5,79	1,63	0,28	5,79	16,43	21,69	26,93	31,68
INPC	0,69	5,93	1,55	0,30	5,93	16,70	23,05	28,57	32,98
IGPM	0,45	5,45	-1,09	-2,51	5,45	24,20	52,94	64,11	76,48
SELIC	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,97

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,97	10,00	2,61	2,28	10,00	25,89	36,82	48,44	60,11
IPCA + 5,00%	1,05	11,05	2,86	2,78	11,05	28,31	40,79	54,22	67,93
IPCA + 5,50%	1,09	11,58	2,98	3,03	11,58	29,53	42,80	57,17	71,96
IPCA + 5,89%	1,12	11,99	3,07	3,22	11,99	30,49	44,38	59,51	75,15
IPCA + 6,00%	1,13	12,11	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83	60,17	76,06
INPC + 4,00%	1,04	10,15	2,53	2,31	10,15	26,18	38,35	50,36	61,69
INPC + 6,00%	1,20	12,26	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46	62,24	77,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
161	01/12/2022	CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	3.000.000,00	0,00	790.686,57035965	3,7941709300
162	01/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	272.550,02	0,00	113.305,22950000	2,4054496090
163	07/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	297,80	123,57105900	2,4099494020
164	08/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	3.871.714,87	0,00	1.605.806,25175400	2,4110722360
165	09/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	51.700,07	0,00	21.432,81882800	2,4121918080
166	12/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	106.544,94	44.148,87665500	2,4133103280
167	13/12/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	104.000,00	0,00	33.509,46279600	3,1036009330
168	19/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	117.175,01	0,00	48.440,94887400	2,4189247470
169	19/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.084.233,08	861.636,18053300	2,4189247470
170	19/12/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	59.210,42	19.037,98276500	3,1101204750
171	20/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.556.616,03	1.056.438,69695800	2,4200325500
172	20/12/2022	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	4.779.672,37	0,00	21.667,70652000	220,5896764000
173	21/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	273.750,03	0,00	113.066,24184100	2,4211473340
174	22/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	52.807,58	0,00	21.800,68772500	2,4222896390
175	22/12/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	7.000,00	2.246,90698100	3,1153937650
176	27/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	117.876,85	0,00	48.594,71218100	2,4257135130
177	28/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	4.843,58	0,00	1.995,81217200	2,4268716600
178	29/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	133.629,16	0,00	55.036,65448500	2,4280029600
<b>Total</b>			<b>12.779.719,54</b>	<b>4.813.902,27</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 8.615.794,95

Value-At-Risk: 2,98%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PORTO FELIZ		2,98	2,98			288.998.991,18	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,87%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545		5,28	0,09	5,29			8.833.471,07	3,06
NTN-B 150535 (4,423526%)		0,23	-0,00	0,20			2.723.972,29	0,94
NTN-B 150535 (4,734998%)		0,27	-0,00	0,24			10.714.826,01	3,71
NTN-B 150535 (5,290003%)		0,17	-0,00	0,14			10.600.828,24	3,67
NTN-B 150535 (5,877000%)		0,17	-0,00	0,14			5.123.351,63	1,77
NTN-B 150535 (6,051500%)		0,25	0,00	0,28			1.517.156,01	0,52
NTN-B 150555 (4,689998%)		0,17	-0,00	0,14			2.745.535,26	0,95
NTN-B 150555 (5,669994%)		0,17	-0,00	0,14			10.381.956,65	3,59
NTN-B 150555 (5,900000%)		0,17	-0,00	0,14			5.125.956,36	1,77
NTN-B 150830 (4,069994%)		0,17	-0,00	0,14			5.482.186,57	1,90
NTN-B 150830 (5,569998%)		0,17	-0,00	0,14			1.592.373,80	0,55
NTN-B 150840 (5,120004%)		0,17	-0,00	0,14			10.599.186,22	3,67
NTN-B 150840 (5,171997%)		0,17	-0,00	0,14			10.767.953,69	3,73
NTN-B 150840 (5,481000%)		0,17	-0,00	0,14			5.197.494,99	1,80
NTN-B 150840 (5,792100%)		0,17	-0,00	0,14			20.404.301,78	7,06
<b>Sub-total</b>	0,82	0,42	0,09		-0,61	0,62	111.810.550,57	38,69

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF M		1,58	0,00	0,02			236.193,79	0,08



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI		1,43	0,04	0,01			15.669.756,56	5,42
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,12	0,00	0,01			1.532.097,03	0,53
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,92	0,08	0,05			12.911.747,05	4,47
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,95	0,08	0,05			14.180.744,19	4,91
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,41	0,06	0,03			22.456.446,55	7,77
BB PREV RF IPCA		0,89	0,00	0,86			3.117.989,65	1,08
<b>Sub-total</b>	3,27	1,87	0,26		-0,20	0,48	70.104.974,82	24,26

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			584.197,20	0,20
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,01	-0,00	0,01			16.364.333,90	5,66
<b>Sub-total</b>	0,01	0,01	-0,00		0,13	1,13	16.948.531,10	5,86

Renda Variável

Value-At-Risk: 12,87%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA		11,88	0,10	3,85			2.975.734,54	1,03
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		14,76	1,14	3,04			26.492.571,17	9,17
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		11,26	0,68	0,19			21.139.424,50	7,31
<b>Sub-total</b>	24,77	12,87	1,93		-0,15	-2,61	50.607.730,21	17,51

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 11,49%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		11,49	0,56	7,74			21.878.625,00	7,57
<b>Sub-total</b>	17,61	11,49	0,56		-0,34	-4,90	21.878.625,00	7,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 13,54%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		13,54	0,14	1,33			17.648.579,48	6,11
<b>Sub-total</b>	22,36	13,54	0,14		-0,26	-4,79	17.648.579,48	6,11