



LDB
EMPRESAS

PORTO FELIZ
SETEMBRO 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 30.09.2024.

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

81,11%

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%)	0,29	0,04	0,53	6,57	5.732.727,99	1,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,569998%)	0,33	0,04	0,65	7,72	1.692.703,45	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,776000%)	2,89	0,04	0,66	4,59	2.249.819,43	0,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,000000%)	0,34	0,04	0,68	8,05	1.580.197,42	0,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,423526%)	0,37	-0,01	0,56	6,84	2.948.467,89	0,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,734998%)	0,43	-0,03	0,58	7,09	11.636.198,02	3,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290003%)	0,39	0,04	0,63	7,51	11.577.173,89	3,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,601000%)	995,10	0,04	0,65	6,18	1.817.442,10	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,635000%)	2,86	0,04	0,65	7,77	1.771.853,05	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,640000%)	2,86	0,04	0,65	7,84	1.798.512,86	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,877000%)	0,41	0,04	0,67	7,96	5.628.087,37	1,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,051500%)	0,41	0,05	0,69	8,09	1.669.468,08	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,120004%)	0,44	0,04	0,61	7,38	11.274.692,55	3,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,171997%)	0,44	0,04	0,62	7,42	11.457.624,67	3,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,481000%)	0,45	0,04	0,64	7,66	5.539.905,72	1,49

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,792100%)	0,47	0,04	0,67	7,90	21.784.389,08	5,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	6,66	-0,30	-1,42	-3,12	9.470.143,26	2,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,582500%)	0,52	0,04	0,65	7,79	1.052.727,99	0,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,850500%)	0,58	0,04	0,67	7,94	5.049.214,71	1,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,145000%)	2,97	0,05	0,69	3,52	1.869.326,61	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (4,689998%)	0,56	0,04	0,58	7,05	3.001.890,30	0,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,669994%)	0,61	0,04	0,66	7,80	11.413.098,32	3,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,900000%)	0,62	0,04	0,67	7,98	5.641.547,88	1,51
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,64	0,01	0,49	6,75	137.657.212,64	36,94

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	3,93	-0,25	-0,69	0,60	29.574.085,17	7,94	4.321.577.868,21	0,68
BB	BB	BB PREV RF IRF M	2,71	-0,07	0,32	3,70	10.304.746,50	2,77	3.419.686.698,34	0,30
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,41	0,03	0,80	6,98	387.462,68	0,10	8.329.801.460,71	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,76	-0,08	0,38	5,14	30.697.716,55	8,24	6.913.810.528,18	0,44
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,92	-0,25	-0,69	0,63	16.533.054,41	4,44	3.720.203.081,78	0,44
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	6,21	-0,24	-0,53	-0,83	18.227.279,11	4,89	137.925.858,56	13,22
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	1,76	-0,08	0,39	5,16	18.441.471,73	4,95	1.594.793.152,04	1,16
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,13	-0,16	-0,16	2,35	124.165.816,15	33,32		

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	0,04	0,04	0,75	6,96	1.619.975,70	0,43	3.861.447.255,05	0,04
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,08	0,04	0,88	8,38	26.370.118,29	7,08	3.331.476.040,52	0,79
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,07	0,04	0,87	8,22	27.990.093,99	7,51		

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	2,38	0,05	0,91	5,21	12.409.274,02	3,33	260.505.108,28	4,76
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			2,38	0,05	0,91	5,21	12.409.274,02	3,33		
Renda Fixa			1,59	-0,06	0,27	4,90	302.222.396,80	81,11		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

8,58%

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	12,73	-0,72	-3,37	-1,56	20.629.448,80	5,54	645.563.640,82	3,20
PLURAL	BEM	BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	12,23	-0,51	-4,87	-1,22	4.939.047,06	1,33	457.095.113,70	1,08
CLARITAS	BTG PACTUAL	PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	15,20	-0,59	-4,18	-1,78	6.387.856,25	1,71	756.261.790,90	0,84
Sub-total Artigo 8º I			14,47	-0,66	-3,77	-2,63	31.956.352,11	8,58		
Renda Variável			14,47	-0,66	-3,77	-2,63	31.956.352,11	8,58		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 4,61%

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	3,47	0,03	1,23	6,78	1.067.840,43	0,29	35.779.877,10	2,98
Sub-total Artigo 9º II			3,47	0,03	1,23	6,78	1.067.840,43	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	15,68	0,53	-0,32	40,56	16.103.209,64	4,32	2.640.148.103,06	0,61
Sub-total Artigo 9º III			15,68	0,53	-0,32	40,56	16.103.209,64	4,32		
Investimentos no Exterior			15,05	0,50	-0,23	39,36	17.171.050,07	4,61		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

5,71%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12,47	0,39	2,33	24,07	13.961.372,29	3,75	2.032.300.517,82	0,69
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	5,54	-0,21	-0,98	-0,98	3.069.635,04	0,82	416.945.042,15	0,74
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	11,29	-0,15	-0,16	5,93	4.237.107,58	1,14	290.145.152,19	1,46
Sub-total Artigo 10º I			11,69	0,19	1,35	23,52	21.268.114,91	5,71		
Investimentos Estruturados			11,69	0,19	1,35	23,52	21.268.114,91	5,71		
Total			3,06	-0,07	-0,05	5,55	372.617.913,89	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	137.657.212,64	36,94	0,00	35,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	124.165.816,15	33,32	0,00	38,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	27.990.093,99	7,51	0,00	3,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	12.409.274,02	3,33	0,00	0,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	302.222.396,80	81,11					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	31.956.352,11	8,58	0,00	12,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	31.956.352,11	8,58					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	1.067.840,43	0,29	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	16.103.209,64	4,32	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	17.171.050,07	4,61					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	21.268.114,91	5,71	0,00	2,50	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	21.268.114,91	5,71					15,00
Total		372.617.913,89	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	0,49 58,61	6,75 84,47	2,11 80,24	4,04 77,21	9,56 86,51	669.836,91	8.756.467,25
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,16 -19,76	2,35 29,43	1,97 74,70	1,31 25,05	6,58 59,53	-202.583,24	2.998.751,06
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,87 104,37	8,22 102,87	2,72 103,53	5,34 102,18	11,34 102,55	234.276,42	1.437.332,63
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,91 109,09	5,21 110,38	3,04 115,62			111.914,20	509.274,02
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-3,77 -0,69	-2,63 -0,86	4,98 -1,40	1,21 -1,68	9,11 -3,97	-1.252.397,91	-2.001.669,62
Artigo 9º II % do CDI	1,23 147,37	6,78 132,98	4,69 178,18			12.968,47	67.840,43
Artigo 9º III % do CDI	-0,32 -38,88	40,56 507,63	0,75 28,44	22,25 425,51	50,57 457,47	-52.401,83	4.646.801,03
Artigo 10º I % do CDI	1,35 161,26	23,52 294,34	6,22 236,38	11,15 213,26	39,56 357,88	280.732,73	2.915.192,04
PORTO FELIZ (Total)						-197.654,25	19.329.988,84

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%)	2.932.154,89	0,00	0,00	0,00	2.948.467,89	16.313,00	191.634,33
NTN-B 150535 (4,734998%)	11.568.925,65	0,00	0,00	0,00	11.636.198,02	67.272,37	781.493,22
NTN-B 150535 (5,290003%)	11.505.245,18	0,00	0,00	0,00	11.577.173,89	71.928,71	820.877,99
NTN-B 150535 (5,601000%)	1.805.708,05	0,00	0,00	0,00	1.817.442,10	11.734,05	107.043,75
NTN-B 150535 (5,635000%)	1.760.366,17	0,00	0,00	0,00	1.771.853,05	11.486,88	129.798,84
NTN-B 150535 (5,640000%)	1.786.846,69	0,00	0,00	0,00	1.798.512,86	11.666,17	132.784,67
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.590.534,15	0,00	0,00	0,00	5.628.087,37	37.553,22	421.537,18
NTN-B 150535 (6,051500%)	1.658.102,08	0,00	0,00	0,00	1.669.468,08	11.366,00	127.012,17
NTN-B 150545	9.606.452,75	0,00	0,00	0,00	9.470.143,26	-136.309,49	-315.129,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.984.663,06	0,00	0,00	0,00	3.001.890,30	17.227,24	200.248,79
NTN-B 150555 (5,669994%)	11.338.790,64	0,00	0,00	0,00	11.413.098,32	74.307,68	838.510,41
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.603.798,82	0,00	0,00	0,00	5.641.547,88	37.749,06	423.369,72
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.702.650,21	0,00	0,00	0,00	5.732.727,99	30.077,78	363.562,46
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.681.815,25	0,00	0,00	0,00	1.692.703,45	10.888,20	125.110,15
NTN-B 150830 (5,776000%)	2.234.984,67	0,00	0,00	0,00	2.249.819,43	14.834,76	101.056,67
NTN-B 150830 (6,000000%)	1.569.501,61	0,00	0,00	0,00	1.580.197,42	10.695,81	121.487,25
NTN-B 150840 (5,120004%)	11.206.159,05	0,00	0,00	0,00	11.274.692,55	68.533,50	797.000,06
NTN-B 150840 (5,171997%)	11.387.510,07	0,00	0,00	0,00	11.457.624,67	70.114,60	814.147,35
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.504.660,24	0,00	0,00	0,00	5.539.905,72	35.245,48	405.713,37
NTN-B 150840 (5,792100%)	21.640.470,76	0,00	0,00	0,00	21.784.389,08	143.918,32	1.642.999,78
NTN-B 150850 (5,582500%)	1.045.946,19	0,00	0,00	0,00	1.052.727,99	6.781,80	78.400,30
NTN-B 150850 (5,850500%)	5.015.627,99	0,00	0,00	0,00	5.049.214,71	33.586,72	382.821,13
NTN-B 150850 (6,145000%)	1.856.461,56	0,00	0,00	0,00	1.869.326,61	12.865,05	64.986,68
	136.987.375,73	0,00	0,00	0,00	137.657.212,64	669.836,91	

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	32.644.097,48	0,00	-2.854.503,30	0,00	29.574.085,17	-215.509,01	255.547,75
BB PREV RF IRF M	10.271.996,07	0,00	0,00	0,00	10.304.746,50	32.750,43	365.917,31
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	336.434,24	175.000,00	-127.308,10	0,00	387.462,68	3.336,54	23.220,33
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	30.580.936,05	0,00	0,00	0,00	30.697.716,55	116.780,50	1.499.741,18
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.647.594,86	0,00	0,00	0,00	16.533.054,41	-114.540,45	103.630,09
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	18.323.637,65	0,00	0,00	0,00	18.227.279,11	-96.358,54	-153.952,19
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	18.370.514,44	0,00	0,00	0,00	18.441.471,73	70.957,29	904.473,32
	127.175.210,79	175.000,00	-2.981.811,40	0,00	124.165.816,15	-202.583,24	

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	1.760.779,28	4.100.774,69	-4.251.367,08	0,00	1.619.975,70	9.788,81	179.866,94
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	25.013.539,53	1.132.091,15	0,00	0,00	26.370.118,29	224.487,61	1.257.465,69
	26.774.318,81	5.232.865,84	-4.251.367,08	0,00	27.990.093,99	234.276,42	

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	12.297.359,82	0,00	0,00	0,00	12.409.274,02	111.914,20	509.274,02
	12.297.359,82	0,00	0,00	0,00	12.409.274,02	111.914,20	

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	21.349.848,30	0,00	0,00	0,00	20.629.448,80	-720.399,50	-785.843,68
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	5.192.099,50	0,00	0,00	0,00	4.939.047,06	-253.052,44	-60.952,94
PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	6.666.802,22	0,00	0,00	0,00	6.387.856,25	-278.945,97	-73.972,75
	33.208.750,02	0,00	0,00	0,00	31.956.352,11	-1.252.397,91	

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	1.054.871,96	0,00	0,00	0,00	1.067.840,43	12.968,47	67.840,43
	1.054.871,96	0,00	0,00	0,00	1.067.840,43	12.968,47	

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	16.155.611,47	0,00	0,00	0,00	16.103.209,64	-52.401,83	4.646.801,03
	16.155.611,47	0,00	0,00	0,00	16.103.209,64	-52.401,83	

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	13.643.643,17	0,00	0,00	0,00	13.961.372,29	317.729,12	2.708.449,42
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	0,00	3.100.000,00	0,00	0,00	3.069.635,04	-30.364,96	-30.364,96
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	4.243.739,01	0,00	0,00	0,00	4.237.107,58	-6.631,43	237.107,58
	17.887.382,18	3.100.000,00	0,00	0,00	21.268.114,91	280.732,73	

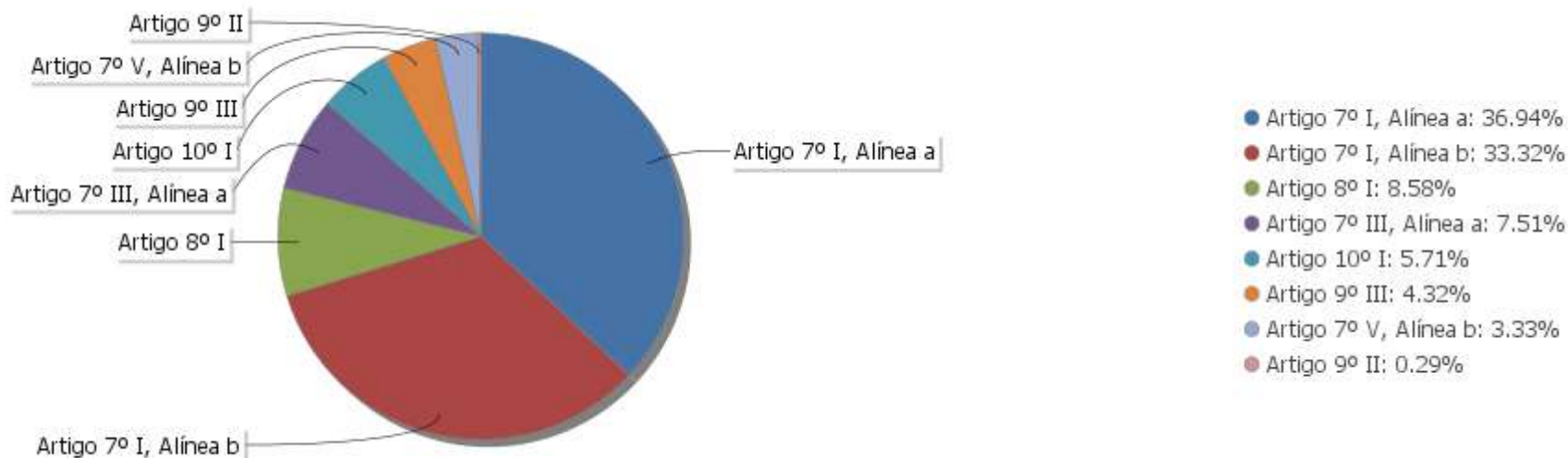
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

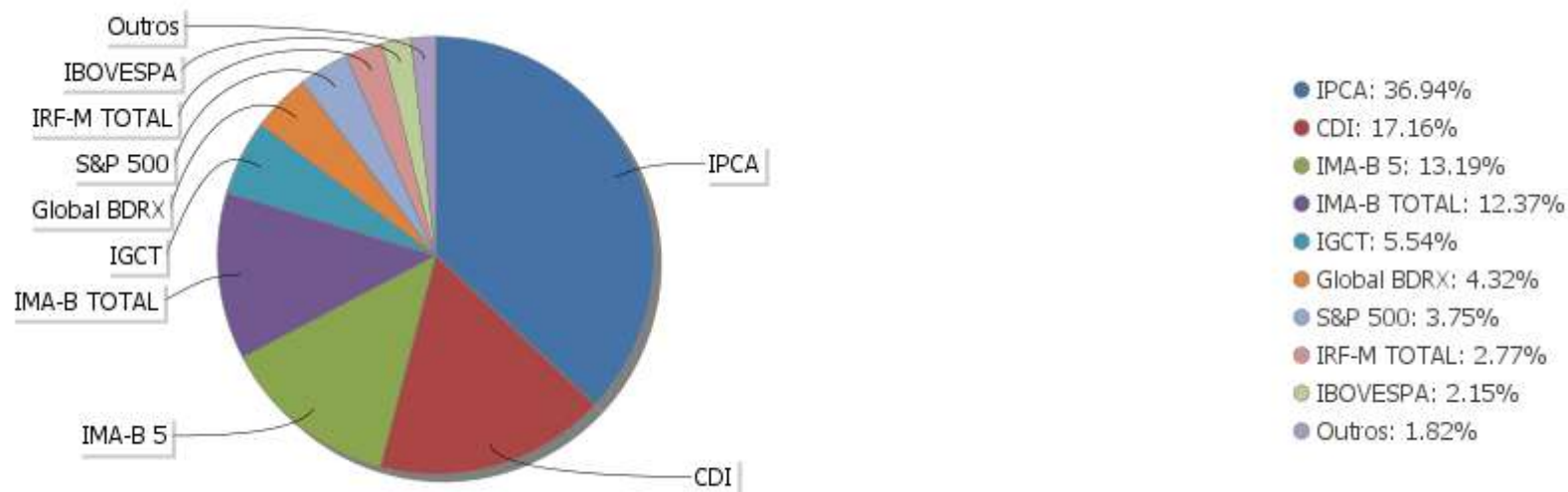
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	221.266.102,38	59,38	60,00	221.266.102,38	59,38	60,00
de 31 dias a 365 dias	9.457.491,29	2,54		230.723.593,67	61,92	60,00
acima de 365 dias	141.894.320,22	38,08	40,00	372.617.913,89	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

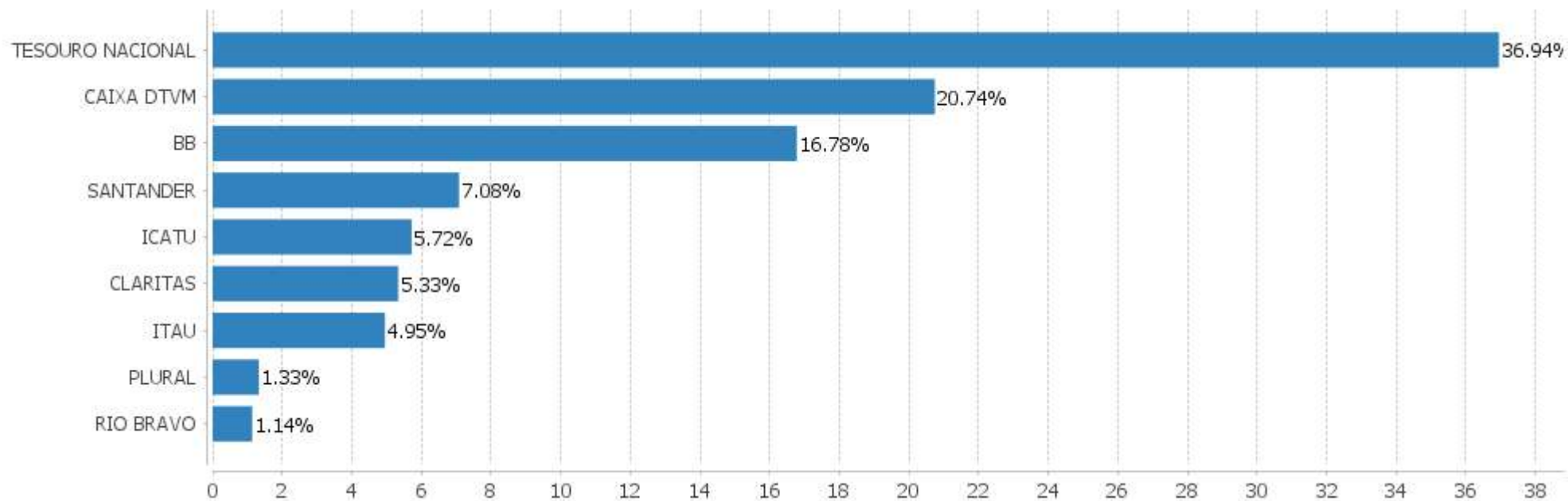


Alocação Por Estratégia



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	0,80	1,38	1,20	-0,05				5,55
IPCA + 5,16%	0,86	1,21	0,56	0,82	0,88	0,61	0,84	0,42	0,86				7,30
p.p. indexador	-1,13	-0,01	0,22	-1,38	0,07	0,19	0,54	0,78	-0,92				-1,75
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	40	49,38
Meses abaixo - Meta Atuarial	41	50,62

	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	2,55	2,14	0,41	2,44
06 meses	3,77	4,52	-0,75	2,33
12 meses	10,97	9,75	1,22	3,06
24 meses	21,98	21,14	0,83	3,92
36 meses	23,16	36,34	-13,18	5,07
48 meses	30,04	58,59	-28,55	5,14
60 meses	32,77	73,22	-40,45	7,09
Desde 29/12/2017	71,56	103,87	-32,31	6,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

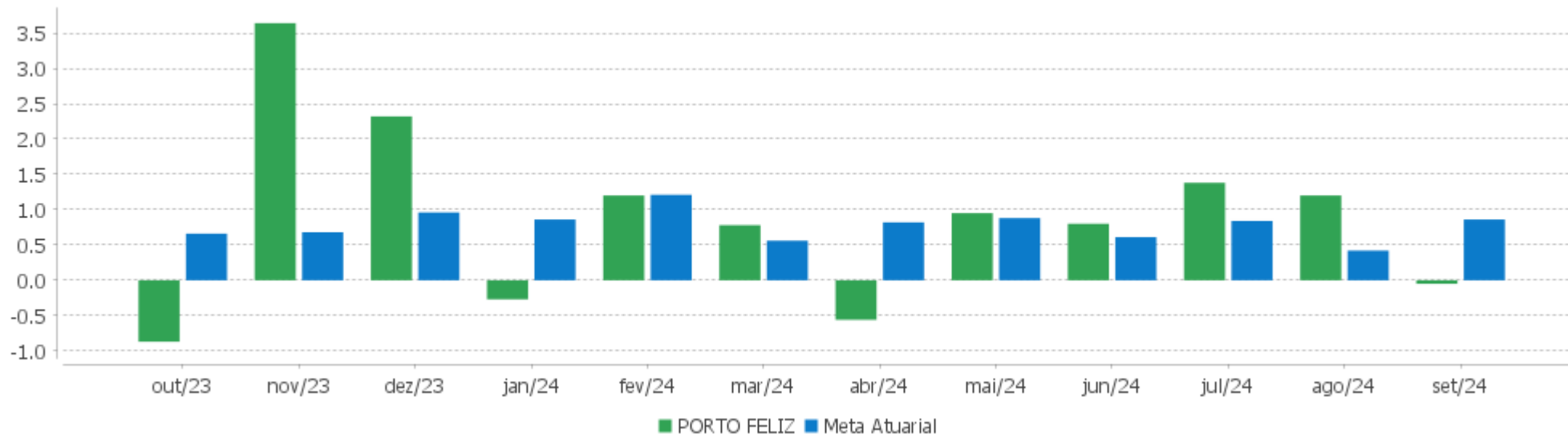


Patrimônio Líquido



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	0,91 109,09	9,23 115,46	3,04 115,62	5,73 109,56	12,81 115,85	28,58 109,98	44,58 112,26
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,69 -0,02	0,63 -0,19	1,88 -0,06	0,50 -0,14	5,37 -0,25	16,71 -0,57	25,05 -0,73
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,38 -0,02	5,14 -0,17	1,87 -0,05	3,07 -0,11	8,21 -0,23	20,61 -0,45	31,64 -0,61
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,39 -0,02	5,16 -0,15	1,87 -0,05	3,09 -0,09	8,23 -0,20	20,61 -0,45	31,54 -0,71
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,80 -0,02	6,98 -0,20	2,47 -0,08	4,44 -0,16	9,98 -0,30	24,49 -0,72	36,40 -1,09
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,32 -0,02	3,70 -0,20	2,31 -0,05	2,06 -0,13	8,19 -0,26	22,33 -0,84	31,91 -1,12
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP % do CDI	-0,53 -63,04	-0,83 -10,45	2,18 82,74	-1,39 -26,56	5,70 51,60	19,19 73,87	26,80 67,47
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,69 -0,02	0,60 -0,22	1,84 -0,09	0,49 -0,15	5,34 -0,28	16,66 -0,62	24,76 -1,01
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	-1,42 -1,86	-3,12 -6,42	3,01 2,21	-1,34 -3,21	3,39 -1,04	14,02 4,18	18,51 0,79
NTN-B 150830 (6,000000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,24	8,05 4,75	2,21 1,41	4,78 2,91	10,64 6,21	19,50 9,66	
NTN-B 150840 (5,120004%) Var. IPCA p.p.	0,61 0,17	7,38 4,07	1,98 1,18	4,33 2,47	9,78 5,36	21,07 11,23	37,26 19,55
NTN-B 150830 (4,069994%) Var. IPCA p.p.	0,53 0,09	6,57 3,26	1,72 0,92	3,79 1,93	8,60 4,17	18,58 8,74	33,09 15,38
NTN-B 150535 (5,640000%) Var. IPCA p.p.	0,65 0,21	7,84 4,53	2,12 1,31	4,59 2,73	7,23 2,80	12,31 2,47	
NTN-B 150850 (6,145000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,25	5,02 1,71	2,24 1,44	4,85 2,99	7,46 3,03		
NTN-B 150535 (5,877000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,23	7,96 4,66	2,18 1,37	4,71 2,85	10,55 6,13	22,79 12,95	36,24 18,52
NTN-B 150535 (5,290003%) Var. IPCA p.p.	0,63 0,19	7,51 4,20	2,03 1,23	4,42 2,55	9,93 5,50	21,43 11,59	37,89 20,17
NTN-B 150840 (5,792100%)	0,67	7,90	2,16	4,67	10,50	22,63	36,00

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.	0,23	4,59	1,35	2,81	6,07	12,79	18,29
NTN-B 150555 (4,689998%) Var. IPCA p.p.	0,58 0,14	7,05 3,74	1,88 1,07	4,11 2,25	9,40 4,97	20,16 10,32	35,67 17,96
NTN-B 150850 (5,850500%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,23	7,94 4,63	2,17 1,37	4,70 2,84	10,62 6,20	19,39 9,55	
NTN-B 150840 (5,481000%) Var. IPCA p.p.	0,64 0,20	7,66 4,35	2,08 1,27	4,51 2,65	10,17 5,74	21,91 12,07	34,93 17,21
NTN-B 150535 (5,601000%) Var. IPCA p.p.	0,65 0,21	7,75 4,44	2,11 1,31	4,57 2,71	7,06 2,64	12,12 2,28	
NTN-B 150830 (5,776000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,22	4,82 1,52	2,15 1,35	4,66 2,80	7,17 2,75		
NTN-B 150535 (5,635000%) Var. IPCA p.p.	0,65 0,21	7,77 4,47	2,12 1,31	4,59 2,73	7,22 2,80	12,30 2,46	
NTN-B 150840 (5,171997%) Var. IPCA p.p.	0,62 0,18	7,42 4,11	2,00 1,20	4,36 2,49	9,84 5,41	21,19 11,35	37,46 19,75
NTN-B 150555 (5,669994%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,22	7,80 4,50	2,12 1,32	4,61 2,75	10,45 6,02	22,44 12,60	35,72 18,01
NTN-B 150850 (5,582500%) Var. IPCA p.p.	0,65 0,21	7,79 4,49	2,10 1,30	4,56 2,70	10,34 5,91	18,89 9,06	
NTN-B 150830 (5,569998%) Var. IPCA p.p.	0,65 0,21	7,72 4,42	2,10 1,30	4,56 2,69	10,18 5,76	22,03 12,19	38,94 21,23
NTN-B 150555 (5,900000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,23	7,98 4,67	2,18 1,38	4,73 2,86	10,69 6,27	22,97 13,13	36,49 18,77
NTN-B 150535 (6,051500%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,25	8,09 4,79	2,22 1,42	4,80 2,94	10,74 6,31	19,65 9,81	29,09 11,37
NTN-B 150535 (4,423526%) Var. IPCA p.p.	0,56 0,12	6,84 3,54	1,81 1,01	3,98 2,11	9,01 4,59	19,43 9,59	34,43 16,72
NTN-B 150535 (4,734998%) Var. IPCA p.p.	0,58 0,14	7,09 3,78	1,89 1,09	4,14 2,27	9,34 4,92	20,15 10,31	35,62 17,91
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,75 90,22	7,19 90,04	2,38 90,26	4,70 89,93	9,96 90,07	23,52 90,51	35,60 89,66
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,88 105,05	8,38 104,88	2,75 104,35	5,44 103,98	11,55 104,48	26,85 103,35	41,49 104,49
PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA Var. IBRX 100 p.p.	-4,18 -1,21	-1,78 -0,55	4,12 -2,31	-1,56 -4,76	9,19 -4,34	9,73 -9,58	15,30 -2,43
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	-4,87	-6,13	2,84	-2,02	6,45	16,68	37,15

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.	-1,79	-4,36	-3,55	-4,92	-6,63	-3,11	18,38
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	-3,37 -0,14	-1,56 -0,29	5,79 -0,32	2,74 -0,04	12,29 -0,75	17,03 -2,81	13,48 -3,72
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-0,32 -0,12	40,56 -1,40	0,75 0,12	22,25 -0,25	51,31 -1,67	81,77 -4,63	40,30 -4,59
PRINCIPAL GLOBAL HIGH YIELD FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	1,23 147,37	9,06 113,39	4,69 178,18	6,47 123,76	17,46 157,94	37,92 145,95	28,20 71,02
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA % do CDI	-0,16 -18,73	6,00 203,10	7,69 292,27				
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	2,33 4,06	24,07 -11,88	6,32 2,89	11,65 -7,94	40,19 -6,02	81,31 19,37	64,51 30,52
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-0,18 2,90	5,53 7,30	4,28 -2,11	4,24 1,35	12,97 -0,11	35,43 15,64	43,39 24,61
PORTO FELIZ Var. IPCA + 5,16% p.p.	-0,05 -0,92	5,55 -1,75	2,55 0,41	3,77 -0,75	10,97 1,18	21,98 0,58	23,16 -13,65
CDI	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71
IBOVESPA	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78
INPC + 6,00%	0,97	7,93	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78
IPCA + 6,00%	0,93	7,95	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10

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
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 será paga no(s) mes(es) de Janeiro e Julho	0,50
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 IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	D+1 du	D+0	D+30	D+32	-	2,00
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 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
PRINCIPAL GLOBAL HIGH YIELD FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+0	D+0	D+1 du	D+5 du		0,87
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	D+0	D+0	D+1	D+2		1,15
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração

FIC FI

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	0,82	7,18	2,55	4,60	10,28	25,21	37,49	40,92	47,32
IRF-M 1+	0,11	2,50	2,27	1,11	7,67	22,81	31,70	27,56	37,27
IRF-M TOTAL	0,34	3,90	2,36	2,19	8,45	23,17	33,03	31,68	40,32
IMA-B 5	0,40	5,30	1,92	3,18	8,43	21,06	32,25	40,12	50,27
IMA-B 5+	-1,42	-2,62	2,55	-1,13	3,64	14,16	20,09	23,93	21,86
IMA-B TOTAL	-0,67	0,82	1,94	0,64	5,61	17,28	25,78	31,70	34,48
IMA-GERAL TOTAL	0,34	4,99	2,51	3,30	8,98	22,61	33,94	37,26	43,22
IDKA 2	0,39	5,01	1,75	2,72	8,05	20,40	31,12	39,27	50,42
IDKA 20	-3,07	-9,14	3,35	-4,78	0,20	8,96	10,04	12,27	2,29
CDI	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71	43,89	49,01

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78	39,34	25,84
IBRX 100	-2,97	-1,23	6,43	3,20	13,53	19,31	17,72	38,71	26,80
IBRX 50	-3,26	-0,22	6,28	4,00	14,18	20,25	20,95	43,28	28,92
SMALL CAP	-4,41	-13,67	1,39	-9,99	-3,75	-6,59	-23,80	-11,80	-13,37
Índice Consumo - ICON	-4,71	-11,22	3,27	-4,43	-0,29	-18,06	-40,81	-41,80	-42,40
Índice Dividendos - IDIV	-0,72	4,25	7,93	8,38	19,48	36,40	46,24	74,87	57,72

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	-1,73	35,95	3,43	19,59	46,21	61,94	33,99	65,50	153,26

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-2,58	-0,16	-1,24	-3,00	2,69	10,54	21,74	18,29	23,16

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-1,59	31,85	4,09	18,60	41,09	55,11	20,24	45,57	114,03

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,44	3,31	0,80	1,86	4,42	9,84	17,71	29,77	33,84
INPC	0,48	3,29	0,60	1,69	4,09	8,78	16,60	29,18	34,20
IGPM	0,62	2,64	1,52	3,58	4,53	-1,71	6,40	32,85	56,68
SELIC	0,83	7,99	2,63	5,23	11,05	25,98	39,71	43,89	49,01

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,77	6,41	1,84	3,93	8,58	18,75	32,35	51,72	62,74
IPCA + 5,00%	0,85	7,18	2,10	4,44	9,62	21,03	36,19	57,62	70,69
IPCA + 5,50%	0,89	7,56	2,22	4,69	10,14	22,18	38,14	60,63	74,78
IPCA + 5,89%	0,92	7,86	2,32	4,89	10,55	23,08	39,67	63,01	78,02
IPCA + 6,00%	0,93	7,95	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10	63,69	78,95
INPC + 4,00%	0,81	6,39	1,64	3,75	8,24	17,60	31,10	51,03	63,17
INPC + 6,00%	0,97	7,93	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78	62,93	79,42

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%)	2.948.467,89	4,423526	2.526.189,61	6,498200	-422.278,28
NTN-B 150535 (4,734998%)	11.636.198,02	4,734998	10.211.619,29	6,498200	-1.424.578,73
NTN-B 150535 (5,290003%)	11.577.173,89	5,290003	10.587.769,35	6,498200	-989.404,54
NTN-B 150535 (5,601000%)	1.817.442,10	5,601000	1.701.224,14	6,498200	-116.217,96
NTN-B 150535 (5,635000%)	1.771.853,05	5,635000	1.662.754,25	6,498200	-109.098,80
NTN-B 150535 (5,640000%)	1.798.512,86	5,640000	1.688.400,84	6,498200	-110.112,02
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.628.087,37	5,877000	5.377.236,11	6,498200	-250.851,26
NTN-B 150535 (6,051500%)	1.669.468,08	6,051500	1.615.735,49	6,498200	-53.732,59
NTN-B 150555 (4,689998%)	3.001.890,30	4,689998	2.358.233,55	6,435900	-643.656,75
NTN-B 150555 (5,669994%)	11.413.098,32	5,669994	10.309.928,51	6,435900	-1.103.169,81
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.641.547,88	5,900000	5.257.769,81	6,435900	-383.778,07
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.732.727,99	4,069994	5.102.452,80	6,525800	-630.275,19
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.692.703,45	5,569998	1.618.474,18	6,525800	-74.229,27
NTN-B 150830 (5,776000%)	2.249.819,43	5,776000	2.172.162,72	6,525800	-77.656,71
NTN-B 150830 (6,000000%)	1.580.197,42	6,000000	1.541.809,61	6,525800	-38.387,81
NTN-B 150840 (5,120004%)	11.274.692,55	5,120004	9.915.531,73	6,420000	-1.359.160,82
NTN-B 150840 (5,171997%)	11.457.624,67	5,171997	10.129.536,02	6,420000	-1.328.088,65
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.539.905,72	5,481000	5.052.179,52	6,420000	-487.726,20
NTN-B 150840 (5,792100%)	21.784.389,08	5,792100	20.489.860,97	6,420000	-1.294.528,11
NTN-B 150850 (5,582500%)	1.052.727,99	5,582500	942.659,34	6,456600	-110.068,65
NTN-B 150850 (5,850500%)	5.049.214,71	5,850500	4.680.220,93	6,456600	-368.993,78
NTN-B 150850 (6,145000%)	1.869.326,61	6,145000	1.798.494,79	6,456600	-70.831,82

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
275	03/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	44.076,65	0,00	15.225,31695400	2,8949577950
274	06/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	125.101,56	0,00	43.168,06887800	2,8980114990
273	10/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.315.529,56	0,00	798.448,69430100	2,9000355020
262	11/09/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	175.000,00	0,00	46.574,14490400	3,7574495540
271	13/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.100.000,00	1.067.845,20879800	2,9030424770
272	13/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.132.091,15	389.967,13240300	2,9030424770
277	13/09/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	1.132.091,15	0,00	4.180,09647312	270,8289527000
261	16/09/2024	ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	3.100.000,00	0,00	2.151.849,49381550	1,4406212000
266	19/09/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	5.000,00	1.328,19071300	3,7645196200
264	25/09/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	80.360,68	21.313,15069500	3,7704739740
265	25/09/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	25.947,42	6.881,73958500	3,7704739740
270	25/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	19.275,93	6.620,74102900	2,9114460020
276	25/09/2024	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	2.854.503,30	357.552,46561700	7,9834529880
263	26/09/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	16.000,00	4.242,33674600	3,7715063560
269	26/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	490.000,80	0,00	168.243,00132800	2,9124587420
268	27/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.057.452,92	0,00	362.949,55755100	2,9134983030
267	30/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	68.613,20	0,00	23.541,38499600	2,9145778810
Total			8.507.865,84	7.233.178,48		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.248.126,71

Value-At-Risk: 1,14%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,58	0,76	5,00	0,39	-0,36	0,27	302.222.396,80	81,11
Artigo 8º	11,62	6,26	20,00	0,43	-0,40	-3,77	31.956.352,11	8,58
Artigo 9º	17,75	8,67	20,00	0,11	-0,06	-0,23	17.171.050,07	4,61
Artigo 10º	10,86	5,46	20,00	0,22	0,05	1,35	21.268.114,91	5,71
PORTO FELIZ		1,14		1,14			372.617.913,89	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,76%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150830 (4,069994%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-1,24	0,53	5.732.727,99	1,54
NTN-B 150830 (5,569998%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,76	0,65	1.692.703,45	0,45
NTN-B 150830 (5,776000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,69	0,66	2.249.819,43	0,60
NTN-B 150830 (6,000000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,62	0,68	1.580.197,42	0,42
NTN-B 150535 (4,423526%)	0,31	0,19	-0,00	0,20	-0,89	0,56	2.948.467,89	0,79
NTN-B 150535 (4,734998%)	0,38	0,27	-0,00	0,28	-0,67	0,58	11.636.198,02	3,12
NTN-B 150535 (5,290003%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,85	0,63	11.577.173,89	3,11
NTN-B 150535 (5,601000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,75	0,65	1.817.442,10	0,49
NTN-B 150535 (5,635000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,74	0,65	1.771.853,05	0,48
NTN-B 150535 (5,640000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,74	0,65	1.798.512,86	0,48
NTN-B 150535 (5,877000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,66	0,67	5.628.087,37	1,51
NTN-B 150535 (6,051500%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,60	0,69	1.669.468,08	0,45
NTN-B 150840 (5,120004%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,90	0,61	11.274.692,55	3,03
NTN-B 150840 (5,171997%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,89	0,62	11.457.624,67	3,07
NTN-B 150840 (5,481000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,79	0,64	5.539.905,72	1,49
NTN-B 150840 (5,792100%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,69	0,67	21.784.389,08	5,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545	5,46	3,35	0,05	3,35	-0,41	-1,42	9.470.143,26	2,54
NTN-B 150850 (5,582500%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,75	0,65	1.052.727,99	0,28
NTN-B 150850 (5,850500%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,67	0,67	5.049.214,71	1,36
NTN-B 150850 (6,145000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,57	0,69	1.869.326,61	0,50
NTN-B 150555 (4,689998%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-1,04	0,58	3.001.890,30	0,81
NTN-B 150555 (5,669994%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,73	0,66	11.413.098,32	3,06
NTN-B 150555 (5,900000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,65	0,67	5.641.547,88	1,51
Sub-total	0,44	0,24	0,05		-0,79	0,49	137.657.212,64	36,94

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	3,93	2,00	0,09	0,04	-0,39	-0,69	29.574.085,17	7,94
BB PREV RF IRF M	2,85	1,46	0,03	0,02	-0,18	0,32	10.304.746,50	2,77
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,30	0,23	0,00	0,01	-0,12	0,80	387.462,68	0,10
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,03	1,01	0,04	0,01	-0,22	0,38	30.697.716,55	8,24
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,93	2,02	0,05	0,01	-0,39	-0,69	16.533.054,41	4,44
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	6,76	3,10	0,10	3,10	-0,20	-0,53	18.227.279,11	4,89
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,03	1,01	0,03	0,01	-0,22	0,39	18.441.471,73	4,95
Sub-total	3,32	1,62	0,34		-0,30	-0,16	124.165.816,15	33,32

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,01	-0,00	0,01	-4,25	0,75	1.619.975,70	0,43
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,06	0,02	-0,00	0,02	0,65	0,88	26.370.118,29	7,08
Sub-total	0,07	0,02	-0,00		0,56	0,87	27.990.093,99	7,51

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	0,19	0,11	0,00	0,11	0,41	0,91	12.409.274,02	3,33
Sub-total	0,19	0,11	0,00		0,41	0,91	12.409.274,02	3,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável Value-At-Risk: 6,26%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	12,02	6,36	0,27	0,35	-0,35	-3,37	20.629.448,80	5,54
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	10,88	5,67	0,06	2,70	-0,52	-4,87	4.939.047,06	1,33
PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	12,86	7,39	0,10	3,78	-0,39	-4,18	6.387.856,25	1,71
Sub-total	11,62	6,26	0,43		-0,40	-3,77	31.956.352,11	8,58

Investimentos Estruturados Value-At-Risk: 5,46%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,63	7,43	0,17	6,12	0,11	2,33	13.961.372,29	3,75
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	5,74	3,02	0,02	4,23	-0,18	-0,18	3.069.635,04	0,82
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	5,53	4,49	0,02	4,49	-0,18	-0,16	4.237.107,58	1,14
Sub-total	10,86	5,46	0,22		0,05	1,35	21.268.114,91	5,71

Investimentos no Exterior Value-At-Risk: 8,67%

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	1,46	1,00	0,00	1,00	0,27	1,23	1.067.840,43	0,29
Sub-total	1,46	1,00	0,00		0,27	1,23	1.067.840,43	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	18,83	9,23	0,11	1,21	-0,06	-0,32	16.103.209,64	4,32
Sub-total	18,83	9,23	0,11		-0,06	-0,32	16.103.209,64	4,32

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 (%)