



PORTO FELIZ
JUNHO 2023



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 30.06.2023.

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

RENTA FIXA

72,41%

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	9,40	1,24	3,77	15,84	9.945.770,37	3,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,423526%)	0,55	-0,04	0,35	5,55	2.802.659,98	0,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,734998%)	0,61	-0,06	0,38	5,70	11.033.075,21	3,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290003%)	0,47	0,02	0,42	5,98	10.930.260,52	3,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,877000%)	0,47	0,02	0,47	6,27	5.289.847,77	1,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,051500%)	2,98	0,02	0,48	6,35	1.567.086,09	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (4,689998%)	0,47	0,01	0,37	5,68	2.832.504,47	0,89
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,669994%)	0,47	0,02	0,45	6,17	10.720.136,08	3,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,900000%)	0,47	0,02	0,47	6,28	5.293.810,30	1,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,069994%)	0,47	0,01	0,32	5,37	5.628.387,36	1,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,569998%)	0,47	0,02	0,44	6,12	1.642.489,55	0,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,000000%)	4,17	0,02	0,48	3,12	1.528.338,42	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,120004%)	0,47	0,02	0,41	5,89	10.930.306,59	3,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,171997%)	0,47	0,02	0,41	5,92	11.105.402,43	3,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,481000%)	0,47	0,02	0,43	6,07	5.363.346,78	1,69

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	0,02	0,46	6,23	21.066.721,64	6,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,582500%)	3,94	0,02	0,10	0,10	1.017.155,63	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,850500%)	4,08	0,02	0,46	0,80	4.877.036,95	1,54
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,86	0,11	0,69	6,75	123.574.336,14	39,01

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	3,42	0,29	2,09	9,44	258.499,89	0,08	4.459.933.733,33	0,01
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,40	0,22	1,03	6,94	16.757.799,85	5,29	1.469.266.924,84	1,14
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,38	0,07	1,16	6,49	325.367,84	0,10	6.781.214.720,11	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,28	0,74	2,37	11,28	14.368.170,41	4,54	6.493.608.770,37	0,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,35	0,73	2,35	11,24	15.775.217,37	4,98	4.240.209.456,14	0,37
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,39	0,22	1,03	7,00	24.029.226,55	7,59	8.254.253.931,25	0,29
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,30	0,44	1,59	8,66	71.514.281,91	22,58		

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	0,02	0,05	1,00	5,98	1.232.147,66	0,39	4.278.810.513,26	0,03
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,08	0,05	1,15	6,37	33.058.485,52	10,44	3.021.387.375,69	1,09
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,08	0,05	1,14	6,35	34.290.633,18	10,83		
Renda Fixa			1,58	0,20	1,04	7,32	229.379.251,23	72,41		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

16,46%

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	22,39	0,48	8,31	5,68	3.144.823,41	0,99	668.758.447,90	0,47
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	25,56	0,79	6,48	4,22	26.479.527,94	8,36	759.747.191,78	3,49
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21,16	-0,25	8,88	6,51	22.515.963,24	7,11	810.368.157,20	2,78
Sub-total Artigo 8º I			22,97	0,32	7,61	5,24	52.140.314,59	16,46		
Renda Variável			22,97	0,32	7,61	5,24	52.140.314,59	16,46		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,38%

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	23,77	0,25	0,47	14,53	20.212.914,15	6,38	2.036.420.590,68	0,99
Sub-total Artigo 9º III			23,77	0,25	0,47	14,53	20.212.914,15	6,38		
Investimentos no Exterior			23,77	0,25	0,47	14,53	20.212.914,15	6,38		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,75%

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	19,46	1,31	7,00	20,84	15.038.698,60	4,75	1.596.861.875,61	0,94
Sub-total Artigo 10º I			19,46	1,31	7,00	20,84	15.038.698,60	4,75		
Investimentos Estruturados			19,43	1,31	7,00	20,84	15.038.698,60	4,75		
Total			5,35	0,28	2,30	8,08	316.771.178,57	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	123.574.336,14	39,01	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	71.514.281,91	22,58	0,00	24,51	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	34.290.633,18	10,83	0,00	5,49	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	229.379.251,23	72,41					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	52.140.314,59	16,46	0,00	10,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	52.140.314,59	16,46					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	20.212.914,15	6,38	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	20.212.914,15	6,38					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	15.038.698,60	4,75	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	15.038.698,60	4,75					15,00
Total		316.771.178,57	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	0,69 64,04	6,75 103,92	3,15 100,22	6,75 103,92	9,66 71,33	837.603,19	7.566.256,92
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,59 148,61	8,66 133,25	4,37 138,97	8,66 133,25	11,53 85,15	1.122.224,96	5.966.792,38
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,14 106,44	6,35 97,71	3,24 102,90	6,35 97,71	13,36 98,63	400.975,53	1.756.393,94
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	7,61 -1,39	5,24 -2,37	15,61 -0,29	5,24 -2,37	13,01 -6,82	3.688.527,16	2.564.943,34
Artigo 9º III % do CDI	0,47 43,67	14,53 223,59	5,60 178,11	14,53 223,59	13,40 98,98	94.173,96	2.564.334,67
Artigo 10º I % do CDI	7,00 653,40	20,84 320,64	10,43 331,51	20,84 320,64	29,04 214,46	984.413,96	3.160.073,60
PORTO FELIZ (Total)						7.127.918,76	23.578.794,85

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%)	2.792.871,97	0,00	0,00	0,00	2.802.659,98	9.788,01	150.646,97
NTN-B 150535 (4,734998%)	10.991.789,61	0,00	0,00	0,00	11.033.075,21	41.285,60	609.130,27
NTN-B 150535 (5,290003%)	10.884.646,57	0,00	0,00	0,00	10.930.260,52	45.613,95	631.028,10
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.265.333,38	0,00	0,00	0,00	5.289.847,77	24.514,39	319.668,34
NTN-B 150535 (6,051500%)	1.559.608,34	0,00	0,00	0,00	1.567.086,09	7.477,75	95.954,80
NTN-B 150545	9.584.826,69	0,00	0,00	0,00	9.945.770,37	360.943,68	1.384.916,60
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.822.026,03	0,00	0,00	0,00	2.832.504,47	10.478,44	155.397,49
NTN-B 150555 (5,669994%)	10.672.199,81	0,00	0,00	0,00	10.720.136,08	47.936,27	637.340,08
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.269.179,01	0,00	0,00	0,00	5.293.810,30	24.631,29	320.417,35
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.610.344,82	0,00	0,00	0,00	5.628.387,36	18.042,54	288.961,72
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.635.273,12	0,00	0,00	0,00	1.642.489,55	7.216,43	95.398,85
NTN-B 150830 (6,000000%)	1.521.107,12	0,00	0,00	0,00	1.528.338,42	7.231,30	46.281,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150840 (5,120004%)	10.886.156,81	0,00	0,00	0,00	10.930.306,59	44.149,78	612.709,76
NTN-B 150840 (5,171997%)	11.060.083,67	0,00	0,00	0,00	11.105.402,43	45.318,76	625.115,59
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.340.157,35	0,00	0,00	0,00	5.363.346,78	23.189,43	309.327,72
NTN-B 150840 (5,792100%)	20.970.479,74	0,00	0,00	0,00	21.066.721,64	96.241,90	1.244.307,70
NTN-B 150850 (5,582500%)	0,00	1.016.115,50	0,00	0,00	1.017.155,63	1.040,13	1.040,13
NTN-B 150850 (5,850500%)	4.854.533,41	0,00	0,00	0,00	4.877.036,95	22.503,54	38.613,72
					123.574.336,14	837.603,19	

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	14.035.246,18	0,00	0,00	0,00	14.368.170,41	332.924,23	1.456.423,36
BB PREV RF IRF M	253.201,09	0,00	0,00	0,00	258.499,89	5.298,80	22.306,10
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	317.090,12	120.000,00	-116.027,83	0,00	325.367,84	4.305,55	67.684,02
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	23.783.883,39	0,00	0,00	0,00	24.029.226,55	245.343,16	1.572.780,00
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.412.491,87	0,00	0,00	0,00	15.775.217,37	362.725,50	1.594.473,18
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	16.586.172,13	0,00	0,00	0,00	16.757.799,85	171.627,72	1.088.043,29
					71.514.281,91	1.122.224,96	

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	2.338.583,88	3.636.923,13	-4.760.747,64	0,00	1.232.147,66	17.388,29	104.325,19
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	31.585.785,87	3.590.000,00	-2.500.887,59	0,00	33.058.485,52	383.587,24	1.652.068,75
					34.290.633,18	400.975,53	

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	20.680.104,64	0,00	0,00	0,00	22.515.963,24	1.835.858,60	1.376.538,74
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	24.868.103,59	0,00	0,00	0,00	26.479.527,94	1.611.424,35	1.019.315,73
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	2.903.579,20	0,00	0,00	0,00	3.144.823,41	241.244,21	169.088,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					52.140.314,59	3.688.527,16	

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	20.118.740,19	0,00	0,00	0,00	20.212.914,15	94.173,96	2.564.334,67
					20.212.914,15	94.173,96	

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	14.054.284,64	0,00	0,00	0,00	15.038.698,60	984.413,96	3.160.073,60
					15.038.698,60	984.413,96	

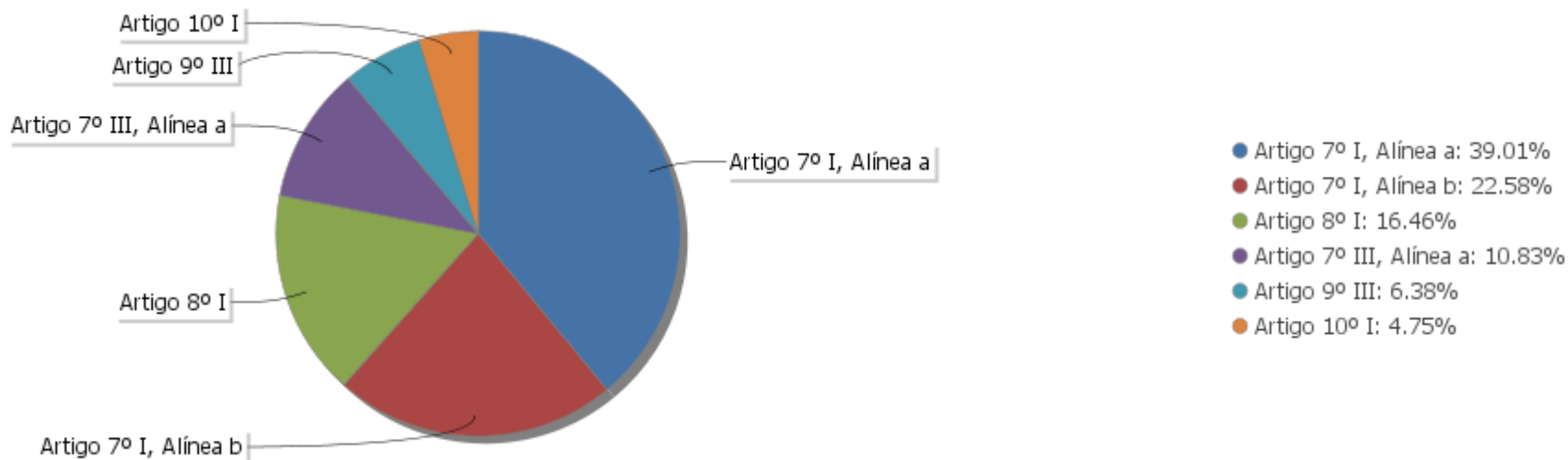
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

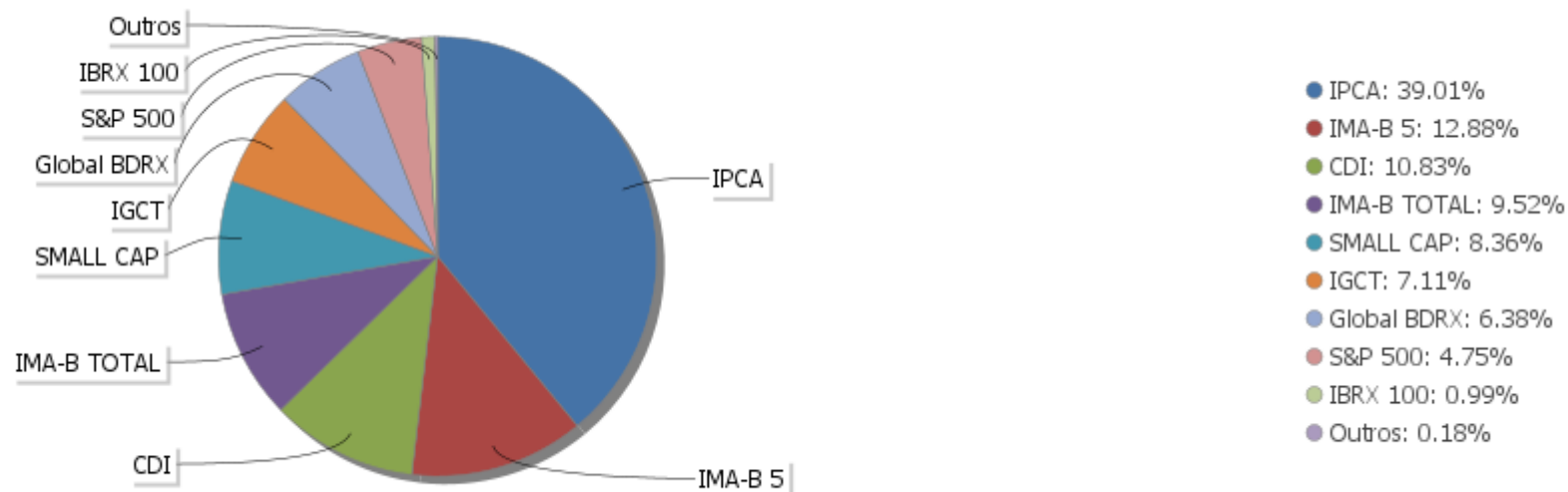
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	190.052.019,02	60,00	190.052.019,02	60,00	
de 31 dias a 365 dias	3.144.823,41	0,99	193.196.842,43	60,99	
acima de 365 dias	123.574.336,14	39,01	316.771.178,57	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

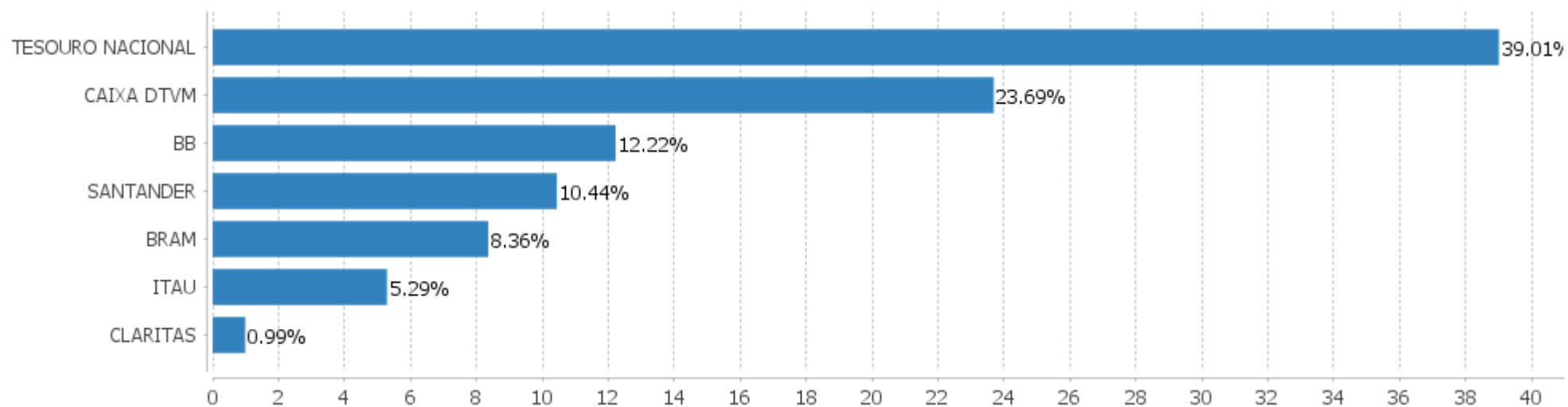


Alocação Por Estratégia



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
2023	1,98	-0,75	0,88	0,98	2,46	2,30							8,08
IPCA + 5,01%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,66	0,33							5,37
p.p. indexador	1,02	-1,94	-0,28	0,01	1,80	1,98							2,70
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

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	32	48,48	03 meses	5,84	1,96	3,88	3,68
Meses abaixo - Meta Atuarial	34	51,52	06 meses	8,08	5,37	2,70	4,07
			12 meses	12,15	8,24	3,91	5,35
			24 meses	8,05	27,35	-19,30	6,06
			36 meses	17,82	45,74	-27,92	5,89
			48 meses	23,58	57,72	-34,14	7,77
			60 meses	52,15	72,69	-20,54	7,22
			Desde 29/12/2017	54,40	82,34	-27,94	7,01

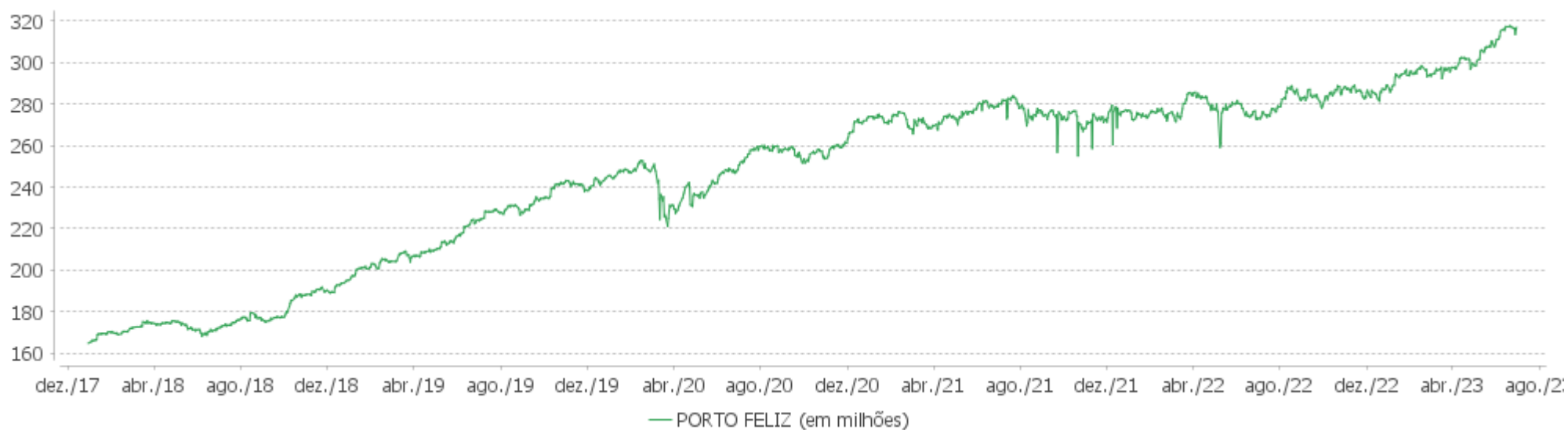
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-7,15	2020-03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

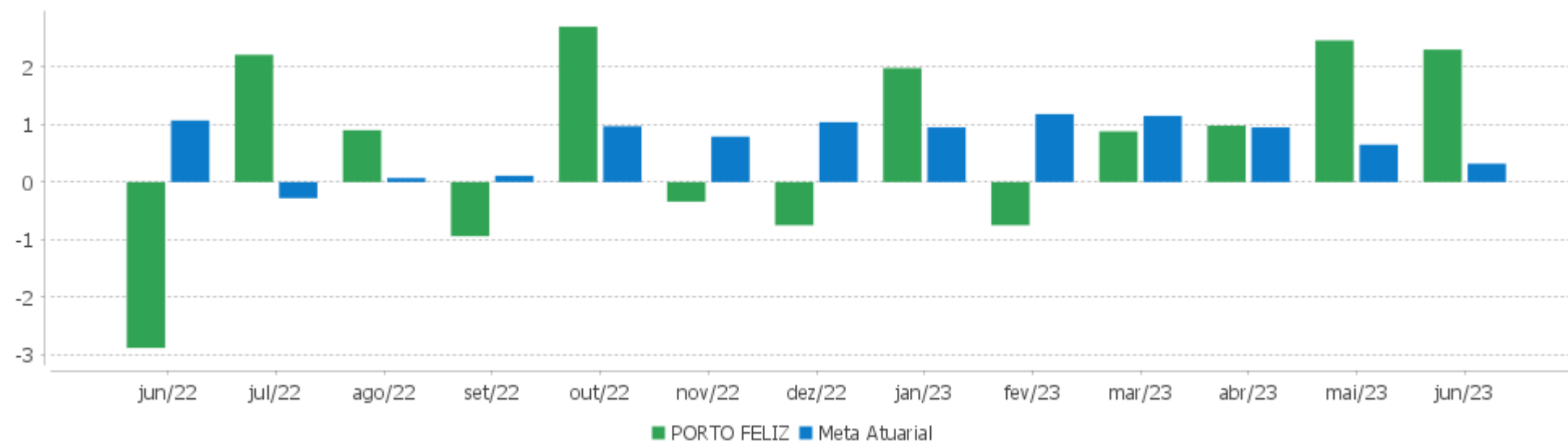


Patrimônio Líquido



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.	3,77 3,85	15,84 12,97	12,54 11,78	15,84 12,97	17,40 14,24	11,97 -3,45	23,48 -1,58
NTN-B 150830 (6,000000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,56	3,28 0,41	2,53 1,77	3,28 0,41	3,52 0,35		
NTN-B 150840 (5,120004%) Var. IPCA p.p.	0,41 0,49	5,89 3,02	2,32 1,56	5,89 3,02	8,81 5,65	24,54 9,12	34,39 9,33
NTN-B 150830 (4,069994%) Var. IPCA p.p.	0,32 0,40	5,37 2,50	2,07 1,31	5,37 2,50	7,73 4,56	25,33 9,91	34,16 9,11
NTN-B 150535 (5,290003%) Var. IPCA p.p.	0,42 0,50	5,98 3,11	2,36 1,60	5,98 3,11	8,98 5,82	28,28 12,86	38,40 13,34
NTN-B 150535 (5,877000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,27 3,40	2,50 1,74	6,27 3,40	9,59 6,43	26,04 10,61	36,32 11,26
NTN-B 150840 (5,792100%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,23 3,36	2,48 1,72	6,23 3,36	9,50 6,34	22,35 6,93	32,31 7,26
NTN-B 150555 (4,689998%) Var. IPCA p.p.	0,37 0,45	5,68 2,81	2,22 1,46	5,68 2,81	8,37 5,20	26,83 11,41	36,96 11,90
NTN-B 150850 (5,850500%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	3,27 0,40	2,49 1,73	3,27 0,40	3,49 0,33		
NTN-B 150840 (5,481000%) Var. IPCA p.p.	0,43 0,51	6,07 3,20	2,41 1,65	6,07 3,20	9,18 6,02	21,86 6,44	31,66 6,60
NTN-B 150555 (5,669994%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,53	6,17 3,29	2,45 1,69	6,17 3,29	9,38 6,21	25,68 10,25	35,94 10,88
NTN-B 150830 (5,569998%) Var. IPCA p.p.	0,44 0,52	6,12 3,25	2,43 1,67	6,12 3,25	9,27 6,11	25,37 9,95	35,35 10,29
NTN-B 150840 (5,171997%) Var. IPCA p.p.	0,41 0,49	5,92 3,05	2,33 1,57	5,92 3,05	8,86 5,70	24,65 9,22	34,53 9,47
NTN-B 150850 (5,582500%) Var. IPCA p.p.	0,44 0,52	3,24 0,37	2,43 1,67	3,24 0,37	3,44 0,28		
NTN-B 150555 (5,900000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,28 3,41	2,51 1,75	6,28 3,41	9,61 6,45	26,11 10,68	36,45 11,39
NTN-B 150535 (4,423526%) Var. IPCA p.p.	0,35 0,43	5,55 2,68	2,16 1,40	5,55 2,68	8,09 4,93	26,12 10,69	35,53 10,47
NTN-B 150535 (4,734998%)	0,38	5,70	2,23	5,70	8,42	26,84	36,50

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.	0,46	2,83	1,47	2,83	5,26	11,42	11,44
NTN-B 150535 (6,051500%)	0,48	6,35	2,54	6,35	6,61	19,22	
Var. IPCA p.p.	0,56	3,48	1,78	3,48	3,45	3,80	
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,35	11,24	7,06	11,24	13,32	17,31	25,74
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,04	-0,12	-0,04	-0,12	-0,21	-0,50	-0,82
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,03	7,00	2,57	7,00	10,18	21,01	28,00
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,04	0,02	-0,04	-0,05	-0,30	-0,68
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	1,03	6,94	2,50	6,94	10,04	20,89	27,91
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,10	-0,04	-0,10	-0,19	-0,43	-0,77
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1,16	6,49	3,14	6,49	13,48	21,33	23,34
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,18	-0,08	-0,18	-0,34	-0,67	-1,15
BB PREV RF IRF M	2,09	9,44	5,43	9,44	16,38	18,13	18,03
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,03	-0,18	-0,08	-0,18	-0,36	-0,66	-0,93
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,37	11,28	7,11	11,28	13,29	17,23	25,61
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,09	0,01	-0,09	-0,24	-0,58	-0,95
BB PREV RF FLUXO FIC	1,00	5,98	2,90	5,98	12,44	20,85	22,25
% do CDI	93,03	92,01	92,23	92,01	91,84	89,21	85,01
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	1,15	6,37	3,26	6,37	13,60	24,20	27,56
% do CDI	107,14	98,06	103,54	98,06	100,39	103,57	105,33
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	8,31	5,68	15,19	5,68	14,70	-5,92	21,95
Var. IBRX 100 p.p.	-0,56	-0,91	0,23	-0,91	-2,90	3,58	-1,43
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	8,88	6,51	15,45	6,51	17,05	-11,63	19,59
Var. IGCT p.p.	-0,16	-1,00	-0,67	-1,00	-1,81	-2,14	-4,20
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	6,48	4,22	15,83	4,22	9,72	-24,07	0,19
Var. SMALL CAP p.p.	-1,69	-9,05	-9,33	-9,05	-10,07	3,57	-0,86
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,47	14,53	5,60	14,53	13,40	-1,43	24,43
Var. Global BDRX p.p.	-0,02	-0,61	-0,29	-0,61	-1,04	-2,02	-4,32
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	7,00	20,17	10,43	20,17	28,33	20,97	67,67
Var. S&P 500 p.p.	6,31	13,11	7,70	13,11	20,17	21,20	41,34
PORTO FELIZ	2,30	8,08	5,84	8,08	12,15	8,05	17,82
Var. IPCA + 4,88% p.p.	1,98	2,70	3,88	2,70	3,84	-19,20	-26,94
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88

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
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	1,19	6,68	3,22	6,68	13,82	22,00	24,49	31,97	41,51
IRF-M 1+	2,65	11,41	6,89	11,41	18,80	17,59	16,30	30,02	54,96
IRF-M TOTAL	2,12	9,62	5,52	9,62	16,74	18,79	18,96	30,63	51,17
IMA-B 5	1,05	7,04	2,55	7,04	10,23	21,32	28,68	40,02	60,53
IMA-B 5+	3,37	14,91	10,90	14,91	16,34	13,82	23,52	25,96	77,32
IMA-B TOTAL	2,39	11,37	7,10	11,37	13,52	17,81	26,56	32,82	71,02
IMA-GERAL TOTAL	1,74	8,64	4,83	8,64	14,01	20,10	24,37	32,47	53,53
IDKA 2	0,97	6,79	1,99	6,79	9,28	20,32	28,82	40,12	58,67
IDKA 20	5,91	22,33	19,68	22,33	23,20	6,46	19,60	13,99	89,13
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23	16,96	62,29
IBRX 100	8,87	6,59	14,96	6,59	17,60	-9,50	23,38	17,63	65,59
IBRX 50	8,77	4,96	13,79	4,96	17,68	-9,03	25,07	16,40	59,58
SMALL CAP	8,17	13,26	25,16	13,26	19,79	-27,64	1,04	6,25	50,57
Índice Consumo - ICON	9,53	8,38	24,04	8,38	7,60	-42,14	-32,37	-22,91	3,43
Índice Dividendos - IDIV	8,78	9,30	13,95	9,30	17,73	12,91	39,77	39,55	106,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	0,69	7,06	2,73	7,06	8,17	-0,23	26,33	90,25	104,62

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,71	10,05	14,28	10,05	12,87	14,54	12,44	20,15	48,47

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,09	4,18	0,15	4,18	5,27	-8,63	14,48	64,05	68,93

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,08	2,87	0,76	2,87	3,16	15,42	25,06	27,72	32,02
INPC	-0,10	2,69	0,79	2,69	3,00	15,28	25,91	28,86	33,13
IGPM	-1,93	-4,46	-4,65	-4,46	-6,86	3,11	39,98	50,22	60,00
SELIC	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,25	4,88	1,72	4,88	7,27	24,82	40,63	49,40	60,53
IPCA + 5,00%	0,33	5,37	1,96	5,37	8,30	27,23	44,71	55,22	68,37
IPCA + 5,50%	0,37	5,62	2,08	5,62	8,81	28,44	46,79	58,20	72,40
IPCA + 5,89%	0,40	5,81	2,17	5,81	9,21	29,39	48,42	60,54	75,60
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88	61,21	76,52
INPC + 4,00%	0,23	4,69	1,75	4,69	7,10	24,66	41,58	50,73	61,88
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89	62,65	78,00

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%)	2.802.659,98	4,423526	2.621.013,77	5,229500	-181.646,21
NTN-B 150535 (4,734998%)	11.033.075,21	4,734998	10.594.927,12	5,229500	-438.148,09
NTN-B 150535 (5,290003%)	10.930.260,52	5,290003	10.985.196,51	5,229500	54.935,99
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.289.847,77	5,877000	5.579.078,41	5,229500	289.230,64
NTN-B 150535 (6,051500%)	1.567.086,09	6,051500	1.676.384,45	5,229500	109.298,36
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.832.504,47	4,689998	2.529.257,14	5,452600	-303.247,33
NTN-B 150555 (5,669994%)	10.720.136,08	5,669994	11.057.624,17	5,452600	337.488,09
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.293.810,30	5,900000	5.639.073,29	5,452600	345.262,99
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.628.387,36	4,069994	5.304.389,38	5,132700	-323.997,98
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.642.489,55	5,569998	1.682.527,52	5,132700	40.037,97
NTN-B 150830 (6,000000%)	1.528.338,42	6,000000	1.602.828,85	5,132700	74.490,43
NTN-B 150840 (5,120004%)	10.930.306,59	5,120004	10.646.115,71	5,371900	-284.190,88
NTN-B 150840 (5,171997%)	11.105.402,43	5,171997	10.875.888,00	5,371900	-229.514,43
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.363.346,78	5,481000	5.424.427,99	5,371900	61.081,21
NTN-B 150840 (5,792100%)	21.066.721,64	5,792100	21.999.569,64	5,371900	932.848,00
NTN-B 150850 (5,582500%)	1.017.155,63	5,582500	1.033.865,74	5,459000	16.710,11
NTN-B 150850 (5,850500%)	4.877.036,95	5,850500	5.133.052,72	5,459000	256.015,77

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
73	07/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.406.264,54	0,00	941.772,29066847	2,5550385840
74	12/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	133.443,90	52.178,10763190	2,5574691390
79	13/06/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	120.000,00	0,00	36.311,80008000	3,3047108580
75	14/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.590.000,00	1.402.428,41832900	2,5598454460
82	14/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	3.590.000,00	0,00	15.336,03487500	234,0891912000
76	21/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.037.303,74	404.253,41004848	2,5659740010
80	21/06/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	23.617,24	7.124,10411700	3,3151171870
84	21/06/2023	NTN-B 150850 (5,582500%)	1.016.115,50	0,00	228,00000000	4.456,6469298246
83	28/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.500.887,59	10.625,35766000	235,3697325000
81	28/06/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	92.410,59	27.804,34584600	3,3236023790
77	29/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.146.845,56	0,00	445.689,23319100	2,5731955690
78	30/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	83.813,03	0,00	32.556,24721100	2,5744069780
Total			8.363.038,63	7.377.663,06		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.876.021,41

Value-At-Risk: 1,85%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PORTO FELIZ		1,85	1,85			316.771.178,57	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,55%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545		3,85	0,06	3,86			9.945.770,37	3,14
NTN-B 150535 (4,423526%)		0,23	-0,00	0,21			2.802.659,98	0,88
NTN-B 150535 (4,734998%)		0,30	-0,00	0,29			11.033.075,21	3,48
NTN-B 150535 (5,290003%)		0,13	-0,00	0,12			10.930.260,52	3,45
NTN-B 150535 (5,877000%)		0,13	-0,00	0,12			5.289.847,77	1,67
NTN-B 150535 (6,051500%)		0,13	-0,00	0,12			1.567.086,09	0,49
NTN-B 150555 (4,689998%)		0,13	-0,00	0,12			2.832.504,47	0,89
NTN-B 150555 (5,669994%)		0,13	-0,00	0,12			10.720.136,08	3,38
NTN-B 150555 (5,900000%)		0,13	-0,00	0,12			5.293.810,30	1,67
NTN-B 150830 (4,069994%)		0,13	-0,00	0,12			5.628.387,36	1,78
NTN-B 150830 (5,569998%)		0,13	-0,00	0,12			1.642.489,55	0,52
NTN-B 150830 (6,000000%)		0,22	-0,00	0,26			1.528.338,42	0,48
NTN-B 150840 (5,120004%)		0,13	-0,00	0,12			10.930.306,59	3,45
NTN-B 150840 (5,171997%)		0,13	-0,00	0,12			11.105.402,43	3,51
NTN-B 150840 (5,481000%)		0,13	-0,00	0,12			5.363.346,78	1,69
NTN-B 150840 (5,792100%)		0,13	-0,00	0,12			21.066.721,64	6,65
NTN-B 150850 (5,582500%)		0,22	-0,00	0,26			1.017.155,63	0,32
NTN-B 150850 (5,850500%)		0,22	-0,00	0,26			4.877.036,95	1,54
Sub-total	0,81	0,34	0,05		-0,48	0,69	123.574.336,14	39,01

Artigo 7º I, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF M		1,22	0,00	0,02			258.499,89	0,08
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI		0,90	0,01	0,01			16.757.799,85	5,29
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,21	0,00	0,01			325.367,84	0,10
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,83	0,04	0,04			14.368.170,41	4,54
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,86	0,04	0,04			15.775.217,37	4,98
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,91	0,02	0,03			24.029.226,55	7,59
Sub-total	2,86	1,23	0,12		0,18	1,59	71.514.281,91	22,58

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	0,00	0,01			1.232.147,66	0,39
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,05	0,00	0,05			33.058.485,52	10,44
Sub-total	0,05	0,05	0,00		1,36	1,14	34.290.633,18	10,83

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,09%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA		8,87	0,08	3,13			3.144.823,41	0,99
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		10,18	0,77	3,22			26.479.527,94	8,36
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		8,36	0,53	0,23			22.515.963,24	7,11
Sub-total	17,07	9,09	1,37		0,38	7,61	52.140.314,59	16,46

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,63%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		7,63	0,12	0,62			20.212.914,15	6,38
Sub-total	13,88	7,63	0,12		-0,04	0,47	20.212.914,15	6,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 6,86%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,86	0,20	5,46			15.038.698,60	4,75
Sub-total	10,58	6,86	0,20		0,56	7,00	15.038.698,60	4,75