



LDB
EMPRESAS

PORTO FELIZ
NOVEMBRO 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 30.11.2023.

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

RENDA FIXA

76,73%

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	8,10	0,16	3,48	16,08	9.689.497,64	2,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,423526%)	0,43	-0,02	0,59	8,50	2.808.262,42	0,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,734998%)	0,50	-0,04	0,61	8,80	11.061.583,40	3,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290003%)	0,33	0,03	0,65	9,32	10.969.246,04	3,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,635000%)	4,00	0,04	0,33	0,33	1.675.367,99	0,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,877000%)	0,33	0,04	0,70	9,87	5.314.026,65	1,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,051500%)	0,50	0,04	0,71	10,04	1.574.699,77	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (4,689998%)	0,33	0,03	0,61	8,75	2.845.532,87	0,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,669994%)	0,33	0,04	0,68	9,68	10.771.535,15	3,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,900000%)	0,33	0,04	0,70	9,89	5.319.234,68	1,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,069994%)	0,33	0,03	0,56	8,17	5.628.486,18	1,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,569998%)	0,33	0,04	0,67	9,58	1.648.618,36	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,000000%)	2,93	0,04	0,71	6,67	1.535.609,98	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,120004%)	0,33	0,03	0,64	9,16	10.972.127,65	3,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,171997%)	0,33	0,03	0,64	9,21	11.148.557,20	3,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,481000%)	0,33	0,04	0,67	9,50	5.386.056,87	1,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,792100%)	0,33	0,04	0,69	9,79	21.162.857,84	6,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,582500%)	2,77	0,04	0,67	3,38	1.021.918,05	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,850500%)	2,87	0,04	0,69	4,21	4.900.234,98	1,50
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,74	0,04	0,88	9,89	125.433.453,72	38,35

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	6,77	0,16	4,83	3,11	12.479.820,97	3,82	209.372.051,28	5,96
BB	BB	BB PREV RF IRF M	2,81	0,11	2,46	14,39	2.854.199,47	0,87	3.789.962.327,27	0,08
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,05	0,07	1,79	10,32	17.287.254,71	5,29	1.439.959.472,06	1,20
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,36	0,05	0,97	11,89	376.341,23	0,12	7.341.410.946,33	0,01
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,60	0,13	2,61	12,68	27.459.902,95	8,40	5.100.554.237,53	0,54
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,62	0,13	2,61	12,78	15.993.351,20	4,89	5.111.389.321,24	0,31
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,05	0,07	1,79	10,38	24.786.644,14	7,58	7.523.766.972,01	0,33
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,09	0,11	2,52	11,47	101.237.514,67	30,96		

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	0,03	0,04	0,83	0,92	5.293.489,62	1,62	3.918.825.638,18	0,14
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,10	0,05	0,94	12,28	18.958.589,69	5,80	2.894.940.806,12	0,65
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,09	0,05	0,93	12,19	24.252.079,31	7,42		
Renda Fixa			1,48	0,07	1,54	10,65	250.923.047,70	76,73		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

15,97%

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	19,69	0,99	11,28	10,42	3.285.936,93	1,00	756.654.897,78	0,43
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	22,47	0,71	12,94	-2,14	24.865.903,56	7,60	739.225.645,67	3,36
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	17,79	0,88	12,16	13,94	24.085.809,36	7,36	796.131.839,92	3,03
Sub-total Artigo 8º I			19,73	0,81	12,47	5,44	52.237.649,85	15,97		
Renda Variável			19,73	0,81	12,47	5,44	52.237.649,85	15,97		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,03%

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	16,34	0,05	6,10	21,40	13.176.917,92	4,03	1.957.059.984,27	0,67
Sub-total Artigo 9º III			16,34	0,05	6,10	21,40	13.176.917,92	4,03		
Investimentos no Exterior			16,35	0,05	6,10	21,40	13.176.917,92	4,03		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,27%

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	13,98	0,41	9,35	27,50	10.697.657,47	3,27	1.551.310.593,69	0,69
Sub-total Artigo 10º I			13,98	0,41	9,35	27,50	10.697.657,47	3,27		
Investimentos Estruturados			13,93	0,41	9,35	27,50	10.697.657,47	3,27		
Total			4,19	0,19	3,64	11,18	327.035.272,94	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	125.433.453,72	38,35	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	101.237.514,67	30,96	0,00	24,51	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	24.252.079,31	7,42	0,00	5,49	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	250.923.047,70	76,73					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	52.237.649,85	15,97	0,00	10,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	52.237.649,85	15,97					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	13.176.917,92	4,03	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	13.176.917,92	4,03					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	10.697.657,47	3,27	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	10.697.657,47	3,27					15,00
Total		327.035.272,94	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	0,88 95,40	9,89 82,10	1,91 65,34	3,64 57,50	10,57 79,45	1.087.854,51	11.157.708,01
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	2,52 274,80	11,47 95,28	1,57 53,73	4,23 66,71	12,01 90,31	2.490.926,04	8.213.038,00
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,93 101,14	12,19 101,24	2,98 101,98	6,70 105,74	13,46 101,15	210.002,76	3.276.660,54
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	12,47 -0,07	5,44 -10,60	5,15 -4,86	7,81 -9,72	2,69 -10,51	5.792.568,60	2.662.278,60
Artigo 9º III % do CDI	6,10 664,11	21,40 177,67	0,87 29,85	6,49 102,50	15,58 117,11	1.114.645,61	3.660.125,41
Artigo 10º I % do CDI	9,35 1.019,00	27,50 228,35	2,63 89,98	12,90 203,73	21,26 159,80	914.896,72	3.819.032,47
PORTO FELIZ (Total)						11.610.894,24	32.788.843,03

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%)	2.864.364,20	0,00	0,00	72.681,58	2.808.262,42	16.579,80	228.930,99
NTN-B 150535 (4,734998%)	11.287.404,61	0,00	0,00	293.800,82	11.061.583,40	67.979,61	931.439,28
NTN-B 150535 (5,290003%)	11.201.850,79	0,00	0,00	304.623,12	10.969.246,04	72.018,37	974.636,74
NTN-B 150535 (5,635000%)	0,00	1.669.938,11	0,00	0,00	1.675.367,99	5.429,88	5.429,88
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.431.466,69	0,00	0,00	154.709,68	5.314.026,65	37.269,64	498.556,90
NTN-B 150535 (6,051500%)	1.609.932,48	0,00	0,00	46.486,69	1.574.699,77	11.253,98	150.055,17
NTN-B 150545	9.631.606,33	0,00	0,00	275.353,72	9.689.497,64	333.245,03	1.403.997,59
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.897.294,73	0,00	0,00	69.115,14	2.845.532,87	17.353,28	237.541,03
NTN-B 150555 (5,669994%)	10.999.869,76	0,00	0,00	302.163,51	10.771.535,15	73.828,90	990.902,66
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.435.931,05	0,00	0,00	154.094,78	5.319.234,68	37.398,41	499.936,51
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.597.183,44	0,00	0,00	0,00	5.628.486,18	31.302,74	435.320,96
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.637.587,70	0,00	0,00	0,00	1.648.618,36	11.030,66	147.920,78

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150830 (6,000000%)	1.524.844,41	0,00	0,00	0,00	1.535.609,98	10.765,57	97.748,84
NTN-B 150840 (5,120004%)	10.902.408,68	0,00	0,00	0,00	10.972.127,65	69.718,97	943.022,79
NTN-B 150840 (5,171997%)	11.077.288,29	0,00	0,00	0,00	11.148.557,20	71.268,91	962.988,77
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.350.380,47	0,00	0,00	0,00	5.386.056,87	35.676,40	479.030,76
NTN-B 150840 (5,792100%)	21.017.777,71	0,00	0,00	0,00	21.162.857,84	145.080,13	1.936.595,52
NTN-B 150850 (5,582500%)	1.015.071,09	0,00	0,00	0,00	1.021.918,05	6.846,96	33.638,42
NTN-B 150850 (5,850500%)	4.866.427,71	0,00	0,00	0,00	4.900.234,98	33.807,27	200.014,42
	124.348.690,14	1.669.938,11	0,00	1.673.029,04	125.433.453,72	1.087.854,51	

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	26.762.020,60	0,00	0,00	0,00	27.459.902,95	697.882,35	1.691.072,33
BB PREV RF IRF M	2.785.590,89	0,00	0,00	0,00	2.854.199,47	68.608,58	118.005,68
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	368.115,31	108.000,00	-103.702,47	0,00	376.341,23	3.928,39	87.706,66
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	24.351.446,53	0,00	0,00	0,00	24.786.644,14	435.197,61	2.330.197,59
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.586.808,03	0,00	0,00	0,00	15.993.351,20	406.543,17	1.812.607,01
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	11.904.379,94	0,00	0,00	0,00	12.479.820,97	575.441,03	390.868,15
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	16.983.929,80	0,00	0,00	0,00	17.287.254,71	303.324,91	1.617.498,15
	98.742.291,10	108.000,00	-103.702,47	0,00	101.237.514,67	2.490.926,04	

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	1.237.221,68	5.699.878,89	-1.669.938,11	0,00	5.293.489,62	26.327,16	199.978,50
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	17.831.587,59	3.541.304,12	-2.597.977,62	0,00	18.958.589,69	183.675,60	3.076.682,04
	19.068.809,27	9.241.183,01	-4.267.915,73	0,00	24.252.079,31	210.002,76	

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	21.474.743,30	0,00	0,00	0,00	24.085.809,36	2.611.066,06	2.946.384,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	22.017.400,14	0,00	0,00	0,00	24.865.903,56	2.848.503,42	-594.308,65
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	2.952.937,81	0,00	0,00	0,00	3.285.936,93	332.999,12	310.202,39
	46.445.081,25	0,00	0,00	0,00	52.237.649,85	5.792.568,60	

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	20.194.059,28	0,00	-8.131.786,97	0,00	13.176.917,92	1.114.645,61	3.660.125,41
	20.194.059,28	0,00	-8.131.786,97	0,00	13.176.917,92	1.114.645,61	

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	9.782.760,75	0,00	0,00	0,00	10.697.657,47	914.896,72	3.819.032,47
	9.782.760,75	0,00	0,00	0,00	10.697.657,47	914.896,72	

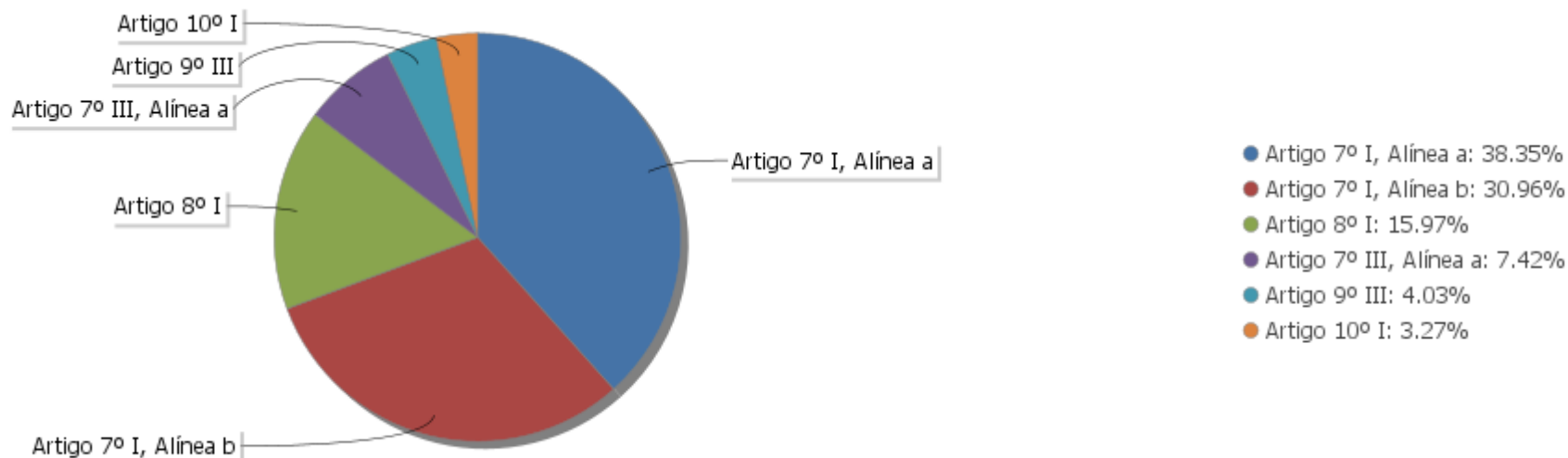
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

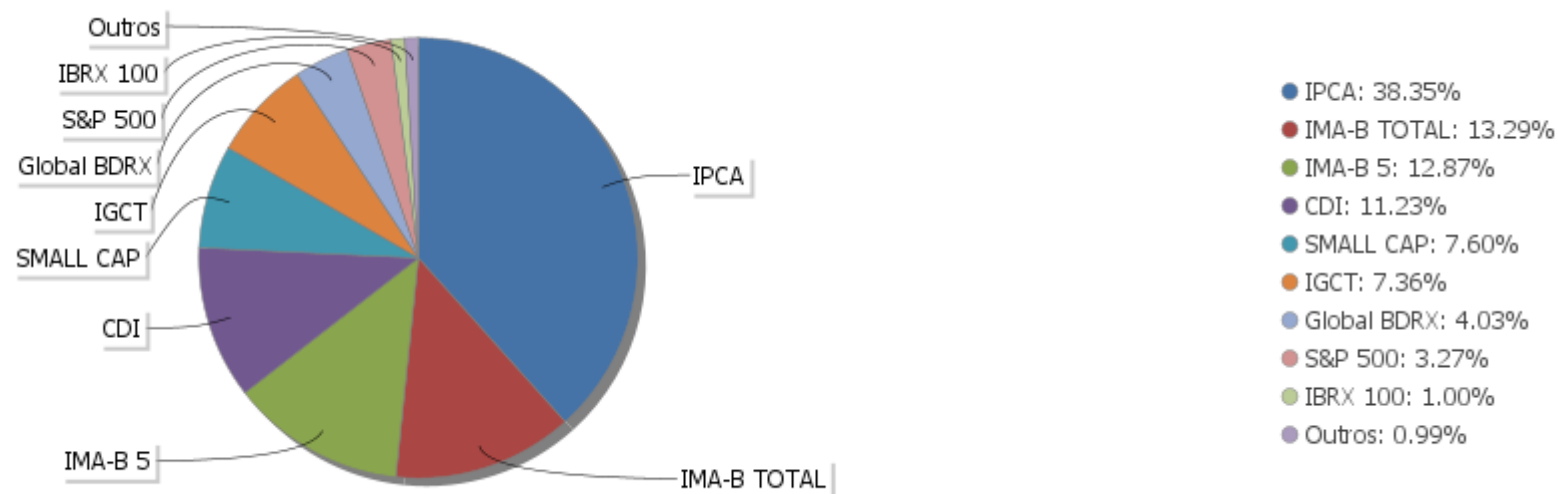
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	198.315.882,29	60,64	198.315.882,29	60,64	
de 31 dias a 365 dias	3.285.936,93	1,00	201.601.819,22	61,65	
acima de 365 dias	125.433.453,72	38,35	327.035.272,94	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

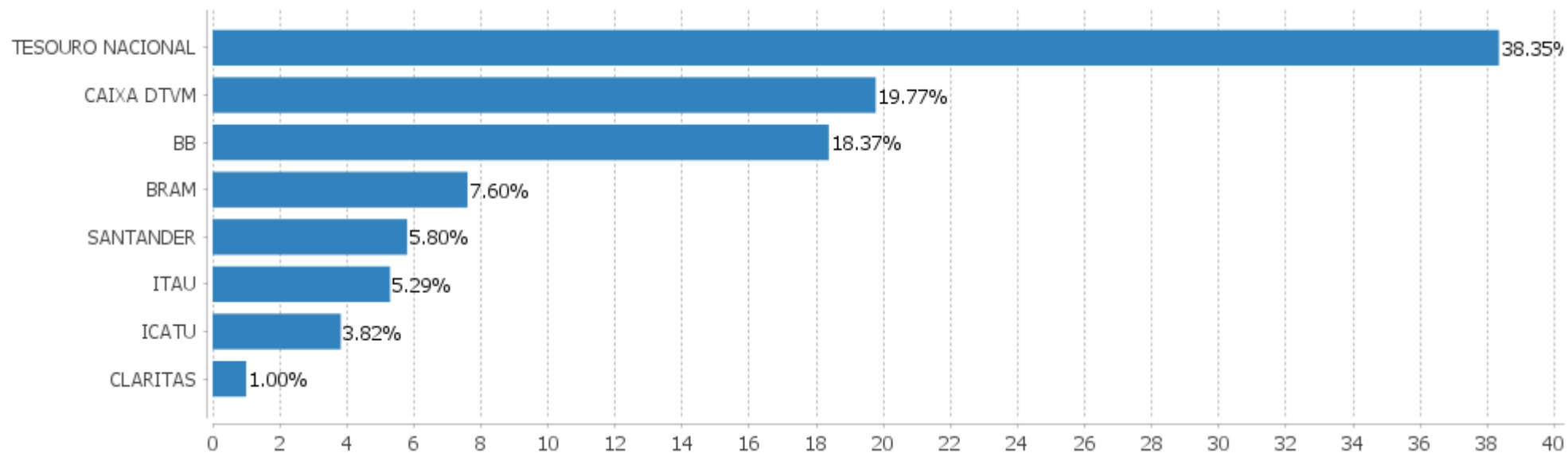


Alocação Por Estratégia



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	1,35	-0,81	-0,40	-0,87	3,64		11,18
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		8,76
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		2,42
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	34	47,89
Meses abaixo - Meta Atuarial	37	52,11
	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	2,34	1,98	0,35	4,63
06 meses	5,25	3,55	1,69	3,97
12 meses	10,35	9,89	0,45	4,19
24 meses	14,81	22,12	-7,30	5,64
36 meses	17,11	42,55	-25,45	5,65
48 meses	21,89	57,37	-35,48	7,80
60 meses	44,50	72,28	-27,77	7,18
Desde 29/12/2017	58,84	88,21	-29,37	6,84

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

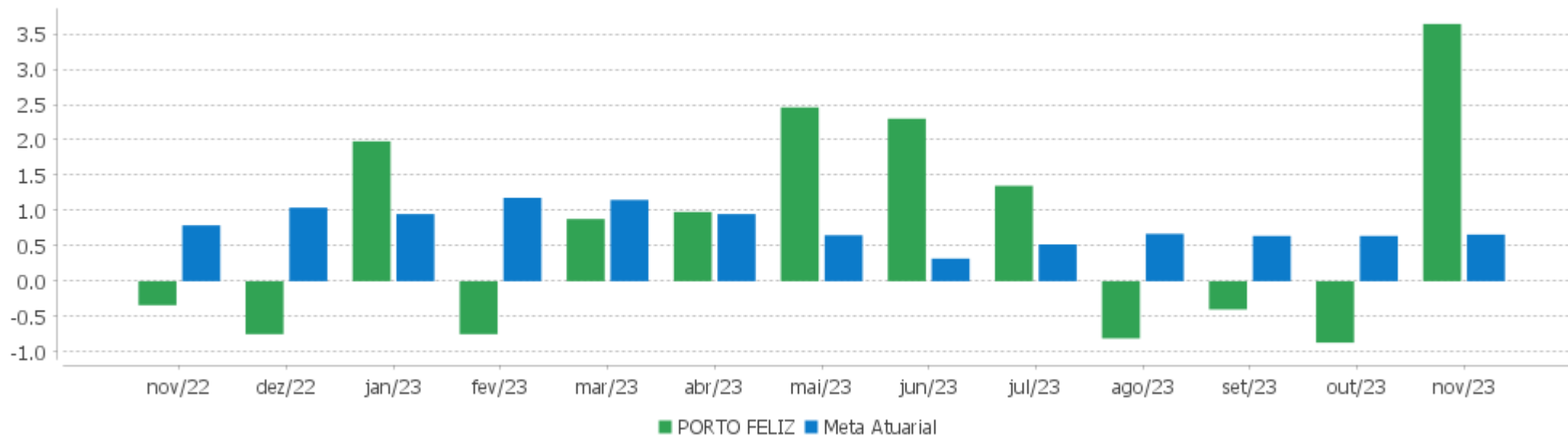


Patrimônio Líquido



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.	3,48 3,20	16,08 12,04	0,69 -0,09	3,98 2,93	14,18 9,50	17,76 6,90	19,00 -3,77
NTN-B 150830 (6,000000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,43	6,84 2,80	2,16 1,38	3,93 2,88	7,77 3,09	14,47 3,61	
NTN-B 150840 (5,120004%) Var. IPCA p.p.	0,64 0,36	9,16 5,12	1,96 1,18	3,50 2,45	10,03 5,35	22,84 11,98	35,72 12,95
NTN-B 150830 (4,069994%) Var. IPCA p.p.	0,56 0,28	8,17 4,13	1,71 0,93	2,98 1,93	8,94 4,26	20,41 9,55	35,36 12,59
NTN-B 150535 (5,877000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,42	9,87 5,83	2,14 1,35	3,87 2,82	10,82 6,14	24,62 13,76	38,00 15,23
NTN-B 150535 (5,290003%) Var. IPCA p.p.	0,65 0,37	9,32 5,28	2,00 1,22	3,59 2,53	10,21 5,53	23,24 12,38	39,89 17,13
NTN-B 150840 (5,792100%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,41	9,79 5,75	2,12 1,33	3,83 2,78	10,73 6,05	20,93 10,07	33,90 11,13
NTN-B 150850 (5,850500%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,41	6,76 2,72	2,13 1,35	3,86 2,81	7,68 3,00		
NTN-B 150555 (4,689998%) Var. IPCA p.p.	0,61 0,33	8,75 4,71	1,86 1,07	3,29 2,24	9,59 4,90	21,84 10,98	37,98 15,22
NTN-B 150840 (5,481000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,39	9,50 5,46	2,04 1,26	3,68 2,63	10,41 5,73	20,33 9,47	33,11 10,34
NTN-B 150535 (5,635000%) Var. IPCA p.p.	-2,13 -2,41	3,62 -0,42	-0,77 -1,55	0,86 -0,19	4,50 -0,19		
NTN-B 150840 (5,171997%) Var. IPCA p.p.	0,64 0,36	9,21 5,17	1,97 1,19	3,53 2,47	10,09 5,40	22,96 12,10	35,88 13,11
NTN-B 150830 (5,569998%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,39	9,58 5,55	2,06 1,28	3,72 2,67	10,50 5,82	23,90 13,03	36,94 14,18
NTN-B 150555 (5,669994%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,40	9,68 5,64	2,09 1,30	3,77 2,72	10,61 5,92	24,13 13,27	37,47 14,71
NTN-B 150850 (5,582500%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,39	6,62 2,58	2,07 1,28	3,73 2,68	7,52 2,83		
NTN-B 150555 (5,900000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,42	9,89 5,86	2,14 1,36	3,89 2,83	10,85 6,16	24,67 13,81	38,12 15,35
NTN-B 150535 (4,734998%)	0,61	8,80	1,87	3,31	9,64	21,86	37,79

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.	0,33	4,76	1,09	2,26	4,95	11,00	15,02
NTN-B 150535 (6,051500%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,43	10,04 6,00	2,18 1,39	3,96 2,91	11,00 6,32	17,93 7,07	
NTN-B 150535 (4,423526%) Var. IPCA p.p.	0,59 0,31	8,50 4,47	1,79 1,01	3,16 2,11	9,31 4,63	21,16 10,30	36,70 13,93
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,61 -0,02	12,78 -0,17	0,95 -0,04	3,77 -0,08	12,52 -0,21	20,02 -0,39	23,64 -0,73
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,79 -0,02	10,38 -0,13	1,57 -0,05	4,22 -0,11	11,39 -0,15	21,98 -0,30	28,57 -0,61
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,79 -0,02	10,32 -0,19	1,58 -0,05	4,23 -0,10	11,34 -0,21	21,85 -0,43	28,46 -0,72
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,97 -0,03	11,89 -0,33	2,82 -0,09	6,29 -0,17	13,19 -0,36	26,07 -0,74	28,72 -1,07
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP % do CDI	4,83 526,69	18,33 152,20	3,47 119,03	7,82 123,39	19,79 148,79	27,89 103,80	17,26 54,53
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	2,46 -0,01	14,39 -0,41	2,97 -0,06	6,71 -0,25	16,03 -0,47	26,54 -0,75	23,76 -1,08
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,61 -0,02	12,68 -0,26	0,93 -0,06	3,66 -0,18	12,44 -0,29	19,79 -0,62	23,43 -0,95
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,83 90,73	11,02 91,50	2,65 90,96	5,80 91,57	12,17 91,47	24,35 90,62	27,69 87,46
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,94 102,73	12,28 101,98	3,00 102,96	6,77 106,85	13,56 101,94	27,76 103,33	33,44 105,64
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA Var. IBRX 100 p.p.	11,28 -1,10	10,42 -4,55	4,39 -5,51	13,17 -4,25	7,83 -4,12	25,08 1,73	18,74 2,80
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	12,16 -0,13	13,94 -1,73	9,08 -0,30	16,47 -0,84	10,95 -1,75	20,71 -3,20	12,27 -3,95
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	12,94 0,47	-2,14 -11,54	1,70 0,52	-0,01 -4,50	-4,69 -10,81	-6,71 -3,17	-12,07 4,19
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	6,42 -0,04	21,77 -1,07	1,18 0,02	6,82 -0,39	15,93 -1,73	-11,50 -1,39	14,35 -4,87
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	9,35 3,06	26,64 14,11	2,63 1,01	12,77 6,93	20,44 16,07	17,68 29,84	52,73 35,97
PORTO FELIZ Var. IPCA + 4,88% p.p.	3,64 2,97	11,18 2,42	2,34 0,35	5,25 1,69	10,35 0,44	14,81 -7,41	17,11 -24,97
CDI	0,92	12,04	2,92	6,33	13,30	26,87	31,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	12,54	16,04	10,01	17,53	13,20	24,94	16,93
INPC + 6,00%	0,56	8,75	1,76	3,31	10,06	23,63	45,34
IPCA + 6,00%	0,74	9,70	2,21	4,04	10,94	24,53	46,11

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
BRANCO 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
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
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	1,00	12,22	2,91	6,45	13,55	26,81	29,79	34,92	44,24
IRF-M 1+	3,14	16,50	3,11	7,34	18,39	28,00	22,52	29,87	50,14
IRF-M TOTAL	2,47	14,81	3,03	6,96	16,50	27,30	24,84	31,46	48,61
IMA-B 5	1,80	10,51	1,62	4,32	11,55	22,27	29,18	38,75	57,20
IMA-B 5+	3,39	14,75	0,42	3,23	13,39	18,13	19,09	19,90	55,21
IMA-B TOTAL	2,62	12,95	0,99	3,85	12,73	20,41	24,38	28,75	57,75
IMA-GERAL TOTAL	1,84	12,96	2,33	5,79	13,83	24,95	27,59	32,92	50,36
IDKA 2	1,83	10,52	1,71	4,50	11,89	21,85	29,05	39,45	56,01
IDKA 20	4,68	19,28	-0,18	3,26	15,32	14,32	11,40	6,27	50,57
CDI	0,92	12,04	2,92	6,33	13,30	26,87	31,66	35,59	43,85

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	12,54	16,04	10,01	17,53	13,20	24,94	16,93	17,65	42,26
IBRX 100	12,38	14,97	9,89	17,42	11,95	23,34	15,95	17,94	44,76
IBRX 50	12,01	14,01	9,98	18,15	11,10	25,06	17,97	19,06	41,25
SMALL CAP	12,46	9,41	1,19	4,49	6,11	-3,54	-16,27	-12,84	24,96
Índice Consumo - ICON	16,33	0,95	1,71	2,02	-4,39	-24,66	-41,54	-39,36	-12,99
Índice Dividendos - IDIV	10,70	18,65	8,63	18,08	16,73	35,80	36,27	36,20	80,93

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	6,29	12,53	1,61	5,84	4,37	-12,16	16,75	69,92	111,42

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,66	10,79	-1,13	5,41	10,79	23,20	13,10	9,91	38,08

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	6,44	8,50	1,48	4,05	2,60	-16,06	3,97	48,41	80,72

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,28	4,04	0,78	1,05	4,68	10,86	22,77	28,06	32,25
INPC	0,10	3,14	0,33	0,34	3,85	10,06	22,12	28,46	32,79
IGPM	0,59	-3,89	1,46	-1,35	-3,46	2,23	20,51	50,06	56,02
SELIC	0,92	12,04	2,92	6,33	13,30	26,87	31,65	35,58	43,84

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	7,81	1,74	3,06	8,85	19,89	38,03	49,69	60,78
IPCA + 5,00%	0,67	8,75	1,98	3,55	9,90	22,20	42,03	55,50	68,63
IPCA + 5,50%	0,71	9,23	2,10	3,80	10,42	23,36	44,06	58,47	72,66
IPCA + 5,89%	0,74	9,59	2,19	3,99	10,82	24,28	45,66	60,82	75,87
IPCA + 6,00%	0,74	9,70	2,21	4,04	10,94	24,53	46,11	61,48	76,78
INPC + 4,00%	0,41	6,88	1,29	2,33	7,99	19,02	37,30	50,17	61,43
INPC + 6,00%	0,56	8,75	1,76	3,31	10,06	23,63	45,34	62,00	77,50

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%)	2.808.262,42	4,423526	2.548.012,42	5,622000	-260.250,00
NTN-B 150535 (4,734998%)	11.061.583,40	4,734998	10.299.833,67	5,622000	-761.749,73
NTN-B 150535 (5,290003%)	10.969.246,04	5,290003	10.679.233,15	5,622000	-290.012,89
NTN-B 150535 (5,635000%)	1.675.367,99	5,635000	1.677.118,17	5,622000	1.750,18
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.314.026,65	5,877000	5.423.688,05	5,622000	109.661,40
NTN-B 150535 (6,051500%)	1.574.699,77	6,051500	1.629.693,23	5,622000	54.993,46
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.845.532,87	4,689998	2.435.887,91	5,751000	-409.644,96
NTN-B 150555 (5,669994%)	10.771.535,15	5,669994	10.649.424,57	5,751000	-122.110,58
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.319.234,68	5,900000	5.430.903,13	5,751000	111.668,45
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.628.486,18	4,069994	5.218.073,06	5,494700	-410.413,12
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.648.618,36	5,569998	1.655.148,39	5,494700	6.530,03
NTN-B 150830 (6,000000%)	1.535.609,98	6,000000	1.576.746,62	5,494700	41.136,64
NTN-B 150840 (5,120004%)	10.972.127,65	5,120004	10.335.486,89	5,701700	-636.640,76
NTN-B 150840 (5,171997%)	11.148.557,20	5,171997	10.558.554,96	5,701700	-590.002,24
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.386.056,87	5,481000	5.266.155,83	5,701700	-119.901,04
NTN-B 150840 (5,792100%)	21.162.857,84	5,792100	21.357.673,53	5,701700	194.815,69
NTN-B 150850 (5,582500%)	1.021.918,05	5,582500	998.978,88	5,756800	-22.939,17
NTN-B 150850 (5,850500%)	4.900.234,98	5,850500	4.959.842,52	5,756800	59.607,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
163	08/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	128.537,99	0,00	47.957,50339700	2,6802477380
162	10/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.170.652,45	0,00	809.206,91079212	2,6824442810
176	13/11/2023	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,00	2.047.243,80	356.565,22148405	5,7415689379
175	13/11/2023	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,00	2.020.636,87	351.931,13411567	5,7415689438
174	14/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	743.304,12	0,00	3.003,98629900	247,4392511000
161	14/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	526.576,55	0,00	196.143,55911000	2,6846486950
171	14/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	2.798.000,00	0,00	11.307,82601209	247,4392511000
166	16/11/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	108.000,00	0,00	31.024,98933400	3,4810648550
160	16/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.673.029,03	0,00	622.926,49895000	2,6857567190
159	17/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.669.938,11	621.518,40723700	2,6868683060
173	17/11/2023	NTN-B 150535 (5,635000%)	1.669.938,11	0,00	389,00000000	4.292,9000360000
165	24/11/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	23.702,47	6.790,99179700	3,4902810530
164	28/11/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	80.000,00	22.900,24914767	3,4934117740
172	28/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.597.977,62	10.456,37164807	248,4588065000
158	29/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.154.810,02	0,00	428.391,07747149	2,6956911120
178	30/11/2023	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,00	2.031.336,89	342.979,57676663	5,9226176356
177	30/11/2023	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,00	2.032.569,41	343.202,87562825	5,9223554181
157	30/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	46.272,85	0,00	17.158,21399800	2,6968337150
Total			11.019.121,12	12.503.405,17		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 6.567.101,73

Value-At-Risk: 2,01%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PORTO FELIZ		2,01		2,01			327.035.272,94	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,85%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545		3,98	0,09	3,98			9.689.497,64	2,96
NTN-B 150535 (4,423526%)		0,21	-0,00	0,21			2.808.262,42	0,86
NTN-B 150535 (4,734998%)		0,22	-0,00	0,22			11.061.583,40	3,38
NTN-B 150535 (5,290003%)		0,06	-0,00	0,06			10.969.246,04	3,35
NTN-B 150535 (5,635000%)		0,17	-0,00	0,18			1.675.367,99	0,51
NTN-B 150535 (5,877000%)		0,06	-0,00	0,06			5.314.026,65	1,62
NTN-B 150535 (6,051500%)		0,06	-0,00	0,06			1.574.699,77	0,48
NTN-B 150555 (4,689998%)		0,06	-0,00	0,06			2.845.532,87	0,87
NTN-B 150555 (5,669994%)		0,06	-0,00	0,06			10.771.535,15	3,29
NTN-B 150555 (5,900000%)		0,06	-0,00	0,06			5.319.234,68	1,63
NTN-B 150830 (4,069994%)		0,06	-0,00	0,06			5.628.486,18	1,72
NTN-B 150830 (5,569998%)		0,06	-0,00	0,06			1.648.618,36	0,50
NTN-B 150830 (6,000000%)		0,06	-0,00	0,06			1.535.609,98	0,47
NTN-B 150840 (5,120004%)		0,06	-0,00	0,06			10.972.127,65	3,36
NTN-B 150840 (5,171997%)		0,06	-0,00	0,06			11.148.557,20	3,41
NTN-B 150840 (5,481000%)		0,06	-0,00	0,06			5.386.056,87	1,65
NTN-B 150840 (5,792100%)		0,06	-0,00	0,06			21.162.857,84	6,47
NTN-B 150850 (5,582500%)		0,06	-0,00	0,06			1.021.918,05	0,31
NTN-B 150850 (5,850500%)		0,06	-0,00	0,06			4.900.234,98	1,50
Sub-total	0,57	0,31	0,09		-0,07	0,88	125.433.453,72	38,35

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP		3,35	0,10	3,35			12.479.820,97	3,82
BB PREV RF IRF M		1,32	0,01	0,03			2.854.199,47	0,87
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI		1,23	0,05	0,00			17.287.254,71	5,29
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,11	0,00	0,00			376.341,23	0,12
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,02	0,13	0,04			27.459.902,95	8,40
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,01	0,08	0,03			15.993.351,20	4,89
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,23	0,07	0,01			24.786.644,14	7,58
Sub-total	2,98	1,75	0,44		0,54	2,52	101.237.514,67	30,96

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	-0,00	0,02			5.293.489,62	1,62
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,03	-0,00	0,03			18.958.589,69	5,80
Sub-total	0,05	0,03	-0,00		0,20	0,93	24.252.079,31	7,42

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,48%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA		8,85	0,08	3,43			3.285.936,93	1,00
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		10,06	0,71	2,62			24.865.903,56	7,60
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		7,39	0,50	0,23			24.085.809,36	7,36
Sub-total	19,36	8,48	1,29		0,60	12,47	52.237.649,85	15,97

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,70%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,70	0,06	0,67			13.176.917,92	4,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	10,01	6,70	0,06		0,52	6,10	13.176.917,92	4,03

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 6,34%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,34	0,14	5,57			10.697.657,47	3,27
Sub-total	13,06	6,34	0,14		0,65	9,35	10.697.657,47	3,27

(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 (%)