



**LDB**  
EMPRESAS

**PORTO FERREIRA - CONSOLIDADO**  
AGOSTO 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 30.08.2024.

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 87,80%

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 (6,100000%)	4,17	0,06	0,07	0,07	5.002.105,39	2,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,120000%)	4,18	0,07	0,07	0,07	5.002.978,71	2,16
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,70</b>	<b>0,07</b>	<b>0,07</b>	<b>0,07</b>	<b>10.005.084,10</b>	<b>4,32</b>

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,65	0,02	0,95	3,39	4.135.687,79	1,79	6.458.247.673,10	0,06
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,82	0,12	0,64	4,56	7.098.773,79	3,07	5.319.492.629,16	0,13
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,05	0,04	0,87	7,07	19.891.118,49	8,59	32.995.563.494,35	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	2,79	0,06	0,67	3,58	30.439.657,67	13,15	471.258.916,16	6,46
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,87	0,11	0,59	4,32	7.089.754,46	3,06	4.335.355.090,03	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,76	0,06	0,58	4,74	16.359.400,53	7,07	7.132.951.786,05	0,23
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,10	0,04	0,86	6,88	71.076.398,73	30,70	11.817.622.756,81	0,60
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,34	-0,00	0,68	4,05	5.212.865,10	2,25	4.604.965.566,98	0,11
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	2,54	0,05	0,70	2,37	2.559.258,71	1,11	1.868.959.978,30	0,14
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,05	0,04	0,86	7,01	8.336.716,26	3,60	7.436.483.772,61	0,11
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,88</b>	<b>0,05</b>	<b>0,78</b>	<b>5,82</b>	<b>172.199.631,53</b>	<b>74,37</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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 REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,04	0,89	7,21	7.421,47	0,00	20.250.525.135,03	0,00
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,10	0,04	0,91	4,06	8.718.057,37	3,77	15.057.333.281,43	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	4,18	-0,27	0,70	2,64	5.132.092,86	2,22	1.058.181.840,27	0,48
GRAPHEN	RJI	LME REC IMA B FI RENDA FIXA	1,82	-1,50	-1,14	-0,64	4.882.210,26	2,11	75.269.488,39	6,49
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>1,37</b>	<b>-0,45</b>	<b>0,33</b>	<b>2,17</b>	<b>18.739.781,96</b>	<b>8,09</b>		

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GENIAL	RJI	INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I	4,33	-0,97	-0,97	-7,32	364.078,27	0,16	5.826.507,47	6,25
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	4,78	-4,45	-4,45	-7,43	1.121.476,57	0,48	66.671.443,11	1,68
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>			<b>4,10</b>	<b>-3,62</b>	<b>-3,62</b>	<b>-7,39</b>	<b>1.485.554,84</b>	<b>0,64</b>		

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				
GENIAL	GENIAL	PIATÁ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,11	-0,01	-0,73	-6,53	864.915,53	0,37	19.308.893,96	4,48
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea b</b>			<b>1,11</b>	<b>-0,01</b>	<b>-0,73</b>	<b>-6,53</b>	<b>864.915,53</b>	<b>0,37</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>0,88</b>	<b>-0,02</b>	<b>0,70</b>	<b>5,49</b>	<b>203.294.967,96</b>	<b>87,80</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

6,68%

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 SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	12,87	0,04	4,68	-4,65	5.523.868,42	2,39	1.149.370.153,49	0,48
XP	SANTANDER	XP INVESTOR FI DE ACOES	15,56	-0,16	5,79	-0,53	9.947.783,12	4,30	212.784.885,00	4,68
		<b>Sub-total Artigo 8º I</b>	<b>14,15</b>	<b>-0,08</b>	<b>5,39</b>	<b>-2,04</b>	<b>15.471.651,54</b>	<b>6,68</b>		
		Renda Variável	14,15	-0,08	5,39	-2,04	15.471.651,54	6,68		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,26%

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	15,12	0,65	0,57	41,02	5.239.190,44	2,26	2.663.493.555,95	0,20
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>15,12</b>	<b>0,65</b>	<b>0,57</b>	<b>41,02</b>	<b>5.239.190,44</b>	<b>2,26</b>		
Investimentos no Exterior			15,12	0,65	0,57	41,02	5.239.190,44	2,26		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,30%

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	12,34	1,02	2,48	21,25	5.320.818,06	2,30	1.941.348.598,98	0,27
GRAPHEN	RJI	LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	1,78	-0,02	-0,39	-4,69	15.923,31	0,01	1.313.363,76	1,21
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>12,27</b>	<b>1,01</b>	<b>2,48</b>	<b>21,10</b>	<b>5.336.741,37</b>	<b>2,30</b>		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GENIAL	RJI	GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
<b>Sub-total Artigo 10º II</b>			<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>		

<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>12,27</b>	<b>1,01</b>	<b>2,48</b>	<b>21,10</b>	<b>5.336.741,37</b>	<b>2,30</b>		
-----------------------------------	--	--	--------------	-------------	-------------	--------------	---------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,95%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GRAPHEN	RJI	HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	5,40	0,14	0,14	-3,65	2.190.127,62	0,95	68.624.901,54	3,19
<b>Sub-total Artigo 11º</b>			<b>5,40</b>	<b>0,14</b>	<b>0,14</b>	<b>-3,65</b>	<b>2.190.127,62</b>	<b>0,95</b>		
Fundos Imobiliários			5,40	0,14	0,14	-3,65	2.190.127,62	0,95		
<b>Total</b>			<b>1,60</b>	<b>0,01</b>	<b>1,09</b>	<b>5,51</b>	<b>231.532.678,93</b>	<b>100,00</b>		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	10.005.084,10	4,32	0,00	15,00	50,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	172.199.631,53	74,37	0,00	53,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	18.739.781,96	8,09	0,00	8,00	50,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.485.554,84	0,64	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	864.915,53	0,37	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>203.294.967,96</b>	<b>87,80</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	15.471.651,54	6,68	0,00	12,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>15.471.651,54</b>	<b>6,68</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	5.239.190,44	2,26	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>5.239.190,44</b>	<b>2,26</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	5.336.741,37	2,30	0,00	2,00	5,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	0,00	0,00	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>5.336.741,37</b>	<b>2,30</b>					15,00
<b>Fundos Imobiliários</b>								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.190.127,62	0,95	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Fundos Imobiliários</b>	<b>2.190.127,62</b>	<b>0,95</b>					5,00
<b>Total</b>		<b>231.532.678,93</b>	<b>100,00</b>					

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades por Artigo**

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,07 57,93	0,07 57,93				6.825,94	6.825,94
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,78 89,75	5,82 82,01	2,21 85,47	4,23 80,93	9,48 84,53	1.407.992,55	10.435.573,42
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,33 38,45	2,17 30,56	1,29 49,83	1,78 34,04	3,24 28,92	57.078,87	319.375,04
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-3,62 -417,24	-7,39 -104,08	-4,66 -180,34	-6,12 -117,16	-9,19 -81,97	-55.789,35	-118.485,05
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	-0,73 -84,04	-6,53 -91,95	-1,90 -73,69	-5,99 -114,68	-8,47 -75,55	-6.419,33	-62.502,70
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,39 -1,15	-2,04 -3,40	11,45 0,06	0,46 -4,95	13,30 -4,20	791.280,68	-322.880,49
Artigo 9º III % do CDI	0,57 65,18	41,02 577,98	13,95 539,52	26,91 514,78	46,38 413,71	68.911,45	1.093.970,20
Artigo 10º I % do CDI	2,48 286,06	21,10 297,28	7,91 306,14	12,74 243,64	30,65 273,42	196.711,45	679.414,57
Artigo 11º % do CDI	0,14 16,30	-3,65 -51,47	-3,86 -149,36	-3,81 -72,94	-6,29 -56,13	3.092,11	-83.150,65
<b>PORTO FERREIRA - CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>2.469.684,37</b>	<b>11.948.140,28</b>

**RESULTADO POR ATIVO**

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150545 (6,100000%)	0,00	4.998.699,42	0,00	0,00	5.002.105,39	3.405,97	3.405,97
NTN-B 150850 (6,120000%)	0,00	4.999.558,74	0,00	0,00	5.002.978,71	3.419,97	3.419,97
	0,00	9.998.258,16	0,00	0,00	10.005.084,10	6.825,94	

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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	4.096.897,58	0,00	0,00	0,00	4.135.687,79	38.790,21	135.687,79

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	9.040.073,81	0,00	-2.000.000,00	0,00	7.098.773,79	58.699,98	419.457,69
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	19.719.525,83	0,00	0,00	0,00	19.891.118,49	171.592,66	1.314.192,15
FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	30.235.723,06	0,00	0,00	0,00	30.439.657,67	203.934,61	1.068.731,82
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.042.002,85	0,00	-2.000.000,00	0,00	7.089.754,46	47.751,61	393.019,97
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.264.961,35	0,00	0,00	0,00	16.359.400,53	94.439,18	739.820,63
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	81.097.158,66	2.318.804,76	-13.008.000,00	0,00	71.076.398,73	668.435,31	5.157.693,94
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5.177.824,27	0,00	0,00	0,00	5.212.865,10	35.040,83	202.685,23
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	2.541.345,44	0,00	0,00	0,00	2.559.258,71	17.913,27	59.258,71
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	8.265.321,37	0,00	0,00	0,00	8.336.716,26	71.394,89	979.962,41
	185.480.834,22	2.318.804,76	-17.008.000,00	0,00	172.199.631,53	1.407.992,55	

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 REF DI LP PERFIL FIC FI	7.355,87	0,00	0,00	0,00	7.421,47	65,60	499,18
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	4.640.377,79	4.000.000,00	0,00	0,00	8.718.057,37	77.679,58	218.057,37
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5.096.332,75	0,00	0,00	0,00	5.132.092,86	35.760,11	132.092,86
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	4.938.636,68	0,00	0,00	0,00	4.882.210,26	-56.426,42	-31.274,37
	14.682.703,09	4.000.000,00	0,00	0,00	18.739.781,96	57.078,87	

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I	367.607,60	0,00	0,00	0,00	364.078,27	-3.529,33	-28.512,07
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1.173.736,59	0,00	0,00	0,00	1.121.476,57	-52.260,02	-89.972,98
	1.541.344,19	0,00	0,00	0,00	1.485.554,84	-55.789,35	

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
PIATÃ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	880.607,14	0,00	0,00	9.272,28	864.915,53	-6.419,33	-62.502,70

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	880.607,14	0,00	0,00	9.272,28	864.915,53	-6.419,33	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	5.276.970,20	0,00	0,00	0,00	5.523.868,42	246.898,22	-269.432,78
XP INVESTOR FI DE ACOES	9.403.400,66	0,00	0,00	0,00	9.947.783,12	544.382,46	-53.447,71
	14.680.370,86	0,00	0,00	0,00	15.471.651,54	791.280,68	

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	4.170.278,99	1.000.000,00	0,00	0,00	5.239.190,44	68.911,45	1.093.970,20
	4.170.278,99	1.000.000,00	0,00	0,00	5.239.190,44	68.911,45	

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	3.124.044,51	2.000.000,00	0,00	0,00	5.320.818,06	196.773,55	680.198,46
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	15.985,41	0,00	0,00	0,00	15.923,31	-62,10	-783,89
	3.140.029,92	2.000.000,00	0,00	0,00	5.336.741,37	196.711,45	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	2.187.035,51	0,00	0,00	0,00	0,00	2.190.127,62	3.092,11	-92.235,50
	2.187.035,51	0,00	0,00	0,00	0,00	2.190.127,62	3.092,11	

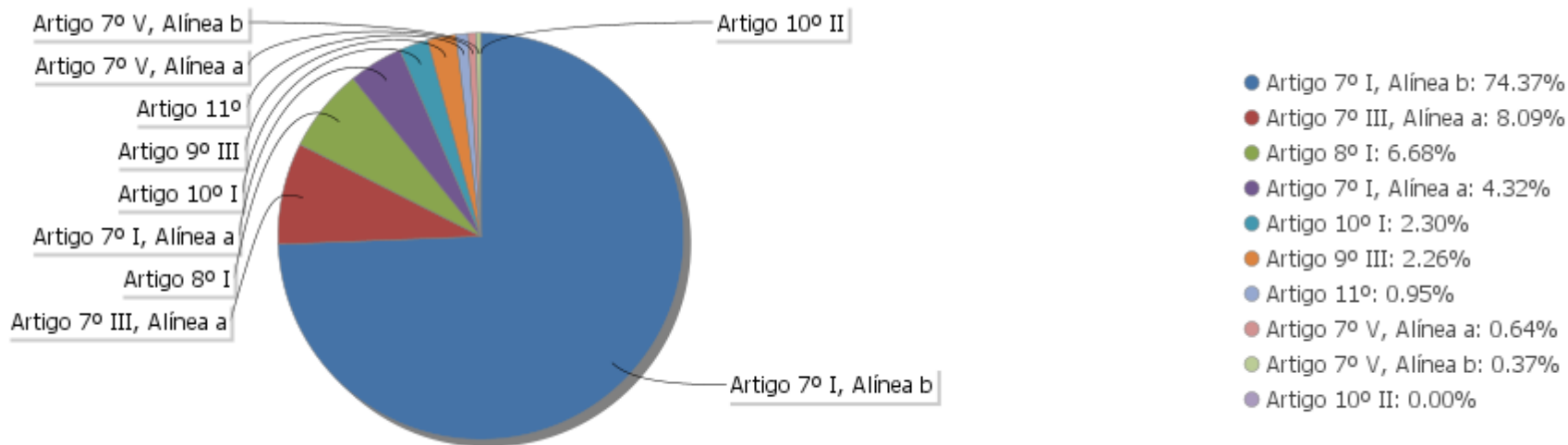
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

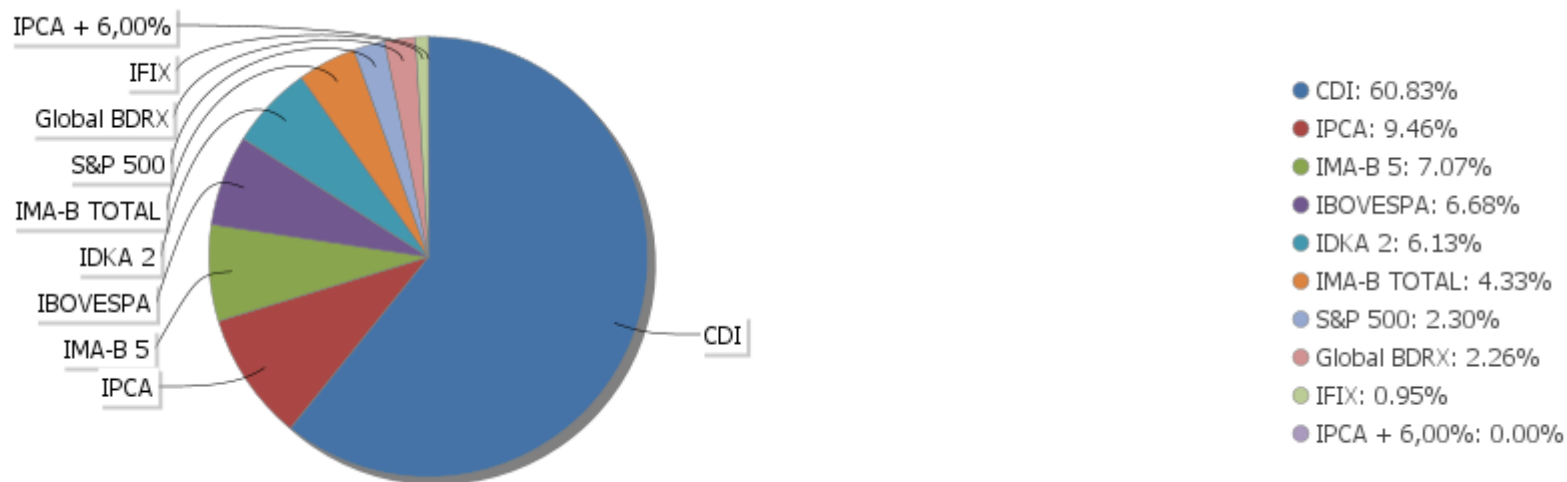
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	185.340.811,37	80,05	50,00	185.340.811,37	80,05	50,00
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00		185.340.811,37	80,05	50,00
acima de 365 dias	46.191.867,56	19,95		231.532.678,93	100,00	50,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

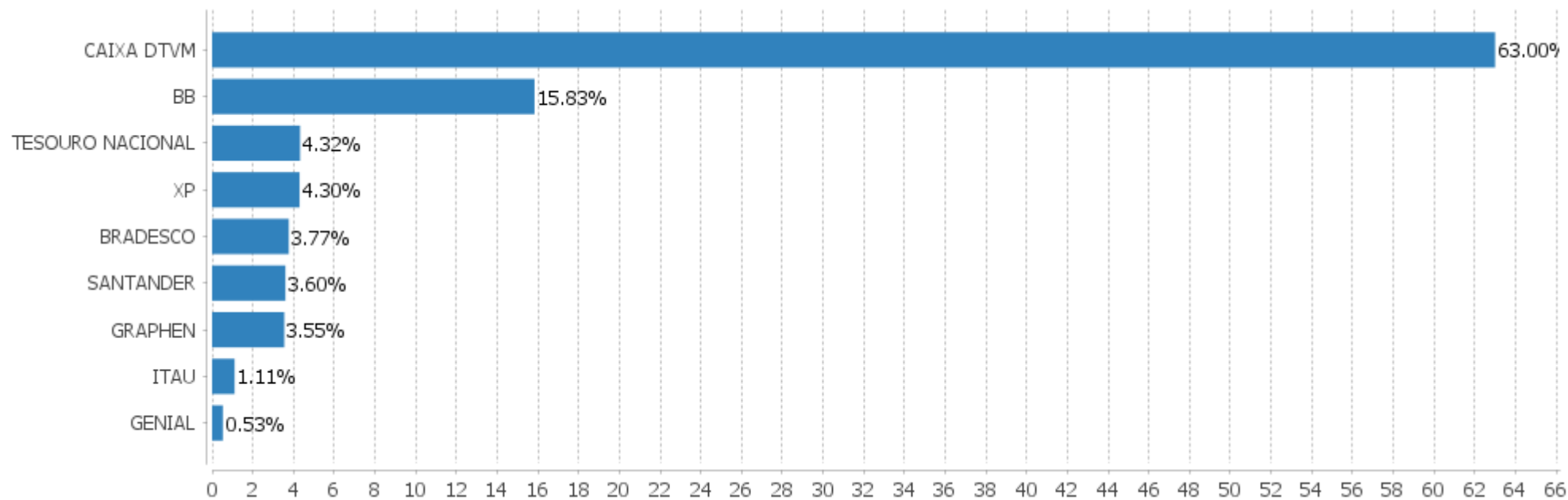


Alocação Por Estratégia



### 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	0,47	0,82	0,65	-0,18	0,72	0,72	1,10	1,09					5,51
IPCA + 4,96%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60	0,82	0,40					6,25
p.p. indexador	-0,37	-0,38	0,11	-0,99	-0,15	0,12	0,27	0,69					-0,74
2023	1,28	-0,12	0,69	0,98	1,45	1,62	1,03	0,51	0,46	0,02	2,16	1,45	12,13
IPCA + 4,81%	0,94	1,18	1,14	0,95	0,64	0,31	0,51	0,66	0,63	0,63	0,65	0,94	9,59
p.p. indexador	0,33	-1,29	-0,46	0,03	0,81	1,30	0,52	-0,15	-0,18	-0,61	1,50	0,52	2,54
2022	0,90	0,32	2,54	-2,42	1,29	-1,90	1,12	1,70	0,58	2,21	-1,08	-0,13	5,11
IPCA + 4,84%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,29	0,07	0,10	0,97	0,79	1,04	10,88
p.p. indexador	-0,03	-1,05	0,50	-3,84	0,40	-2,97	1,41	1,63	0,48	1,24	-1,87	-1,17	-5,77
2021	-0,87	-1,11	0,42	1,13	1,62	0,49	-1,14	-1,30	-1,12	-2,34	1,30	0,98	-2,01
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,67	1,37	1,22	15,99
p.p. indexador	-1,54	-2,35	-0,99	0,40	0,35	-0,48	-2,56	-2,64	-2,73	-4,01	-0,07	-0,24	-18,00
2020	0,22	-1,14	-7,62	-0,32	1,94	1,77	2,89	0,49	-1,40	-0,10	2,74	3,33	2,34
IPCA + 5,86%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,62
p.p. indexador	-0,49	-1,80	-8,19	-0,46	1,87	1,03	2,01	-0,22	-2,52	-1,44	1,40	1,48	-8,28
2019	3,17	0,13	0,33	0,93	1,68	2,27	1,00	0,16	1,69	1,80	0,46	2,27	17,05
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	2,34	-0,76	-0,87	-0,13	1,04	1,82	0,27	-0,46	1,25	1,17	-0,52	0,63	6,46
2018	2,72	-0,87	0,78	0,37	-2,04	-0,27	2,02	-0,90	0,55	4,00	0,72	0,93	8,16
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	1,92	-1,61	0,20	-0,34	-2,93	-2,02	1,18	-1,34	-0,37	3,04	0,46	0,31	-1,76

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	37	46,25
Meses abaixo - Meta Atuarial	43	53,75

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,00	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-7,62	2020-03

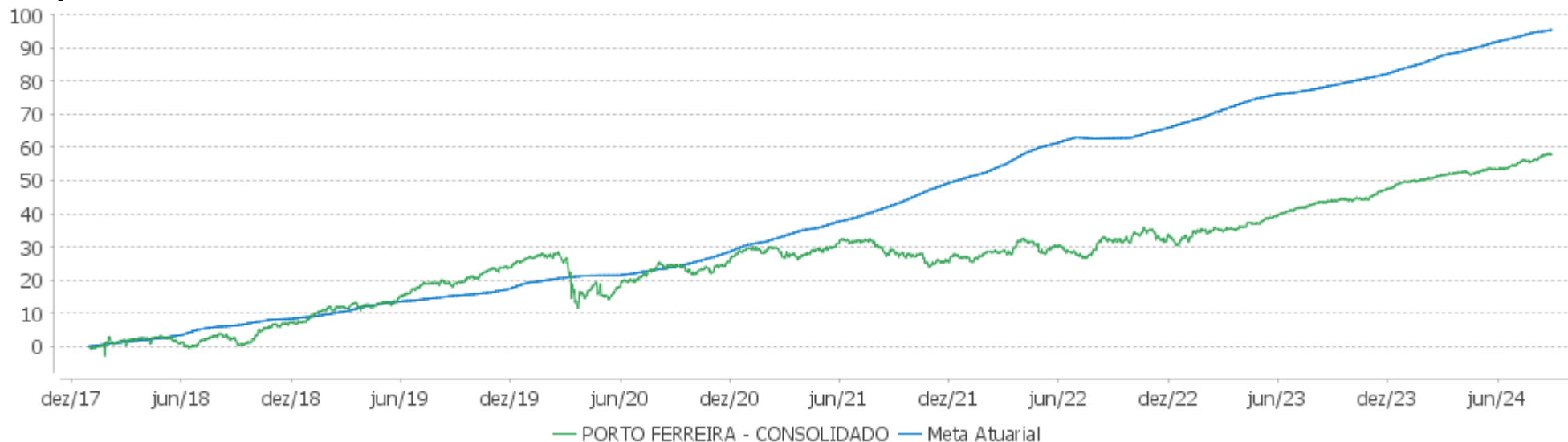
Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,93	1,83	1,10	1,61
06 meses	4,16	4,11	0,05	1,54
12 meses	9,87	9,32	0,56	1,60
24 meses	20,14	19,84	0,30	3,40
36 meses	22,83	36,85	-14,02	4,12
48 meses	27,43	58,41	-30,99	4,37
60 meses	32,65	71,86	-39,21	6,13
Desde 29/12/2017	57,88	101,37	-43,49	6,25

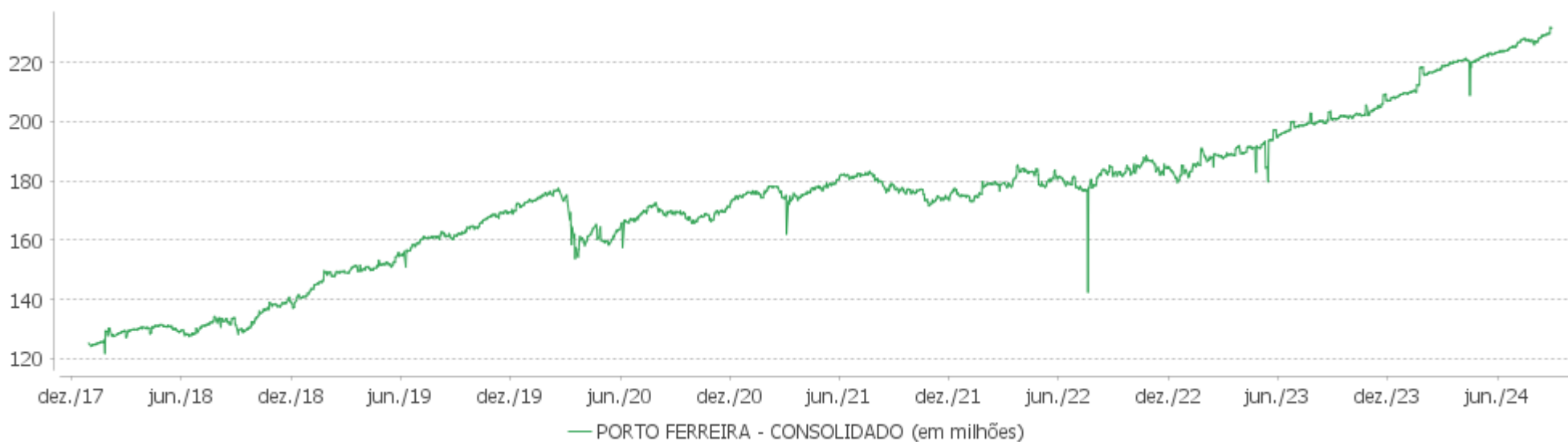


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

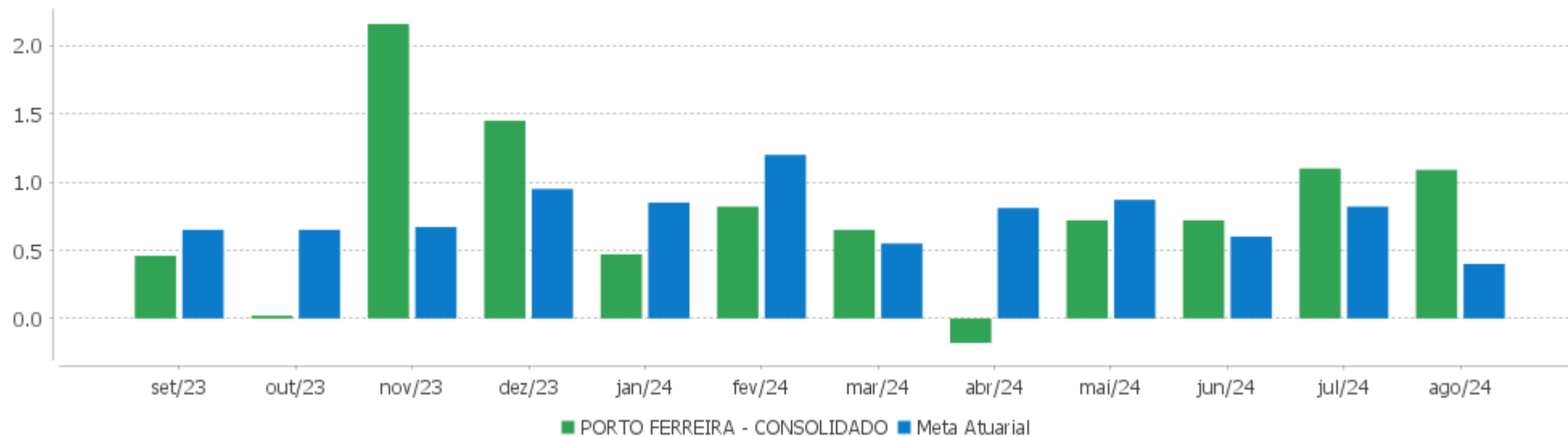


Patrimônio Líquido



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
PIATÃ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO % do CDI	-0,73 -84,04	-4,26 -60,02	-1,90 -73,69	-3,72 -71,08	-6,25 -55,76	-7,98 -30,37	-63,61 -162,41
NTN-B 150850 (6,120000%) Var. IPCA p.p.	-2,14 -2,12	1,31 -1,54	-0,51 -1,08	2,19 0,61	4,41 0,17		
NTN-B 150545 (6,100000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,78	4,32 1,47	2,44 1,87	2,17 0,59	4,39 0,16		
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,58 -0,01	4,74 -0,14	1,86 -0,05	3,45 -0,11	7,91 -0,23	20,66 -0,42	32,43 -0,62
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IDKA 2 p.p.	0,64 0,04	4,56 -0,04	1,66 0,13	3,36 0,03	7,81 -0,13	20,28 -0,39	31,43 -0,62
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,68 0,70	4,05 1,19	1,82 1,25	2,80 1,22	7,52 3,28	22,31 13,27	32,69 14,13
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,59 -0,00	4,32 -0,29	1,52 -0,01	3,11 -0,22	7,68 -0,26	20,09 -0,58	31,00 -1,05
FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA % do CDI	0,67 77,75	3,58 50,41	1,56 60,41	2,42 46,38	6,47 57,76	19,56 74,41	
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,95 0,97	5,91 3,05	2,38 1,81	4,21 2,63	9,96 5,72	25,37 16,33	35,11 16,55
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,86 99,68	6,88 96,89	2,58 99,68	5,04 96,48	10,90 97,28	25,87 98,44	38,93 99,41
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,87 100,31	7,07 99,68	2,59 100,05	5,21 99,68	11,15 99,47	26,18 99,62	39,14 99,95
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA Var. IPCA p.p.	0,70 0,72	3,53 0,68	1,38 0,81	2,47 0,89	7,38 3,15	21,12 12,08	33,21 14,65
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,86 99,57	7,01 98,81	2,56 99,10	5,16 98,77	11,05 98,57	25,97 98,82	38,79 99,04
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I % do CDI	-0,96 -110,67	-9,26 -130,49	-2,83 -109,64	-5,12 -98,00	-10,40 -92,74	197.898.284,42 752.993.285,45	197.898.284,42 505.319.211,81
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	-4,45 -513,25	-7,43 -104,65	-5,24 -202,72	-6,45 -123,30	-8,97 -80,00	-9,93 -37,78	-6,33 -16,16
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,91 105,43	7,71 108,70	2,77 107,16	5,61 107,31	12,12 108,13	27,88 106,10	41,82 106,78
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	0,70	1,46	1,68	1,36	5,23	19,40	25,80

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,18	-0,04	0,05	-0,03	-0,08	-0,42	-0,65
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,89 102,80	7,21 101,61	2,68 103,55	5,34 102,13	11,32 100,95	26,39 100,41	39,64 101,22
LME REC IMA B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,14 -1,66	-0,64 -2,13	-1,04 -2,66	-1,01 -2,41	0,40 -4,91	6,49 -13,32	7,65 -18,81
XP INVESTOR FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	5,79 -0,75	-0,53 -1,89	12,69 1,30	-0,05 -5,46	15,78 -1,73	18,08 -6,10	24,47 9,97
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	4,68 -1,86	-4,65 -6,01	9,30 -2,09	1,39 -4,02	9,11 -8,40	10,30 -13,87	4,71 -9,79
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	0,57 0,02	41,02 -1,23	13,95 0,21	26,91 -0,81	46,38 -1,62	68,28 -2,86	40,40 -4,54
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V % do CDI	-0,39 -44,78	-4,69 -66,11	-1,16 -44,70	-2,27 -43,41	-6,06 -54,02	-12,02 -45,72	-16,82 -42,95
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	2,48 0,31	21,25 -17,11	7,95 -7,54	12,81 -12,99	30,89 -13,11	61,90 5,93	53,31 15,97
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,00 -0,49	0,00 -6,95	0,00 -2,09	0,00 -4,63	0,00 -10,44	0,00 -22,43	0,00 -41,11
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO Var. IFIX p.p.	0,14 -0,71	-3,55 -6,03	-3,86 -4,19	-3,71 -4,71	-6,19 -11,81	-0,14 -14,16	4,07 -19,34
PORTO FERREIRA - CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,96% p.p.	1,09 0,69	5,51 -0,74	2,93 1,10	4,16 0,05	9,87 0,51	20,14 0,08	22,83 -14,17
CDI	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	39,16
IBOVESPA	6,54	1,36	11,39	5,41	17,51	24,18	14,50
INPC + 6,00%	0,37	6,90	1,89	4,44	9,88	21,17	39,78
IPCA + 6,00%	0,49	6,95	2,09	4,63	10,44	22,43	41,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 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
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	Não se aplica	Não se aplica				
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Não se aplica	Não se aplica				
INCENTIVO FIDC MULTISETORIAL I	Não se aplica	Não se aplica				
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,00
LEME MULTISETORIAL IPCA FIDC	D+0	D+0				
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1008 du	D+1009 du	PERÍODO SEMESTRAL, C /VENCIMENTO NO ÚLTIMO DIA ÚTIL DE	0,00

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					DEZEMBRO E JUNHO.	
PIATÃ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+0	D+0	D+0 ou D+1080 (isento de taxa de resgate)	D+1 du ou D+1081 (isento de taxa de resgate)		1,40
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
XP INVESTOR FI DE ACOES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	Para informações adicionais, vide o Regulamento	2,00

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	0,77	6,30	2,36	4,62	10,39	25,57	36,92	39,98	47,06
IRF-M 1+	0,60	2,39	1,43	1,43	7,39	24,61	30,60	26,26	39,69
IRF-M TOTAL	0,66	3,54	1,70	2,39	8,26	24,46	32,14	30,49	41,85
IMA-B 5	0,59	4,88	1,91	3,56	8,14	21,08	33,04	39,39	52,27
IMA-B 5+	0,77	-1,21	1,69	-0,25	3,11	18,58	20,29	22,46	28,23
IMA-B TOTAL	0,52	1,49	1,63	1,40	5,32	19,81	26,45	30,58	39,25
IMA-GERAL TOTAL	0,79	4,63	2,21	3,49	8,81	23,74	33,48	35,98	44,83
IDKA 2	0,60	4,60	1,53	3,33	7,94	20,67	32,05	38,75	52,22
IDKA 20	0,42	-6,26	1,27	-3,24	-0,28	18,04	10,08	10,85	10,58
CDI	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	39,16	42,92	48,46

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,54	1,36	11,39	5,41	17,51	24,18	14,50	36,87	34,48
IBRX 100	6,60	1,79	11,34	5,58	18,00	22,90	12,85	36,41	34,88
IBRX 50	6,51	3,14	11,66	6,63	19,46	24,91	15,69	41,27	38,19
SMALL CAP	4,51	-9,69	5,65	-3,81	-2,18	-4,07	-25,42	-12,75	-7,50
Índice Consumo - ICON	6,25	-6,83	9,13	1,55	0,43	-15,02	-41,58	-41,33	-37,96
Índice Dividendos - IDIV	6,69	5,00	10,87	7,85	21,94	34,91	40,69	67,98	61,87

**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	2,18	38,35	15,49	25,80	44,00	55,98	37,34	66,82	163,79

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,86	2,48	0,33	1,00	5,63	14,02	23,41	21,98	27,74

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,29	33,98	14,52	24,30	39,63	48,51	23,68	47,36	123,03

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,02	2,85	0,57	1,58	4,24	9,04	18,56	30,03	33,20
INPC	-0,14	2,80	0,37	1,40	3,71	7,92	17,44	29,68	33,49
IGPM	0,29	2,00	1,72	2,46	4,26	-3,24	5,07	37,76	55,70
SELIC	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	39,16	42,92	48,46

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,32	5,59	1,59	3,62	8,37	17,88	33,30	52,03	61,96
IPCA + 5,00%	0,41	6,27	1,84	4,13	9,41	20,15	37,17	57,93	69,87
IPCA + 5,50%	0,45	6,61	1,97	4,38	9,92	21,29	39,13	60,95	73,94
IPCA + 5,89%	0,48	6,88	2,07	4,58	10,33	22,18	40,67	63,33	77,17
IPCA + 6,00%	0,49	6,95	2,09	4,63	10,44	22,43	41,11	64,01	78,09
INPC + 4,00%	0,20	5,54	1,39	3,44	7,82	16,67	32,04	51,61	62,31
INPC + 6,00%	0,37	6,90	1,89	4,44	9,88	21,17	39,78	63,57	78,48



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150545 (6,100000%)	5.002.105,39	6,100000	4.921.215,41	6,243000	-80.889,98
NTN-B 150850 (6,120000%)	5.002.978,71	6,120000	4.914.836,09	6,257400	-88.142,62

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
92	01/08/2024	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	4.000.000,00	0,00	226.314,34000000	17,6745318000
93	01/08/2024	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	2.000.000,00	628.077,57829400	3,1843200000
94	01/08/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	3.000.000,00	527.244,01631000	5,6899650000
95	02/08/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	2.000.000,00	517.275,75384500	3,8664097150
96	02/08/2024	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.000.000,00	0,00	842.297,83904200	2,3744570000
97	02/08/2024	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1.000.000,00	0,00	121.215,81748644	8,2497484300
98	05/08/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	7.500,00	1.316,93491800	5,6950430000
99	09/08/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	193.404,62	0,00	33.911,62672800	5,7031950000
100	09/08/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.785,42	0,00	1.189,75767000	5,7031950000
101	09/08/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19.066,65	0,00	3.343,15239000	5,7031950000
102	21/08/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	500,00	87,40197300	5,7206940000
103	27/08/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	10.000.000,00	1.745.179,98750200	5,7300680000
104	27/08/2024	NTN-B 150545 (6,100000%)	4.998.699,42	0,00	1.147,00000000	4.358,0640104620
105	27/08/2024	NTN-B 150850 (6,120000%)	4.999.558,74	0,00	1.168,00000000	4.280,4441267120
106	28/08/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.761.683,13	0,00	307.340,07242100	5,7320320000
107	28/08/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	33.000,00	0,00	5.757,12068500	5,7320320000
108	28/08/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	304.864,94	0,00	53.186,18946900	5,7320320000
<b>Total</b>			<b>19.317.062,92</b>	<b>17.008.000,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 2.002.457,80 Value-At-Risk: 0,86%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,29	0,52	5,00	0,32	-0,16	0,66	203.294.967,96	87,80
Artigo 8º	14,94	7,48	20,00	0,43	0,30	5,39	15.471.651,54	6,68
Artigo 9º	19,49	9,37	20,00	0,02	-0,02	0,57	5.239.190,44	2,26
Artigo 10º	19,48	7,02	20,00	0,09	NaN	NaN	5.336.741,37	2,30
Artigo 11º	0,48	0,18	20,00	0,00	-1,52	0,14	2.190.127,62	0,95
PORTO FERREIRA - CONSOLIDADO		0,86		0,86			231.532.678,93	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,52%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545 (6,100000%)	0,26	0,22	-0,00	0,24	-0,41	0,76	5.002.105,39	2,16
NTN-B 150850 (6,120000%)	9,95	0,25	-0,00	0,24	-0,30	-2,14	5.002.978,71	2,16
<b>Sub-total</b>	0,70	0,17	-0,00		-0,07	0,07	10.005.084,10	4,32

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,86	0,44	0,01	0,45	0,09	0,95	4.135.687,79	1,79
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,63	1,26	0,03	0,20	-0,09	0,64	7.098.773,79	3,07
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,01	0,00	0,00	0,00	0,19	0,87	19.891.118,49	8,59
FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	3,41	1,68	0,15	1,68	-0,06	0,67	30.439.657,67	13,15
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,83	1,36	0,03	0,24	-0,10	0,59	7.089.754,46	3,06
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,29	1,09	0,05	0,01	-0,13	0,58	16.359.400,53	7,07
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,08	0,05	0,01	0,05	-0,03	0,86	71.076.398,73	30,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,35	0,64	0,01	0,64	-0,14	0,68	5.212.865,10	2,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	1,46	0,95	0,01	0,95	-0,11	0,70	2.559.258,71	1,11
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,02	0,01	-0,00	0,00	-0,24	0,86	8.336.716,26	3,60
<b>Sub-total</b>	1,12	0,56	0,29		-0,08	0,78	172.199.631,53	74,37

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,02	0,02	0,00	0,02	1,07	0,89	7.421,47	0,00
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,08	0,05	-0,00	0,05	0,58	0,91	8.718.057,37	3,77
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,16	2,21	0,03	0,18	-0,03	0,70	5.132.092,86	2,22
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	5,24	0,53	0,00	1,88	-0,38	-1,14	4.882.210,26	2,11
<b>Sub-total</b>	2,33	0,68	0,03		-0,23	0,33	18.739.781,96	8,09

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I	3,27	0,20	0,00	0,20	-0,56	-0,96	364.078,27	0,16
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	15,41	0,29	0,00	0,29	-0,35	-4,45	1.121.476,57	0,48
<b>Sub-total</b>	12,48	0,25	0,00		-0,36	-3,62	1.485.554,84	0,64

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PIATÁ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,89	0,50	-0,00	0,50	-1,80	-0,73	864.915,53	0,37
<b>Sub-total</b>	0,89	0,50	-0,00		-1,80	-0,73	864.915,53	0,37

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,48%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	12,48	6,23	0,12	1,75	0,31	4,68	5.523.868,42	2,39
XP INVESTOR FI DE ACOES	17,39	8,58	0,31	4,70	0,28	5,79	9.947.783,12	4,30
<b>Sub-total</b>	14,94	7,48	0,43		0,30	5,39	15.471.651,54	6,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados Value-At-Risk: 7,02%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	19,55	7,04	0,09	6,23	0,08	2,48	5.320.818,06	2,30
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	0,00	0,00	-0,00	0,00	-2.800,05	-0,39	15.923,31	0,01
<b>Sub-total</b>	19,48	7,02	0,09		0,08	2,48	5.336.741,37	2,30

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	0,00	NaN	0,00	NaN	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>Sub-total</b>	0,00	NaN	0,00		0,00	NaN	0,00	0,00

Investimentos no Exterior Value-At-Risk: 9,37%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	19,49	9,37	0,02	1,21	-0,02	0,57	5.239.190,44	2,26
<b>Sub-total</b>	19,49	9,37	0,02		-0,02	0,57	5.239.190,44	2,26

Fundos Imobiliários Value-At-Risk: 0,18%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	0,48	0,18	0,00	2,42	-1,52	0,14	2.190.127,62	0,95
<b>Sub-total</b>	0,48	0,18	0,00		-1,52	0,14	2.190.127,62	0,95

(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 (%)

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

- Referente ao mês de Agosto de 2024, cabe ressaltar que:

- REGULAR POR ANÁLISE - DAIR;
- QUANTO AO DESENQUADRAMENTO EM TELA, CUMPRE-NOS INFORMAR QUE TRATA-SE DE UMA APLICAÇÃO REALIZADA EM 31/03/2010, ANTES MESMO DA RESOLUÇÃO 3922/2010 (O QUE JUSTIFICA O PERCENTUAL APLICADO EM RELAÇÃO AO PL DO FUNDO), EM UM FUNDO FECHADO COM CARÊNCIA PARA A LIQUIDAÇÃO DA OPERAÇÃO. CARÊNCIA ENCERRADA EM DEZEMBRO DE 2019, PORÉM O MESMO ENCONTRA-SE FECHADO PARA RESGATES DESDE 06/07/2017. O FUNDO ENCONTRA-SE ATUALMENTE EM RECUPERAÇÃO DE CRÉDITOS, O QUE JUSTIFICA A VALORIZAÇÃO DAS COTAS, BEM COMO, O DESENQUADRAMENTO EM DISCUSSÃO.