



LDB
EMPRESAS

PORTO FERREIRA
MAIO 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 31.05.2023.

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

90,93%

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				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA	1,47	0,00	0,63	5,28	0,00	0,00	4.284.225.708,38	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	4,61	-0,03	1,55	8,17	29.615.831,61	15,22	387.262.168,42	7,65
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,03	0,05	1,13	5,32	20.389.294,04	10,48	7.062.035.271,33	0,29
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,07	0,06	1,22	5,36	63.465.056,63	32,61	15.093.190.243,42	0,42
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,02	0,05	1,14	1,89	17.320.967,46	8,90	28.911.825.239,48	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,45	0,00	0,63	5,91	14.775.134,05	7,59	8.623.099.025,61	0,17
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,69	0,01	0,39	5,49	9.610.984,38	4,94	7.232.116.284,73	0,13
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,79	0,01	0,36	5,50	9.613.259,31	4,94	6.636.813.957,94	0,14
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,62	0,04	1,81	6,03	4.676.840,26	2,40	5.078.181.389,68	0,09
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,03	0,03	1,13	5,84	169.467.367,74	87,08		

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				
GRAPHEN	RJI	LME REC IMA B FI RENDA FIXA	1,20	0,02	0,65	2,44	4.806.306,01	2,47	74.099.265,39	6,49
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	1,15	5,29	6.451,00	0,00	15.420.425.695,62	0,00
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			3,74	0,02	0,65	2,79	4.812.757,01	2,47		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GENIAL	RJI	INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I	16,20	0,00	0,00	-2,22	410.063,36	0,21	6.504.927,18	6,30
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	0,93	-0,29	-0,29	-0,68	1.245.243,95	0,64	74.029.375,82	1,68
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			4,16	-0,34	-0,34	-1,37	1.655.307,31	0,85		

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	PIATÃ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	75,19	0,57	0,57	-0,51	1.012.712,24	0,52	22.608.395,89	4,48
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			75,19	0,57	0,57	-0,51	1.012.712,24	0,52		
Renda Fixa			3,10	0,03	1,10	5,52	176.948.144,30	90,93		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

5,92%

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	21,44	-0,51	3,08	-3,48	4.000.946,57	2,06	1.275.029.732,58	0,31
BRAM	BRADERCO	BRADERCO FIA DIVIDENDOS	19,33	0,00	2,97	-1,66	0,00	0,00	566.825.917,03	0,00
BRAM	BEM	BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	25,93	0,00	4,59	-6,65	0,00	0,00	732.883.551,57	0,00
XP	SANTANDER	XP INVESTOR FI DE ACOES	20,71	0,52	5,21	3,80	7.518.009,89	3,86	200.254.698,28	3,75
BRAM	BEM	BRADERCO F I A SELECTION	21,12	0,00	3,88	-4,12	0,00	0,00	414.831.621,42	0,00
Sub-total Artigo 8º I			20,44	0,16	4,43	-0,69	11.518.956,46	5,92		
Renda Variável			20,44	0,16	4,43	-0,69	11.518.956,46	5,92		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,77%

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	24,59	0,03	5,80	14,00	1.501.333,59	0,77	2.053.133.646,70	0,07
Sub-total Artigo 9º III			24,59	0,03	5,80	14,00	1.501.333,59	0,77		
Investimentos no Exterior			24,59	0,03	5,80	14,00	1.501.333,59	0,77		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,15%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GRAPHEN	RJI	LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	2,29	-0,02	-0,41	-1,80	17.136,14	0,01	1.413.398,72	1,21
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	20,97	-0,46	1,21	12,31	2.226.094,31	1,14	1.555.010.010,21	0,14
Sub-total Artigo 10º I			20,78	-0,46	1,20	12,18	2.243.230,45	1,15		

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	-8.550.198,79	
Sub-total Artigo 10º II			0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		

Investimentos Estruturados			25,14	-0,46	1,20	12,18	2.243.230,45	1,15		
-----------------------------------	--	--	--------------	--------------	-------------	--------------	---------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,23%

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	3,13	-0,01	-0,01	0,37	2.395.077,72	1,23	75.046.755,67	3,19
Sub-total Artigo 11º			3,13	-0,01	-0,01	0,37	2.395.077,72	1,23		
Fundos Imobiliários			3,13	-0,01	-0,01	0,37	2.395.077,72	1,23		
Total			5,13	0,03	1,45	4,35	194.606.742,52	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 b	Fundos 100% Títulos Públicos	169.467.367,74	87,08	5,00	60,00	90,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	4.812.757,01	2,47	5,00	13,00	50,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.655.307,31	0,85	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	1.012.712,24	0,52	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	176.948.144,30	90,93					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	11.518.956,46	5,92	5,00	8,00	20,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	11.518.956,46	5,92					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	1.501.333,59	0,77	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	1.501.333,59	0,77					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	2.243.230,45	1,15	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	0,00	0,00	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	2.243.230,45	1,15					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.395.077,72	1,23	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	2.395.077,72	1,23					5,00
Total		194.606.742,52	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 b % do CDI	1,13 100,78	5,84 108,79	3,53 108,73	6,38 97,43	9,58 71,12	1.834.843,12	8.233.170,66
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,65 58,11	2,79 51,97	1,91 58,63	2,86 43,68	5,15 38,23	31.210,19	212.288,14
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,34 -29,87	-1,37 -25,60	-1,09 -33,56	-1,47 -22,49	-1,07 -7,92	-5.573,70	-19.746,79
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,57 50,93	-0,51 -9,41	-0,05 -1,50	-3,25 -49,60	-10,07 -74,73	5.760,99	-5.140,49
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	4,43 0,70	-0,69 0,58	3,07 -0,17	-2,99 0,70	-3,32 -0,61	800.379,47	-801.194,20
Artigo 9º III % do CDI	5,80 516,77	14,00 260,69	8,47 260,42	8,53 130,21	13,81 102,47	82.369,88	184.332,38
Artigo 10º I % do CDI	1,20 106,74	12,18 226,90	7,23 222,55	6,71 102,41	10,45 77,53	26.578,10	243.600,88
Artigo 11º % do CDI	-0,01 -0,93	0,37 6,85	0,12 3,69	0,70 10,64	4,22 31,32	-250,91	8.800,28
PORTO FERREIRA (Total)						2.775.317,14	8.056.110,86

RESULTADO POR ATIVO

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 IDKA2	9.573.761,02	0,00	0,00	0,00	9.610.984,38	37.223,36	499.897,29
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	17.125.703,60	0,00	0,00	0,00	17.320.967,46	195.263,86	320.967,46
FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA	12.695.741,68	0,00	-12.776.299,88	0,00	0,00	80.558,20	640.379,58
FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	30.038.036,52	0,00	0,00	885.582,26	29.615.831,61	463.377,35	2.303.188,53
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.578.735,03	0,00	0,00	0,00	9.613.259,31	34.524,28	500.916,71
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	14.682.553,08	0,00	0,00	0,00	14.775.134,05	92.580,97	824.636,49
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	39.786.296,47	25.698.606,60	-2.639.437,36	0,00	63.465.056,63	619.590,92	1.821.312,46
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	4.593.917,59	0,00	0,00	0,00	4.676.840,26	82.922,67	265.928,88
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	20.160.492,53	0,00	0,00	0,00	20.389.294,04	228.801,51	788.250,84

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					169.467.367,74	1.834.843,12	

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	6.377,60	0,00	0,00	0,00	6.451,00	73,40	323,88
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	4.775.169,22	0,00	0,00	0,00	4.806.306,01	31.136,79	114.496,88
					4.812.757,01	31.210,19	

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	411.958,18	0,00	0,00	0,00	410.063,36	-1.894,82	-11.264,04
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1.248.922,83	0,00	0,00	0,00	1.245.243,95	-3.678,88	-8.482,75
					1.655.307,31	-5.573,70	

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	1.006.951,25	0,00	0,00	0,00	1.012.712,24	5.760,99	-5.140,49
					1.012.712,24	5.760,99	

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	3.881.468,38	0,00	0,00	0,00	4.000.946,57	119.478,19	-144.352,20
BRADESCO F I A SELECTION	3.865.555,81	0,00	-4.015.490,54	0,00	0,00	149.934,73	-172.688,57
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	1.095.915,16	0,00	-1.146.184,96	0,00	0,00	50.269,80	-81.651,96
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	3.657.940,94	0,00	-3.766.678,94	0,00	0,00	108.738,00	-63.565,10
XP INVESTOR FI DE ACOES	7.146.051,14	0,00	0,00	0,00	7.518.009,89	371.958,75	275.480,08
					11.518.956,46	800.379,47	

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1.418.963,71	0,00	0,00	0,00	1.501.333,59	82.369,88	184.332,38
					1.501.333,59	82.369,88	

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	2.199.445,07	0,00	0,00	0,00	2.226.094,31	26.649,24	243.915,21
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	17.207,28	0,00	0,00	0,00	17.136,14	-71,14	-314,33
					2.243.230,45	26.578,10	

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	

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	2.395.328,63	0,00	0,00	0,00	0,00	2.395.077,72	-250,91	8.800,28
						2.395.077,72	-250,91	

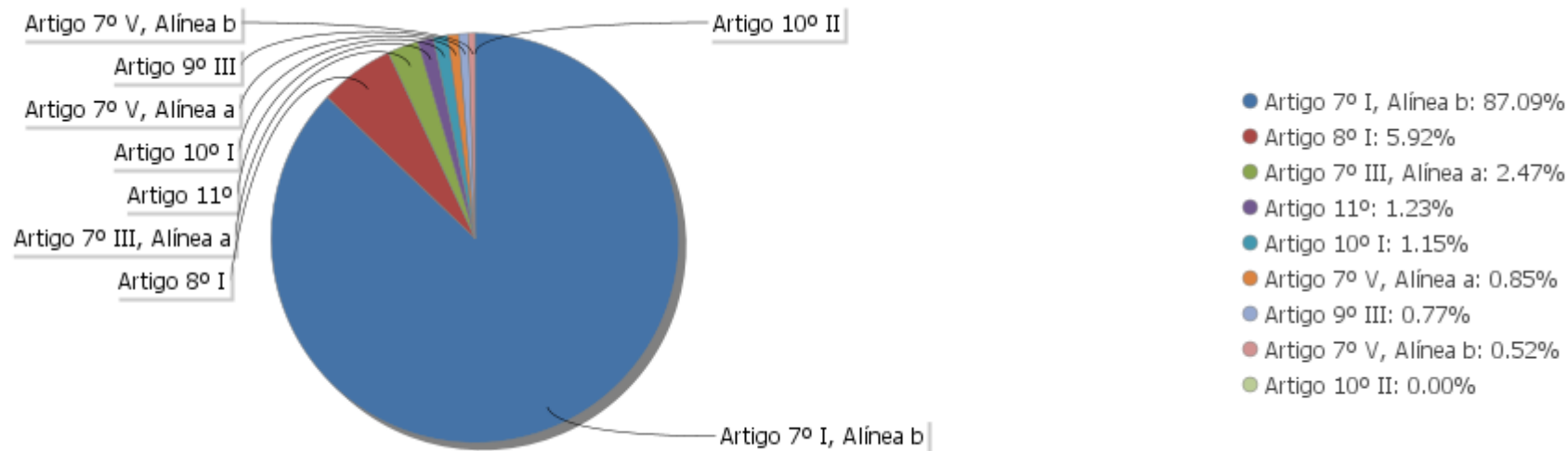
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

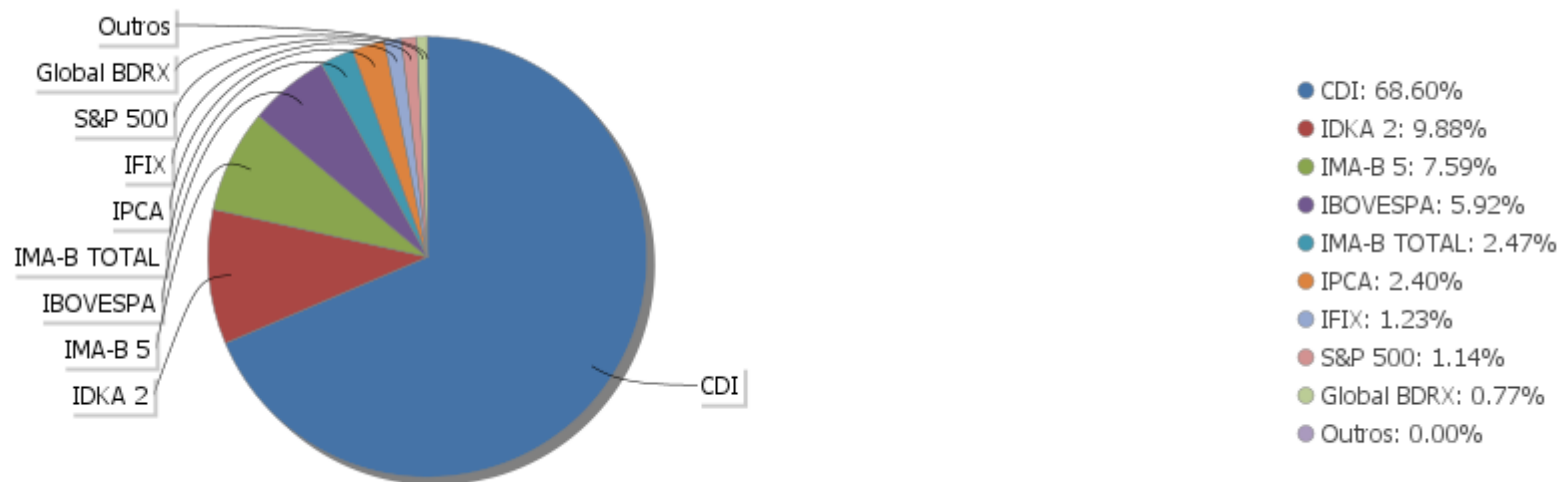
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	188.787.724,27	97,01	188.787.724,27	97,01	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	188.787.724,27	97,01	
acima de 365 dias	5.819.018,25	2,99	194.606.742,52	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

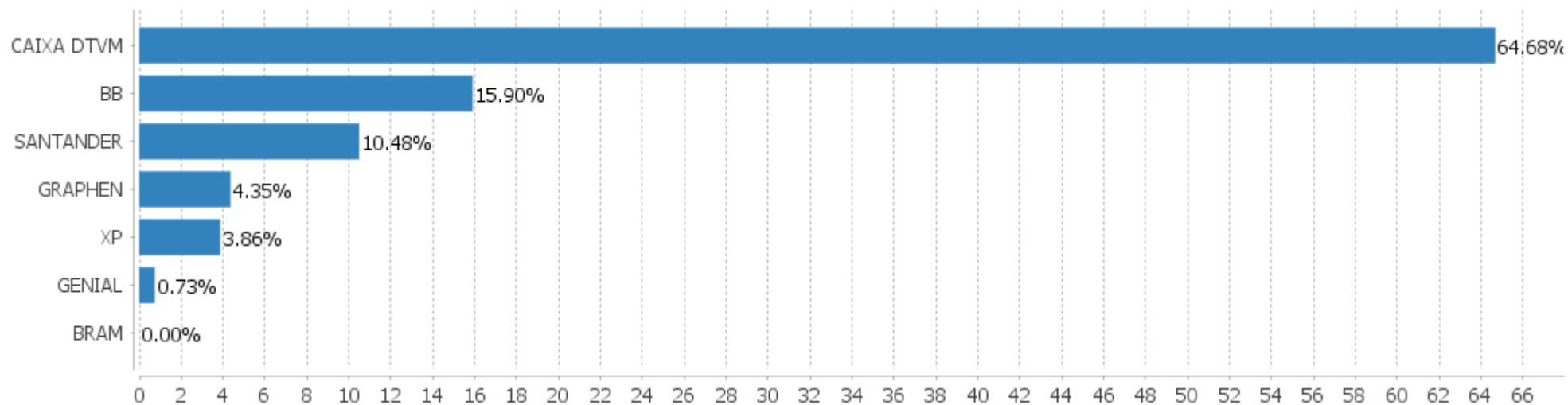


Alocação Por Estratégia



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	1,28	-0,12	0,69	0,98	1,45								4,35
IPCA + 4,81%	0,94	1,18	1,14	0,95	0,64								4,95
p.p. indexador	0,33	-1,29	-0,46	0,03	0,81								-0,60
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	-5,78
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	29	44,62
Meses abaixo - Meta Atuarial	36	55,38

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

Relatório

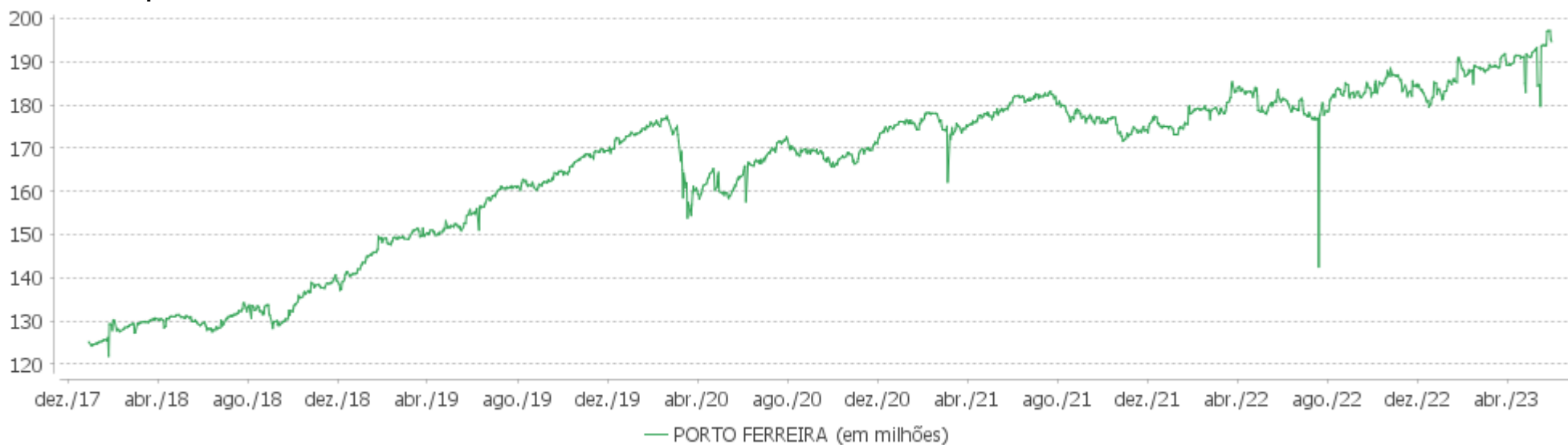
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,15	2,76	0,40	2,62
06 meses	4,21	6,04	-1,83	4,10
12 meses	6,91	8,93	-2,02	5,13
24 meses	6,23	28,01	-21,78	5,20
36 meses	18,26	46,15	-27,88	5,24
48 meses	21,04	57,70	-36,67	6,88
60 meses	38,00	74,91	-36,91	6,51
Desde 29/12/2017	39,25	81,50	-42,25	6,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

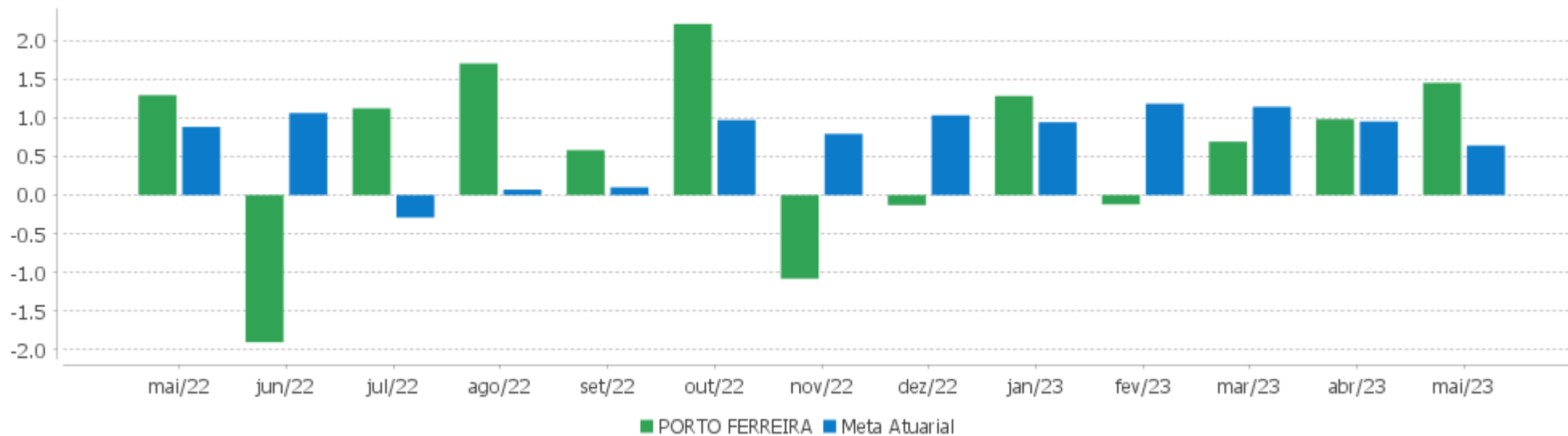


Patrimônio Líquido



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	0,57 50,93	-0,51 -9,41	-0,05 -1,50	-3,25 -49,60	-10,07 -74,73	-61,66 -274,86	-62,13 -247,54
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,63 0,06	5,91 -0,02	3,04 0,02	6,89 -0,04	9,41 -0,03	19,60 -0,30	28,08 -0,68
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,39 0,10	5,49 -0,27	2,47 -0,13	6,77 -0,30	8,61 -0,13	18,88 0,09	28,11 -0,73
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,81 1,58	6,03 3,08	3,94 2,38	7,24 3,65	12,48 8,55	16,41 0,28	20,43 -5,06
FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,63 -0,02	5,28 0,25	2,79 -0,02	6,28 0,15	9,83 0,72		
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,36 0,07	5,50 -0,26	2,49 -0,11	6,80 -0,27	8,34 -0,40	18,22 -0,57	27,61 -1,23
FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA % do CDI	1,55 137,73	8,17 152,22	5,11 157,18	8,53 130,20			
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	1,14 101,50	5,35 99,55	3,22 99,09	6,52 99,49	13,46 99,89	22,52 100,39	24,92 99,27
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	1,22 108,98	5,36 99,81	3,24 99,53	6,51 99,37	13,40 99,46	22,55 100,53	24,62 98,09
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	1,13 101,03	5,32 99,02	3,19 98,28	6,47 98,70	13,37 99,24	22,33 99,54	24,48 97,54
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I % do CDI	-0,46 -40,95	-3,88 -72,33	-1,89 -58,01	-4,72 -71,96	-5,21 -38,65	1.703.206.708,05 7.592.134.809,01	1.703.206.708,05 6.785.866.920,37
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	-0,29 -26,22	-0,68 -12,60	-0,83 -25,42	-0,49 -7,49	0,23 1,70	4,16 18,55	-0,21 -0,83
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,15 102,46	5,29 98,46	3,23 99,51	6,47 98,71	13,47 99,91	22,81 101,66	25,60 102,01
LME REC IMA B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,65 -1,88	2,44 -6,32	1,90 -5,48	2,65 -5,91	5,73 -4,74	4,72 -10,83	6,31 -19,82
BRANDESCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	2,93 2,10	-1,70 -2,18	2,14 -0,50	-3,81 -2,67	-1,91 -1,06	-6,21 -7,76	25,87 -14,11
XP INVESTOR FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	5,21 1,47	3,80 5,08	6,40 3,16	2,16 5,85	2,64 5,34	-7,50 6,66	24,91 0,96
BRANDESCO F I A SELECTION	5,90	-2,26	1,65	-4,78	-2,06	-16,67	20,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	2,16	-0,98	-1,59	-1,09	0,65	-2,51	-3,94
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	3,08 -0,66	-3,48 -2,21	0,99 -2,25	-5,96 -2,27	-9,91 -7,20	-15,82 -1,65	29,47 5,52
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	9,65 -3,89	-2,13 -6,84	3,77 -9,92	-4,69 -6,24	-12,67 -5,33	-28,06 4,18	2,09 -4,80
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	5,80 -0,10	14,00 -0,59	8,47 -0,07	8,53 -1,22	13,81 -0,98	-3,05 -2,88	29,26 -4,63
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V % do CDI	-0,41 -36,80	-1,80 -33,55	-1,11 -34,30	-4,35 -66,32	-6,29 -46,65	-11,56 -51,54	-15,67 -62,44
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	1,21 -0,95	12,31 5,98	7,30 4,28	6,81 8,20	10,60 1,60	16,12 19,29	58,02 29,08
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,00 -0,74	0,00 -5,43	0,00 -3,05	0,00 -6,63	0,00 -10,15	145,70 115,25	-61,94 -111,32
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO Var. IFIX p.p.	-0,01 -5,44	0,37 -4,74	0,12 -7,18	0,70 -4,40	4,22 -2,62	6,29 -0,70	8,35 -5,04
PORTO FERREIRA Var. IPCA + 4,81% p.p.	1,45 0,81	4,35 -0,60	3,15 0,40	4,21 -1,82	6,91 -2,00	6,23 -21,31	18,26 -26,16
CDI	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10
IBOVESPA	3,74	-1,28	3,24	-3,69	-2,71	-14,17	23,95
INPC + 6,00%	0,87	5,27	3,03	6,53	9,94	30,40	50,49
IPCA + 6,00%	0,74	5,43	3,05	6,63	10,15	30,45	49,38

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 IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	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
FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA						
FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D+0	D+0	D+0	D+0		
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
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA	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				
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 DEZEMBRO E JUNHO.	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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	1,14	5,42	3,26	6,67	13,53	20,82	23,37	31,17	40,60
IRF-M 1+	2,85	8,54	6,92	10,30	15,84	14,80	14,48	30,11	50,74
IRF-M TOTAL	2,20	7,34	5,54	8,93	14,73	16,57	17,40	30,67	48,09
IMA-B 5	0,57	5,93	3,02	6,92	9,45	19,90	28,76	40,94	59,58
IMA-B 5+	4,13	11,16	11,29	9,84	11,30	11,03	22,89	28,01	69,69
IMA-B TOTAL	2,53	8,76	7,39	8,55	10,47	15,54	26,13	34,56	66,49
IMA-GERAL TOTAL	1,77	6,78	4,95	7,60	12,55	18,47	23,45	32,82	51,09
IDKA 2	0,29	5,76	2,60	7,07	8,74	18,79	28,85	40,48	57,41
IDKA 20	7,14	15,51	20,12	11,68	12,90	1,60	17,65	14,97	73,96
CDI	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10	31,21	39,57

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,74	-1,28	3,24	-3,69	-2,71	-14,17	23,95	11,65	41,15
IBRX 100	3,59	-2,09	2,36	-4,66	-4,47	-16,34	23,50	12,48	44,21
IBRX 50	2,92	-3,51	0,95	-5,97	-4,44	-15,81	25,71	11,41	38,93
SMALL CAP	13,54	4,71	13,69	1,56	-7,34	-32,24	6,89	5,09	34,10
Índice Consumo - ICON	12,26	-1,05	6,51	-6,28	-15,80	-46,84	-32,02	-26,79	-9,87
Índice Dividendos - IDIV	0,84	0,48	2,64	-1,14	-0,85	1,55	39,98	32,28	81,33

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	2,16	6,32	3,02	-1,39	9,00	-3,17	28,94	96,40	109,24

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	5,43	5,10	7,30	5,10	6,84	6,99	13,39	18,05	36,10

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,56	4,28	0,55	-1,39	6,70	-11,51	19,15	69,85	72,84

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,23	2,95	1,56	3,59	3,94	16,13	25,48	27,84	33,80
INPC	0,36	2,79	1,54	3,50	3,74	16,08	26,41	29,00	35,17
IGPM	-1,84	-2,58	-2,73	-2,14	-4,47	5,78	44,96	54,39	66,19
SELIC	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10	31,21	39,57

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	4,62	2,56	5,63	8,08	25,59	41,11	49,48	62,68
IPCA + 5,00%	0,66	5,03	2,80	6,13	9,11	28,01	45,21	55,30	70,63
IPCA + 5,50%	0,70	5,23	2,93	6,38	9,63	29,23	47,29	58,27	74,72
IPCA + 5,89%	0,73	5,39	3,02	6,57	10,03	30,18	48,92	60,62	77,96
IPCA + 6,00%	0,74	5,43	3,05	6,63	10,15	30,45	49,38	61,28	78,88
INPC + 4,00%	0,70	4,45	2,54	5,53	7,87	25,54	42,15	50,84	64,35
INPC + 6,00%	0,87	5,27	3,03	6,53	9,94	30,40	50,49	62,75	80,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
72	08/05/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	198.373,65	0,00	40.004,41437900	4,9587940000
74	08/05/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.000,00	201,66193200	4,9587940000
75	11/05/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7.861,37	0,00	1.582,42207200	4,9679350000
79	12/05/2023	BRADESCO F I A SELECTION	0,00	248.386,85	295,36842310	840,9390850000
80	12/05/2023	BRADESCO F I A SELECTION	0,00	248.816,65	295,87952070	840,9390850000
81	12/05/2023	BRADESCO F I A SELECTION	0,00	246.395,20	293,00005719	840,9390850000
82	12/05/2023	BRADESCO F I A SELECTION	0,00	243.489,19	289,54438478	840,9390850000
83	12/05/2023	BRADESCO F I A SELECTION	0,00	239.658,38	284,98898942	840,9390850000
84	12/05/2023	BRADESCO F I A SELECTION	0,00	239.365,35	284,64053374	840,9390850000
85	12/05/2023	BRADESCO F I A SELECTION	0,00	239.144,27	284,37763717	840,9390850000
86	12/05/2023	BRADESCO F I A SELECTION	0,00	235.734,14	280,32249209	840,9390850000
87	12/05/2023	BRADESCO F I A SELECTION	0,00	239.434,69	284,72298918	840,9390850000
88	12/05/2023	BRADESCO F I A SELECTION	0,00	236.849,63	281,64897342	840,9390850000
89	12/05/2023	BRADESCO F I A SELECTION	0,00	315.489,04	375,16277413	840,9390850000
90	12/05/2023	BRADESCO F I A SELECTION	0,00	315.846,34	375,58765627	840,9390850000
91	12/05/2023	BRADESCO F I A SELECTION	0,00	317.909,69	378,04128226	840,9390850000
92	12/05/2023	BRADESCO F I A SELECTION	0,00	325.978,96	387,63682865	840,9390850000
93	12/05/2023	BRADESCO F I A SELECTION	0,00	322.992,16	384,08508507	840,9390850000
94	12/05/2023	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	0,00	227.827,50	25.589,54830644	8,9031466000
95	12/05/2023	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	0,00	227.471,42	25.549,55345788	8,9031466000
96	12/05/2023	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	0,00	228.747,79	25.692,91513183	8,9031466000
97	12/05/2023	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	0,00	232.061,05	26.065,05996431	8,9031466000
98	12/05/2023	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	0,00	230.077,20	25.842,23425008	8,9031466000
99	12/05/2023	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	0,00	205.606,48	17.974,42830006	11,4388328000
100	12/05/2023	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	0,00	206.553,37	18.057,20685068	11,4388328000
101	12/05/2023	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	0,00	204.894,33	17.912,17107396	11,4388328000
102	12/05/2023	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	0,00	202.070,33	17.665,29273861	11,4388328000
103	12/05/2023	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	0,00	199.140,04	17.409,12237130	11,4388328000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
104	12/05/2023	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	0,00	199.204,59	17.414,76542956	11,4388328000
105	12/05/2023	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	0,00	199.274,51	17.420,87794132	11,4388328000
106	12/05/2023	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	0,00	196.515,10	17.179,64616110	11,4388328000
107	12/05/2023	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	0,00	199.449,95	17.436,21517048	11,4388328000
108	12/05/2023	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	0,00	198.039,95	17.312,95084582	11,4388328000
109	12/05/2023	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	0,00	346.355,25	30.278,89786098	11,4388328000
110	12/05/2023	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	0,00	347.011,24	30.336,24549526	11,4388328000
111	12/05/2023	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	0,00	349.784,52	30.578,68981178	11,4388328000
112	12/05/2023	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	0,00	357.466,33	31.250,24521733	11,4388328000
113	12/05/2023	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	0,00	355.312,95	31.061,99349290	11,4388328000
124	16/05/2023	FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA	0,00	12.776.299,88	11.683.415,65435549	1,0935415000
76	16/05/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8.920.354,44	0,00	1.792.548,20698000	4,9763540000
73	17/05/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	885.582,26	0,00	177.878,80498200	4,9785710000
77	17/05/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12.776.299,88	0,00	2.566.258,44644900	4,9785710000
78	18/05/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7.953,80	0,00	1.596,81993100	4,9810250000
114	25/05/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	150.000,00	0,00	30.033,36707000	4,9944450000
117	25/05/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.676.698,58	0,00	535.935,13994000	4,9944450000
118	26/05/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.760,91	0,00	3.354,03543900	4,9972370000
115	30/05/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	40.250,62	8.046,02882300	5,0025450000
119	30/05/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.685,05	0,00	536,73680000	5,0025450000
120	30/05/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	38.676,40	0,00	7.731,34474500	5,0025450000
122	30/05/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.957.063,22	391.213,51607300	5,0025450000
116	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	52.819,34	10.552,56567900	5,0053550000
121	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	17.360,26	0,00	3.468,33741000	5,0053550000
123	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	588.304,18	117.534,95602000	5,0053550000
Total			25.698.606,60	24.344.091,68		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.419.892,39

Value-At-Risk: 0,73%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PORTO FERREIRA		0,73	0,73			194.606.742,52	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,43%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA		1,50	0,18	1,50			29.615.831,61	15,22
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI		0,02	0,00	0,02			20.389.294,04	10,48
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,05	0,00	0,05			63.465.056,63	32,61
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO		0,01	-0,00	0,01			17.320.967,46	8,90
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,86	0,05	0,03			14.775.134,05	7,59
BB PREV RF IDKA2		0,99	0,03	0,16			9.610.984,38	4,94
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,01	0,03	0,16			9.613.259,31	4,94
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,30	0,00	0,33			4.676.840,26	2,40
Sub-total	0,77	0,44	0,30		0,01	1,13	169.467.367,74	87,08

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LME REC IMA B FI RENDA FIXA		0,57	0,01	1,67			4.806.306,01	2,47
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			6.451,00	0,00
Sub-total	0,35	0,57	0,01		-1,36	0,65	4.812.757,01	2,47

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I		0,18	-0,00	0,18			410.063,36	0,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC		0,03	0,00	0,03			1.245.243,95	0,64
Sub-total	1,14	0,04	-0,00		-1,28	-0,34	1.655.307,31	0,85

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PIATÁ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO		0,02	0,00	0,02			1.012.712,24	0,52
Sub-total	1,93	0,02	0,00		-0,29	0,57	1.012.712,24	0,52

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,80%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI		8,44	0,15	1,02			4.000.946,57	2,06
BRADESCO FIA DIVIDENDOS		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
XP INVESTOR FI DE ACOES		7,88	0,26	4,33			7.518.009,89	3,86
BRADESCO F I A SELECTION		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
Sub-total	16,81	7,80	0,41		0,20	4,43	11.518.956,46	5,92

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,02%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO		0,02	0,00	2,26			2.395.077,72	1,23
Sub-total	0,04	0,02	0,00		-31,98	-0,01	2.395.077,72	1,23

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,44%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V		0,01	-0,00	0,01			17.136,14	0,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		7,50	0,02	6,11			2.226.094,31	1,14
Sub-total	12,61	7,44	0,02		0,01	1,20	2.243.230,45	1,15

Artigo 10º II

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

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,57%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		7,57	-0,01	0,61			1.501.333,59	0,77
Sub-total	17,30	7,57	-0,01		0,27	5,80	1.501.333,59	0,77

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de maio de 2023, vale observar que:

- O Instituto está com 6,30%% do patrimônio líquido do fundo INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I (Artigo 7º V, Alínea a), percentual este, superior ao permitido na Resolução CMN nº 4.963/2021;