



LDB
EMPRESAS

PORTO FERREIRA
OUTUBRO 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 31.10.2023.

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 90,29%

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 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	4,05	-0,10	-1,04	8,95	29.827.896,64	14,75	424.903.891,59	7,02
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,03	0,05	0,97	10,91	21.471.978,41	10,62	7.255.038.120,30	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,08	0,05	0,96	10,96	65.869.257,24	32,56	12.230.065.528,97	0,54
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,03	0,05	0,98	7,33	18.246.896,91	9,02	30.573.293.814,21	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,31	-0,02	-0,32	8,44	15.127.718,24	7,48	7.787.487.970,57	0,19
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,36	-0,01	-0,33	8,23	9.861.279,61	4,88	5.824.441.376,72	0,17
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,41	-0,01	-0,29	8,48	9.884.690,38	4,89	5.184.421.071,28	0,19
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,50	0,01	0,26	10,64	4.880.381,56	2,41	5.136.324.306,86	0,10
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,35	0,01	0,34	10,01	175.170.098,99	86,60		

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	1,21	0,02	0,02	3,57	4.859.136,81	2,40	74.913.762,20	6,49
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	0,99	10,95	6.798,23	0,00	15.296.039.303,73	0,00
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			2,78	0,02	0,02	3,93	4.865.935,04	2,41		

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	16,27	0,00	0,00	-2,22	398.583,57	0,20	6.322.820,60	6,30
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1,20	-0,45	-0,45	-2,62	1.220.874,45	0,60	72.580.615,49	1,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea a	4,28	-0,50	-0,50	-3,51	1.619.458,02	0,80		

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	3,69	-0,04	-0,86	-1,04	976.219,40	0,48	21.793.707,95	4,48
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	3,69	-0,04	-0,86	-1,04	976.219,40	0,48		
		Renda Fixa	2,35	0,00	0,32	9,50	182.631.711,45	90,29		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

6,62%

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	18,61	0,31	-2,90	1,40	4.939.029,57	2,44	1.302.352.358,50	0,38
XP	SANTANDER	XP INVESTOR FI DE ACOES	18,33	0,81	-3,93	6,60	8.444.733,32	4,17	189.542.320,56	4,46
		Sub-total Artigo 8º I	17,63	0,63	-3,55	2,83	13.383.762,89	6,62		
		Renda Variável	17,63	0,63	-3,55	2,83	13.383.762,89	6,62		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,75%

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	20,25	0,45	-1,40	14,42	1.506.954,17	0,75	1.935.277.303,73	0,08
Sub-total Artigo 9º III			20,25	0,45	-1,40	14,42	1.506.954,17	0,75		
Investimentos no Exterior			20,25	0,45	-1,40	14,42	1.506.954,17	0,75		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,14%

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	-0,36	-3,57	16.827,93	0,01	1.387.976,40	1,21
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	15,71	0,69	-1,77	15,81	2.295.630,21	1,13	1.452.300.441,47	0,16
Sub-total Artigo 10º I			15,58	0,68	-1,76	15,64	2.312.458,14	1,14		

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

Investimentos Estruturados			21,05	0,68	-1,76	15,64	2.312.458,14	1,14		
-----------------------------------	--	--	--------------	-------------	--------------	--------------	---------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,21%

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	6,32	0,00	0,20	2,72	2.439.830,98	1,21	76.449.042,93	3,19
Sub-total Artigo 11º			6,32	0,00	0,20	2,72	2.439.830,98	1,21		
Fundos Imobiliários			6,32	0,00	0,20	2,72	2.439.830,98	1,21		
Total			3,87	0,06	0,02	8,19	202.274.717,63	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	175.170.098,99	86,60	5,00	60,00	90,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	4.865.935,04	2,41	0,00	3,00	10,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.619.458,02	0,80	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	976.219,40	0,48	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	182.631.711,45	90,29					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	13.383.762,89	6,62	5,00	8,00	20,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	13.383.762,89	6,62					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	1.506.954,17	0,75	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	1.506.954,17	0,75					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	2.312.458,14	1,14	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	2.312.458,14	1,14					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.439.830,98	1,21	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	2.439.830,98	1,21					5,00
Total		202.274.717,63	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	0,34 34,53	10,01 90,76	1,81 57,54	5,11 78,02	10,16 75,71	595.834,62	14.892.178,54
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,02 1,92	3,93 35,61	0,32 10,22	1,76 26,94	3,75 27,95	929,66	265.466,17
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,50 -50,14	-3,51 -31,84	-1,43 -45,47	-2,49 -38,07	-3,44 -25,64	-8.140,42	-55.596,08
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	-0,86 -86,53	-1,04 -9,40	-0,73 -23,35	0,04 0,54	-5,61 -41,79	-8.500,50	-10.277,79
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-3,55 -0,62	2,83 -0,28	-6,22 0,99	8,14 -0,20	-4,87 -2,38	-493.190,24	-436.387,77
Artigo 9º III % do CDI	-1,40 -140,26	14,42 130,83	-2,16 -68,81	6,20 94,66	16,47 122,72	-21.383,77	189.952,96
Artigo 10º I % do CDI	-1,76 -176,58	15,64 141,91	-6,97 -221,74	4,32 65,98	16,59 123,63	-41.465,57	312.828,57
Artigo 11º % do CDI	0,20 19,57	2,72 24,69	-3,08 -97,86	2,33 35,64	3,03 22,56	4.758,42	65.249,51
PORTO FERREIRA (Total)						28.842,20	15.223.414,11

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	9.893.903,67	0,00	0,00	0,00	9.861.279,61	-32.624,06	750.192,52
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	18.070.130,43	0,00	0,00	0,00	18.246.896,91	176.766,48	1.246.896,91
FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	30.140.872,51	0,00	0,00	0,00	29.827.896,64	-312.975,87	2.515.253,56
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.913.612,16	0,00	0,00	0,00	9.884.690,38	-28.921,78	772.347,78
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.176.541,07	0,00	0,00	0,00	15.127.718,24	-48.822,83	1.177.220,68
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	64.865.433,66	3.055.473,23	-2.675.536,32	0,00	65.869.257,24	623.886,67	5.181.789,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	4.867.888,24	0,00	0,00	0,00	4.880.381,56	12.493,32	469.470,18
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	21.265.945,72	0,00	0,00	0,00	21.471.978,41	206.032,69	1.870.935,21
	174.194.327,46	3.055.473,23	-2.675.536,32	0,00	175.170.098,99	595.834,62	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	6.731,71	0,00	0,00	0,00	6.798,23	66,52	671,11
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	4.858.273,67	0,00	0,00	0,00	4.859.136,81	863,14	167.327,68
	4.865.005,38	0,00	0,00	0,00	4.865.935,04	929,66	

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	401.234,47	0,00	0,00	0,00	398.583,57	-2.650,90	-22.743,83
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1.226.363,97	0,00	0,00	0,00	1.220.874,45	-5.489,52	-32.852,25
	1.627.598,44	0,00	0,00	0,00	1.619.458,02	-8.140,42	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
PIATÃ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	984.719,90	0,00	0,00	0,00	976.219,40	-8.500,50	-10.277,79
	984.719,90	0,00	0,00	0,00	976.219,40	-8.500,50	

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	5.086.682,26	0,00	0,00	0,00	4.939.029,57	-147.652,69	43.730,80
XP INVESTOR FI DE ACOES	8.790.270,87	0,00	0,00	0,00	8.444.733,32	-345.537,55	452.203,51
	13.876.953,13	0,00	0,00	0,00	13.383.762,89	-493.190,24	

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	1.528.337,94	0,00	0,00	0,00	1.506.954,17	-21.383,77	189.952,96
	1.528.337,94	0,00	0,00	0,00	1.506.954,17	-21.383,77	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.337.034,39	0,00	0,00	0,00	2.295.630,21	-41.404,18	313.451,11
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	16.889,32	0,00	0,00	0,00	16.827,93	-61,39	-622,54
	2.353.923,71	0,00	0,00	0,00	2.312.458,14	-41.465,57	

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	2.437.796,46	0,00	0,00	0,00	2.723,90	2.439.830,98	4.758,42	65.249,51
	2.437.796,46	0,00	0,00	0,00	2.723,90	2.439.830,98	4.758,42	

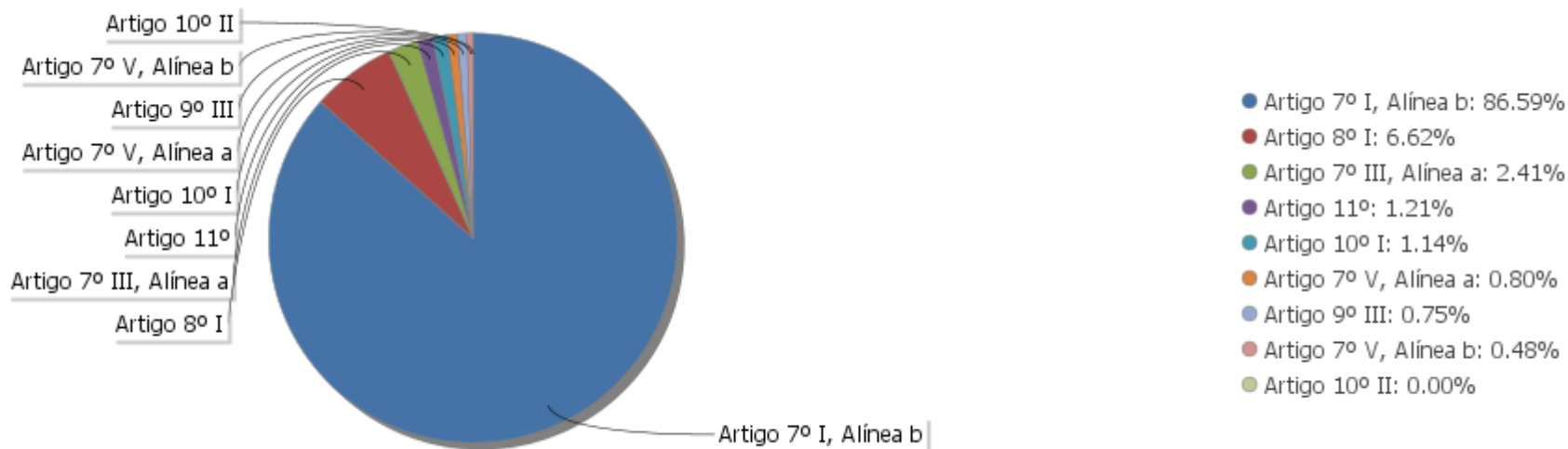
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

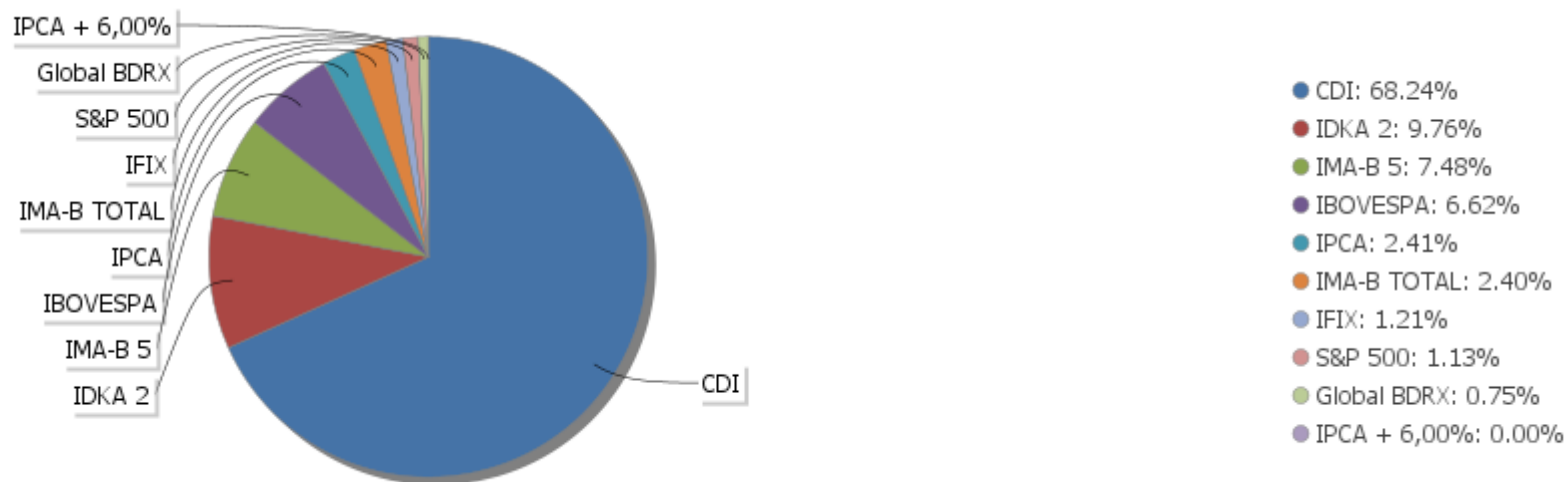
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	166.611.464,78	82,37	166.611.464,78	82,37	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	166.611.464,78	82,37	
acima de 365 dias	35.663.252,85	17,63	202.274.717,63	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

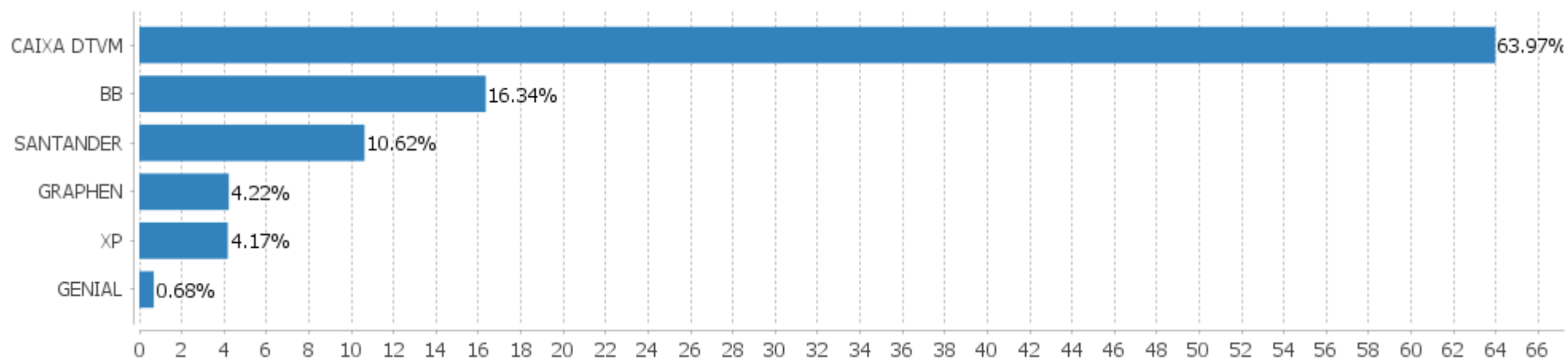


Alocação Por Estratégia



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	1,62	1,03	0,51	0,46	0,02			8,19
IPCA + 4,81%	0,94	1,18	1,14	0,95	0,64	0,31	0,51	0,66	0,63	0,63			7,87
p.p. indexador	0,33	-1,29	-0,46	0,03	0,81	1,30	0,52	-0,15	-0,18	-0,61			0,32
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	31	44,29
Meses abaixo - Meta Atuarial	39	55,71

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

Relatório

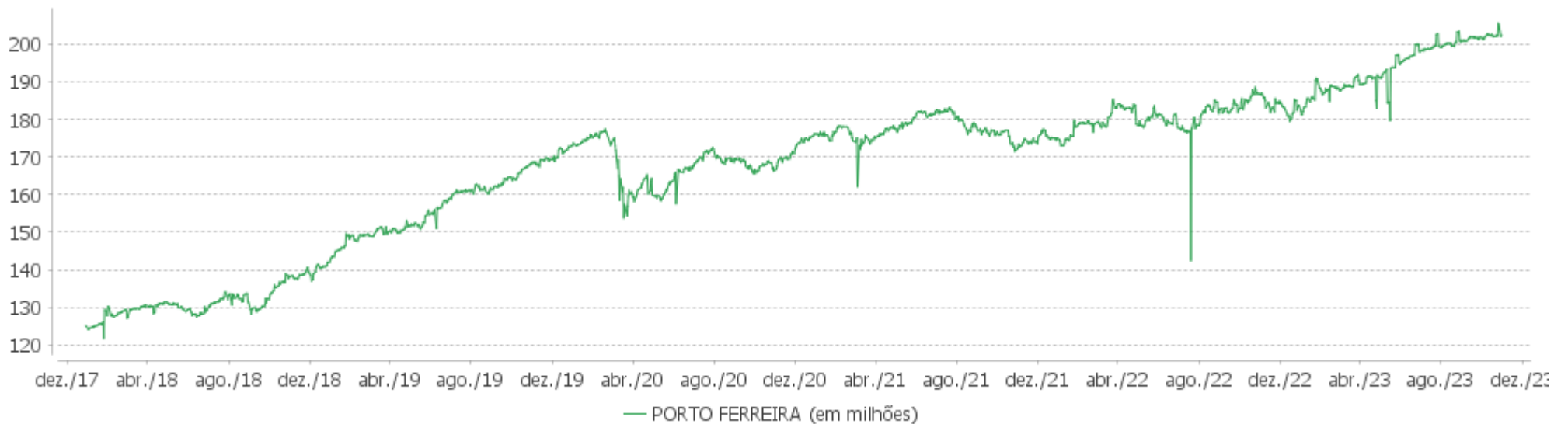
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,99	1,94	-0,95	1,74
06 meses	5,19	3,44	1,74	1,68
12 meses	6,87	9,85	-2,97	3,87
24 meses	16,32	22,73	-6,41	4,63
36 meses	18,31	43,22	-24,90	4,79
48 meses	17,17	57,51	-40,34	6,78
60 meses	35,69	71,19	-35,50	6,33
Desde 29/12/2017	44,38	86,56	-42,18	6,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

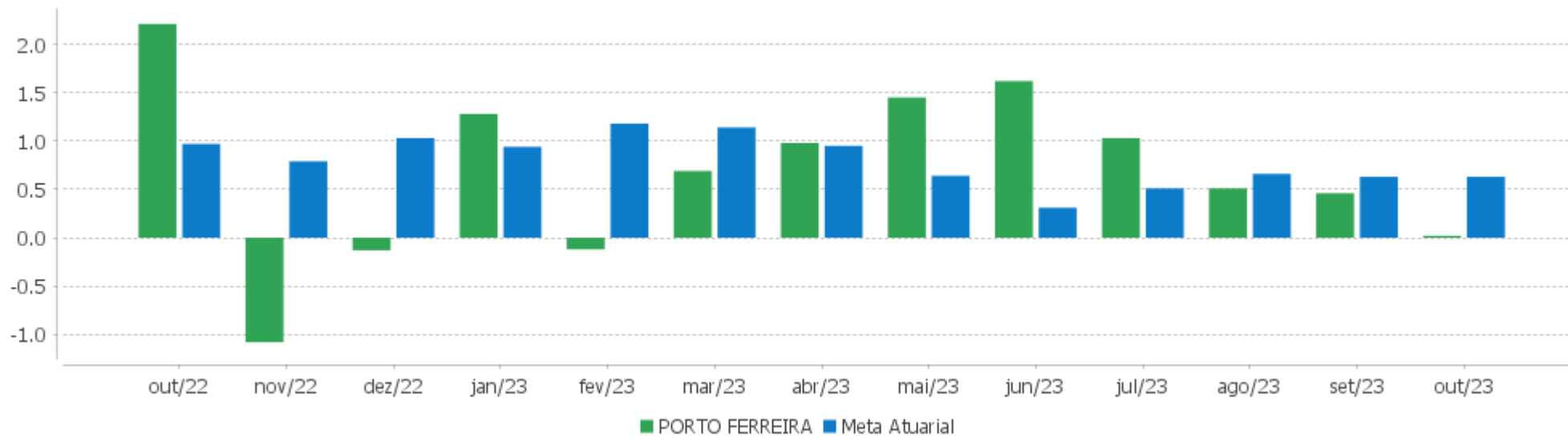


Patrimônio Líquido



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	-0,86 -86,53	-1,04 -9,40	-0,73 -23,35	0,04 0,54	-5,61 -41,79	-61,57 -232,77	-61,94 -202,07
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,32 -0,01	8,44 -0,11	0,39 -0,05	3,03 -0,03	9,06 -0,15	22,79 -0,32	27,94 -0,63
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	-0,33 0,08	8,23 -0,29	0,62 -0,02	3,00 0,09	8,84 -0,19	22,05 -0,60	27,39 -0,92
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,26 0,02	10,64 6,90	1,30 0,56	6,24 5,23	12,00 7,18	24,61 13,01	24,98 1,47
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,29 0,12	8,48 -0,05	0,84 0,20	3,19 0,28	9,04 0,01	22,01 -0,64	27,38 -0,94
FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA % do CDI	-1,04 -104,09	8,95 81,16	-1,04 -33,15	2,27 34,72	8,61 64,20		
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,96 95,80	10,96 99,46	3,07 97,59	6,61 100,91	13,28 98,94	26,47 100,06	30,62 99,88
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,98 98,06	10,98 99,57	3,13 99,50	6,55 99,94	13,34 99,46	26,41 99,82	30,68 100,07
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,97 97,12	10,91 98,95	3,11 98,77	6,51 99,31	13,24 98,66	26,21 99,08	30,39 99,14
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I % do CDI	-0,66 -66,23	-6,57 -59,63	-1,90 -60,55	-3,25 -49,56	-7,53 -56,12	-12,45 -47,05	1.655.525.134,03 5.400.697.003,13
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	-0,45 -44,87	-2,62 -23,77	-1,27 -40,52	-2,25 -34,28	-2,14 -15,91	1,47 5,56	0,64 2,10
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,99 99,06	10,95 99,36	3,15 100,06	6,60 100,68	13,35 99,46	26,71 100,98	31,23 101,88
LME REC IMA B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,02 0,67	3,57 -6,49	0,32 2,28	1,76 -1,99	4,46 -4,52	7,94 -13,46	7,13 -16,49
XP INVESTOR FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-3,93 -1,00	6,60 3,50	-6,03 1,18	8,04 -0,30	-5,29 -2,79	21,23 11,91	19,76 -0,67
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-2,90 0,03	1,40 -1,71	-6,64 0,58	8,29 -0,05	-5,16 -2,66	2,67 -6,65	21,68 1,25
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-1,40 0,17	14,42 -0,97	-2,16 -0,29	6,20 -0,45	16,47 -1,90	-17,58 -1,45	10,07 -4,78
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	-0,36	-3,57	-1,09	-2,20	-6,38	-11,36	-15,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-36,44	-32,36	-34,64	-33,66	-47,58	-42,94	-50,75
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-1,77 -0,55	15,81 9,94	-7,01 -4,49	4,37 2,65	16,80 12,60	7,09 25,47	54,56 42,18
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,00 -0,73	0,00 -8,88	0,00 -2,23	0,00 -4,04	0,00 -11,08	0,00 -25,37	0,00 -47,00
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO Var. IFIX p.p.	0,20 2,17	2,72 -7,34	-3,08 -1,78	2,33 -8,07	3,03 -2,46	7,44 -10,50	8,57 -5,49
PORTO FERREIRA Var. IPCA + 4,81% p.p.	0,02 -0,61	8,19 0,32	0,99 -0,95	5,19 1,74	6,87 -2,97	16,32 -6,25	18,31 -23,82
CDI	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65
IBOVESPA	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32	20,43
INPC + 6,00%	0,61	8,14	1,93	3,62	10,36	24,54	46,58
IPCA + 6,00%	0,73	8,88	2,23	4,04	11,08	25,37	47,00

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
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
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	Não se aplica	Não se aplica				
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Não se aplica	Não se aplica				
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL 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 MULTISSETORIAL 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
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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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	0,96	11,12	3,06	6,61	13,48	26,55	28,80	34,03	43,59
IRF-M 1+	0,12	12,95	0,56	7,03	13,15	26,82	19,34	24,87	47,27
IRF-M TOTAL	0,37	12,04	1,31	6,68	12,95	26,45	22,28	27,70	46,46
IMA-B 5	-0,31	8,55	0,43	3,06	9,21	23,11	28,57	35,91	54,63
IMA-B 5+	-0,98	10,98	-4,11	3,97	8,37	19,37	18,16	11,25	52,40
IMA-B TOTAL	-0,66	10,06	-1,97	3,75	8,97	21,40	23,62	22,38	55,11
IMA-GERAL TOTAL	0,30	10,92	1,11	5,71	11,71	24,89	26,20	29,58	48,76
IDKA 2	-0,41	8,53	0,64	2,92	9,03	22,65	28,32	36,96	53,47
IDKA 20	-1,16	13,95	-7,55	5,69	7,85	15,86	10,01	-4,59	48,02
CDI	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65	34,86	43,24

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32	20,43	5,52	29,42
IBRX 100	-3,03	2,31	-7,11	8,24	-3,47	7,90	19,13	5,97	32,25
IBRX 50	-2,99	1,78	-6,48	8,57	-2,99	9,63	22,40	7,19	28,83
SMALL CAP	-7,40	-2,72	-16,71	5,49	-16,24	-16,19	-13,16	-18,52	16,44
Índice Consumo - ICON	-8,90	-13,22	-21,67	-1,55	-29,56	-40,09	-45,26	-46,32	-22,15
Índice Dividendos - IDIV	-3,15	7,18	-4,65	7,57	6,28	23,78	40,83	25,93	75,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-1,22	5,87	-2,52	1,73	4,20	-18,39	12,38	74,39	110,39

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,97	10,06	-1,30	10,41	5,49	17,94	14,06	13,03	40,73

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,10	1,94	-3,96	-1,70	4,45	-23,43	1,25	50,47	78,73

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,24	3,75	0,73	1,00	4,82	11,60	23,51	28,35	31,61
INPC	0,12	3,04	0,43	0,60	4,14	10,87	23,15	29,03	32,32
IGPM	0,50	-4,46	0,73	-3,74	-4,57	1,65	23,73	49,63	54,34
SELIC	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65	34,86	43,24

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	7,18	1,74	3,04	9,00	20,69	38,87	50,04	59,99
IPCA + 5,00%	0,65	8,03	1,99	3,54	10,04	23,02	42,90	55,86	67,80
IPCA + 5,50%	0,69	8,46	2,11	3,79	10,56	24,19	44,94	58,84	71,82
IPCA + 5,89%	0,72	8,79	2,21	3,98	10,97	25,11	46,55	61,19	75,01
IPCA + 6,00%	0,73	8,88	2,23	4,04	11,08	25,37	47,00	61,85	75,91
INPC + 4,00%	0,45	6,44	1,44	2,62	8,29	19,90	38,47	50,83	60,87
INPC + 6,00%	0,61	8,14	1,93	3,62	10,36	24,54	46,58	62,71	76,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
188	06/10/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11.895,51	0,00	2.272,73482821	5,2340070000
196	06/10/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	198.373,65	0,00	37.900,91415600	5,2340070000
189	16/10/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.723,90	0,00	519,27834400	5,2455490000
190	26/10/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.617.366,88	0,00	497.167,92289800	5,2645530000
193	26/10/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	150.000,00	0,00	28.492,44750694	5,2645530000
191	30/10/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	2.578.536,32	489.361,41559626	5,2691860000
194	30/10/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	88.000,00	16.700,87109800	5,2691860000
192	31/10/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	75.113,29	0,00	14.248,47292300	5,2716730000
195	31/10/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	9.000,00	1.707,23771400	5,2716730000
Total			3.055.473,23	2.675.536,32		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.693.258,08

Value-At-Risk: 0,84%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PORTO FERREIRA		0,84		0,84			202.274.717,63	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,52%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA		1,72	0,22	1,72			29.827.896,64	14,75
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI		0,02	0,00	0,02			21.471.978,41	10,62
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,03	0,00	0,03			65.869.257,24	32,56
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO		0,02	0,00	0,02			18.246.896,91	9,02
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,19	0,08	0,01			15.127.718,24	7,48
BB PREV RF IDKA2		1,10	0,05	0,16			9.861.279,61	4,88
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,94	0,04	0,31			9.884.690,38	4,89
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,84	0,02	0,85			4.880.381,56	2,41
Sub-total	1,42	0,53	0,41		-0,46	0,34	175.170.098,99	86,60

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		0,53	0,01	1,69			4.859.136,81	2,40
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			6.798,23	0,00
Sub-total	1,28	0,53	0,01		-0,76	0,02	4.865.935,04	2,41

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I		0,13	-0,00	0,13			398.583,57	0,20
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC		0,09	-0,00	0,09			1.220.874,45	0,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	1,74	0,10	-0,00		-0,86	-0,50	1.619.458,02	0,80

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PIATÃ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO		0,17	-0,00	0,17			976.219,40	0,48
Sub-total	1,76	0,17	-0,00		-1,06	-0,86	976.219,40	0,48

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,81%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI		7,37	0,15	0,79			4.939.029,57	2,44
XP INVESTOR FI DE ACOES		6,87	0,25	3,51			8.444.733,32	4,17
Sub-total	16,58	6,81	0,40		-0,27	-3,55	13.383.762,89	6,62

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,11%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO		0,11	0,00	2,13			2.439.830,98	1,21
Sub-total	0,68	0,11	0,00		-1,19	0,20	2.439.830,98	1,21

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 6,01%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V		0,00	0,00	0,00			16.827,93	0,01
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,06	0,03	5,27			2.295.630,21	1,13
Sub-total	15,09	6,01	0,03		-0,18	-1,76	2.312.458,14	1,14

Artigo 10º II

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA		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: 6,90%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,90	-0,00	0,71			1.506.954,17	0,75
Sub-total	16,49	6,90	-0,00		-0,15	-1,40	1.506.954,17	0,75

(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 (%)