



LDB
EMPRESAS

PORTO FERREIRA
DEZEMBRO 2022



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 30.12.2022.

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 80,65%

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	1,92	0,04	0,95	4,28	12.135.920,30	6,61	4.067.815.586,77	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	5,25	0,04	0,33	3,51	28.198.225,34	15,35	264.274.846,25	10,67
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,27	0,05	1,22	1,22	7.722.266,20	4,20	6.757.838.619,84	0,11
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,10	0,05	1,09	12,43	10.338.310,63	5,63	16.549.368.546,86	0,06
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,32	0,04	-0,22	6,09	5.367.671,90	2,92	6.078.064.149,48	0,09
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,40	0,04	-0,24	6,19	8.882.656,95	4,84	3.466.339.701,42	0,26
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,60	0,04	0,92	9,67	13.950.497,56	7,59	7.960.289.495,76	0,18
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,82	0,04	1,22	9,32	9.111.087,09	4,96	7.489.389.892,90	0,12
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,38	0,04	-1,19	2,95	4.104.660,05	2,23	830.239.076,41	0,49
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,40	0,04	-1,23	3,06	7.628.618,18	4,15	1.062.055.943,18	0,72
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,92	0,04	1,23	9,04	9.112.342,60	4,96	6.893.208.496,34	0,13
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,43		-0,39	7,27	0,00	0,00	0,00	
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,78	0,05	1,14	10,70	4.410.911,38	2,40	5.292.657.963,96	0,08
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,14	0,04	0,51	8,25	120.963.168,18	65,85		

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	1,41	0,03	0,20	6,22	4.691.809,13	2,55	72.334.055,99	6,49
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,50	0,04	-0,26	6,02	15.078.111,37	8,21	1.457.873.778,20	1,03
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,09	0,05	1,12	12,59	6.127,12	0,00	12.858.761.791,29	0,00
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM	0,09	0,05	1,09	3,05	4.601.043,20	2,50	6.347.301.770,81	0,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
		FIC FI								
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	4,07	0,04	0,08	6,59	24.377.090,82	13,27		

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	2,82	0,00	0,00	-2,17	474.193,35	0,26	7.522.235,56	6,30
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1,26	0,19	0,19	3,39	1.253.726,70	0,68	74.553.671,31	1,68
GENIAL	RJI	INCENTIVO MULTISSETORIAL I FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS	0,00	0,00	0,00	0,00	63.038,89	0,03	861.375,60	7,32
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea a	0,78	-0,10	-0,10	0,80	1.790.958,94	0,98		

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				
PLURAL	INTRADER	PIATÃ FI RF LONGO PRAZO	107,82	-2,76	-2,76	-61,06	1.017.852,73	0,55	22.723.155,22	4,48
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	107,82	-2,76	-2,76	-61,06	1.017.852,73	0,55		
		Renda Fixa	3,65	0,02	0,41	5,86	148.149.070,67	80,65		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL

16,24%

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	21,09	0,01	-2,57	-0,75	4.145.298,77	2,26	1.369.079.222,31	0,30
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	18,85	-0,00	-2,15	9,56	3.830.244,04	2,09	629.734.501,52	0,61
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	26,41	-0,00	-2,61	-8,25	1.227.836,92	0,67	893.768.575,50	0,14
XP	SANTANDER	XP INVESTOR FI DE ACOES	20,23	-0,00	-1,58	11,07	7.242.529,81	3,94	193.552.829,20	3,74
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21,38	-0,01	-2,62	2,43	4.584.349,06	2,50	844.496.837,07	0,54
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	20,34	-0,00	-2,71	3,65	4.603.130,45	2,51	384.478.473,26	1,20
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	21,43	-0,00	-2,58	7,16	4.188.179,11	2,28	465.783.812,97	0,90
Sub-total Artigo 8º I			20,19	-0,00	-2,31	5,09	29.821.568,16	16,24		
Renda Variável			20,19	-0,00	-2,31	5,09	29.821.568,16	16,24		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,72%

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	26,84	-0,00	-4,79	-28,54	1.317.001,21	0,72	1.938.590.167,99	0,07
Sub-total Artigo 9º III			26,84	-0,00	-4,79	-28,54	1.317.001,21	0,72		
Investimentos no Exterior			26,84	-0,00	-4,79	-28,54	1.317.001,21	0,72		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,09%

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	2,39	-0,02	-2,59	-7,29	17.450,47	0,01	1.439.324,16	1,21
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	24,18	0,05	-4,90	-11,97	1.982.179,10	1,08	1.723.160.287,50	0,12
Sub-total Artigo 10º I			23,96	0,05	-4,88	-11,93	1.999.629,57	1,09		

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	0,58	0,00	0,00	-100,00	0,00	0,00	0,00	
Sub-total Artigo 10º II			0,58	0,00	0,00	-100,00	0,00	0,00		
Investimentos Estruturados			32,21	6,10	-4,88	-22,74	1.999.629,57	1,09		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,30%

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	3,16	0,33	0,33	4,33	2.395.325,87	1,30	75.054.531,17	3,19
Sub-total Artigo 11º			3,16	0,33	0,33	4,33	2.395.325,87	1,30		
Fundos Imobiliários			3,16	0,33	0,33	4,33	2.395.325,87	1,30		
Total			5,67	0,08	-0,13	5,11	183.682.595,48	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	120.963.168,18	65,85	0,00	55,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	24.377.090,82	13,27	0,00	15,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.790.958,94	0,98	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	1.017.852,73	0,55	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	148.149.070,67	80,65					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	29.821.568,16	16,24	0,00	20,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	29.821.568,16	16,24					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	1.317.001,21	0,72	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	1.317.001,21	0,72					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	1.999.629,57	1,09	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	0,00	0,00	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	1.999.629,57	1,09					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.395.325,87	1,30	0,00	1,50	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	2.395.325,87	1,30					5,00
Total		183.682.595,48	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	0,51 45,48	8,25 66,64	1,58 49,47	3,36 50,86	8,25 66,64	611.355,49	9.376.336,77
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,08 7,08	6,59 53,24	0,77 24,10	2,50 37,83	6,59 53,24	19.368,04	1.262.039,37
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,10 -8,95	0,80 6,46	-0,01 -0,42	0,13 2,02	0,80 6,46	-1.802,22	14.209,82
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	-2,76 -245,62	-61,06 -493,47	-19,07 -596,41	-2,88 -43,50	-61,06 -493,47	-28.880,84	-2.494.322,16
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-2,31 0,14	5,09 0,41	-2,26 -1,99	8,92 -2,43	5,09 0,41	-705.405,31	1.788.914,43
Artigo 9º III % do CDI	-4,79 -426,73	-28,54 -230,65	3,52 110,00	-0,98 -14,87	-28,54 -230,65	-66.309,21	-525.959,26
Artigo 10º I % do CDI	-4,88 -434,22	-11,93 -96,46	9,57 299,23	6,68 101,05	-11,93 -96,46	-102.537,29	-270.995,46
Artigo 10º II % do CDI	0,00 0,00	-100,00 -808,21	0,00 0,00	0,00 0,00	-100,00 -808,21	0,00	-317.616,99
Artigo 11º % do CDI	0,33 29,24	4,33 35,02	0,34 10,78	0,71 10,75	4,33 35,02	7.843,12	99.943,80
PORTO FERREIRA (Total)						-266.368,22	8.932.550,32

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 ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	7.658.661,01	0,00	-7.629.098,06	0,00	0,00	-29.562,95	516.900,60
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,00	7.629.098,06	0,00	0,00	7.722.266,20	93.168,14	93.168,14
BB PREV RF IDKA2	9.001.394,54	0,00	0,00	0,00	9.111.087,09	109.692,55	776.861,05
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5.379.404,35	0,00	0,00	0,00	5.367.671,90	-11.732,45	308.282,67
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.154.056,55	0,00	0,00	0,00	4.104.660,05	-49.396,50	117.450,92
FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA	12.021.551,58	0,00	0,00	0,00	12.135.920,30	114.368,72	509.037,98
FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	28.104.933,81	0,00	0,00	0,00	28.198.225,34	93.291,53	976.049,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.001.272,06	0,00	0,00	0,00	9.112.342,60	111.070,54	755.480,33
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	13.823.041,52	0,00	0,00	0,00	13.950.497,56	127.456,04	1.229.884,51
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7.723.843,58	0,00	0,00	0,00	7.628.618,18	-95.225,40	226.297,22
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8.903.745,71	0,00	0,00	0,00	8.882.656,95	-21.088,76	518.168,03
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11.033.963,39	2.714.719,38	-3.530.000,00	0,00	10.338.310,63	119.627,86	1.134.363,14
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	4.361.225,21	0,00	0,00	0,00	4.410.911,38	49.686,17	1.644.063,61
					120.963.168,18	0,00	0,00

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	6.059,11	0,00	0,00	0,00	6.127,12	68,01	685,00
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	15.117.933,67	0,00	0,00	0,00	15.078.111,37	-39.822,30	856.098,78
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	4.682.449,66	0,00	0,00	0,00	4.691.809,13	9.359,47	274.540,87
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	4.551.280,34	0,00	0,00	0,00	4.601.043,20	49.762,86	130.714,72
					24.377.090,82	0,00	0,00

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	478.335,22	0,00	0,00	0,00	474.193,35	-4.141,87	-26.855,08
INCENTIVO MULTISSETORIAL I FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS	63.038,89	0,00	0,00	0,00	63.038,89	0,00	0,00
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1.251.387,05	0,00	0,00	0,00	1.253.726,70	2.339,65	41.064,90
					1.790.958,94	0,00	0,00

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 LONGO PRAZO	1.046.733,57	0,00	0,00	0,00	1.017.852,73	-28.880,84	-2.494.322,16
					1.017.852,73	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	4.731.580,91	0,00	0,00	0,00	4.603.130,45	-128.450,46	162.195,40
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	4.707.822,89	0,00	0,00	0,00	4.584.349,06	-123.473,83	108.567,36
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	4.254.480,99	0,00	0,00	0,00	4.145.298,77	-109.182,22	-31.531,21
BRADESCO F I A SELECTION	4.299.078,55	0,00	0,00	0,00	4.188.179,11	-110.899,44	279.998,79
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	1.260.802,68	0,00	0,00	0,00	1.227.836,92	-32.965,76	-110.413,72
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	3.914.327,77	0,00	0,00	0,00	3.830.244,04	-84.083,73	334.094,46
XP INVESTOR FI DE ACOES	7.358.879,68	0,00	0,00	0,00	7.242.529,81	-116.349,87	721.990,62
					29.821.568,16	0,00	0,00

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	1.383.310,42	0,00	0,00	0,00	1.317.001,21	-66.309,21	-525.959,26
					1.317.001,21	0,00	0,00

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	2.084.252,21	0,00	0,00	0,00	1.982.179,10	-102.073,11	-269.624,04
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	17.914,65	0,00	0,00	0,00	17.450,47	-464,18	-1.371,42
					1.999.629,57	0,00	0,00

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	-317.616,99
					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	2.387.482,75	0,00	0,00	0,00	0,00	2.395.325,87	7.843,12	99.943,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
						2.395.325,87	0,00	0,00

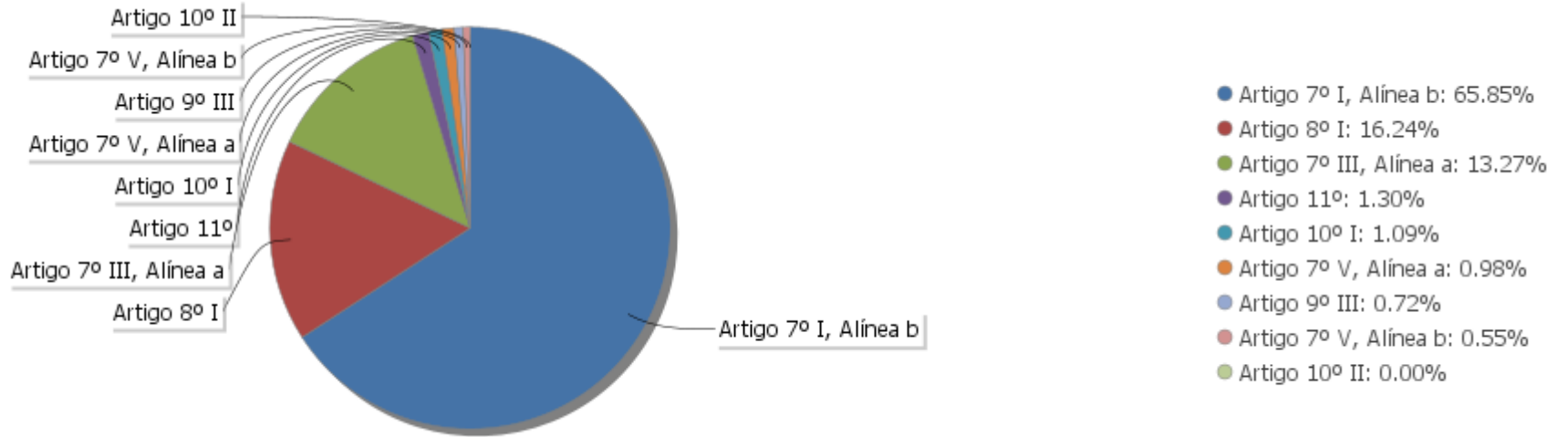
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

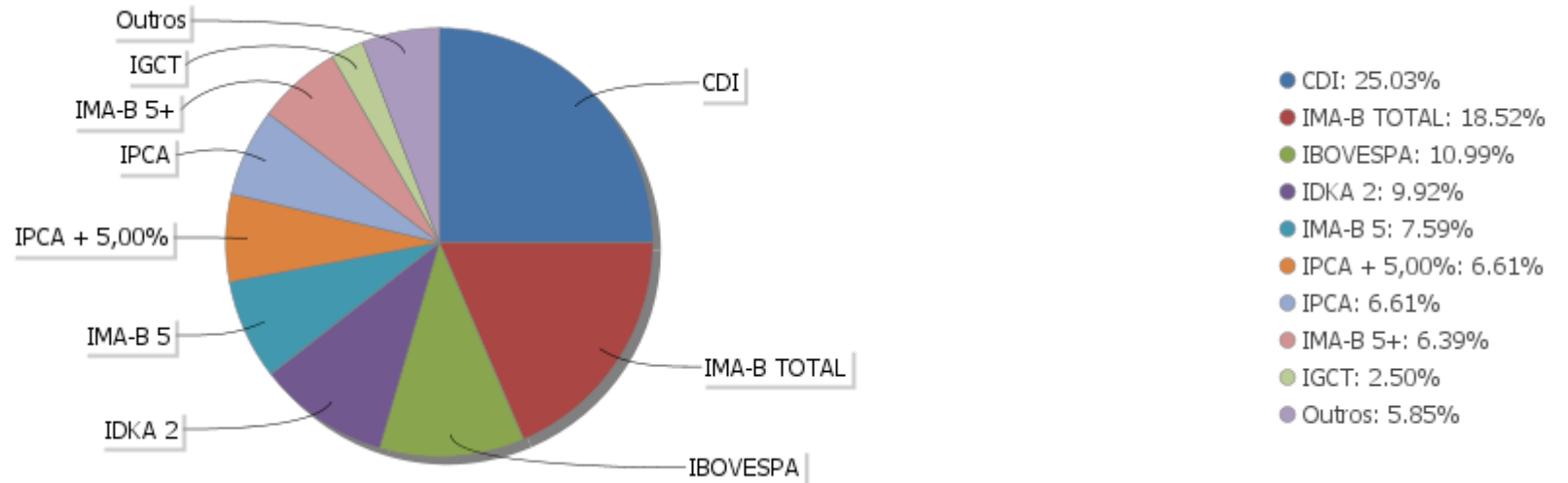
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	137.638.787,98	74,93	137.638.787,98	74,93
de 31 a 365 dias	12.135.920,30	6,61	149.774.708,28	81,54
acima de 365 dias	33.907.887,20	18,46	183.682.595,48	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

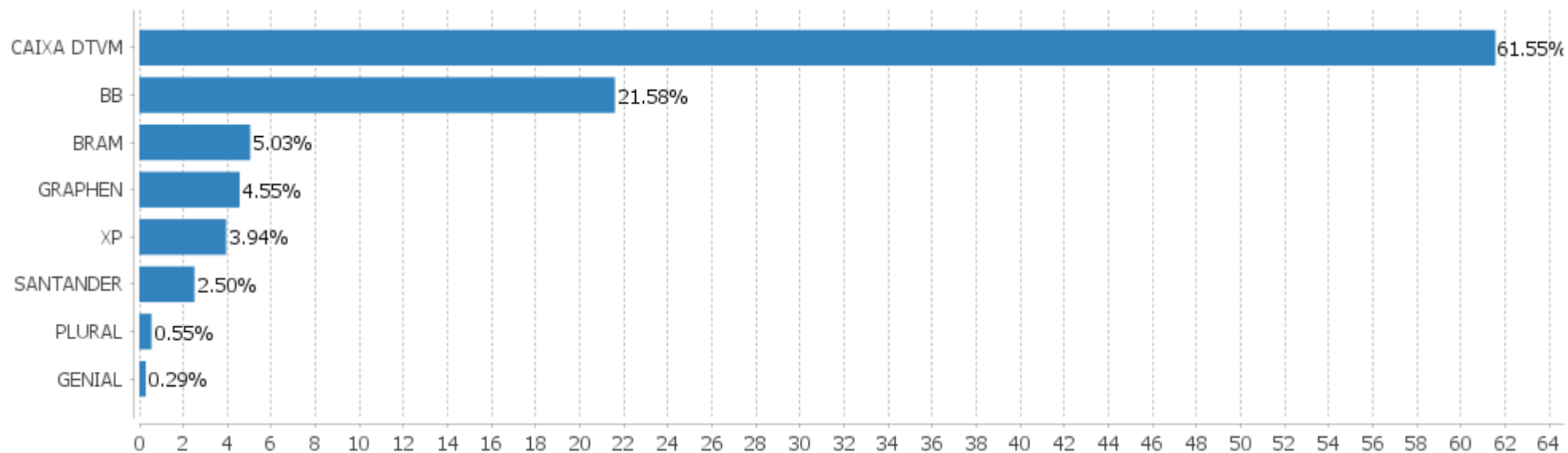


Alocação Por Estratégia



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
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	26	43,33
Meses abaixo - Meta Atuarial	34	56,67

	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	0,96	2,82	-1,85	6,74
06 meses	4,44	2,70	1,74	6,12
12 meses	5,11	10,88	-5,78	5,67
24 meses	3,00	28,62	-25,62	5,42
36 meses	5,41	42,27	-36,86	7,63
48 meses	23,38	57,34	-33,96	6,92
60 meses	33,45	72,95	-39,49	7,09
Desde 29/12/2017	33,45	72,95	-39,49	7,09

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

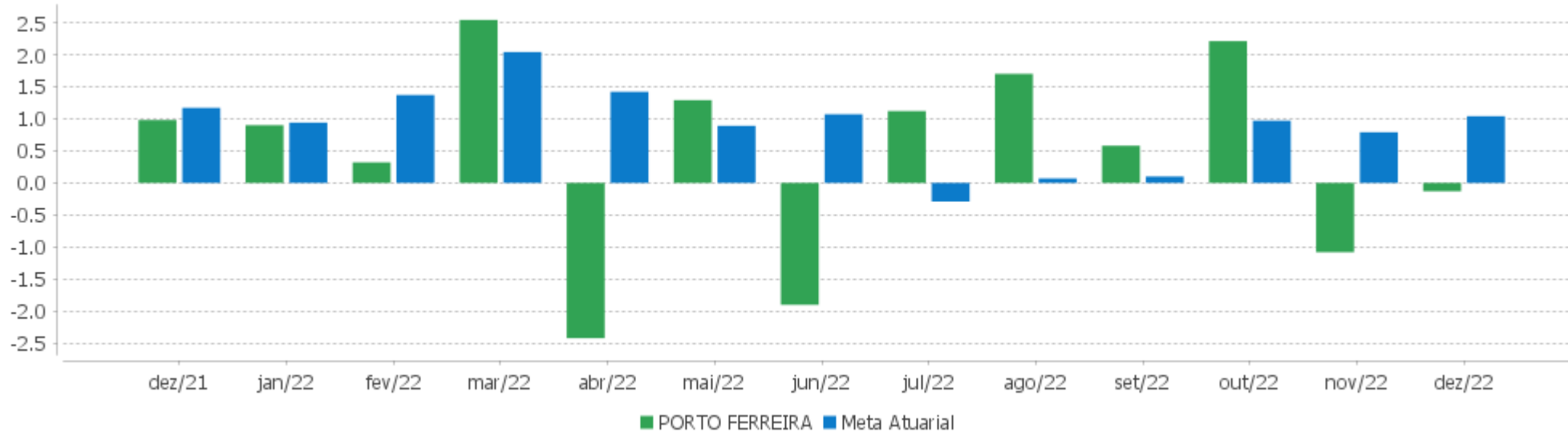


Patrimônio Líquido



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 LONGO PRAZO % do CDI	-2,76 -245,62	-61,06 -493,47	-19,07 -596,41	-2,88 -43,50	-61,06 -493,47	-61,42 -354,76	-62,39 -303,45
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,24 -0,04	6,19 -0,17	0,10 -0,13	1,86 -0,07	6,19 -0,17	4,57 -0,45	10,91 -0,84
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,92 -0,02	9,67 -0,11	2,46 -0,07	2,96 -0,01	9,67 -0,11	14,40 -0,40	23,26 -0,76
FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,95 -0,10	10,69 1,16	3,97 1,11	3,98 1,21			
FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA % do CDI	0,33 29,55	1,56 20,85	1,15 35,87	1,65 25,01			
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	1,09 97,41	12,43 100,42	3,12 97,45	6,55 98,96	12,43 100,42	17,30 99,95	20,18 98,18
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,23 -0,04	3,06 -0,24	-1,79 -0,07	1,09 -0,15	3,06 -0,24	-4,16 -0,69	0,86 -0,98
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,22 -0,02	9,32 -0,02	2,42 0,17	2,69 0,36	9,32 -0,02	14,40 -0,38	23,46 -1,22
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,39	7,27	0,54	3,43	7,27	6,84	12,28
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,14 0,52	10,70 4,91	2,23 0,60	5,84 5,56	10,70 4,91	10,58 -5,85	17,95 -3,74
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,23 -0,01	9,04 -0,30	2,36 0,11	2,47 0,13	9,04 -0,30	14,12 -0,66	23,29 -1,38
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,22 -0,02	6,09 -0,28	0,17 -0,07	1,80 -0,14	6,09 -0,28	4,49 -0,54	10,90 -0,85
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,77 0,15	9,30 3,52	1,67 0,04	4,80 4,51	9,30 3,52	9,89 -6,54	
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,19 0,00	2,95 -0,35	-1,79 -0,07	1,07 -0,17	2,95 -0,35	-4,03 -0,56	0,83 -1,01
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I % do CDI	-0,87 -77,08	-5,36 -43,32	-1,16 -36,41	-1,27 -19,17	-5,36 -43,32	-22,18 -128,10	17.720.069,47 86.192.103,88
INCENTIVO MULTISSETORIAL I FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS % do CDI	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 0,00
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	0,19	3,39	0,43	0,68	3,39	2,55	-2,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	16,64	27,37	13,40	10,30	27,37	14,70	-11,14
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1,12	12,59	3,22	6,67	12,59	17,79	20,62
% do CDI	99,92	101,73	100,61	100,91	101,73	102,78	100,29
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	-0,26	6,02	-0,06	1,74	6,02	4,43	10,75
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,07	-0,35	-0,29	-0,20	-0,35	-0,59	-1,00
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	1,09	12,30	3,16	6,57	12,30	17,17	19,90
% do CDI	97,34	99,41	98,69	99,31	99,41	99,16	96,78
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	0,20	6,22	1,37	2,85	6,22	1,88	-0,39
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,39	-0,15	1,13	0,91	-0,15	-3,14	-12,14
BRADERCO FIA DIVIDENDOS	-2,15	9,56	0,34	9,88	9,56	0,13	-5,52
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,53	-3,09	-2,81	2,17	-3,09	-5,29	-9,89
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	-2,71	3,65	-1,81	9,14	3,65	-10,01	-11,64
Var. IBOVESPA p.p.	-0,27	-1,03	-1,53	-2,22	-1,03	-2,22	-6,53
XP INVESTOR FI DE ACOES	-1,58	11,07	-4,68	6,88	11,07	-4,70	-8,98
Var. IBOVESPA p.p.	0,86	6,39	-4,40	-4,48	6,39	3,10	-3,87
BRADERCO F I A SELECTION	-2,58	7,16	-0,93	12,81	7,16	-11,71	-14,95
Var. IBOVESPA p.p.	-0,13	2,48	-0,65	1,46	2,48	-3,91	-9,84
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	-2,57	-0,75	-2,39	7,00	-0,75	-6,97	6,08
Var. IBOVESPA p.p.	-0,12	-5,44	-2,11	-4,36	-5,44	0,83	11,19
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-2,62	2,43	-1,12	9,89	2,43	-9,39	-7,32
Var. IGCT p.p.	-0,06	-1,11	-0,42	-0,66	-1,11	-1,72	-2,72
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	-2,61	-8,25	-5,64	5,28	-8,25	-17,28	-18,85
Var. SMALL CAP p.p.	0,40	6,81	1,97	-0,48	6,81	11,54	10,44
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-4,79	-28,54	3,52	-0,98	-28,54	-6,74	44,34
Var. Global BDRX p.p.	-0,58	-0,49	-0,42	-0,37	-0,49	-2,90	-3,76
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	-2,59	-7,29	-3,25	-4,24	-7,29	-11,75	-8,31
% do CDI	-230,66	-58,89	-101,55	-64,16	-58,89	-67,89	-40,43
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-4,90	-11,97	9,70	6,79	-11,97	16,92	30,01
Var. S&P 500 p.p.	2,36	12,71	6,36	5,75	12,71	14,29	-23,83
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	0,00	-0,99	0,00	0,00	-0,99	140,40	-92,80
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,13	-13,10	-3,10	-3,27	-13,10	109,64	-137,63
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	0,33	4,33	0,34	0,71	4,33	5,55	8,06
Var. IFIX p.p.	0,33	2,11	4,48	-1,85	2,11	5,66	18,40
PORTO FERREIRA	-0,13	5,11	0,96	4,44	5,11	3,00	5,41
Var. IPCA + 4,84% p.p.	-1,17	-5,78	-1,85	1,74	-5,78	-24,92	-34,74
CDI	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	-2,45	4,69	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11
INPC + 6,00%	1,20	12,26	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46
IPCA + 6,00%	1,13	12,11	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
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 FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0		D+3 du		
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+2 du	D+2 du		0,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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 IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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 MULTIELSTRATEGIA	Não se aplica	Não se aplica				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Não se aplica	Não se aplica				
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I	Não se aplica	Não se aplica				
INCENTIVO MULTISSETORIAL I FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS	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 LONGO PRAZO	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	1,18	12,02	3,16	6,70	12,02	15,30	19,73	27,82	36,73
IRF-M 1+	1,62	7,41	1,10	6,63	7,41	2,06	10,68	26,44	41,95
IRF-M TOTAL	1,48	8,82	1,74	6,49	8,82	6,66	13,80	27,49	41,17
IMA-B 5	0,94	9,78	2,53	2,98	9,78	14,79	24,02	40,34	54,18
IMA-B 5+	-1,19	3,30	-1,72	1,24	3,30	-3,47	1,84	32,76	53,22
IMA-B TOTAL	-0,19	6,37	0,23	1,94	6,37	5,02	11,75	37,40	55,34
IMA-GERAL TOTAL	0,77	9,66	1,73	4,95	9,66	10,71	16,62	31,57	44,78
IDKA 2	1,24	9,34	2,25	2,34	9,34	14,78	24,67	39,41	53,01
IDKA 20	-3,32	-1,92	-5,66	0,71	-1,92	-16,13	-14,29	23,65	48,88
CDI	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,96

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,45	4,69	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11	24,86	43,63
IBRX 100	-2,63	4,02	-0,39	10,33	4,02	-7,61	-4,37	27,56	47,23
IBRX 50	-2,55	5,72	0,38	12,12	5,72	-5,43	-2,00	26,57	44,96
SMALL CAP	-3,01	-15,06	-7,61	5,76	-15,06	-28,82	-29,28	11,87	20,97
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	-1,61	12,65	3,15	7,71	12,65	5,43	4,37	51,51	75,68

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	-7,26	-24,68	3,34	1,04	-24,68	2,63	53,84	106,24	126,51

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,00	2,22	-4,14	2,56	2,22	-0,11	-10,33	21,92	28,78

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-5,43	-25,01	5,58	1,05	-25,01	-5,95	38,64	78,90	86,12

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,62	5,79	1,63	0,28	5,79	16,43	21,69	26,93	31,68
INPC	0,69	5,93	1,55	0,30	5,93	16,70	23,05	28,57	32,98
IGPM	0,45	5,45	-1,09	-2,51	5,45	24,20	52,94	64,11	76,48
SELIC	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,97

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,97	10,00	2,61	2,28	10,00	25,89	36,82	48,44	60,11
IPCA + 5,00%	1,05	11,05	2,86	2,78	11,05	28,31	40,79	54,22	67,93
IPCA + 5,50%	1,09	11,58	2,98	3,03	11,58	29,53	42,80	57,17	71,96
IPCA + 5,89%	1,12	11,99	3,07	3,22	11,99	30,49	44,38	59,51	75,15
IPCA + 6,00%	1,13	12,11	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83	60,17	76,06
INPC + 4,00%	1,04	10,15	2,53	2,31	10,15	26,18	38,35	50,36	61,69
INPC + 6,00%	1,20	12,26	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46	62,24	77,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
156	12/12/2022	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	7.629.098,06	0,00	6.589.226,75154400	1,1578138600
146	12/12/2022	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	7.629.098,06	4.673.650,32902000	1,6323638960
161	16/12/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	20.000,00	4.230,89272200	4,7271350000
164	16/12/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	946.000,00	200.121,21449700	4,7271350000
162	19/12/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.000,00	211,44337400	4,7293980000
150	19/12/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	378.917,32	0,00	80.119,56701400	4,7293980000
159	23/12/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.199.000,00	0,00	464.059,15646300	4,7386200000
153	23/12/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	112.000,00	0,00	23.635,57322500	4,7386200000
163	27/12/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	92.000,00	19.394,91398900	4,7435120000
165	27/12/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	2.471.000,00	520.922,05192300	4,7435120000
157	29/12/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.395,37	0,00	1.978,63245300	4,7484160000
149	29/12/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.005,13	0,00	3.160,02852300	4,7484160000
151	29/12/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	401,56	0,00	84,56714800	4,7484160000
Total			10.343.817,44	11.159.098,06		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.420.701,56

Value-At-Risk: 2,95%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PORTO FERREIRA		2,95	2,95			183.682.595,48	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,77%

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		0,89	0,01	0,86			12.135.920,30	6,61
FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA		2,25	0,29	2,25			28.198.225,34	15,35
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		1,31	0,05	1,32			7.722.266,20	4,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,02	0,00	0,02			10.338.310,63	5,63
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,92	0,07	0,05			5.367.671,90	2,92
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,95	0,12	0,05			8.882.656,95	4,84
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,41	0,09	0,03			13.950.497,56	7,59
BB PREV RF IDKA2		1,48	0,06	0,39			9.111.087,09	4,96
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		4,80	0,09	0,11			4.104.660,05	2,23
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		4,84	0,17	0,07			7.628.618,18	4,15
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,52	0,06	0,40			9.112.342,60	4,96
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,62	0,01	0,64			4.410.911,38	2,40
Sub-total	3,23	1,79	1,03		-0,19	0,51	120.963.168,18	65,85

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		0,72	0,01	2,56			4.691.809,13	2,55
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		3,01	0,21	0,10			15.078.111,37	8,21
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	0,00	0,01			6.127,12	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI		0,01	-0,00	0,01			4.601.043,20	2,50
Sub-total	3,54	1,95	0,22		-0,29	0,08	24.377.090,82	13,27

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I		0,05	-0,00	0,05			474.193,35	0,26
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC		0,02	0,00	0,02			1.253.726,70	0,68
INCENTIVO MULTISSETORIAL I FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS		0,00	0,00	0,00			63.038,89	0,03
Sub-total	0,34	0,01	0,00		-3,60	-0,10	1.790.958,94	0,98

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PIATÁ FI RF LONGO PRAZO		0,11	-0,00	0,11			1.017.852,73	0,55
Sub-total	9,47	0,11	-0,00		-0,41	-2,76	1.017.852,73	0,55

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,32%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI		11,32	0,23	1,32			4.145.298,77	2,26
BRADERCO FIA DIVIDENDOS		10,20	0,20	2,67			3.830.244,04	2,09
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		14,76	0,09	3,04			1.227.836,92	0,67
XP INVESTOR FI DE ACOES		13,05	0,47	5,72			7.242.529,81	3,94
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		11,26	0,26	0,19			4.584.349,06	2,50
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		10,82	0,24	2,83			4.603.130,45	2,51
BRADERCO F I A SELECTION		11,23	0,24	2,33			4.188.179,11	2,28
Sub-total	20,09	11,32	1,72		-0,17	-2,31	29.821.568,16	16,24

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,03%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO		0,03	-0,00	3,07			2.395.325,87	1,30
Sub-total	1,11	0,03	-0,00		-0,72	0,33	2.395.325,87	1,30

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 11,39%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V		0,11	0,00	0,11			17.450,47	0,01
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		11,49	0,02	7,74			1.982.179,10	1,08
Sub-total	17,44	11,39	0,02		-0,34	-4,88	1.999.629,57	1,09

Artigo 10º II

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: 13,54%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		13,54	-0,03	1,33			1.317.001,21	0,72
Sub-total	22,36	13,54	-0,03		-0,26	-4,79	1.317.001,21	0,72