



PORTO FERREIRA - CONSOLIDADO
SETEMBRO 2024



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 30.09.2024.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA	88,05%
------------	--------

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,130000%)	4,17	0,09	0,64	0,64	4.024.293,16	1,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,100000%)	4,16	0,08	0,69	0,76	5.036.582,29	2,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,250000%)	4,23	0,07	0,65	0,65	5.030.688,85	2,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,270000%)	4,24	0,07	0,63	0,63	5.028.491,04	2,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,120000%)	4,17	0,10	0,69	0,76	5.037.532,28	2,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,260000%)	4,24	-0,00	0,65	0,65	5.029.953,75	2,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,290000%)	4,26	0,01	0,63	0,63	5.029.060,90	2,17
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,36	0,06	0,67	0,73	34.216.602,27	14,73

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,65	0,02	0,71	4,12	4.164.919,16	1,79	6.153.638.080,30	0,07
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,81	-0,08	0,48	5,06	7.132.671,18	3,07	4.976.909.586,20	0,14
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,04	0,04	0,83	7,97	20.056.839,09	8,64	32.173.775.540,30	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	2,72	-0,09	0,30	3,89	30.532.270,28	13,15	474.759.760,32	6,43
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,90	-0,09	0,40	4,73	7.117.869,86	3,06	4.168.680.215,13	0,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,76	-0,08	0,38	5,14	16.421.872,77	7,07	6.913.810.528,18	0,24
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,10	0,04	0,83	7,77	47.496.761,04	20,45	11.229.374.861,63	0,42
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,34	-0,01	0,52	4,59	5.240.209,22	2,26	4.436.237.468,68	0,12
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	2,37	-0,03	0,63	3,02	2.575.460,07	1,11	1.856.541.125,92	0,14
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,04	0,04	0,83	7,90	8.405.706,66	3,62	7.219.680.253,06	0,12
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,88	-0,02	0,62	6,47	149.144.579,33	64,22		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,05	0,04	0,84	8,11	7.483,94	0,00	20.065.228.623,01	0,00
BRABESCO	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,10	0,04	0,88	4,98	8.795.212,11	3,79	14.753.446.791,76	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP	4,03	-0,23	-0,64	1,99	5.099.329,75	2,20	1.021.358.141,89	0,50
GRAPHEN	RJI	LME REC IMA B FI RENDA FIXA *	1,78	-0,04	0,01	-0,63	4.882.677,19	2,10	75.276.686,80	6,49
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,35	-0,05	0,24	2,41	18.784.702,99	8,09		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GENIAL	RJI	INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I *	4,26	-0,98	-0,98	-8,23	360.498,41	0,16	5.713.828,31	6,31
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC *	4,77	-0,42	-0,42	-7,82	1.116.738,01	0,48	66.389.735,50	1,68
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			4,10	-0,56	-0,56	-7,91	1.477.236,42	0,64		

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 *	1,50	-0,01	0,73	-5,85	871.209,27	0,38	19.449.399,46	4,48
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			1,50	-0,01	0,73	-5,85	871.209,27	0,38		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa	0,87	-0,01	0,59	6,11	204.494.330,28	88,05
------------	------	-------	------	------	----------------	-------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL

6,40%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	12,56	-0,83	-3,14	-7,65	5.350.177,51	2,30	1.096.030.531,90	0,49
XP	SANTANDER	XP INVESTOR FI DE ACOES	15,83	-0,69	-4,28	-4,79	9.522.284,39	4,10	205.143.452,15	4,64
Sub-total Artigo 8º I			14,21	-0,74	-3,87	-5,84	14.872.461,90	6,40		
Renda Variável			14,21	-0,74	-3,87	-5,84	14.872.461,90	6,40		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,25%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	15,68	0,53	-0,32	40,56	5.222.196,77	2,25	2.640.148.103,06	0,20
Sub-total Artigo 9º III			15,68	0,53	-0,32	40,56	5.222.196,77	2,25		
Investimentos no Exterior			15,68	0,53	-0,32	40,56	5.222.196,77	2,25		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,35%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12,47	0,39	2,33	24,07	5.444.727,70	2,34	2.032.300.517,82	0,27
GRAPHEN	RJI	LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V *	1,78	-0,02	-0,38	-5,06	15.862,23	0,01	1.308.325,93	1,21
Sub-total Artigo 10º I			12,40	0,38	2,32	23,91	5.460.589,93	2,35		

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			12,40	0,38	2,32	23,91	5.460.589,93	2,35		
----------------------------	--	--	-------	------	------	-------	--------------	------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,94%

Artigo 11° (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 *	4,25	0,20	0,20	-3,46	2.194.423,89	0,94	68.759.519,84	3,19
		Sub-total Artigo 11°	4,25	0,20	0,20	-3,46	2.194.423,89	0,94		
		Fundos Imobiliários	4,25	0,20	0,20	-3,46	2.194.423,89	0,94		
		Total	1,60	-0,03	0,31	5,84	232.244.002,77	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	34.216.602,27	14,73	0,00	15,00	50,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	149.144.579,33	64,22	0,00	53,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	18.784.702,99	8,09	0,00	8,00	50,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.477.236,42	0,64	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	871.209,27	0,38	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	204.494.330,28	88,05					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	14.872.461,90	6,40	0,00	12,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	14.872.461,90	6,40					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	5.222.196,77	2,25	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	5.222.196,77	2,25					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	5.460.589,93	2,35	0,00	2,00	5,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	0,00	0,00	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	5.460.589,93	2,35					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.194.423,89	0,94	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	2.194.423,89	0,94					5,00
Total		232.244.002,77	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,67 79,86	0,73 77,12				222.833,86	229.659,80
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,62 73,84	6,47 80,99	2,31 87,71	4,07 77,81	9,54 86,32	941.706,38	11.377.279,80
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,24 28,73	2,41 30,20	1,76 67,02	1,87 35,86	3,58 32,38	44.921,03	364.296,07
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,56 -67,12	-7,91 -98,94	-4,53 -172,18	-6,15 -117,72	-9,24 -83,57	-8.318,42	-126.803,47
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,73 87,23	-5,85 -73,16	-0,45 -17,13	-4,65 -88,98	-7,40 -66,95	6.293,74	-56.208,96
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-3,87 -0,79	-5,84 -4,07	5,55 -0,84	-2,27 -5,17	7,17 -5,91	-599.189,64	-922.070,13
Artigo 9º III % do CDI	-0,32 -38,88	40,56 507,63	0,75 28,44	22,25 425,51	51,31 464,13	-16.993,67	1.076.976,53
Artigo 10º I % do CDI	2,32 278,18	23,91 299,21	6,30 239,26	11,59 221,65	39,88 360,72	123.848,56	803.263,13
Artigo 11º % do CDI	0,20 23,51	-3,46 -43,35	0,47 17,94	-3,63 -69,51	-2,93 -26,55	4.296,27	-78.854,38
PORTO FERREIRA - CONSOLIDADO (Total)						719.398,11	12.667.538,39

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150545 (6,100000%)	5.002.105,39	0,00	0,00	0,00	5.036.582,29	34.476,90	37.882,87
NTN-B 150545 (6,250000%)	0,00	4.998.112,94	0,00	0,00	5.030.688,85	32.575,91	32.575,91
NTN-B 150545 (6,270000%)	0,00	4.997.091,38	0,00	0,00	5.028.491,04	31.399,66	31.399,66
NTN-B 150840 (6,130000%)	0,00	3.998.582,86	0,00	0,00	4.024.293,16	25.710,30	25.710,30
NTN-B 150850 (6,120000%)	5.002.978,71	0,00	0,00	0,00	5.037.532,28	34.553,57	37.973,54
NTN-B 150850 (6,260000%)	0,00	4.997.327,22	0,00	0,00	5.029.953,75	32.626,53	32.626,53
NTN-B 150850 (6,290000%)	0,00	4.997.569,91	0,00	0,00	5.029.060,90	31.490,99	31.490,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	10.005.084,10	23.988.684,31	0,00	0,00	34.216.602,27	222.833,86	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	4.135.687,79	0,00	0,00	0,00	4.164.919,16	29.231,37	164.919,16
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	7.098.773,79	0,00	0,00	0,00	7.132.671,18	33.897,39	453.355,08
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	19.891.118,49	0,00	0,00	0,00	20.056.839,09	165.720,60	1.479.912,75
FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	30.439.657,67	0,00	0,00	0,00	30.532.270,28	92.612,61	1.161.344,43
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7.089.754,46	0,00	0,00	0,00	7.117.869,86	28.115,40	421.135,37
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.359.400,53	0,00	0,00	0,00	16.421.872,77	62.472,24	802.292,87
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	71.076.398,73	550.711,50	-24.547.470,08	0,00	47.496.761,04	417.120,89	5.574.814,83
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5.212.865,10	0,00	0,00	0,00	5.240.209,22	27.344,12	230.029,35
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	2.559.258,71	0,00	0,00	0,00	2.575.460,07	16.201,36	75.460,07
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	8.336.716,26	0,00	0,00	0,00	8.405.706,66	68.990,40	1.048.952,81
	172.199.631,53	550.711,50	-24.547.470,08	0,00	149.144.579,33	941.706,38	

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.421,47	0,00	0,00	0,00	7.483,94	62,47	561,65
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	8.718.057,37	0,00	0,00	0,00	8.795.212,11	77.154,74	295.212,11
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP	5.132.092,86	0,00	0,00	0,00	5.099.329,75	-32.763,11	99.329,75
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	4.882.210,26	0,00	0,00	0,00	4.882.677,19	466,93	-30.807,44
	18.739.781,96	0,00	0,00	0,00	18.784.702,99	44.921,03	

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	364.078,27	0,00	0,00	0,00	360.498,41	-3.579,86	-32.091,93
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1.121.476,57	0,00	0,00	0,00	1.116.738,01	-4.738,56	-94.711,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	1.485.554,84	0,00	0,00	0,00	1.477.236,42	-8.318,42	

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	864.915,53	0,00	0,00	0,00	871.209,27	6.293,74	-56.208,96
	864.915,53	0,00	0,00	0,00	871.209,27	6.293,74	

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	5.523.868,42	0,00	0,00	0,00	5.350.177,51	-173.690,91	-443.123,69
XP INVESTOR FI DE ACOES	9.947.783,12	0,00	0,00	0,00	9.522.284,39	-425.498,73	-478.946,44
	15.471.651,54	0,00	0,00	0,00	14.872.461,90	-599.189,64	

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	5.239.190,44	0,00	0,00	0,00	5.222.196,77	-16.993,67	1.076.976,53
	5.239.190,44	0,00	0,00	0,00	5.222.196,77	-16.993,67	

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	5.320.818,06	0,00	0,00	0,00	5.444.727,70	123.909,64	804.108,10
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	15.923,31	0,00	0,00	0,00	15.862,23	-61,08	-844,97
	5.336.741,37	0,00	0,00	0,00	5.460.589,93	123.848,56	

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	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	2.190.127,62	0,00	0,00	0,00	0,00	2.194.423,89	4.296,27	-87.939,23
	2.190.127,62	0,00	0,00	0,00	0,00	2.194.423,89	4.296,27	

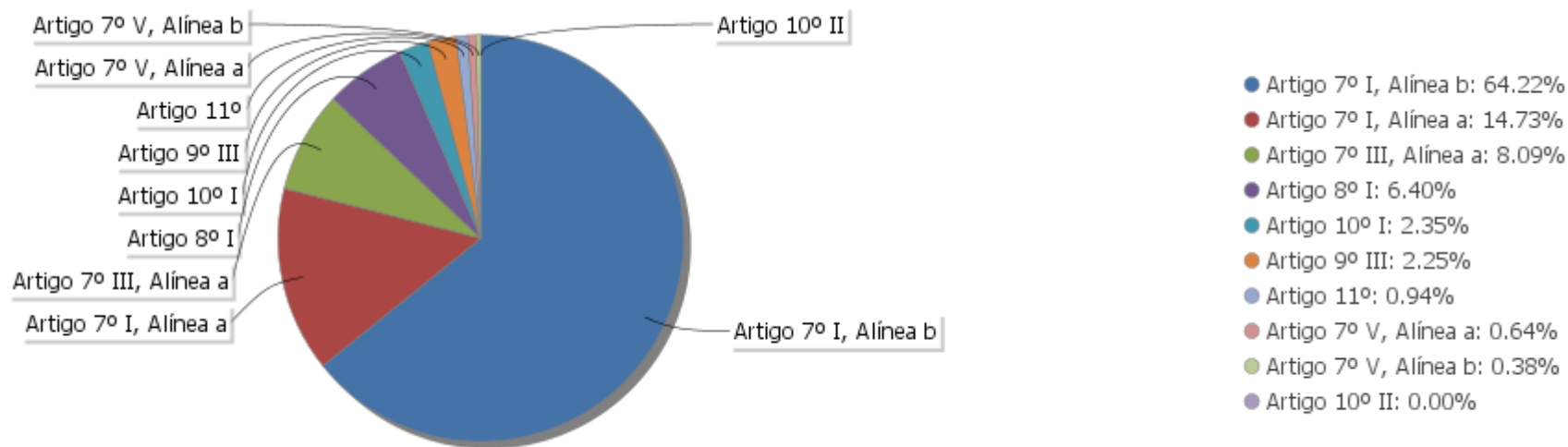
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

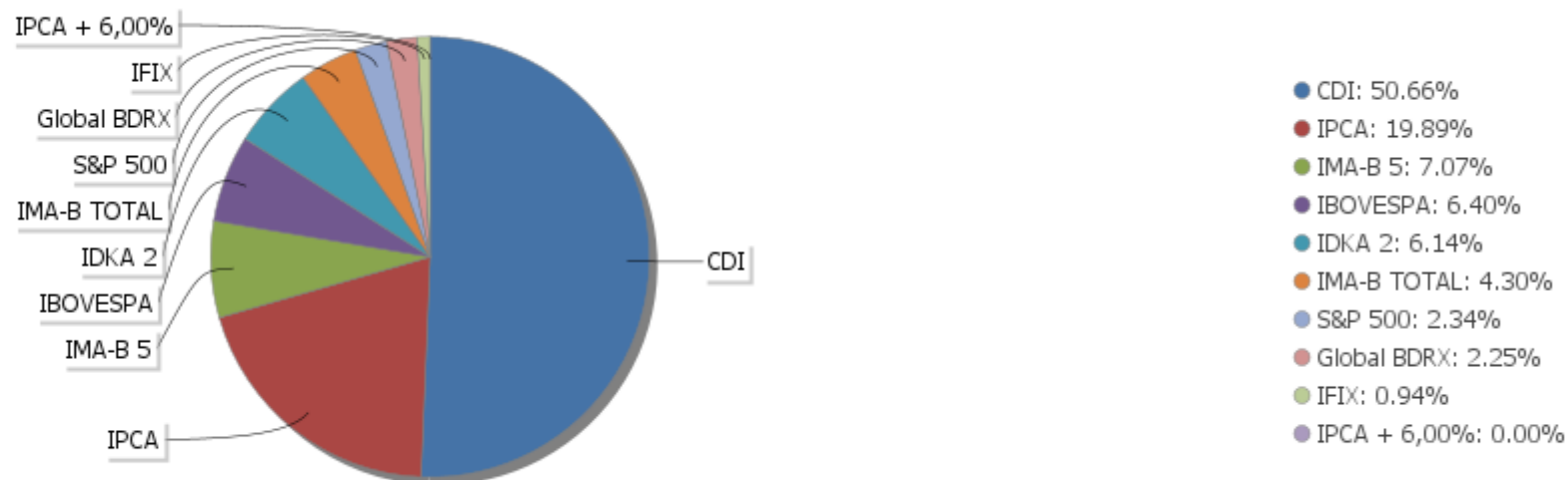
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	161.741.243,76	69,64	50,00	161.741.243,76	69,64	50,00
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00		161.741.243,76	69,64	50,00
acima de 365 dias	70.502.759,01	30,36		232.244.002,77	100,00	50,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

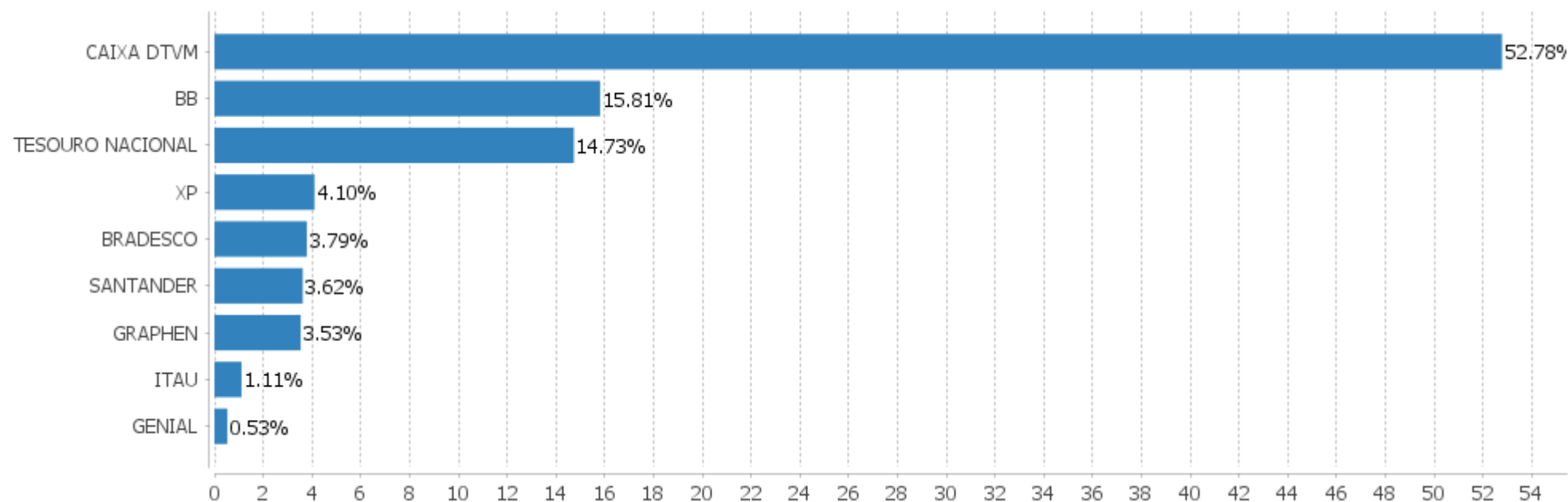


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2024	0,47	0,82	0,65	-0,18	0,72	0,72	1,10	1,09	0,31				5,84
IPCA + 4,96%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60	0,82	0,40	0,85				7,15
p.p. indexador	-0,37	-0,38	0,11	-0,99	-0,15	0,12	0,27	0,69	-0,54				-1,31
2023	1,28	-0,12	0,69	0,98	1,45	1,62	1,03	0,51	0,46	0,02	2,16	1,45	12,13
IPCA + 4,81%	0,94	1,18	1,14	0,95	0,64	0,31	0,51	0,66	0,63	0,63	0,65	0,94	9,59
p.p. indexador	0,33	-1,29	-0,46	0,03	0,81	1,30	0,52	-0,15	-0,18	-0,61	1,50	0,52	2,54
2022	0,90	0,32	2,54	-2,42	1,29	-1,90	1,12	1,70	0,58	2,21	-1,08	-0,13	5,11
IPCA + 4,84%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,29	0,07	0,10	0,97	0,79	1,04	10,88
p.p. indexador	-0,03	-1,05	0,50	-3,84	0,40	-2,97	1,41	1,63	0,48	1,24	-1,87	-1,17	-5,77
2021	-0,87	-1,11	0,42	1,13	1,62	0,49	-1,14	-1,30	-1,12	-2,34	1,30	0,98	-2,01
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,67	1,37	1,22	15,99
p.p. indexador	-1,54	-2,35	-0,99	0,40	0,35	-0,48	-2,56	-2,64	-2,73	-4,01	-0,07	-0,24	-18,00
2020	0,22	-1,14	-7,62	-0,32	1,94	1,77	2,89	0,49	-1,40	-0,10	2,74	3,33	2,34
IPCA + 5,86%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,62
p.p. indexador	-0,49	-1,80	-8,19	-0,46	1,87	1,03	2,01	-0,22	-2,52	-1,44	1,40	1,48	-8,28
2019	3,17	0,13	0,33	0,93	1,68	2,27	1,00	0,16	1,69	1,80	0,46	2,27	17,05
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	2,34	-0,76	-0,87	-0,13	1,04	1,82	0,27	-0,46	1,25	1,17	-0,52	0,63	6,46
2018	2,72	-0,87	0,78	0,37	-2,04	-0,27	2,02	-0,90	0,55	4,00	0,72	0,93	8,16
IPCA + 6,00%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	1,92	-1,61	0,20	-0,34	-2,93	-2,02	1,18	-1,34	-0,37	3,04	0,46	0,31	-1,76

Performance Sobre a Meta Atuarial

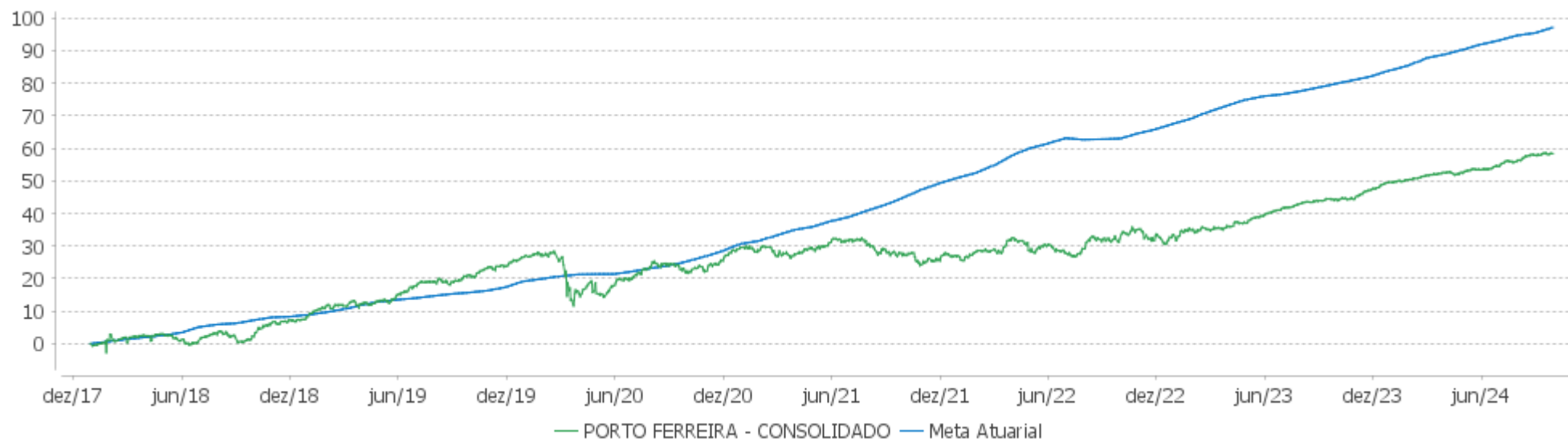
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	37	45,68
Meses abaixo - Meta Atuarial	44	54,32
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,00	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-7,62	2020-03

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,52	2,09	0,43	1,62
06 meses	3,80	4,42	-0,61	1,59
12 meses	9,71	9,55	0,17	1,60
24 meses	19,82	20,73	-0,91	3,18
36 meses	24,61	35,83	-11,22	4,01
48 meses	29,64	57,99	-28,34	4,27
60 meses	30,85	72,55	-41,70	6,12
Desde 29/12/2017	58,37	103,08	-44,70	6,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

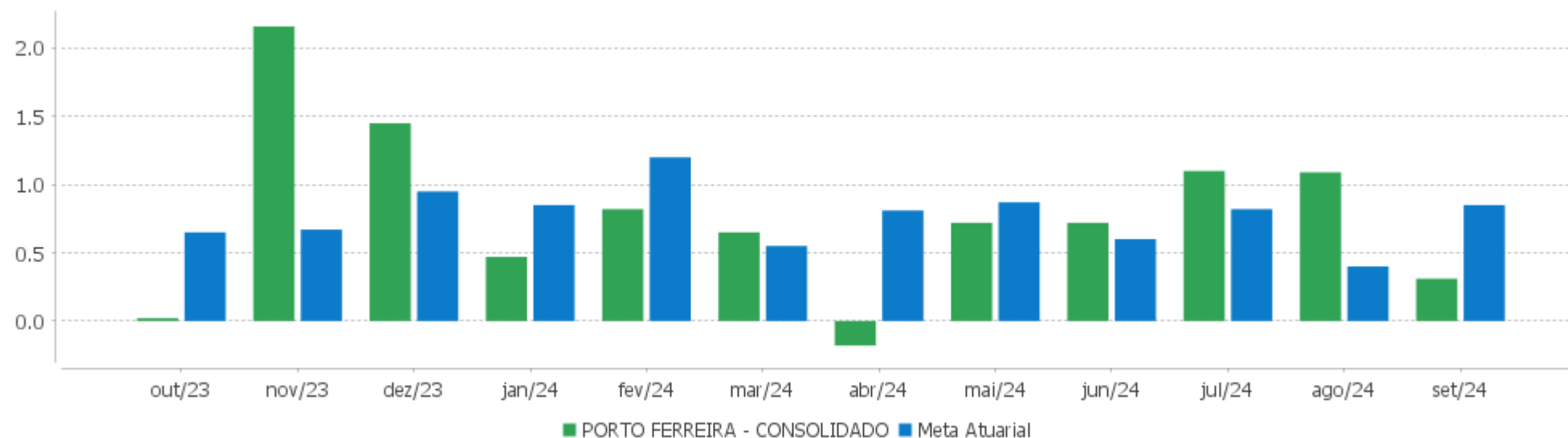


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
PIATÃ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO % do CDI	0,73 87,23	-3,56 -44,59	-0,45 -17,13	-2,34 -44,77	-5,16 -46,65	-23,38 -89,98	-63,29 -159,38
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,38 -0,02	5,14 -0,17	1,87 -0,05	3,07 -0,11	8,21 -0,23	20,61 -0,45	31,64 -0,61
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IDKA 2 p.p.	0,48 0,09	5,06 0,05	1,89 0,14	2,95 0,24	8,09 0,04	20,22 -0,17	30,71 -0,42
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,52 0,08	4,59 1,29	2,18 1,38	2,74 0,88	7,65 3,22	21,44 11,61	32,91 15,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,40 0,00	4,73 -0,28	1,72 -0,02	2,60 -0,12	7,72 -0,33	19,96 -0,44	30,11 -1,01
FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA % do CDI	0,30 36,47	3,89 48,72	1,89 71,88	2,11 40,35	7,23 65,40	19,40 74,68	
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	6,65 3,35	2,71 1,91	4,15 2,28	9,77 5,34	24,69 14,85	35,92 18,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,83 99,84	7,77 97,19	2,64 100,14	5,08 97,24	10,77 97,44	25,55 98,32	39,49 99,44
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,83 99,87	7,97 99,70	2,63 100,06	5,21 99,72	10,99 99,45	25,87 99,58	39,67 99,89
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA Var. IPCA p.p.	0,63 0,19	4,18 0,88	2,23 1,43	2,55 0,69	8,39 3,96	20,05 10,21	32,94 15,23
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,83 99,20	7,90 98,84	2,61 99,09	5,17 98,82	10,90 98,55	25,66 98,74	39,31 99,00
NTN-B 150850 (6,290000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,23	1,92 -1,38	-0,78 -1,58	1,78 -0,08	4,33 -0,10		
NTN-B 150850 (6,260000%) Var. IPCA p.p.	0,65 0,21	1,91 -1,40	-0,79 -1,60	1,76 -0,10	4,30 -0,12		
NTN-B 150850 (6,120000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,25	2,01 -1,29	-0,68 -1,48	1,85 -0,02	4,38 -0,05		
NTN-B 150840 (6,130000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,30	2,03 -1,28	-0,67 -1,48	1,85 -0,01	4,39 -0,03		
NTN-B 150545 (6,250000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,28	5,09 1,78	2,29 1,49	1,84 -0,02	4,39 -0,03		
NTN-B 150545 (6,100000%)	0,69	5,04	2,27	1,83	4,36		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,25	1,73	1,47	-0,04	-0,06		
NTN-B 150545 (6,270000%)	0,73	5,10	2,30	1,85	4,40		
Var. IPCA p.p.	0,29	1,79	1,50	-0,02	-0,02		
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I	-0,98	-10,15	-2,40	-5,19	-10,15	195.952.417,46	195.952.417,46
% do CDI	-117,86	-127,06	-91,32	-99,35	-91,84	754.112.427,43	493.437.006,15
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	-0,42	-7,82	-5,20	-6,46	-8,94	-10,54	-7,17
% do CDI	-50,65	-97,84	-197,54	-123,57	-80,86	-40,58	-18,06
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,88	8,67	2,82	5,58	11,94	27,59	42,37
% do CDI	106,08	108,47	107,20	106,79	108,00	106,19	106,70
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,84	8,11	2,73	5,33	11,17	26,07	40,17
% do CDI	100,90	101,54	103,75	101,89	101,08	100,35	101,16
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP	-0,64	0,81	2,14	0,61	5,61	16,86	25,18
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,03	-0,01	0,20	-0,03	-0,00	-0,42	-0,60
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	0,01	-0,63	-0,69	-1,15	0,50	5,49	8,05
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,68	-1,45	-2,63	-1,79	-5,11	-11,79	-17,73
XP INVESTOR FI DE ACOES	-4,28	-4,79	6,50	-3,39	8,33	14,58	25,21
Var. IBOVESPA p.p.	-1,20	-3,02	0,12	-6,29	-4,76	-5,21	6,43
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	-3,14	-7,65	3,89	-0,21	5,18	7,22	5,63
Var. IBOVESPA p.p.	-0,07	-5,88	-2,49	-3,11	-7,90	-12,58	-13,15
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-0,32	40,56	0,75	22,25	51,31	81,77	40,30
Var. Global BDRX p.p.	-0,12	-1,40	0,12	-0,25	-1,67	-4,63	-4,59
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	-0,38	-5,06	-1,16	-2,28	-6,08	-12,05	-16,81
% do CDI	-45,98	-63,30	-44,11	-43,66	-55,01	-46,39	-42,32
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2,33	24,07	6,32	11,65	40,19	81,31	64,51
Var. S&P 500 p.p.	4,06	-11,88	2,89	-7,94	-6,02	19,37	30,52
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,93	-7,95	-2,35	-4,95	-10,66	-23,33	-40,10
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	0,20	-3,36	0,47	-3,53	-2,83	-0,03	4,13
Var. IFIX p.p.	2,78	-3,19	1,71	-0,53	-5,52	-10,57	-17,61
PORTO FERREIRA - CONSOLIDADO	0,31	5,84	2,52	3,80	9,71	19,82	24,61
Var. IPCA + 4,96% p.p.	-0,54	-1,31	0,43	-0,61	0,13	-1,12	-11,42
CDI	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71
IBOVESPA	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78
INPC + 6,00%	0,97	7,93	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78
IPCA + 6,00%	0,93	7,95	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI						
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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				
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,00
LEME MULTISETORIAL IPCA FIDC	D+0	D+0				
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1008 du	D+1009 du	PERÍODO SEMESTRAL, C / VENCIMENTO NO ÚLTIMO DIA ÚTIL DE	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,82	7,18	2,55	4,60	10,28	25,21	37,49	40,92	47,32
IRF-M 1+	0,11	2,50	2,27	1,11	7,67	22,81	31,70	27,56	37,27
IRF-M TOTAL	0,34	3,90	2,36	2,19	8,45	23,17	33,03	31,68	40,32
IMA-B 5	0,40	5,30	1,92	3,18	8,43	21,06	32,25	40,12	50,27
IMA-B 5+	-1,42	-2,62	2,55	-1,13	3,64	14,16	20,09	23,93	21,86
IMA-B TOTAL	-0,67	0,82	1,94	0,64	5,61	17,28	25,78	31,70	34,48
IMA-GERAL TOTAL	0,34	4,99	2,51	3,30	8,98	22,61	33,94	37,26	43,22
IDKA 2	0,39	5,01	1,75	2,72	8,05	20,40	31,12	39,27	50,42
IDKA 20	-3,07	-9,14	3,35	-4,78	0,20	8,96	10,04	12,27	2,29
CDI	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71	43,89	49,01

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78	39,34	25,84
IBRX 100	-2,97	-1,23	6,43	3,20	13,53	19,31	17,72	38,71	26,80
IBRX 50	-3,26	-0,22	6,28	4,00	14,18	20,25	20,95	43,28	28,92
SMALL CAP	-4,41	-13,67	1,39	-9,99	-3,75	-6,59	-23,80	-11,80	-13,37
Índice Consumo - ICON	-4,71	-11,22	3,27	-4,43	-0,29	-18,06	-40,81	-41,80	-42,40
Índice Dividendos - IDIV	-0,72	4,25	7,93	8,38	19,48	36,40	46,24	74,87	57,72

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	-1,73	35,95	3,43	19,59	46,21	61,94	33,99	65,50	153,26

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-2,58	-0,16	-1,24	-3,00	2,69	10,54	21,74	18,29	23,16

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-1,59	31,85	4,09	18,60	41,09	55,11	20,24	45,57	114,03

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,44	3,31	0,80	1,86	4,42	9,84	17,71	29,77	33,84
INPC	0,48	3,29	0,60	1,69	4,09	8,78	16,60	29,18	34,20
IGPM	0,62	2,64	1,52	3,58	4,53	-1,71	6,40	32,85	56,68
SELIC	0,83	7,99	2,63	5,23	11,05	25,98	39,71	43,89	49,01

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,77	6,41	1,84	3,93	8,58	18,75	32,35	51,72	62,74
IPCA + 5,00%	0,85	7,18	2,10	4,44	9,62	21,03	36,19	57,62	70,69
IPCA + 5,50%	0,89	7,56	2,22	4,69	10,14	22,18	38,14	60,63	74,78
IPCA + 5,89%	0,92	7,86	2,32	4,89	10,55	23,08	39,67	63,01	78,02
IPCA + 6,00%	0,93	7,95	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10	63,69	78,95
INPC + 4,00%	0,81	6,39	1,64	3,75	8,24	17,60	31,10	51,03	63,17
INPC + 6,00%	0,97	7,93	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78	62,93	79,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150545 (6,100000%)	5.036.582,29	6,100000	4.851.386,47	6,436600	-185.195,82
NTN-B 150545 (6,250000%)	5.030.688,85	6,250000	4.927.519,83	6,436600	-103.169,02
NTN-B 150545 (6,270000%)	5.028.491,04	6,270000	4.935.979,09	6,436600	-92.511,95
NTN-B 150840 (6,130000%)	4.024.293,16	6,130000	3.910.823,35	6,420000	-113.469,81
NTN-B 150850 (6,120000%)	5.037.532,28	6,120000	4.829.061,88	6,456600	-208.470,40
NTN-B 150850 (6,260000%)	5.029.953,75	6,260000	4.911.751,29	6,456600	-118.202,46
NTN-B 150850 (6,290000%)	5.029.060,90	6,290000	4.928.289,18	6,456600	-100.771,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
116	03/09/2024	NTN-B 150545 (6,250000%)	4.998.112,94	0,00	1.165,00000000	4.290,2256995700
115	03/09/2024	NTN-B 150840 (6,130000%)	3.998.582,86	0,00	932,00000000	4.290,3249571000
117	03/09/2024	NTN-B 150850 (6,260000%)	4.997.327,22	0,00	1.188,00000000	4.206,5043939400
121	03/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	14.000.000,00	2.438.596,57352100	5,7410070000
114	04/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.383,43	0,00	1.633,74060300	5,7435250000
119	04/09/2024	NTN-B 150545 (6,270000%)	4.997.091,38	0,00	1.167,00000000	4.281,9977549300
118	04/09/2024	NTN-B 150850 (6,290000%)	4.997.569,91	0,00	1.192,00000000	4.192,5922063800
122	04/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	47.121,63	0,00	8.204,30484700	5,7435250000
123	04/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	10.000.000,00	1.741.091,05498300	5,7435250000
109	09/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	190.086,98	0,00	33.056,69655200	5,7503320000
113	11/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19.066,65	0,00	3.313,15780600	5,7548270000
124	11/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.785,42	0,00	1.179,08322800	5,7548270000
112	27/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	295.000,00	51.020,95494700	5,7819380000
111	30/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	252.470,08	43.647,75969300	5,7842620000
110	30/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	28.000,00	0,00	4.840,72125300	5,7842620000
120	30/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	250.267,39	0,00	43.266,95263800	5,7842620000
Total			24.539.395,81	24.547.470,08		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.870.004,67

Value-At-Risk: 0,81%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,89	0,47	5,00	0,27	-0,28	0,58	204.494.330,28	88,05
Artigo 8º	14,20	7,40	20,00	0,41	-0,33	-3,87	14.872.461,90	6,40
Artigo 9º	18,83	9,23	20,00	0,03	-0,06	-0,32	5.222.196,77	2,25
Artigo 10º	13,59	7,41	20,00	0,09	NaN	NaN	5.460.589,93	2,35
Artigo 11º	0,68	0,17	20,00	0,00	-0,94	0,20	2.194.423,89	0,94
PORTO FERREIRA - CONSOLIDADO		0,81		0,81			232.244.002,77	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,47%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,130000%)	0,41	0,20	-0,00	0,20	-0,23	0,74	4.024.293,16	1,73
NTN-B 150545 (6,100000%)	0,33	0,23	-0,00	0,24	-0,44	0,69	5.036.582,29	2,17
NTN-B 150545 (6,250000%)	0,29	0,20	-0,00	0,21	-0,38	0,72	5.030.688,85	2,17
NTN-B 150545 (6,270000%)	0,31	0,20	-0,00	0,21	-0,33	0,73	5.028.491,04	2,17
NTN-B 150850 (6,120000%)	0,39	0,25	-0,00	0,25	-0,37	0,69	5.037.532,28	2,17
NTN-B 150850 (6,260000%)	0,37	0,20	-0,00	0,20	-0,49	0,65	5.029.953,75	2,17
NTN-B 150850 (6,290000%)	0,30	0,20	-0,00	0,20	-0,55	0,67	5.029.060,90	2,17
Sub-total	0,32	0,15	-0,00		-0,53	0,67	34.216.602,27	14,73

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,37	0,42	0,00	0,43	-0,34	0,71	4.164.919,16	1,79
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,72	1,12	0,02	0,23	-0,21	0,48	7.132.671,18	3,07
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,01	0,01	0,00	0,01	-0,09	0,83	20.056.839,09	8,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	2,36	1,50	0,13	1,50	-0,22	0,30	30.532.270,28	13,15
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,94	1,22	0,02	0,25	-0,23	0,40	7.117.869,86	3,06
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,03	1,01	0,05	0,01	-0,22	0,38	16.421.872,77	7,07
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,04	0,04	0,00	0,04	-0,03	0,83	47.496.761,04	20,45
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,18	0,66	0,01	0,66	-0,26	0,52	5.240.209,22	2,26
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	1,06	0,70	0,00	0,71	-0,19	0,63	2.575.460,07	1,11
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,01	0,01	-0,00	0,01	-0,54	0,83	8.405.706,66	3,62
Sub-total	0,95	0,58	0,24		-0,23	0,62	149.144.579,33	64,22

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,02	0,02	0,00	0,02	0,33	0,84	7.483,94	0,00
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,04	0,05	-0,00	0,05	1,20	0,88	8.795.212,11	3,79
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP	3,78	2,09	0,03	0,14	-0,39	-0,64	5.099.329,75	2,20
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	0,85	0,53	0,00	1,84	-0,97	0,01	4.882.677,19	2,10
Sub-total	1,24	0,64	0,03		-0,48	0,24	18.784.702,99	8,09

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I	3,42	0,20	0,00	0,20	-0,53	-0,98	360.498,41	0,16
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1,47	0,28	-0,00	0,28	-0,86	-0,42	1.116.738,01	0,48
Sub-total	1,95	0,25	0,00		-0,72	-0,56	1.477.236,42	0,64

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	3,73	0,52	-0,00	0,52	-0,03	0,73	871.209,27	0,38
Sub-total	3,73	0,52	-0,00		-0,03	0,73	871.209,27	0,38

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,40%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	12,09	6,15	0,12	1,65	-0,33	-3,14	5.350.177,51	2,30
XP INVESTOR FI DE ACOES	16,10	8,55	0,30	4,62	-0,32	-4,28	9.522.284,39	4,10
Sub-total	14,20	7,40	0,41		-0,33	-3,87	14.872.461,90	6,40

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,41%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,63	7,43	0,09	6,12	0,11	2,33	5.444.727,70	2,34
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	0,00	0,00	0,00	0,01	-2.562,50	-0,38	15.862,23	0,01
Sub-total	13,59	7,41	0,09		0,11	2,32	5.460.589,93	2,35

Artigo 10º II

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

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,23%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,83	9,23	0,03	1,21	-0,06	-0,32	5.222.196,77	2,25
Sub-total	18,83	9,23	0,03		-0,06	-0,32	5.222.196,77	2,25

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,17%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	0,68	0,17	0,00	2,51	-0,94	0,20	2.194.423,89	0,94
Sub-total	0,68	0,17	0,00		-0,94	0,20	2.194.423,89	0,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

- (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 (%)