



PORTO FERREIRA - CONSOLIDADO
NOVEMBRO 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 29.11.2024.

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	88,28%
------------	--------

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%)	4,16	0,09	0,86	2,58	4.101.828,09	1,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,100000%)	2,95	0,07	0,86	2,70	4.985.136,94	2,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,250000%)	3,00	0,06	0,87	2,61	4.978.014,23	2,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,270000%)	3,00	0,07	0,87	2,59	4.975.671,96	2,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,120000%)	4,17	0,09	0,86	2,70	5.134.514,64	2,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,260000%)	4,24	-0,01	0,87	2,61	5.127.980,64	2,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,290000%)	4,25	0,01	0,87	2,60	5.127.300,32	2,18
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,26	0,05	0,87	2,69	34.430.446,82	14,63

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	0,68	0,02	0,45	5,38	4.215.172,29	1,79	5.659.641.883,51	0,07
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,75	-0,10	0,31	6,24	7.212.954,40	3,06	4.812.833.118,29	0,15
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,03	0,04	0,80	9,85	20.405.867,63	8,67	31.890.085.235,30	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	2,39	-0,10	0,12	4,70	29.874.481,48	12,69	467.862.128,95	6,39
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,88	-0,10	0,20	5,74	7.186.493,30	3,05	3.885.051.809,15	0,18

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	1,66	-0,05	0,34	6,25	16.595.530,54	7,05	6.786.887.264,23	0,24
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,10	0,04	0,81	9,67	50.182.251,37	21,32	11.355.883.585,27	0,44
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,24	-0,00	0,53	6,05	5.313.338,48	2,26	3.931.535.018,92	0,14
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	1,73	-0,00	0,59	4,47	2.611.779,95	1,11	1.736.916.429,57	0,15
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM RF REF DI CIC FIF RESP LIMITADA	0,04	0,04	0,80	9,76	8.551.175,47	3,63	7.142.004.073,50	0,12
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,83	-0,01	0,54	7,94	152.149.044,91	64,65		

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	0,81	10,00	7.614,66	0,00	19.993.814.988,50	0,00
BRABESCO	BRABESCO	BRABESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,09	0,04	0,81	6,81	8.948.568,21	3,80	15.384.948.340,63	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP	3,90	0,15	0,05	1,39	5.069.332,19	2,15	894.779.148,87	0,57
GRAPHEN	RJI	LME REC IMA B FI RENDA FIXA *	1,80	-0,05	-0,22	-0,91	4.869.011,02	2,07	75.065.994,37	6,49
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,44	0,05	0,34	3,01	18.894.526,08	8,03		

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 *	4,45	-1,07	-1,07	-10,02	353.514,37	0,15	5.713.828,31	6,19
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC *	4,76	-0,42	-0,42	-8,58	1.107.506,68	0,47	65.840.937,25	1,68
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			4,12	-0,58	-0,58	-8,92	1.461.021,05	0,62		

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 *	2,12	-0,04	0,41	-5,72	839.458,68	0,36	18.740.580,50	4,48

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 b	2,12	-0,04	0,41	-5,72	839.458,68	0,36		
		Renda Fixa	0,81	-0,00	0,57	7,58	207.774.497,54	88,28		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL

5,79%

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	11,84	0,63	-2,46	-10,83	5.165.737,38	2,19	1.002.275.983,06	0,52
XP	SANTANDER	XP INVESTOR FI DE ACOES	17,09	0,53	-9,85	-15,37	8.463.800,69	3,60	169.110.734,37	5,00
Sub-total Artigo 8º I			14,65	0,57	-7,18	-13,71	13.629.538,07	5,79		
Renda Variável			14,65	0,57	-7,18	-13,71	13.629.538,07	5,79		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,54%

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	15,85	0,85	8,26	61,18	5.988.346,97	2,54	3.068.343.167,19	0,20
Sub-total Artigo 9º III			15,85	0,85	8,26	61,18	5.988.346,97	2,54		
Investimentos no Exterior			15,85	0,85	8,26	61,18	5.988.346,97	2,54		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,45%

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	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	11,93	0,60	6,02	31,10	5.753.075,33	2,44	2.093.767.426,45	0,27
GRAPHEN	RJI	LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V *	1,77	-0,02	-0,37	-5,79	15.740,14	0,01	1.298.255,45	1,21
Sub-total Artigo 10º I			11,88	0,59	6,00	30,90	5.768.815,47	2,45		

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 MULTIESTRATEGIA *	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			11,88	0,59	6,00	30,90	5.768.815,47	2,45		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,93%

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 *	4,26	0,18	0,18	-3,22	2.193.084,89	0,93	68.717.563,86	3,19
		Sub-total Artigo 11°	4,26	0,18	0,18	-3,22	2.193.084,89	0,93		
		Fundos Imobiliários	4,26	0,18	0,18	-3,22	2.193.084,89	0,93		
		Total	1,48	0,07	0,39	7,05	235.354.282,94	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	34.430.446,82	14,63	0,00	15,00	50,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	152.149.044,91	64,65	0,00	53,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	18.894.526,08	8,03	0,00	8,00	50,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.461.021,05	0,62	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	839.458,68	0,36	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	207.774.497,54	88,28					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	13.629.538,07	5,79	0,00	12,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	13.629.538,07	5,79					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	5.988.346,97	2,54	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	5.988.346,97	2,54					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	5.768.815,47	2,45	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	5.768.815,47	2,45					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.193.084,89	0,93	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	2.193.084,89	0,93					5,00
Total		235.354.282,94	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	Atribuição Desemp. (%)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,87 109,79	2,69 99,73	2,62 101,69			298.831,41	0,13	891.711,68
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,54 68,68	7,94 80,62	2,01 77,99	4,26 81,55	9,18 84,67	816.740,13	0,35	13.441.619,22
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,34 42,78	3,01 30,57	0,83 32,07	2,12 40,65	3,54 32,66	63.735,07	0,03	474.119,16
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,58 -72,97	-8,92 -90,48	-1,65 -64,13	-6,24 -119,31	-9,47 -87,37	-8.483,49	-0,00	-143.018,84
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,41 51,82	-5,72 -58,00	0,87 33,66	-1,05 -20,18	-5,93 -54,73	3.493,47	0,00	-55.051,02
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-7,18 -4,06	-13,71 -7,36	-11,91 -4,31	-1,82 -4,74	-9,18 -7,88	-1.054.478,75	-0,45	-2.164.993,96
Artigo 9º III % do CDI	8,26 1.044,45	61,18 620,85	14,30 555,28	30,24 578,57	65,35 602,94	457.083,34	0,20	1.843.126,73
Artigo 10º I % do CDI	6,00 758,89	30,90 313,57	8,10 314,40	16,65 318,57	37,65 347,33	326.757,34	0,14	1.111.488,67
Artigo 11º % do CDI	0,18 23,32	-3,22 -32,72	0,44 17,25	-3,43 -65,70	-3,02 -27,88	4.038,81	0,00	-73.419,55
PORTO FERREIRA - CONSOLIDADO (Total)						907.717,33	0,39	15.325.582,09

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%)	5.089.580,49	0,00	0,00	147.770,57	4.985.136,94	43.327,02	134.208,09
NTN-B 150545 (6,250000%)	5.084.284,84	0,00	0,00	150.089,55	4.978.014,23	43.818,94	129.990,84
NTN-B 150545 (6,270000%)	5.082.149,37	0,00	0,00	150.347,21	4.975.671,96	43.869,80	128.927,79
NTN-B 150840 (6,130000%)	4.066.735,23	0,00	0,00	0,00	4.101.828,09	35.092,86	103.245,23
NTN-B 150850 (6,120000%)	5.090.626,11	0,00	0,00	0,00	5.134.514,64	43.888,53	134.955,90
NTN-B 150850 (6,260000%)	5.083.609,18	0,00	0,00	0,00	5.127.980,64	44.371,46	130.653,42
NTN-B 150850 (6,290000%)	5.082.837,52	0,00	0,00	0,00	5.127.300,32	44.462,80	129.730,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	34.579.822,74	0,00	0,00	448.207,33	34.430.446,82	298.831,41	

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	4.196.083,72	0,00	0,00	0,00	4.215.172,29	19.088,57	215.172,29
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	7.190.352,80	0,00	0,00	0,00	7.212.954,40	22.601,60	533.638,30
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	20.244.274,53	0,00	0,00	0,00	20.405.867,63	161.593,10	1.828.941,29
FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	30.734.246,06	0,00	0,00	898.961,26	29.874.481,48	39.196,68	1.402.516,89
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7.171.887,22	0,00	0,00	0,00	7.186.493,30	14.606,08	489.758,81
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.539.675,26	0,00	0,00	0,00	16.595.530,54	55.855,28	975.950,64
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	47.929.249,61	1.890.539,18	-30.131,85	0,00	50.182.251,37	392.594,43	6.421.217,74
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5.285.169,90	0,00	0,00	0,00	5.313.338,48	28.168,58	303.158,61
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	2.596.585,42	0,00	0,00	0,00	2.611.779,95	15.194,53	111.779,95
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM RF REF DI CIC FIF RESP LIMITADA	8.483.334,19	0,00	0,00	0,00	8.551.175,47	67.841,28	1.194.421,62
	150.370.858,71	1.890.539,18	-30.131,85	898.961,26	152.149.044,91	816.740,13	

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	7.553,76	0,00	0,00	0,00	7.614,66	60,90	692,37
BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	8.876.798,85	0,00	0,00	0,00	8.948.568,21	71.769,36	448.568,21
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP	5.066.915,91	0,00	0,00	0,00	5.069.332,19	2.416,28	69.332,19
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	4.879.522,49	0,00	0,00	0,00	4.869.011,02	-10.511,47	-44.473,61
	18.830.791,01	0,00	0,00	0,00	18.894.526,08	63.735,07	

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	357.324,02	0,00	0,00	0,00	353.514,37	-3.809,65	-39.075,97

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1.112.180,52	0,00	0,00	0,00	1.107.506,68	-4.673,84	-103.942,87
	1.469.504,54	0,00	0,00	0,00	1.461.021,05	-8.483,49	

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	847.803,86	0,00	0,00	11.838,65	839.458,68	3.493,47	-55.051,02
	847.803,86	0,00	0,00	11.838,65	839.458,68	3.493,47	

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	5.295.856,63	0,00	0,00	0,00	5.165.737,38	-130.119,25	-627.563,82
XP INVESTOR FI DE ACOES	9.388.160,19	0,00	0,00	0,00	8.463.800,69	-924.359,50	-1.537.430,14
	14.684.016,82	0,00	0,00	0,00	13.629.538,07	-1.054.478,75	

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	5.531.263,63	0,00	0,00	0,00	5.988.346,97	457.083,34	1.843.126,73
	5.531.263,63	0,00	0,00	0,00	5.988.346,97	457.083,34	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	5.426.258,94	0,00	0,00	0,00	5.753.075,33	326.816,39	1.112.455,73
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	15.799,19	0,00	0,00	0,00	15.740,14	-59,05	-967,06
	5.442.058,13	0,00	0,00	0,00	5.768.815,47	326.757,34	

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	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	2.189.046,08	0,00	0,00	0,00	0,00	2.193.084,89	4.038,81	-82.504,40
	2.189.046,08	0,00	0,00	0,00	0,00	2.193.084,89	4.038,81	

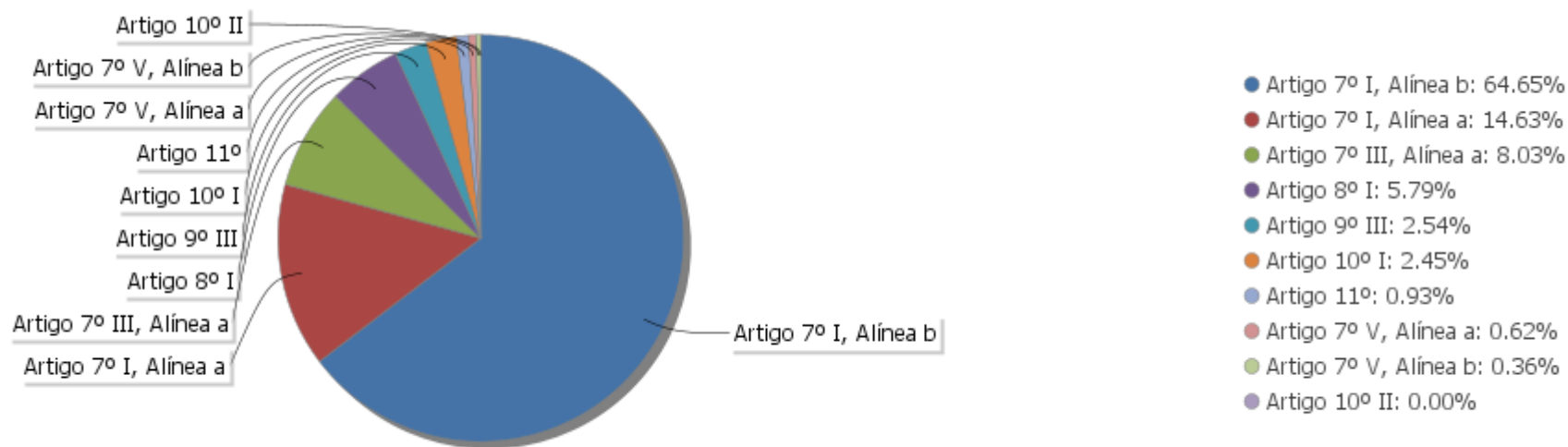
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

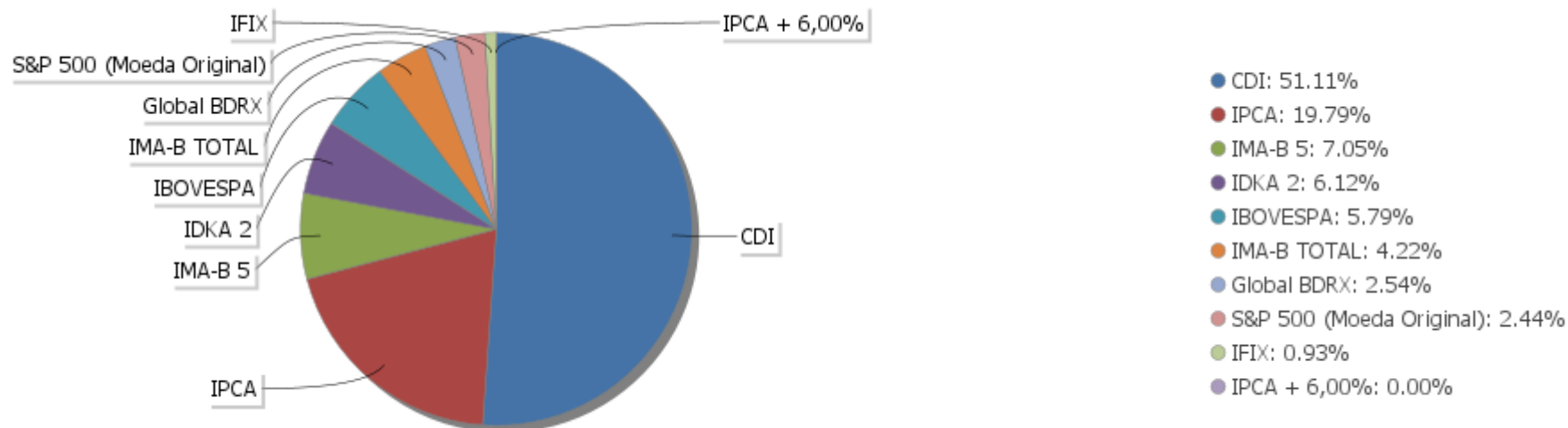
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	162.040.293,37	68,85	50,00	162.040.293,37	68,85	50,00
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00		162.040.293,37	68,85	50,00
acima de 365 dias	73.313.989,57	31,15		235.354.282,94	100,00	50,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

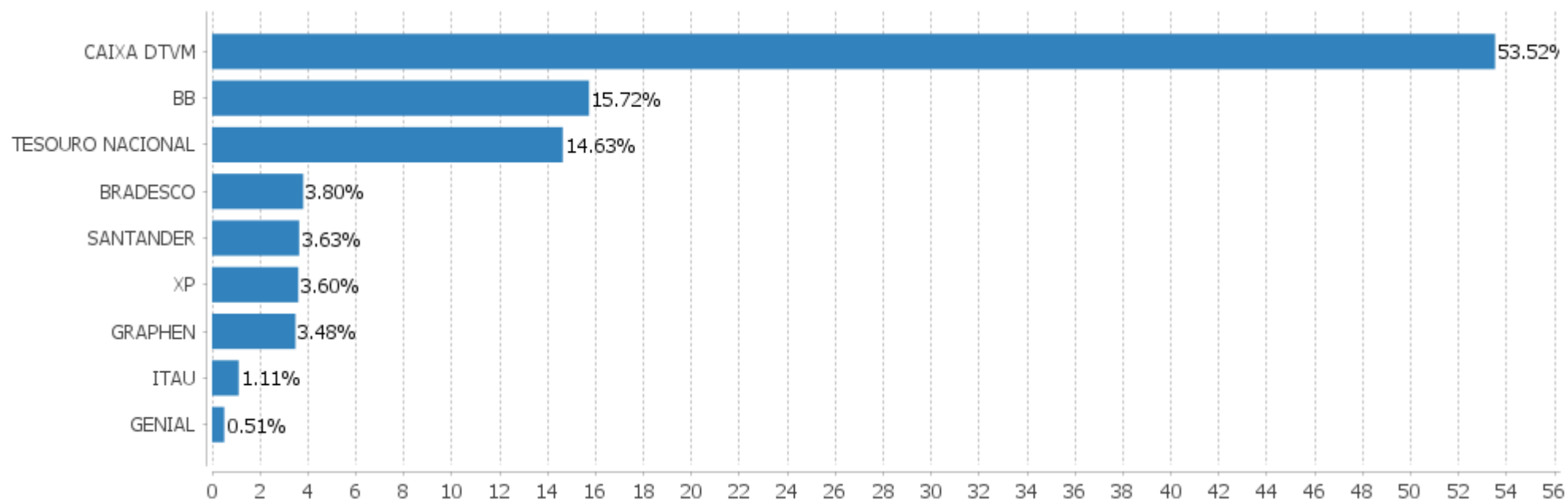


Alocação Por Estratégia



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	0,75	0,39		7,05
IPCA + 4,96%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60	0,82	0,40	0,85	1,01	0,76		9,04
p.p. indexador	-0,37	-0,38	0,11	-0,99	-0,15	0,12	0,27	0,69	-0,54	-0,25	-0,37		-1,99
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	44,58
Meses abaixo - Meta Atuarial	46	55,42
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	1,46	2,63	-1,17	1,56
06 meses	4,43	4,51	-0,08	1,59
12 meses	8,61	10,06	-1,46	1,48
24 meses	19,87	20,74	-0,87	2,45
36 meses	27,40	34,12	-6,72	3,80
48 meses	27,76	56,55	-28,79	4,17
60 meses	29,41	72,81	-43,40	6,08
Desde 29/12/2017	60,19	106,67	-46,49	6,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

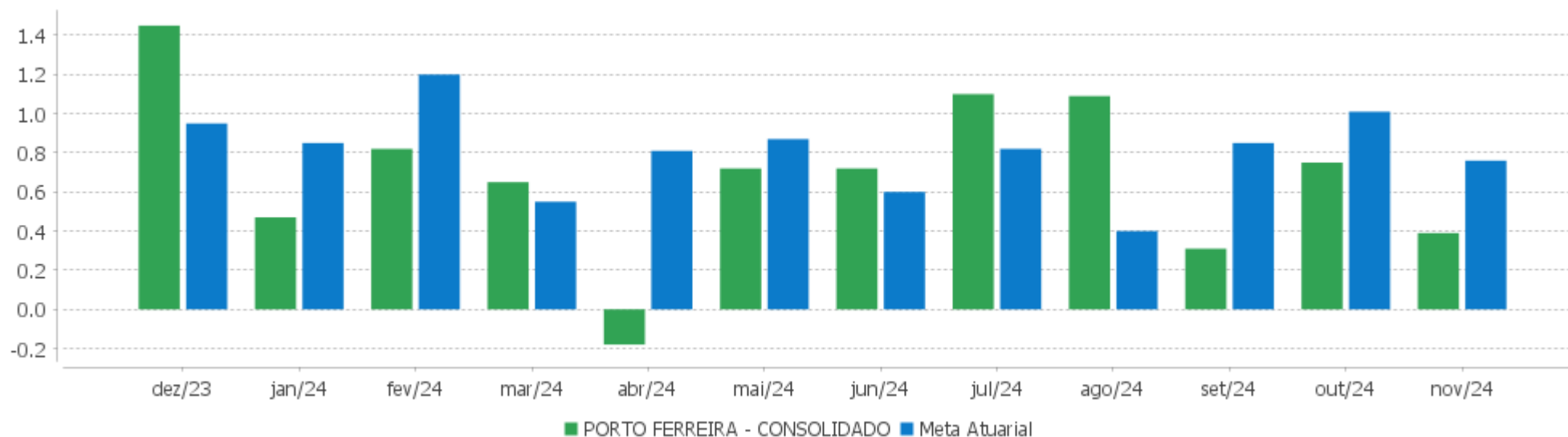


Patrimônio Líquido



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	1,80 227,81	-2,09 -21,21	2,27 87,98	0,32 6,08	-2,32 -21,36	-6,53 -25,52	-62,62 -154,17
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,34 -0,02	6,25 -0,21	1,44 -0,06	3,33 -0,11	7,78 -0,24	20,06 -0,43	31,46 -0,61
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IDKA 2 p.p.	0,31 0,10	6,24 0,15	1,61 0,19	3,30 0,33	7,75 0,11	20,15 -0,28	30,68 -0,47
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,53 0,14	6,05 1,76	1,93 0,53	3,78 1,81	7,33 2,46	21,83 12,05	34,45 18,19
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,20 -0,01	5,74 -0,35	1,36 -0,06	2,90 -0,07	7,22 -0,41	19,78 -0,65	29,95 -1,20
FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA % do CDI	0,12 14,96	4,70 47,73	1,09 42,22	2,67 51,00	6,47 59,73	19,37 75,70	
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,45 0,06	7,94 3,65	1,92 0,53	4,35 2,38	8,96 4,09	25,07 15,29	36,69 20,43
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,81 102,25	9,67 98,15	2,62 101,63	5,26 100,66	10,66 98,31	25,26 98,75	40,39 99,43
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,80 100,89	9,85 99,90	2,59 100,49	5,24 100,27	10,83 99,90	25,49 99,64	40,54 99,81
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA Var. IPCA p.p.	0,59 0,20	5,65 1,36	2,05 0,66	3,47 1,49	7,35 2,48	21,94 12,15	33,11 16,84
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM RF REF DI CIC FIF RESP LIMITADA % do CDI	0,80 101,08	9,76 99,09	2,57 99,90	5,20 99,49	10,74 99,10	25,28 98,80	40,20 98,97
NTN-B 150850 (6,290000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,48	3,92 -0,37	2,64 1,24	2,04 0,07	4,81 -0,06		
NTN-B 150850 (6,260000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,48	3,89 -0,40	2,61 1,22	2,02 0,04	4,78 -0,09		
NTN-B 150850 (6,120000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,47	3,98 -0,31	2,63 1,23	2,10 0,13	4,86 -0,01		
NTN-B 150840 (6,130000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,47	3,99 -0,30	2,68 1,29	2,11 0,14	4,87 0,00		
NTN-B 150545 (6,250000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,48	7,13 2,84	2,68 1,29	5,19 3,22	8,05 3,18		
NTN-B 150545 (6,100000%)	0,86	7,06	2,63	5,13	7,96		

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.	0,47	2,77	1,23	3,15	3,09		
NTN-B 150545 (6,270000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,48	7,15 2,86	2,70 1,30	5,21 3,23	8,07 3,20		
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I % do CDI	-1,07 -134,75	-11,89 -120,69	-2,90 -112,68	-5,65 -108,16	-11,89 -109,72	192.156.171,92 751.110.801,74	192.156.171,92 473.066.700,48
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	-0,42 -53,11	-8,58 -87,07	-1,25 -48,37	-6,42 -122,84	-8,98 -82,88	-11,50 -44,94	-8,55 -21,06
BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA % do CDI	0,81 102,19	10,56 107,18	2,64 102,68	5,49 104,99	11,60 107,01	27,09 105,90	43,11 106,12
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,81 101,89	10,00 101,50	2,60 101,09	5,35 102,35	10,99 101,43	25,67 100,35	41,04 101,03
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,05 0,03	0,22 0,03	-1,22 0,07	0,44 0,12	2,99 0,05	15,93 -0,12	23,50 -0,45
LME REC IMA B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,22 -0,24	-0,91 -1,09	-0,27 1,02	-1,30 -1,62	-0,40 -3,34	3,98 -12,06	8,94 -15,01
XP INVESTOR FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-9,85 -6,73	-15,37 -9,02	-14,92 -7,32	-4,12 -7,05	-10,92 -9,62	5,16 -6,56	21,18 -2,12
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-2,46 0,66	-10,83 -4,49	-6,48 1,12	2,21 -0,71	-6,18 -4,87	3,33 -8,39	9,00 -14,30
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	8,26 -0,06	61,18 -1,84	14,30 -0,30	30,24 -0,11	65,35 -2,30	91,70 -5,57	46,34 -4,37
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V % do CDI	-0,37 -47,24	-5,79 -58,74	-1,15 -44,67	-2,29 -43,86	-6,13 -56,53	-12,14 -47,45	-16,74 -41,21
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 (Moeda Original) p.p.	6,02 0,29	31,10 4,63	8,12 1,33	16,72 2,42	37,90 5,84	66,09 18,24	62,28 30,19
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,00 -0,83	0,00 -10,04	0,00 -2,88	0,00 -5,04	0,00 -11,17	0,00 -23,33	0,00 -38,44
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO Var. IFIX p.p.	0,18 2,29	-3,12 2,14	0,44 7,99	-3,43 3,81	-2,91 -1,68	0,20 -9,22	4,28 -17,40
PORTO FERREIRA - CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,96% p.p.	0,39 -0,37	7,05 -1,99	1,46 -1,17	4,43 -0,08	8,61 -1,47	19,87 -1,05	27,40 -7,01
CDI	0,79	9,85	2,58	5,23	10,84	25,58	40,62
IBOVESPA	-3,12	-6,35	-7,60	2,92	-1,31	11,72	23,31
INPC + 6,00%	0,77	10,01	2,91	4,86	11,13	22,31	37,39
IPCA + 6,00%	0,83	10,04	2,88	5,04	11,17	23,33	38,44

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
BRDESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
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 MULTISTRATEGIA	Não se aplica	Não se aplica				
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Não se aplica	Não se aplica				
INCENTIVO FIDC MULTISETORIAL I	Não se aplica	Não se aplica				
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,00
LEME MULTISETORIAL IPCA FIDC	D+0	D+0				
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1008 du	D+1009 du	PERÍODO SEMESTRAL, C / VENCIMENTO	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					NO ÚLTIMO DIA ÚTIL DE 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 TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM RF REF DI CIC FIF RESP LIMITADA	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	0,57	8,70	2,25	4,67	9,69	24,55	39,10	42,37	47,99
IRF-M 1+	-1,13	1,19	-1,16	0,25	2,94	21,88	31,77	26,13	33,70
IRF-M TOTAL	-0,52	3,57	0,03	1,73	5,11	22,46	33,80	31,22	38,18
IMA-B 5	0,36	6,46	1,51	3,44	8,02	20,49	32,08	39,53	49,87
IMA-B 5+	-0,23	-4,45	-3,28	-1,64	-0,68	12,61	17,33	18,28	19,09
IMA-B TOTAL	0,02	0,19	-1,29	0,32	2,94	16,04	23,95	28,04	32,54
IMA-GERAL TOTAL	0,32	5,72	1,04	3,28	7,44	22,31	34,25	37,09	42,81
IDKA 2	0,22	6,09	1,42	2,97	7,63	20,43	31,15	38,90	50,09
IDKA 20	-0,82	-13,71	-7,94	-6,77	-8,03	6,06	5,14	2,45	-2,26
CDI	0,79	9,85	2,58	5,23	10,84	25,58	40,62	45,93	50,28

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,12	-6,35	-7,60	2,92	-1,31	11,72	23,31	15,40	16,11
IBRX 100	-2,91	-5,57	-7,24	3,28	-0,40	11,51	22,85	15,49	17,47
IBRX 50	-2,62	-4,28	-7,20	3,62	0,80	11,99	26,06	18,92	20,01
SMALL CAP	-4,48	-18,66	-9,94	-4,85	-12,93	-7,61	-16,01	-27,09	-24,11
Índice Consumo - ICON	-5,91	-16,48	-10,36	-2,17	-11,49	-15,37	-33,32	-48,25	-46,33
Índice Dividendos - IDIV	-0,07	2,38	-2,50	8,11	9,45	27,77	48,64	49,15	49,07

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	10,77	58,14	14,30	32,01	61,98	69,06	42,28	89,11	175,24

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-2,11	-5,26	-7,55	-7,24	-1,23	9,42	21,68	11,71	8,55

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,57	48,34	10,72	26,80	52,35	56,31	27,87	58,39	126,10

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,39	4,29	1,40	1,98	4,87	9,78	16,26	28,75	34,30
INPC	0,33	4,27	1,43	1,80	4,84	8,88	15,38	28,03	34,68
IGPM	1,30	5,55	3,48	5,25	6,33	2,65	8,70	28,14	59,57
SELIC									

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,69	8,12	2,40	4,03	9,07	18,72	30,76	50,55	63,27
IPCA + 5,00%	0,76	9,08	2,64	4,53	10,12	21,01	34,56	56,40	71,24
IPCA + 5,50%	0,80	9,56	2,76	4,79	10,64	22,17	36,49	59,39	75,34
IPCA + 5,89%	0,82	9,93	2,86	4,98	11,05	23,07	38,01	61,76	78,59
IPCA + 6,00%	0,83	10,04	2,88	5,04	11,17	23,33	38,44	62,43	79,51
INPC + 4,00%	0,63	8,10	2,43	3,85	9,03	17,74	29,77	49,70	63,73
INPC + 6,00%	0,77	10,01	2,91	4,86	11,13	22,31	37,39	61,52	80,03

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%)	4.985.136,94	6,100000	4.595.774,24	6,830100	-389.362,70
NTN-B 150545 (6,250000%)	4.978.014,23	6,250000	4.667.896,24	6,830100	-310.117,99
NTN-B 150545 (6,270000%)	4.975.671,96	6,270000	4.675.909,80	6,830100	-299.762,16
NTN-B 150840 (6,130000%)	4.101.828,09	6,130000	3.835.097,84	6,835600	-266.730,25
NTN-B 150850 (6,120000%)	5.134.514,64	6,120000	4.714.541,02	6,821200	-419.973,62
NTN-B 150850 (6,260000%)	5.127.980,64	6,260000	4.795.269,46	6,821200	-332.711,18
NTN-B 150850 (6,290000%)	5.127.300,32	6,290000	4.811.415,15	6,821200	-315.885,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
140	08/11/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	189.620,59	0,00	32.392,57415900	5,8538290000
138	12/11/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.785,42	0,00	1.158,11656300	5,8590130000
143	12/11/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19.094,87	0,00	3.259,05916200	5,8590130000
137	19/11/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	448.207,37	0,00	76.368,42747300	5,8690140000
139	21/11/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	898.961,26	0,00	153.106,49432800	5,8714770000
136	26/11/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11.838,66	0,00	2.013,74708000	5,8789210000
141	29/11/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	37.000,00	0,00	6.285,45548900	5,8866060000
142	29/11/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	30.131,85	5.118,71343800	5,8866060000
135	29/11/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	279.031,01	0,00	47.400,99982900	5,8866060000
Total			1.890.539,18	30.131,85		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.792.219,36

Value-At-Risk: 0,76%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,00	0,41	5,00	0,21	-0,22	0,57	207.774.497,54	88,28
Artigo 8º	25,07	7,80	20,00	0,36	-0,32	-7,18	13.629.538,07	5,79
Artigo 9º	16,17	9,80	20,00	0,07	0,46	8,26	5.988.346,97	2,54
Artigo 10º	11,67	7,83	20,00	0,12	NaN	NaN	5.768.815,47	2,45
Artigo 11º	0,67	0,03	20,00	0,00	-0,90	0,18	2.193.084,89	0,93
PORTO FERREIRA - CONSOLIDADO		0,76		0,76			235.354.282,94	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,41%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,130000%)	0,28	0,28	-0,00	0,28	0,26	0,86	4.101.828,09	1,74
NTN-B 150545 (6,100000%)	0,21	0,11	-0,00	0,13	0,33	0,86	4.985.136,94	2,12
NTN-B 150545 (6,250000%)	0,17	0,09	-0,00	0,10	0,46	0,87	4.978.014,23	2,12
NTN-B 150545 (6,270000%)	0,19	0,10	-0,00	0,11	0,43	0,87	4.975.671,96	2,11
NTN-B 150850 (6,120000%)	0,28	0,29	-0,00	0,28	0,25	0,86	5.134.514,64	2,18
NTN-B 150850 (6,260000%)	0,31	0,24	-0,00	0,23	0,26	0,87	5.127.980,64	2,18
NTN-B 150850 (6,290000%)	0,23	0,22	-0,00	0,21	0,36	0,87	5.127.300,32	2,18
Sub-total	0,15	0,15	-0,00		0,51	0,87	34.430.446,82	14,63

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	0,91	0,32	0,00	0,34	-0,37	0,45	4.215.172,29	1,79
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,26	1,02	0,02	0,20	-0,21	0,31	7.212.954,40	3,06
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,02	0,01	-0,00	0,01	0,46	0,80	20.405.867,63	8,67

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	2,52	1,26	0,09	1,26	-0,27	0,12	29.874.481,48	12,69
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,37	1,10	0,02	0,22	-0,25	0,20	7.186.493,30	3,05
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,26	1,00	0,04	0,01	-0,20	0,34	16.595.530,54	7,05
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,02	0,04	0,00	0,04	0,74	0,81	50.182.251,37	21,32
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,10	0,53	0,01	0,53	-0,24	0,53	5.313.338,48	2,26
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	1,06	0,60	0,00	0,60	-0,19	0,59	2.611.779,95	1,11
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM RF REF DI CIC FIF RESP LIMITADA	0,02	0,02	-0,00	0,02	0,51	0,80	8.551.175,47	3,63
Sub-total	1,05	0,49	0,19		-0,24	0,54	152.149.044,91	64,65

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	0,03	0,02	0,00	0,02	0,58	0,81	7.614,66	0,00
BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,03	0,03	-0,00	0,03	0,55	0,81	8.948.568,21	3,80
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP	6,13	2,02	0,02	0,10	-0,12	0,05	5.069.332,19	2,15
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	1,52	0,54	0,00	1,85	-0,66	-0,22	4.869.011,02	2,07
Sub-total	2,01	0,62	0,03		-0,23	0,34	18.894.526,08	8,03

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I	3,90	0,20	-0,00	0,20	-0,48	-1,07	353.514,37	0,15
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1,53	0,28	-0,00	0,28	-0,79	-0,42	1.107.506,68	0,47
Sub-total	2,11	0,25	-0,00		-0,65	-0,58	1.461.021,05	0,62

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	5,72	0,34	0,00	0,33	0,18	1,80	839.458,68	0,36
Sub-total	3,01	0,34	0,00		-0,13	0,41	839.458,68	0,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,80%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	12,85	6,16	0,11	1,76	-0,25	-2,46	5.165.737,38	2,19
XP INVESTOR FI DE ACOES	32,61	9,27	0,26	4,83	-0,33	-9,85	8.463.800,69	3,60
Sub-total	25,07	7,80	0,36		-0,32	-7,18	13.629.538,07	5,79

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,80%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	16,17	9,80	0,07	1,19	0,46	8,26	5.988.346,97	2,54
Sub-total	16,17	9,80	0,07		0,46	8,26	5.988.346,97	2,54

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,83%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	11,71	7,86	0,12	0,80	0,45	6,02	5.753.075,33	2,44
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	0,00	0,01	0,00	0,02	-2.810,04	-0,37	15.740,14	0,01
Sub-total	11,67	7,83	0,12		0,45	6,00	5.768.815,47	2,45

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

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,03%

Artigo 11º

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	0,67	0,03	0,00	2,89	-0,90	0,18	2.193.084,89	0,93
Sub-total	0,67	0,03	0,00		-0,90	0,18	2.193.084,89	0,93

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)
(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de novembro de 2024, vale observar que:

- O Instituto está com 6,19% do patrimônio líquido do fundo INCENTIVO FIDC MULTISETORIAL I, percentual este superior ao permitido no Artigo 19 da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo PIATÃ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo INCENTIVO FIDC MULTISETORIAL I não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo LEME MULTISETORIAL IPCA FIDC não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo LME REC IMA B FI RENDA FIXA não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021.