



**LDB**  
EMPRESAS

**PORTO FELIZ**  
JUNHO 2021



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 30.06.2021.

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 78,92%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	9,61	0,66	-1,63	9.943.844,10	3,56
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>9,61</b>	<b>0,66</b>	<b>-1,63</b>	<b>9.943.844,10</b>	<b>3,56</b>

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	2,97	0,17	-1,70	8.116.531,37	2,91	7.001.217.927,34	0,12
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,54	-0,15	1,17	20.972.321,66	7,52	1.606.247.660,38	1,31
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,71	0,40	-0,84	11.882.333,99	4,26	409.950.834,72	2,90
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,35	0,18	0,65	4.162.643,45	1,49	7.575.446.149,90	0,05
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,73	0,38	-0,82	40.367.836,11	14,47	7.399.889.507,38	0,55
BRAM	BRANDESCO	BRANDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,72	0,39	-0,91	43.836.046,84	15,71	700.654.334,30	6,26
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,72	0,40	-0,84	50.589.435,79	18,14	5.867.854.510,24	0,86
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,55	-0,15	1,15	29.866.464,27	10,71	14.363.834.668,17	0,21
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>4,58</b>	<b>0,23</b>	<b>-0,50</b>	<b>209.793.613,48</b>	<b>75,21</b>		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,15	0,20	0,20	420.646,35	0,15	2.307.212.680,54	0,02
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>0,15</b>	<b>0,20</b>	<b>0,20</b>	<b>420.646,35</b>	<b>0,15</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>4,78</b>	<b>0,25</b>	<b>-0,54</b>	<b>220.158.103,93</b>	<b>78,92</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

17,56%

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,43	0,88	9,21	29.019.613,05	10,40	1.350.902.525,33	2,15
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b>			<b>20,43</b>	<b>0,88</b>	<b>9,21</b>	<b>29.019.613,05</b>	<b>10,40</b>		

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações )

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BEM	BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	20,04	0,89	13,54	9.514.415,83	3,41	2.359.525.962,49	0,40
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>20,04</b>	<b>0,89</b>	<b>13,54</b>	<b>9.514.415,83</b>	<b>3,41</b>		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	15,05	2,71	12,99	10.453.615,07	3,75	2.298.502.554,43	0,45
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>15,05</b>	<b>2,71</b>	<b>12,99</b>	<b>10.453.615,07</b>	<b>3,75</b>		

<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>			<b>19,40</b>	<b>1,30</b>	<b>10,05</b>	<b>48.987.643,95</b>	<b>17,56</b>		
--	--	--	--------------	-------------	--------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,51%

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	21,15	-1,19	0,08	9.803.366,15	3,51	2.860.128.891,15	0,34
<b>Sub-total Artigo 9º A, III</b>			<b>21,15</b>	<b>-1,19</b>	<b>0,08</b>	<b>9.803.366,15</b>	<b>3,51</b>		
Investimentos no Exterior			17,51	-1,19	0,08	9.803.366,15	3,51		
Total			5,53	0,40	0,82	278.949.114,03	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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	9.943.844,10	3,56	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	209.793.613,48	75,21	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	420.646,35	0,15	0,00	0,00	40,00	0,00	40,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>220.158.103,93</b>	<b>78,92</b>					100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	29.019.613,05	10,40	0,00	10,00	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	9.514.415,83	3,41	0,00	10,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	10.453.615,07	3,75	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>48.987.643,95</b>	<b>17,56</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	9.803.366,15	3,51	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>9.803.366,15</b>	<b>3,51</b>					10,00

**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	0,66 215,73	-1,63 -127,63	2,97 376,58	-1,63 -127,63	10,27 451,27	65.587,92	-171.883,63
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,23 75,02	-0,50 -39,05	1,81 229,73	-0,50 -39,05	5,98 262,74	529.231,84	-1.428.394,45
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,20 72,75	0,20 72,75				2.025,54	2.025,54
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,88 0,42	9,21 2,67	9,90 1,19	9,21 2,67	35,33 1,93	241.087,16	2.331.645,28
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,89 0,42	13,54 7,00	14,01 5,29	13,54 7,00	31,95 -1,45	80.127,64	967.925,07
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,71 2,25	12,99 5,75	8,76 0,04			261.075,52	709.900,74
Artigo 9º A, III % do CDI	-1,19 -386,15	0,08 8,45	-4,36 -552,79			-65.473,97	-196.633,85
<b>PORTO FELIZ (Total)</b>						<b>1.113.661,65</b>	<b>2.214.584,70</b>

**RESULTADO POR ATIVO**

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150545	9.878.256,18	0,00	0,00	0,00	9.943.844,10	65.587,92	-171.883,63
					9.943.844,10	0,00	0,00

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	40.216.759,58	0,00	0,00	0,00	40.367.836,11	151.076,53	-332.967,84
BB PREV RF IRF-M	13.290.155,86	0,00	-5.200.000,00	0,00	8.116.531,37	26.375,51	-531.825,19
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	4.117.525,36	97.000,00	-59.396,31	0,00	4.162.643,45	7.514,40	31.262,78
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	43.665.279,61	0,00	0,00	0,00	43.836.046,84	170.767,23	-401.489,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	29.911.244,17	0,00	0,00	0,00	29.866.464,27	-44.779,90	340.855,87

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	50.387.199,31	0,00	0,00	0,00	50.589.435,79	202.236,48	-426.085,94
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	11.835.072,15	0,00	0,00	0,00	11.882.333,99	47.261,84	-101.218,28
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	21.003.541,91	0,00	0,00	0,00	20.972.321,66	-31.220,25	243.148,20
					209.793.613,48	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.838.830,58	-1.420.209,77	0,00	420.646,35	2.025,54	2.025,54
					420.646,35	0,00	0,00

Artigo 8º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	28.178.525,89	600.000,00	0,00	0,00	29.019.613,05	241.087,16	2.331.645,28
					29.019.613,05	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	8.834.288,19	600.000,00	0,00	0,00	9.514.415,83	80.127,64	967.925,07
					9.514.415,83	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	8.192.539,55	2.000.000,00	0,00	0,00	10.453.615,07	261.075,52	709.900,74
					10.453.615,07	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	7.868.840,12	2.000.000,00	0,00	0,00	9.803.366,15	-65.473,97	-196.633,85



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					9.803.366,15	0,00	0,00

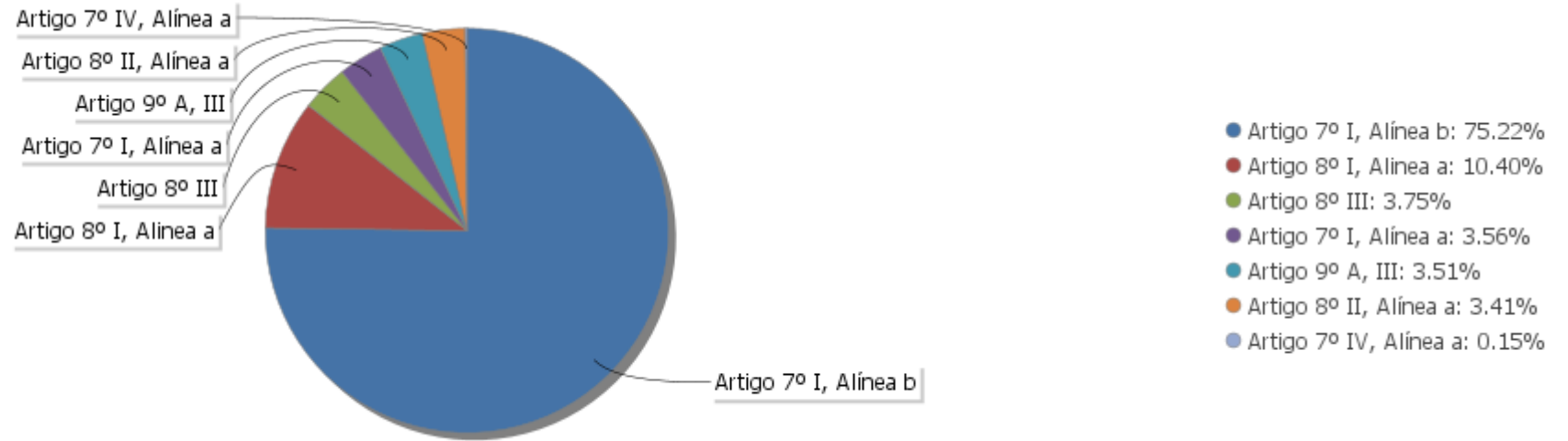
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

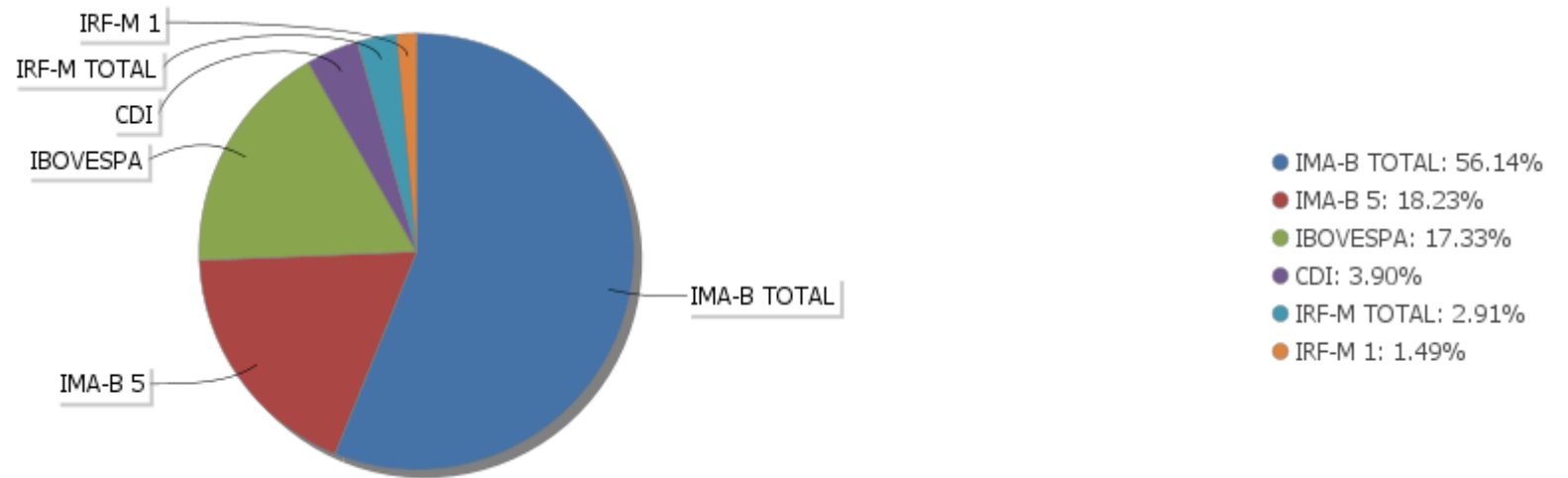
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	269.005.269,93	96,44	269.005.269,93	96,44
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	269.005.269,93	96,44
acima de 365 dias	9.943.844,10	3,56	278.949.114,03	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

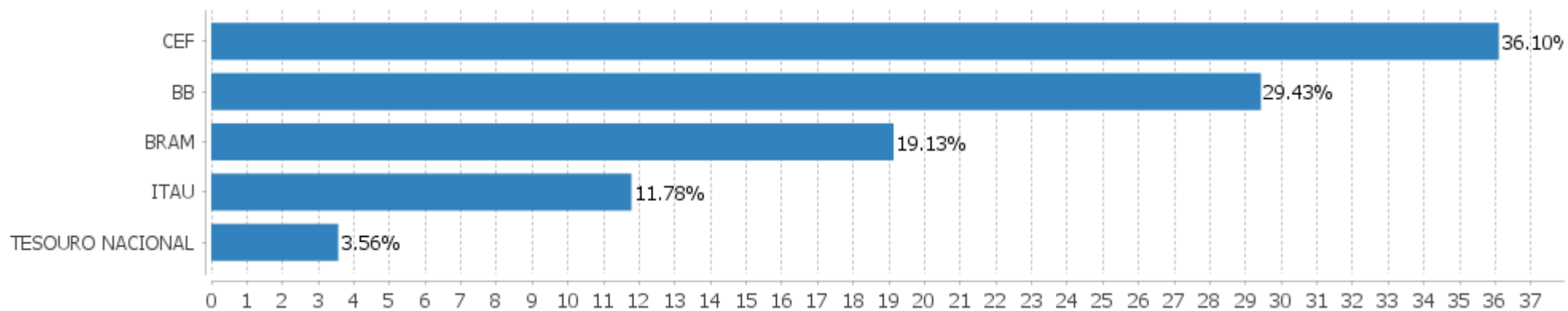


Alocação Por Estratégia



## 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
2021	-0,94	-1,43	0,32	1,05	1,43	0,40							0,82
IPCA + 5,87%	0,70	1,27	1,46	0,77	1,31	1,01							6,70
p.p. indexador	-1,64	-2,70	-1,13	0,29	0,12	-0,60							-5,88
2020	0,26	-0,04	-7,15	1,74	1,95	2,22	3,87	-1,53	-1,57	0,01	2,81	4,49	6,70
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,63
p.p. indexador	-0,45	-0,70	-7,72	1,60	1,88	1,48	2,99	-2,25	-2,69	-1,33	1,46	2,64	-3,92
2019	3,29	0,47	0,58	1,25	2,87	3,03	1,18	-0,30	2,52	2,94	-2,03	1,93	19,09
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	2,46	-0,43	-0,62	0,19	2,23	2,58	0,46	-0,92	2,07	2,30	-3,01	0,29	8,50
2018	2,70	0,63	1,00	0,02	-2,62	-0,18	1,98	-0,44	0,21	5,62	0,80	1,47	11,54
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	1,90	-0,11	0,42	-0,69	-3,50	-1,93	1,14	-0,88	-0,71	4,66	0,55	0,86	1,62

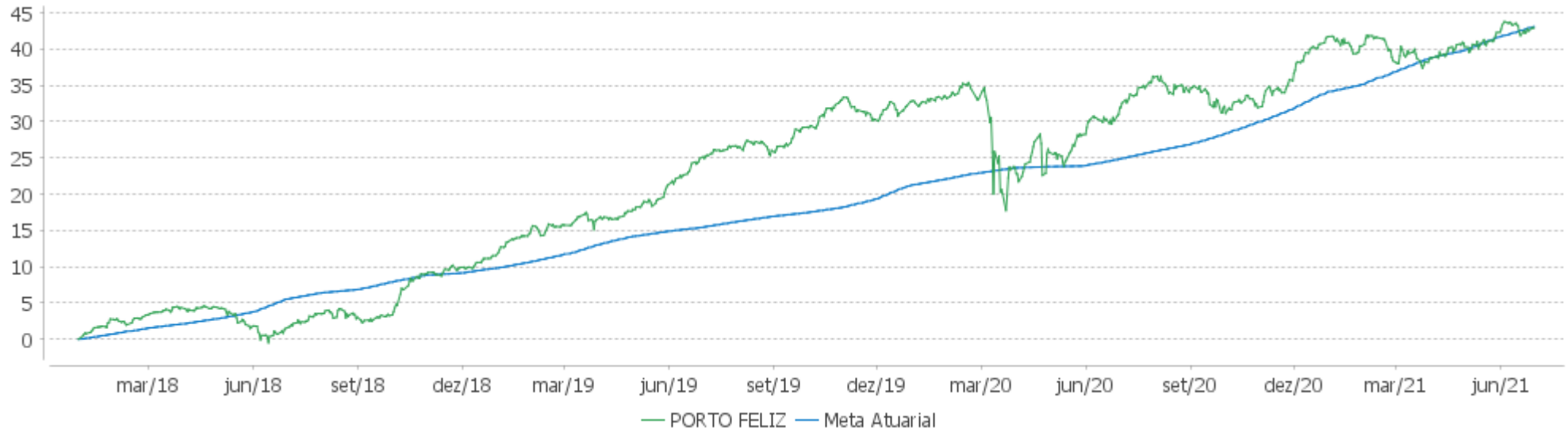
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

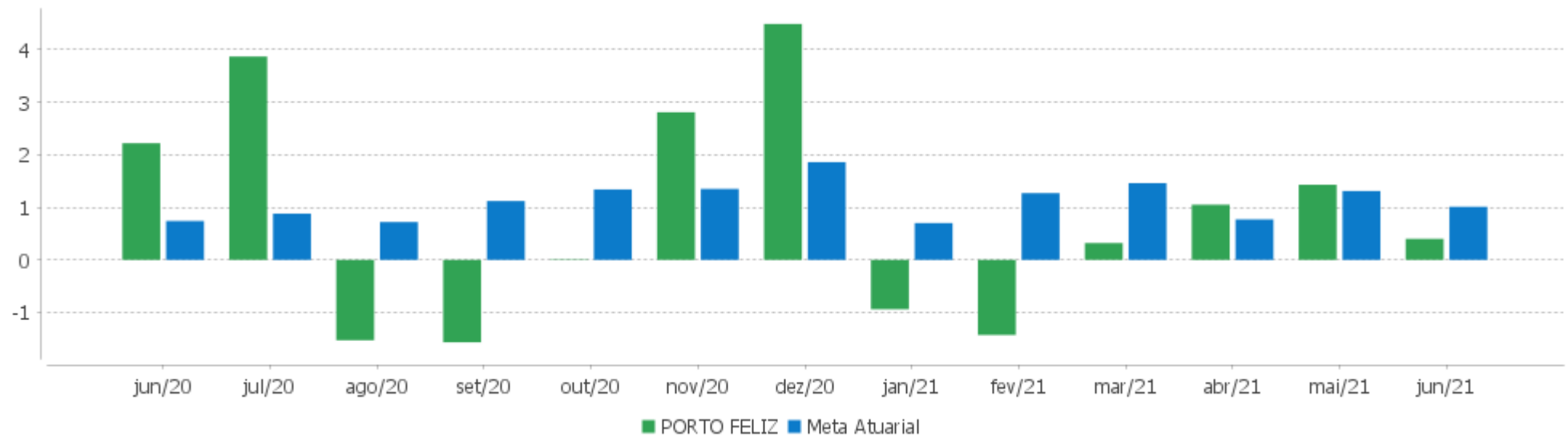
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	22	52,38	03 meses	2,92	3,12	-0,20	4,52
Meses abaixo - Meta Atuarial	20	47,62	06 meses	0,82	6,70	-5,88	5,20
			12 meses	9,04	14,68	-5,64	5,53
			24 meses	14,37	24,11	-9,74	9,16
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10	36 meses	40,81	35,89	4,93	7,90
Menor rentabilidade da Carteira	-7,15	2020-03	Desde 29/12/2017	42,90	43,48	-0,59	7,49

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



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
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,22 72,90	0,76 59,28	0,53 66,67	0,76 59,28	1,16 50,75	4,70 67,24	10,13 73,73
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,40 -0,02	-0,84 -0,12	2,08 -0,06	-0,84 -0,12	7,12 -0,30	12,15 -0,59	43,69 -1,47
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,40 -0,02	-0,84 -0,11	2,09 -0,06	-0,84 -0,11	7,19 -0,24	12,04 -0,70	44,01 -1,16
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,15 -0,02	1,15 -0,13	1,38 -0,05	1,15 -0,13	5,77 -0,29	14,77 -0,64	31,38 -0,95
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-0,15 -0,02	1,17 -0,11	1,38 -0,06	1,17 -0,11	5,81 -0,26	14,95 -0,47	31,31 -1,01
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,18 -0,03	0,65 -0,16	0,60 -0,08	0,65 -0,16	1,65 -0,38	7,46 -0,71	15,02 -0,97
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,17 -0,04	-1,70 -0,12	1,15 -0,11	-1,70 -0,12	-0,09 -0,23	9,41 -0,56	26,38 -0,88
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,38 -0,04	-0,82 -0,10	2,09 -0,05	-0,82 -0,10	7,15 -0,28	12,23 -0,51	44,09 -1,07
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,39 -0,03	-0,91 -0,19	2,05 -0,09	-0,91 -0,19	7,06 -0,37	11,97 -0,77	43,66 -1,51
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,66 0,24	-1,63 -0,91	2,97 0,82	-1,63 -0,91	10,27 2,85	10,42 -2,32	57,12 11,96
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP % do CDI	2,71 882,02	16,15 1.264,12	8,76 1.111,63	16,15 1.264,12	38,60 1.695,81	43,45 622,14	
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p.	0,89 0,42	13,54 7,00	14,01 5,29	13,54 7,00	31,95 -1,45	40,19 14,61	101,63 27,36
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	0,88 0,42	9,21 2,67	9,90 1,19	9,21 2,67	35,33 1,93	30,01 4,42	83,50 9,23
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-1,19 -1,65	8,36 1,82	-4,36 -13,07	8,36 1,82	26,23 -7,17	95,14 69,55	110,45 36,18
PORTO FELIZ Var. IPCA + 5,87% p.p.	0,40 -0,60	0,82 -5,88	2,92 -0,20	0,82 -5,88	9,04 -5,64	14,37 -9,66	40,81 5,18
CDI	0,31	1,28	0,79	1,28	2,28	6,98	13,74
IBOVESPA	0,46	6,54	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27
INPC + 6,00%	1,09	6,95	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 6,00%	1,02	6,76	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14



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	0,21	0,81	0,68	0,81	2,04	8,17	15,99	25,04	41,88
IRF-M 1+	0,22	-3,30	1,54	-3,30	-1,09	10,57	31,78	44,01	70,12
IRF-M TOTAL	0,21	-1,58	1,26	-1,58	0,14	9,97	27,26	38,64	61,89
IMA-B 5	-0,13	1,29	1,44	1,29	6,07	15,42	32,32	45,20	62,50
IMA-B 5+	0,83	-2,55	2,69	-2,55	8,52	10,66	55,78	65,31	89,15
IMA-B TOTAL	0,42	-0,72	2,14	-0,72	7,42	12,74	45,16	57,06	77,99
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,32	-0,34	1,32	-0,34	2,74	9,23	26,31	36,75	56,76
IMA-GERAL TOTAL	0,35	0,14	1,48	0,14	3,55	10,30	27,83	38,65	58,38
IDKA 2	-0,32	1,87	1,91	1,87	7,06	16,45	31,87	45,03	63,71
IDKA 20	1,07	-3,63	3,85	-3,63	12,34	7,07	77,65	82,49	113,49
CDI	0,31	1,28	0,79	1,28	2,28	6,98	13,74	22,11	37,80

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,46	6,54	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27	101,60	146,09
IBRX 100	0,63	8,82	9,61	8,82	36,33	29,97	82,97	109,81	156,78
IBRX 50	0,66	9,11	9,99	9,11	37,48	27,96	75,42	102,75	146,44
SMALL CAP	1,29	11,42	12,41	11,42	39,64	46,83	108,08	137,16	216,68
IFIX	-2,19	-4,02	-3,23	-4,02	-1,83	4,90	29,63	32,82	68,17
Índice Consumo - ICON	0,64	3,32	8,00	3,32	16,90	33,24	78,77	81,45	99,34
Índice Dividendos - IDIV	-2,17	2,06	5,45	2,06	23,79	23,60	82,61	98,77	171,68

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,53	3,77	1,68	3,77	8,35	10,66	14,38	19,40	22,99
INPC	0,60	3,95	1,95	3,95	9,22	11,78	15,49	19,56	22,62
IGPM	0,60	15,08	6,30	15,08	35,75	45,68	55,16	65,90	64,61
SELIC	0,31	1,28	0,79	1,28	2,28	6,98	13,75	22,12	37,84

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-2,27	10,13	-5,03	10,13	26,62	90,69	105,09	168,14	219,09
MSCI ACWI	-3,25	7,23	-6,11	7,23	25,29	79,54	84,88	134,07	181,00
MSCI World	-3,06	7,96	-5,78	7,96	25,18	80,80	87,35	138,06	184,42

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,86	5,77	2,66	5,77	12,66	19,69	28,60	39,56	49,47
IPCA + 5,00%	0,94	6,27	2,91	6,27	13,74	22,00	32,33	44,97	56,75
IPCA + 5,50%	0,98	6,51	3,03	6,51	14,28	23,16	34,23	47,73	60,50
IPCA + 5,89%	1,01	6,71	3,12	6,71	14,70	24,08	35,71	49,92	63,47
IPCA + 6,00%	1,02	6,76	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14	50,54	64,32
INPC + 4,00%	0,93	5,96	2,94	5,96	13,57	20,91	29,85	39,74	49,03
INPC + 6,00%	1,09	6,95	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46	50,74	63,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

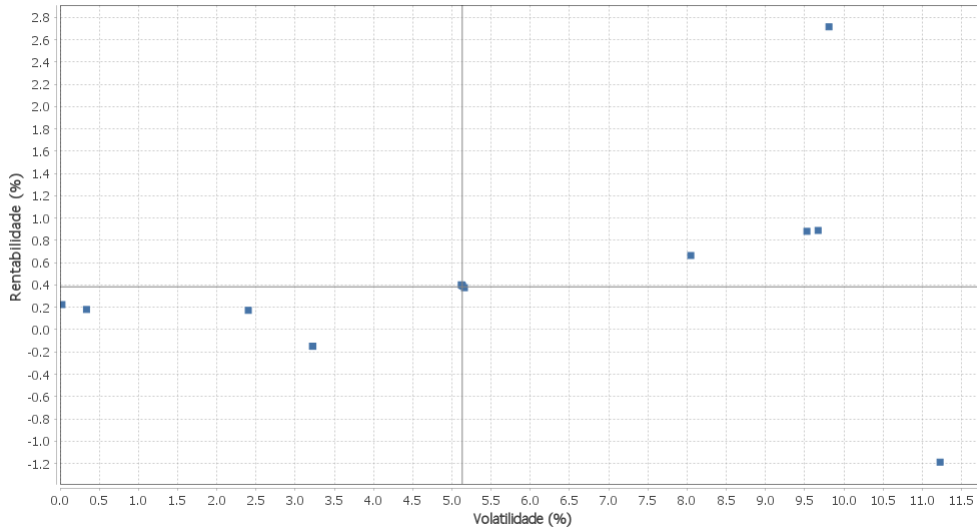
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
53	02/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	168.038,97	0,00	79.043,34679000	2,1259090970
54	07/06/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	5.500,00	2.007,76907900	2,7393588520
55	08/06/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.000.000,00	0,00	1.317.484,86868600	1,5180440000
56	08/06/2021	BB PREV RF IRF-M	0,00	5.200.000,00	859.876,12772000	6,0473826780
57	09/06/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2.000.000,00	0,00	356.565,22148405	5,6090720000
58	09/06/2021	BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	600.000,00	0,00	45.956,44800860	13,0558393000
59	09/06/2021	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	600.000,00	0,00	172.586,93047700	3,4765089010
60	10/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.475.021,33	0,00	693.497,27675200	2,1269316830
61	17/06/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	97.000,00	0,00	35.415,19120200	2,7389376340
62	21/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	64.369,56	0,00	30.242,55021300	2,1284435190
63	24/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.420.209,77	667.003,50315400	2,1292388470
64	25/06/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	53.896,31	19.661,51175200	2,7412088490
65	30/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	131.400,72	0,00	61.683,02785300	2,1302572940

**Total**

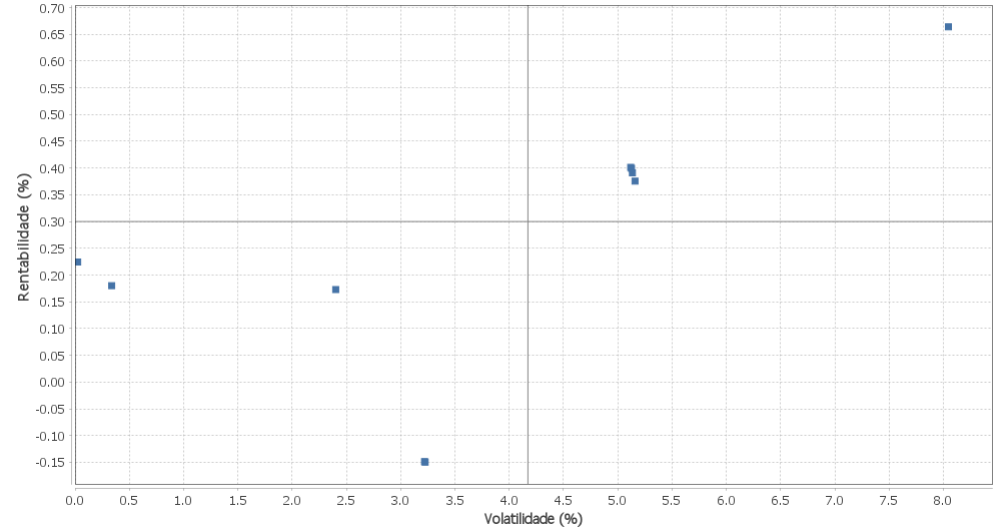
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

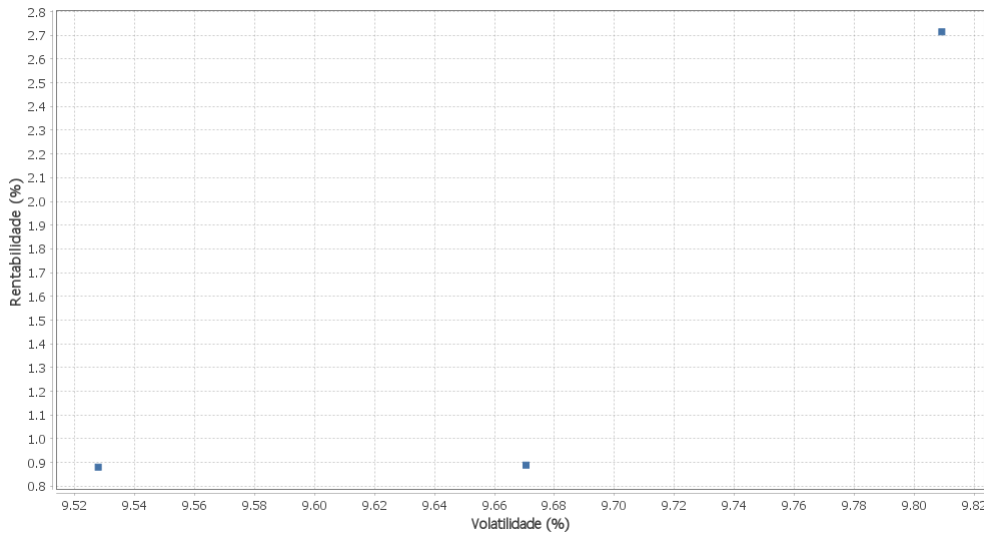
PORTO FELIZ - No Mês



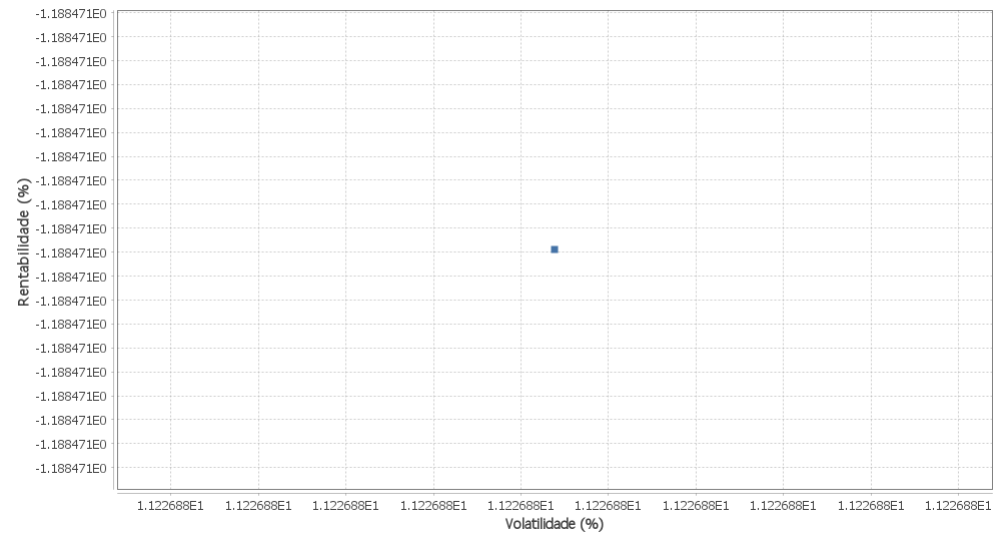
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 7.259.413,99

Value-At-Risk: 2,60%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,03	0,00	-3,44	0,22	420.646,35	0,15
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,34	0,15	0,00	-0,38	0,18	4.162.643,45	1,49
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,40	1,46	0,03	-0,06	0,17	8.116.531,37	2,91
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,22	1,47	0,09	-0,14	-0,15	20.972.321,66	7,52
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,23	1,48	0,13	-0,14	-0,15	29.866.464,27	10,71
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,12	2,67	0,43	0,02	0,40	50.589.435,79	18,14
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	5,13	2,67	0,10	0,02	0,40	11.882.333,99	4,26
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	5,13	2,67	0,37	0,02	0,39	43.836.046,84	15,71
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,16	2,67	0,34	0,01	0,38	40.367.836,11	14,47
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	8,05	3,95	0,12	0,04	0,66	9.943.844,10	3,56
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	9,53	7,92	0,66	0,06	0,88	29.019.613,05	10,40
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	9,67	8,76	0,19	0,06	0,89	9.514.415,83	3,41
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	9,81	6,43	0,13	0,25	2,71	10.453.615,07	3,75
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	11,23	9,34	0,01	-0,13	-1,19	9.803.366,15	3,51