



LDB
EMPRESAS

PORTO FELIZ
SETEMBRO 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 30.09.2021.

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

71,01%

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	8,88	-1,25	-6,24	9.477.797,28	3,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,423526%)	3,59	1,53	2,26	2.555.395,45	0,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,734998%)	3,70	0,39	0,39	10.038.168,93	3,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (4,689998%)	3,43	1,56	2,24	2.555.783,11	0,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,069994%)	2,61	1,51	3,41	5.037.244,11	1,85
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		7,90	0,36	-2,53	29.664.388,88	10,89

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	2,91	-0,38	-3,19	215.512,80	0,08	6.207.836.765,86	0,00
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,48	0,98	2,32	13.115.255,11	4,81	1.512.297.730,19	0,87
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,30	-0,15	-2,47	11.687.152,74	4,29	461.408.407,40	2,53
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,40	0,37	1,53	4.247.972,79	1,56	6.892.529.188,23	0,06
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,33	-0,15	-2,46	39.697.564,33	14,57	7.233.196.021,39	0,55
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,31	-0,16	-2,57	24.225.541,62	8,89	649.147.051,80	3,73
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,31	-0,16	-2,51	49.737.194,86	18,25	5.161.580.539,44	0,96
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,48	0,98	2,30	20.081.144,21	7,37	11.150.255.278,19	0,18
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,36	0,08	-1,56	163.007.338,46	59,82		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	0,35	1,10	844.516,79	0,31	2.310.961.339,30	0,04
		Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a	0,16	0,35	1,10	844.516,79	0,31		
		Renda Fixa	4,49	0,12	-1,58	193.516.244,13	71,01		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

22,90%

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	20,39	-6,75	-5,50	25.110.974,74	9,21	1.120.979.496,53	2,24
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			20,39	-6,75	-5,50	25.110.974,74	9,21		

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	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	20,14	-3,91	2,47	20.843.133,16	7,65	1.995.199.093,32	1,04
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			20,14	-3,91	2,47	20.843.133,16	7,65		

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	13,92	-4,64	14,28	16.443.531,62	6,03	3.166.279.756,52	0,52
Sub-total Artigo 8º III			13,92	-4,64	14,28	16.443.531,62	6,03		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			18,47	-5,41	0,04	62.397.639,52	22,90		
--	--	--	--------------	--------------	-------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,09%

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	18,24	-0,25	7,81	16.602.147,93	6,09	3.337.438.389,61	0,50
Sub-total Artigo 9º A, III			18,24	-0,25	7,81	16.602.147,93	6,09		
Investimentos no Exterior			16,31	-0,25	7,81	16.602.147,93	6,09		
Total			5,36	-1,13	-1,72	272.516.031,58	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	29.664.388,88	10,89	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	163.007.338,46	59,82	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	844.516,79	0,31	0,00	0,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	193.516.244,13	71,01					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	25.110.974,74	9,21	0,00	10,00	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	20.843.133,16	7,65	0,00	10,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	16.443.531,62	6,03	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	62.397.639,52	22,90					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	16.602.147,93	6,09	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	16.602.147,93	6,09					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	0,36 82,34	-2,53 -100,98	-0,92 -74,91	2,02 100,46	8,22 274,93	71.086,08	-318.869,13
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,08 18,27	-1,56 -62,28	-1,07 -87,33	0,72 35,88	4,03 134,74	235.648,36	-3.402.746,71
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,35 79,41	1,10 73,22	0,90 73,21			4.991,75	12.210,43
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-6,75 -0,18	-5,50 1,26	-13,47 -0,99	-4,90 -0,05	17,56 0,25	-1.818.104,52	-1.576.993,03
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,91 2,66	2,47 9,22	-9,75 2,73	2,89 7,74	17,72 0,41	-792.795,38	-833.857,60
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-4,64 1,93	14,28 20,41	1,14 13,61	9,99 14,84		-767.000,44	699.817,29
Artigo 9º A, III % do CDI	-0,25 -57,07	7,81 351,04	7,72 631,10	3,03 150,20		-52.901,63	602.147,93
PORTO FELIZ (Total)						-3.119.075,78	-4.818.290,82

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 150535 (4,423526%)	2.516.780,16	0,00	0,00	0,00	2.555.395,45	38.615,29	56.555,02
NTN-B 150535 (4,734998%)	0,00	9.999.556,19	0,00	0,00	10.038.168,93	38.612,74	38.612,74
NTN-B 150545	9.597.814,25	0,00	0,00	0,00	9.477.797,28	-120.016,97	-637.930,45
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.516.626,83	0,00	0,00	0,00	2.555.783,11	39.156,28	55.908,01
NTN-B 150830 (4,069994%)	4.962.525,37	0,00	0,00	0,00	5.037.244,11	74.718,74	167.985,54
					29.664.388,88	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	39.758.615,18	0,00	0,00	0,00	39.697.564,33	-61.050,85	-1.003.239,62

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IRF-M	216.325,82	0,00	0,00	0,00	215.512,80	-813,02	-572.218,70
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	4.242.465,27	0,00	-10.000,00	0,00	4.247.972,79	15.507,52	67.889,82
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	43.171.312,13	0,00	-19.000.000,00	0,00	24.225.541,62	54.229,49	-1.011.994,42
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19.886.049,15	0,00	0,00	0,00	20.081.144,21	195.095,06	555.535,81
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	49.814.794,36	0,00	0,00	0,00	49.737.194,86	-77.599,50	-1.278.326,87
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	11.704.759,65	0,00	0,00	0,00	11.687.152,74	-17.606,91	-296.399,53
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	12.987.368,54	0,00	0,00	0,00	13.115.255,11	127.886,57	386.081,65
					163.007.338,46	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	597.039,17	1.798.018,89	-1.555.533,02	0,00	844.516,79	4.991,75	12.210,43
					844.516,79	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	26.929.079,26	0,00	0,00	0,00	25.110.974,74	-1.818.104,52	-1.576.993,03
					25.110.974,74	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	16.635.928,54	5.000.000,00	0,00	0,00	20.843.133,16	-792.795,38	-833.857,60
					20.843.133,16	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	15.210.532,06	2.000.000,00	0,00	0,00	16.443.531,62	-767.000,44	699.817,29
					16.443.531,62	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	14.655.049,56	2.000.000,00	0,00	0,00	16.602.147,93	-52.901,63	602.147,93
					16.602.147,93	0,00	0,00

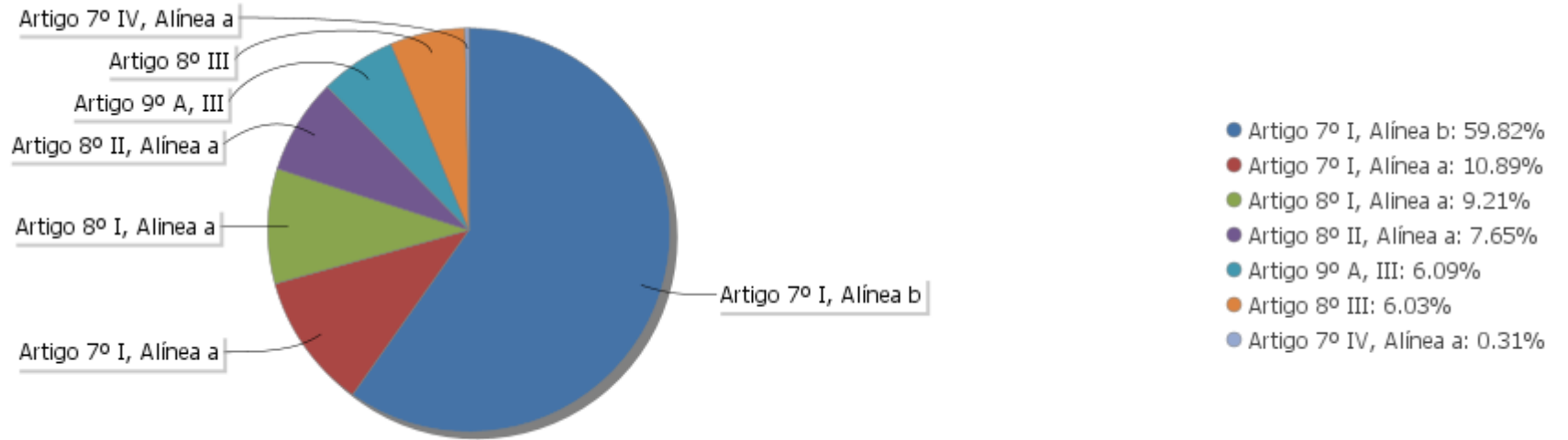
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

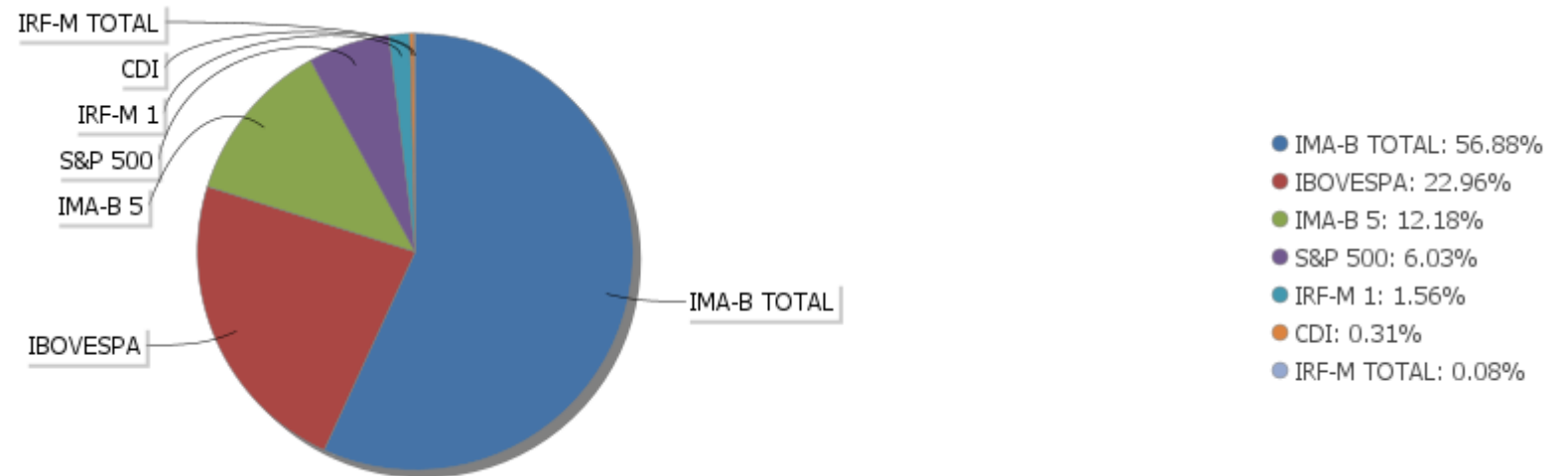
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	242.851.642,70	89,11	242.851.642,70	89,11
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	242.851.642,70	89,11
acima de 365 dias	29.664.388,88	10,89	272.516.031,58	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

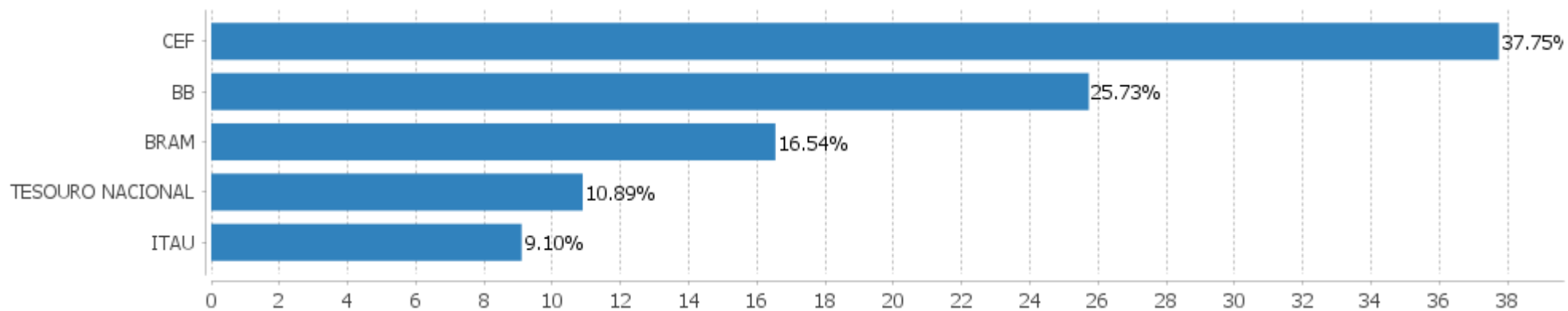


Alocação Por Estratégia



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	-0,56	-0,85	-1,13				-1,72
IPCA + 5,42%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61				11,19
p.p. indexador	-1,61	-2,67	-1,09	0,32	0,16	-0,57	-1,99	-2,18	-2,73				-12,91
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

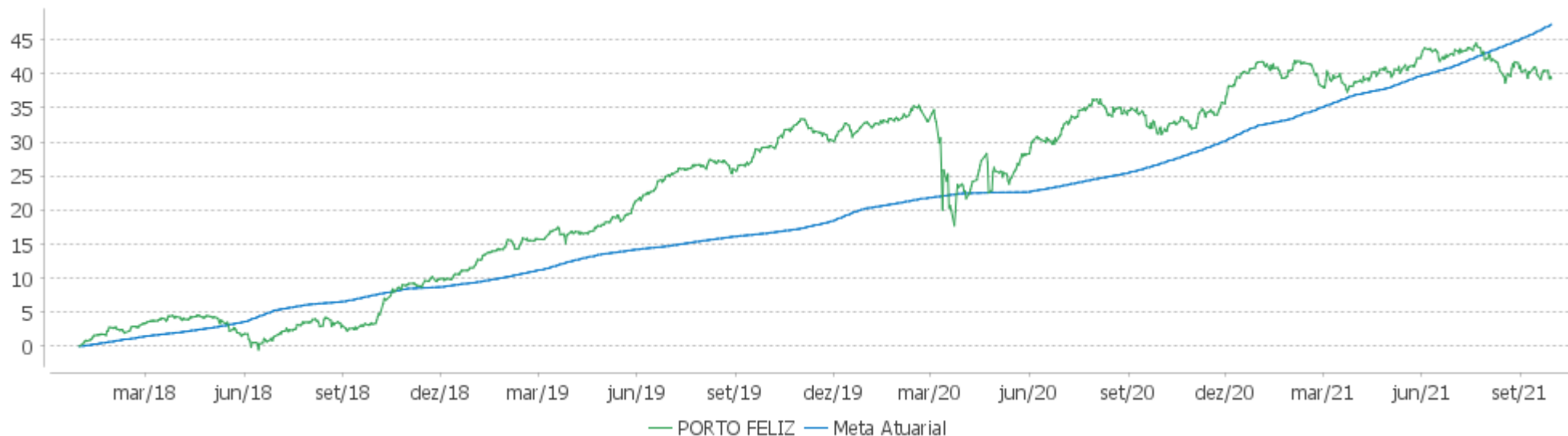
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

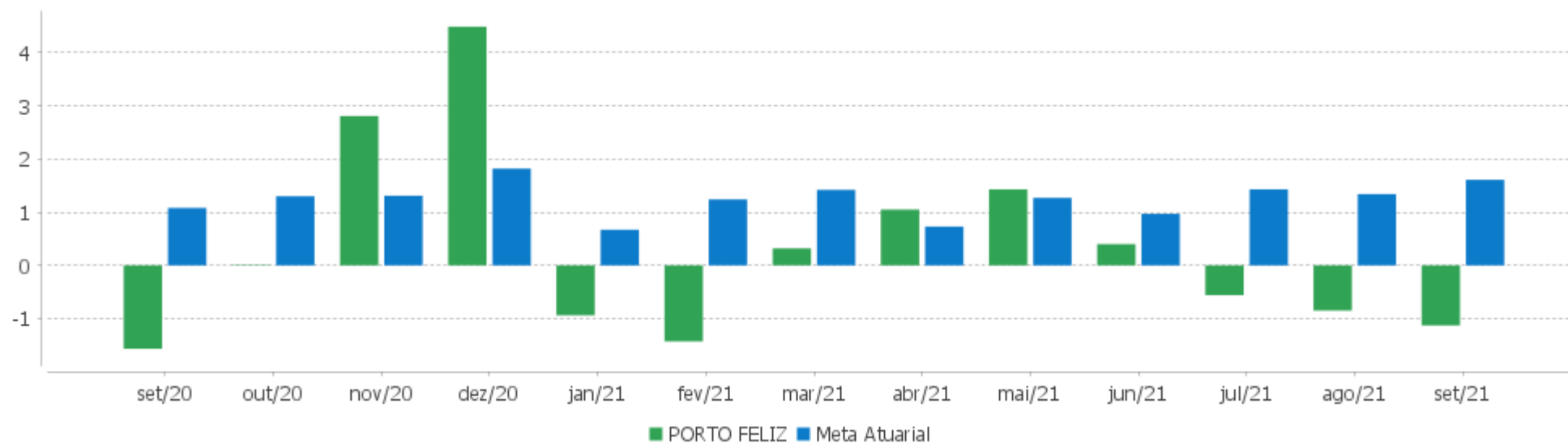
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	22	48,89	03 meses	-2,52	4,43	-6,95	5,91
Meses abaixo - Meta Atuarial	23	51,11	06 meses	0,33	7,57	-7,25	5,30
			12 meses	5,59	16,32	-10,73	5,36
			24 meses	7,80	27,05	-19,25	9,33
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10	36 meses	34,92	38,54	-3,62	7,99
Menor rentabilidade da Carteira	-7,15	2020-03	Desde 29/12/2017	39,30	49,53	-10,23	7,40

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
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,15 -0,02	-2,47 -0,17	-1,64 -0,05	0,40 -0,12	4,43 -0,28	6,37 -0,54	39,14 -1,32
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,16 -0,02	-2,51 -0,21	-1,68 -0,09	0,37 -0,15	4,45 -0,26	6,20 -0,72	39,29 -1,17
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,98 -0,02	2,30 -0,19	1,13 -0,05	2,53 -0,11	5,69 -0,26	13,00 -0,62	30,19 -0,93
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,98 -0,02	2,32 -0,16	1,13 -0,05	2,53 -0,11	5,70 -0,25	13,16 -0,46	30,18 -0,93
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,37 -0,04	1,53 -0,25	0,87 -0,09	1,47 -0,18	2,16 -0,33	6,42 -0,73	14,11 -1,01
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,38 -0,05	-3,19 -0,24	-1,51 -0,12	-0,38 -0,23	-1,26 -0,24	4,87 -0,60	22,26 -0,96
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,15 -0,02	-2,46 -0,16	-1,66 -0,07	0,40 -0,12	4,49 -0,22	6,40 -0,52	39,39 -1,07
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,16 -0,03	-2,57 -0,27	-1,68 -0,09	0,34 -0,18	4,34 -0,37	6,19 -0,73	39,01 -1,45
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,35 79,41	1,66 66,19	0,90 73,21	1,43 70,75	1,88 62,88	4,33 65,05	9,68 72,54
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,25 -1,12	-6,24 -3,94	-4,69 -3,10	-1,86 -2,38	4,10 -0,61	0,48 -6,44	47,29 6,83
NTN-B 150555 (4,689998%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,56 1,69	8,21 10,52	3,96 5,55	4,50 3,98	9,86 5,15	12,60 5,68	16,02 -24,44
NTN-B 150830 (4,069994%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,51 1,64	7,58 9,88	3,80 5,39	6,71 6,19	11,69 6,98	13,49 6,58	16,00 -24,46
NTN-B 150535 (4,734998%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,56 1,69	8,04 10,34	3,97 5,56	4,32 3,80	9,49 4,77	11,85 4,93	14,90 -25,56
NTN-B 150535 (4,423526%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,53 1,67	7,88 10,18	3,89 5,48	4,24 3,72	9,33 4,62	11,53 4,61	14,42 -26,04
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p.	-3,91 2,66	2,47 9,22	-9,75 2,73	2,89 7,74	17,72 0,41	15,75 9,80	74,77 34,90
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	-6,75 -0,18	-5,50 1,26	-13,47 -0,99	-4,90 -0,05	17,56 0,25	7,93 1,97	46,90 7,02
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-4,64	17,47	1,14	9,99	30,71	42,05	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. S&P 500 p.p.	-5,36	-2,57	-7,86	6,48	7,20	-46,96	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-0,25	16,72	7,72	3,03	18,25	90,64	101,42
Var. IBOVESPA p.p.	6,32	23,48	20,20	7,87	0,94	84,69	61,54
PORTO FELIZ	-1,13	-1,72	-2,52	0,33	5,59	7,80	34,92
Var. IPCA + 5,42% p.p.	-2,73	-12,91	-6,95	-7,25	-10,61	-18,53	-2,09
CDI	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35
IBOVESPA	-6,57	-6,75	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87
INPC + 6,00%	1,69	11,97	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02
IPCA + 6,00%	1,65	11,65	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28

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	0,40	1,78	0,96	1,65	2,49	7,15	15,12	22,90	38,45
IRF-M 1+	-0,73	-5,87	-2,65	-1,15	-3,14	4,23	25,92	32,64	58,13
IRF-M TOTAL	-0,33	-2,95	-1,39	-0,15	-1,02	5,48	23,23	30,30	53,03
IMA-B 5	1,00	2,48	1,18	2,64	5,95	13,62	31,12	39,68	58,47
IMA-B 5+	-1,26	-6,63	-4,19	-1,61	3,20	1,48	46,98	45,78	70,99
IMA-B TOTAL	-0,13	-2,30	-1,59	0,52	4,71	6,92	40,46	44,04	66,75
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,02	-0,76	-0,42	0,89	2,05	6,02	23,59	29,99	49,60
IMA-GERAL TOTAL	-0,01	-0,38	-0,52	0,96	2,48	6,93	24,87	31,60	51,09
IDKA 2	1,10	3,07	1,18	3,12	6,21	14,71	29,45	40,48	59,67
IDKA 20	-3,03	-11,97	-8,65	-5,13	2,03	-7,04	59,98	49,40	80,44
CDI	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,90	34,86

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-6,57	-6,75	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87	49,38	90,14
IBRX 100	-6,99	-5,99	-13,61	-5,31	17,82	7,71	45,23	53,72	95,90
IBRX 50	-7,47	-6,33	-14,15	-5,58	18,46	6,59	37,53	47,56	87,32
SMALL CAP	-6,43	-5,54	-15,22	-4,70	15,75	13,69	78,82	65,15	133,65
IFIX	-1,24	-5,38	-1,42	-4,61	-2,83	1,17	27,21	22,27	49,54
Índice Consumo - ICON	-5,95	-11,50	-14,34	-7,48	-1,67	-2,69	50,48	25,77	51,19
Índice Dividendos - IDIV	-4,48	-4,67	-6,59	-1,51	19,58	7,85	64,83	56,04	121,60

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	1,16	6,90	3,02	4,75	10,25	13,70	16,99	22,29	25,39
INPC	1,20	7,21	3,13	5,14	10,78	15,09	18,46	23,16	25,17
IGPM	-0,64	16,00	0,80	7,15	24,86	47,25	52,21	67,49	65,07
SELIC	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,91	34,89

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	0,73	20,04	8,99	3,52	23,52	89,01	100,82	193,57	232,88
MSCI ACWI	1,23	14,91	7,16	0,61	21,06	78,00	83,86	150,21	184,12
MSCI World	1,22	16,99	8,36	2,09	22,47	80,14	87,02	158,04	191,94

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,49	10,07	4,07	6,84	14,64	22,96	31,56	42,95	52,39
IPCA + 5,00%	1,57	10,86	4,32	7,36	15,74	25,33	35,38	48,50	59,82
IPCA + 5,50%	1,61	11,26	4,45	7,61	16,29	26,53	37,32	51,33	63,64
IPCA + 5,89%	1,64	11,56	4,55	7,81	16,71	27,46	38,84	53,57	66,67
IPCA + 6,00%	1,65	11,65	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28	54,21	67,53
INPC + 4,00%	1,53	10,39	4,18	7,24	15,20	24,46	33,20	43,97	52,12
INPC + 6,00%	1,69	11,97	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02	55,31	67,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

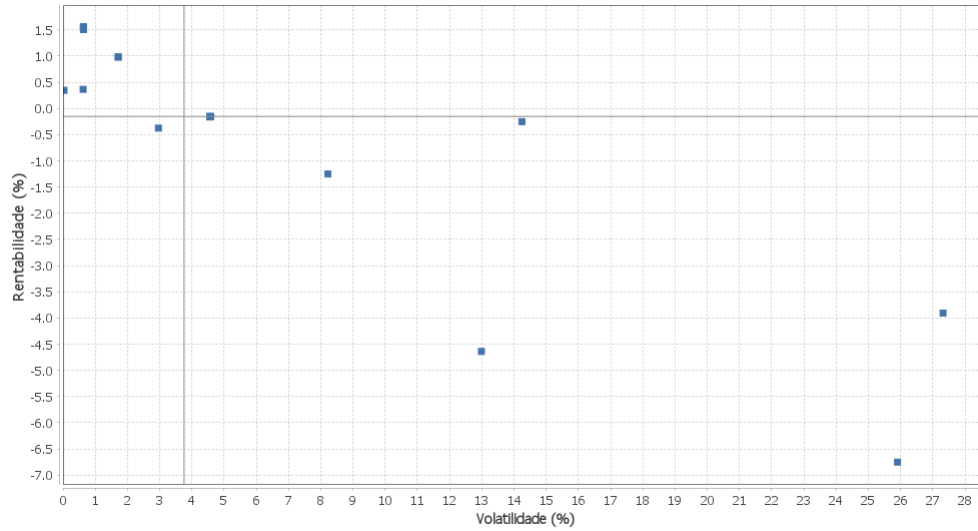
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
11	01/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	21.339,44	0,00	9.961,33867500	2,1422261300
12	03/09/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	10.000,00	3.626,37981400	2,7575710520
13	08/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	54.955,95	0,00	25.638,02083600	2,1435332450
14	10/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.521.265,03	0,00	709.493,31592700	2,1441569580
15	13/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	105.185,66	49.048,99850900	2,1445016860
16	20/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	67.193,69	0,00	31.308,00992600	2,1462140250
17	22/09/2021	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	0,00	1.864.778,44	507.144,61102000	3,6770152000
18	22/09/2021	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	0,00	7.631.700,94	2.075.515,20048100	3,6770152000
19	22/09/2021	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	0,00	954.085,63	259.472,85347000	3,6770152000
20	22/09/2021	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	0,00	1.169.363,51	318.019,76608000	3,6770152000
21	22/09/2021	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	0,00	779.997,23	212.127,82280000	3,6770152000
22	22/09/2021	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	0,00	6.600.074,25	1.794.954,30056500	3,6770152000
23	23/09/2021	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	5.000.000,00	0,00	411.136,65594510	12,1614065000
24	23/09/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.000.000,00	0,00	1.238.683,84886300	1,6146170000
25	23/09/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2.000.000,00	0,00	323.788,37580303	6,1768740000
26	24/09/2021	NTN-B 150535 (4,734998%)	9.999.556,19	0,00	2.389,00000000	4.185,6660486000
27	27/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.450.347,36	675.181,73804200	2,1480844020
28	28/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	12.384,18	0,00	5.764,12810900	2,1484914570
29	30/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	120.880,60	0,00	56.241,10518000	2,1493283180
Total						

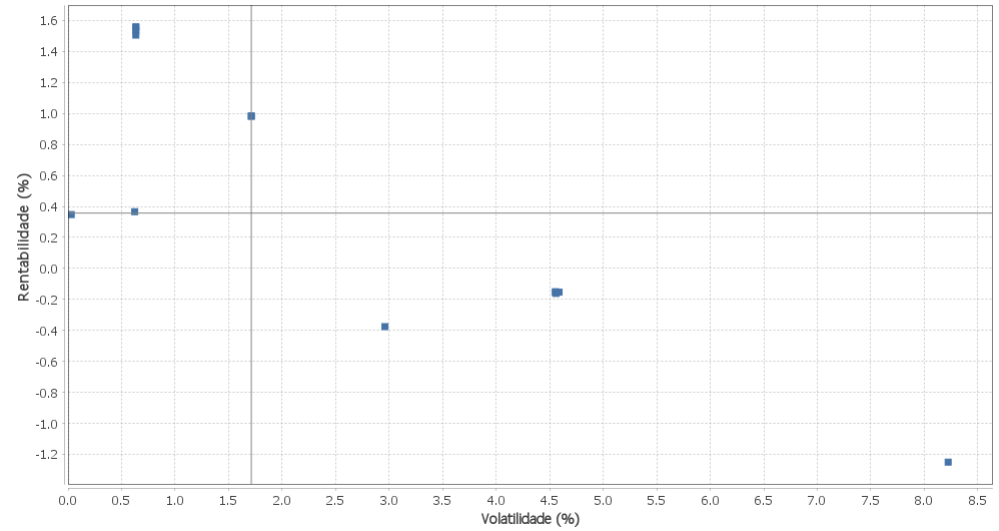
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

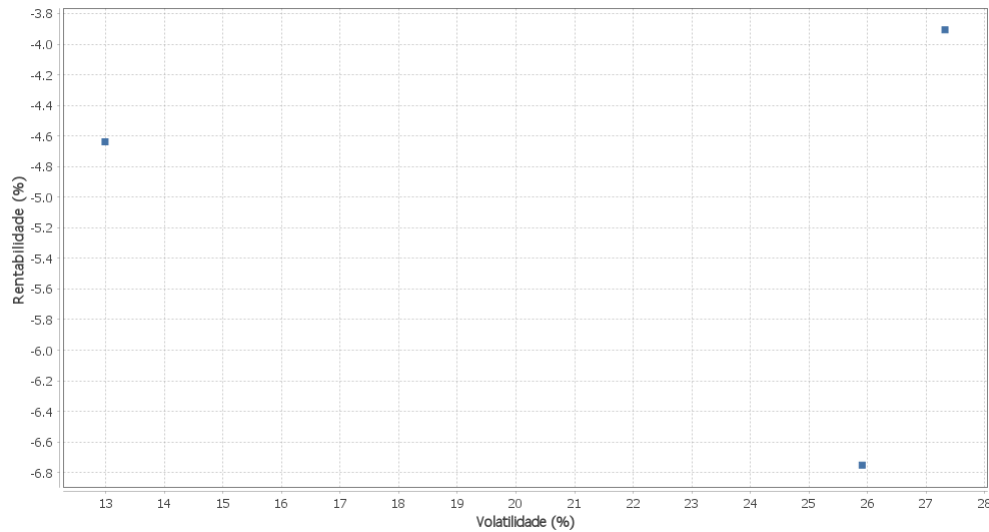
PORTO FELIZ - No Mês



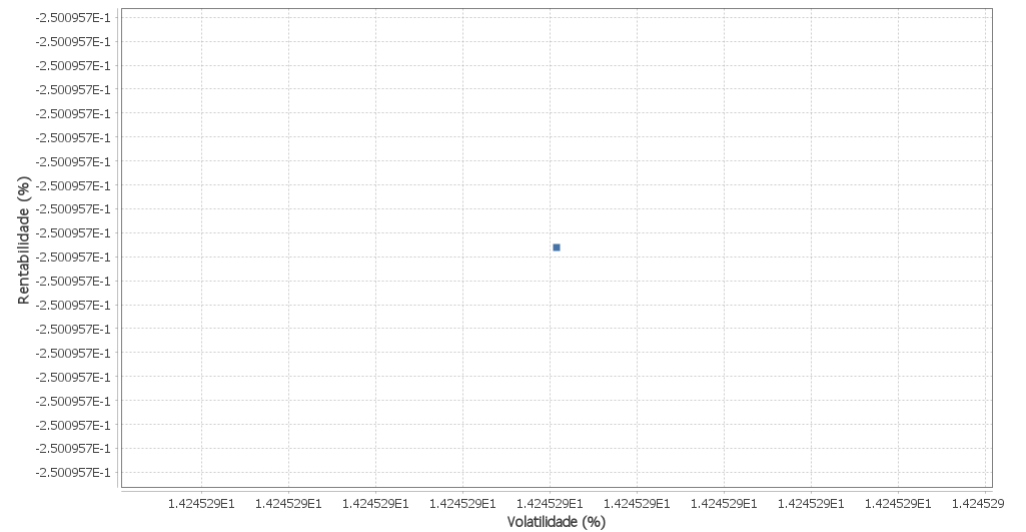
Renda Fixa - No Mês



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\$): 7.659.460,68

Value-At-Risk: 2,81%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	-0,00	-3,03	0,35	844.516,79	0,31
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,62	0,18	0,00	-0,12	0,37	4.247.972,79	1,56
NTN-B 150555 (4,689998%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,63	0,24	-0,00	1,76	1,56	2.555.783,11	0,94
NTN-B 150535 (4,423526%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,63	0,25	-0,00	1,73	1,53	2.555.395,45	0,94
NTN-B 150830 (4,069994%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,63	0,13	0,00	1,68	1,51	5.037.244,11	1,85
NTN-B 150535 (4,734998%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,63	0,25	-0,00	1,77	1,56	10.038.168,93	3,68
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,71	1,24	0,04	0,32	0,98	13.115.255,11	4,81
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,71	1,23	0,06	0,32	0,98	20.081.144,21	7,37
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,96	1,48	0,00	-0,27	-0,38	215.512,80	0,08
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	4,55	2,95	0,10	-0,13	-0,15	11.687.152,74	4,29
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,55	2,95	0,45	-0,13	-0,16	49.737.194,86	18,25
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	4,56	2,96	0,22	-0,13	-0,16	24.225.541,62	8,89
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,59	2,97	0,36	-0,13	-0,15	39.697.564,33	14,57
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	8,22	4,32	0,12	-0,21	-1,25	9.477.797,28	3,48
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	12,99	6,26	0,22	-0,39	-4,64	16.443.531,62	6,03
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	14,25	6,65	-0,04	-0,05	-0,25	16.602.147,93	6,09
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	25,91	8,65	0,68	-0,28	-6,75	25.110.974,74	9,21
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	27,32	9,29	0,60	-0,16	-3,91	20.843.133,16	7,65