



LDB
EMPRESAS

PORTO FELIZ
NOVEMBRO 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 30.11.2021.

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

66,42%

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	9,95	4,54	-6,27	9.224.709,95	3,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,423526%)	2,60	1,60	5,33	2.566.428,09	0,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,734998%)	2,67	1,62	3,44	10.078.884,77	3,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290003%)	2,80	1,66	2,11	9.932.429,68	3,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (4,689998%)	2,48	1,62	5,34	2.571.105,63	0,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,069994%)	2,62	1,57	6,46	5.185.455,39	1,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,171997%)	3,81	0,88	0,88	10.085.673,64	3,70
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		7,39	2,27	-0,69	49.644.687,15	18,20

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	3,46	1,80	-4,08	213.520,02	0,08	4.900.044.382,84	0,00
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,75	2,48	3,55	14.187.770,88	5,20	1.428.303.604,83	0,99
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,83	3,45	-1,69	11.780.882,97	4,32	390.085.139,81	3,02
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,62	0,77	1,78	4.362.095,03	1,60	7.084.325.912,32	0,06
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,86	3,44	-1,71	40.002.960,16	14,67	7.086.428.606,24	0,56
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,84	3,44	-1,82	4.921.839,79	1,80	630.322.637,46	0,78
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,84	3,44	-1,74	32.844.636,64	12,04	4.821.319.332,60	0,68
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,76	2,47	3,52	20.320.723,89	7,45	11.929.906.744,63	0,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,84	3,12	-0,77	128.634.429,38	47,16		
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	0,11	0,51	2,02	2.870.806,78	1,05	2.679.858.220,32	0,11
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,11	0,51	2,02	2.870.806,78	1,05		
Renda Fixa			4,79	2,88	-0,64	181.149.923,31	66,42		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

25,40%

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	20,36	-1,77	-14,48	22.725.253,44	8,33	962.076.089,31	2,36
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			20,36	-1,77	-14,48	22.725.253,44	8,33		

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	BRANDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	21,96	-3,17	-13,22	24.933.557,03	9,14	1.389.103.299,23	1,79
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			21,96	-3,17	-13,22	24.933.557,03	9,14		

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	12,73	-0,49	22,41	21.610.289,89	7,92	3.554.282.113,36	0,61
Sub-total Artigo 8º III			12,73	-0,49	22,41	21.610.289,89	7,92		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			17,89	-2,00	-7,20	69.269.100,36	25,40		
----------------------------------------------------	--	--	--------------	--------------	--------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

8,18%

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	17,25	-0,89	18,52	22.320.528,73	8,18	3.764.762.598,77	0,59
Sub-total Artigo 9º A, III			17,25	-0,89	18,52	22.320.528,73	8,18		
Investimentos no Exterior			16,80	-0,89	18,52	22.320.528,73	8,18		
Total			5,68	1,28	-2,39	272.739.552,40	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	49.644.687,15	18,20	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	128.634.429,38	47,16	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	2.870.806,78	1,05	0,00	0,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	181.149.923,31	66,42					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	22.725.253,44	8,33	0,00	10,00	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	24.933.557,03	9,14	0,00	10,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	21.610.289,89	7,92	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	69.269.100,36	25,40					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	22.320.528,73	8,18	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	22.320.528,73	8,18					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	2,27 387,39	-0,69 -19,15	2,26 149,20	1,63 62,13	7,07 187,18	987.502,17	577.561,12
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	3,12 531,72	-0,77 -21,38	0,88 58,45	-0,04 -1,63	3,05 80,90	4.120.996,52	-2.788.599,23
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,51 86,14	2,02 77,87	1,26 83,09			10.657,04	30.208,63
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,77 -0,24	-14,48 -0,11	-15,61 -1,41	-21,00 -1,75	-6,99 -0,58	-409.933,88	-3.962.714,33
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,17 -1,64	-13,22 1,15	-18,61 -4,42	-22,89 -3,63	-5,75 0,66	-1.078.556,64	-4.743.433,73
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,49 1,04	22,41 36,21	2,15 16,35	11,27 30,53		-124.688,41	1.866.575,56
Artigo 9º A, III % do CDI	-0,89 -152,03	18,52 558,26	9,66 638,81	17,02 650,01		-135.254,70	2.320.528,73
PORTO FELIZ (Total)						3.370.722,10	-6.699.873,25

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%)	2.590.616,15	0,00	0,00	65.126,05	2.566.428,09	40.937,99	132.713,71
NTN-B 150535 (4,734998%)	10.178.925,33	0,00	0,00	263.259,13	10.078.884,77	163.218,57	342.587,71
NTN-B 150535 (5,290003%)	10.040.260,03	0,00	0,00	272.956,41	9.932.429,68	165.126,06	209.233,57
NTN-B 150545	9.062.842,46	0,00	0,00	246.729,67	9.224.709,95	408.597,16	-644.288,11
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.591.532,59	0,00	0,00	61.930,36	2.571.105,63	41.503,40	133.160,89
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.105.292,92	0,00	0,00	0,00	5.185.455,39	80.162,47	316.196,82
NTN-B 150840 (5,171997%)	0,00	9.997.717,12	0,00	0,00	10.085.673,64	87.956,52	87.956,52
					49.644.687,15	0,00	0,00

Artigo 7º I, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	38.672.491,38	0,00	0,00	0,00	40.002.960,16	1.330.468,78	-697.843,79
BB PREV RF IRF-M	209.741,54	0,00	0,00	0,00	213.520,02	3.778,48	-574.211,48
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	4.225.936,76	160.000,00	-57.056,56	0,00	4.362.095,03	33.214,83	79.068,62
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	4.758.146,99	0,00	0,00	0,00	4.921.839,79	163.692,80	-1.315.696,25
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19.831.326,44	0,00	0,00	0,00	20.320.723,89	489.397,45	795.115,49
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	48.463.107,75	0,00	-17.000.000,00	0,00	32.844.636,64	1.381.528,89	-1.170.885,09
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	11.388.519,31	0,00	0,00	0,00	11.780.882,97	392.363,66	-202.669,30
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	12.951.219,25	910.000,00	0,00	0,00	14.187.770,88	326.551,63	548.597,42
					128.634.429,38	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	1.372.923,81	3.897.281,39	-2.410.055,46	0,00	2.870.806,78	10.657,04	30.208,63
					2.870.806,78	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	23.135.187,32	0,00	0,00	0,00	22.725.253,44	-409.933,88	-3.962.714,33
					22.725.253,44	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	23.012.113,67	3.000.000,00	0,00	0,00	24.933.557,03	-1.078.556,64	-4.743.433,73
					24.933.557,03	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	19.734.978,30	2.000.000,00	0,00	0,00	21.610.289,89	-124.688,41	1.866.575,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					21.610.289,89	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	20.455.783,43	2.000.000,00	0,00	0,00	22.320.528,73	-135.254,70	2.320.528,73
					22.320.528,73	0,00	0,00

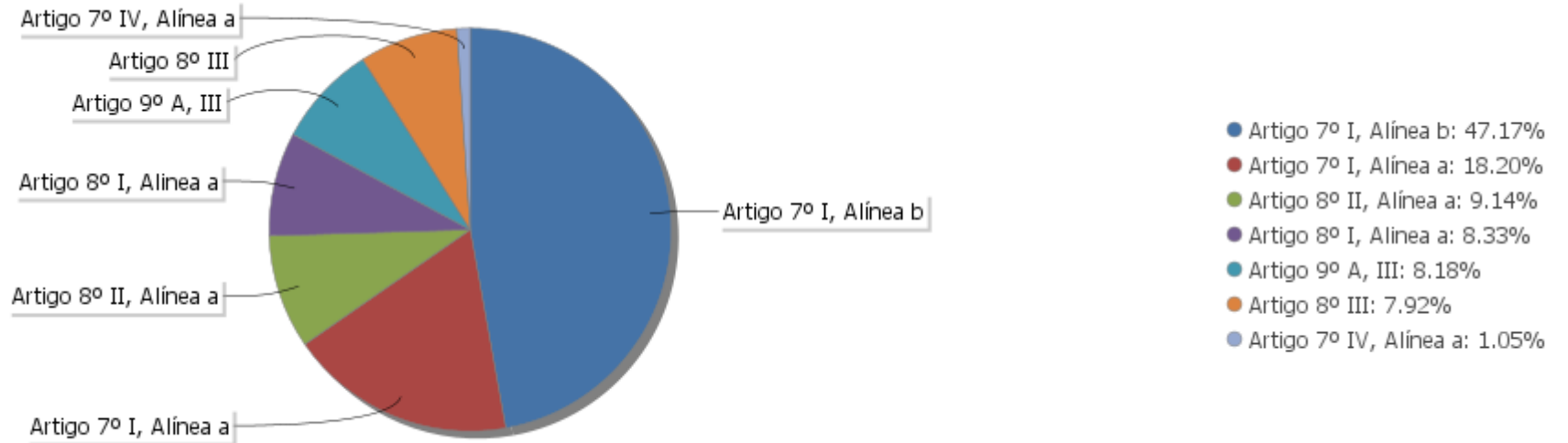
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

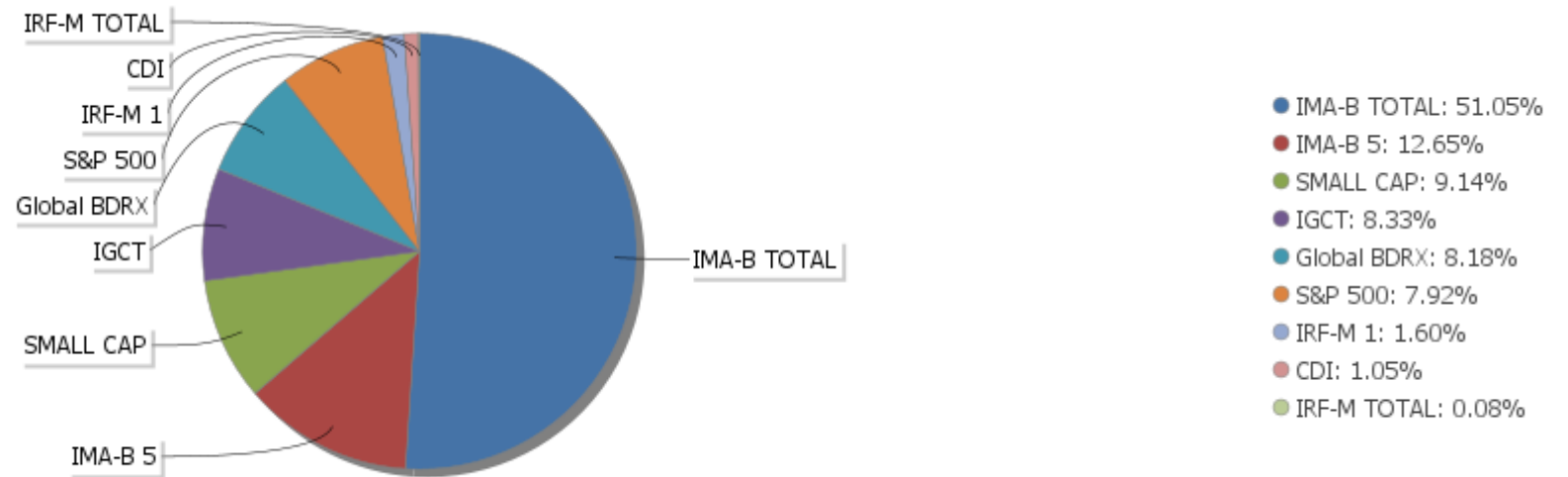
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	223.094.865,25	81,80	223.094.865,25	81,80
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	223.094.865,25	81,80
acima de 365 dias	49.644.687,15	18,20	272.739.552,40	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

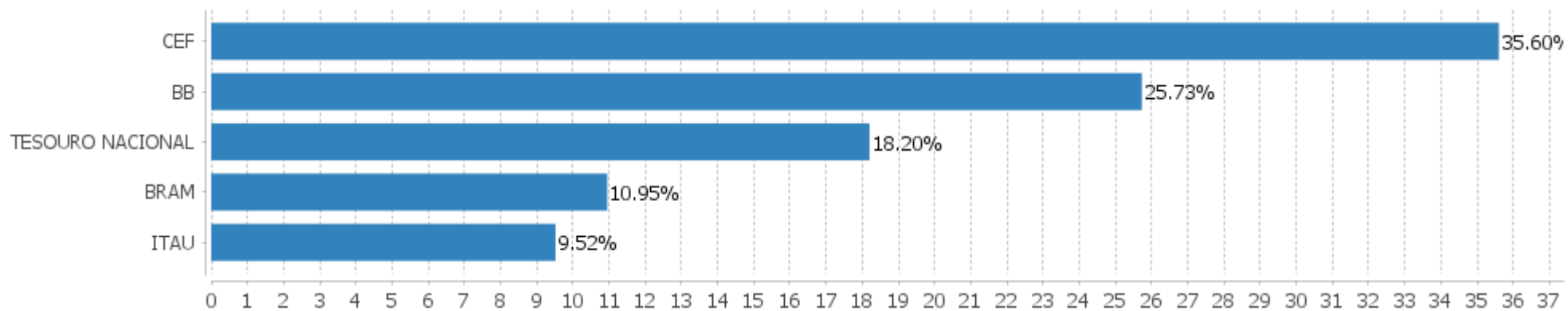


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

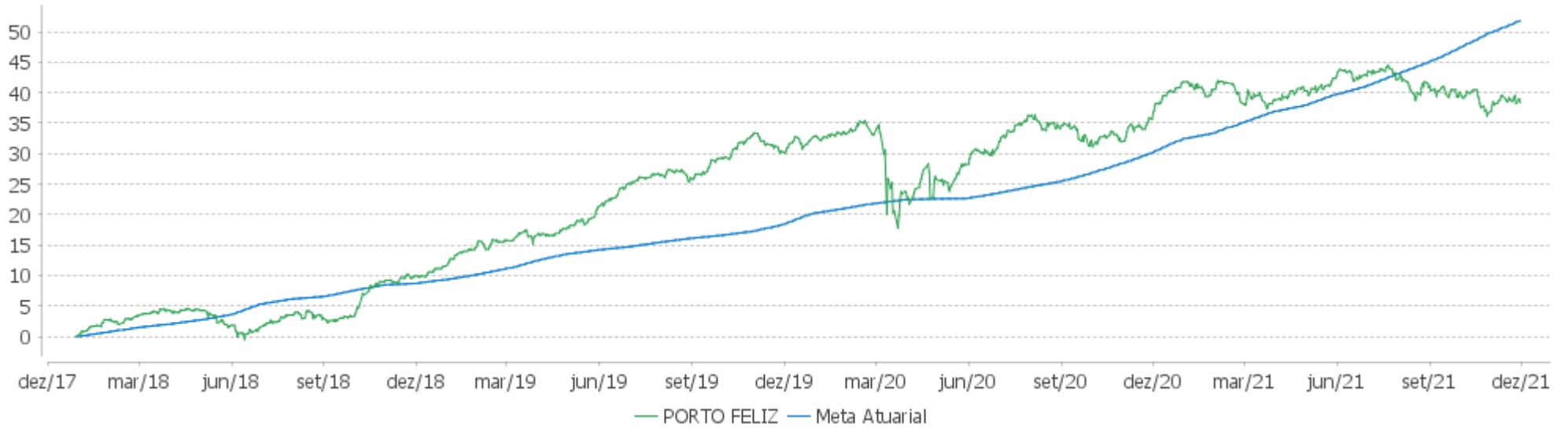
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,94	-1,43	0,32	1,05	1,43	0,40	-0,56	-0,85	-1,13	-1,94	1,28		-2,39
IPCA + 5,42%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,68	1,37		14,61
p.p. indexador	-1,61	-2,67	-1,09	0,32	0,16	-0,57	-1,99	-2,18	-2,73	-3,62	-0,09		-17,00
2020	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

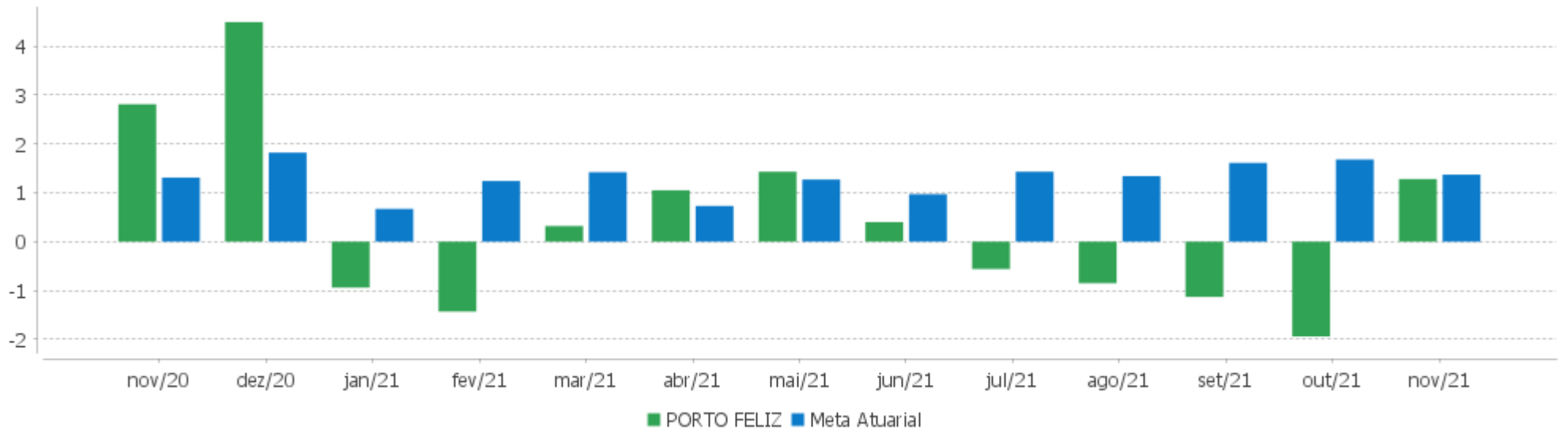
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	22	46,81	03 meses	-1,80	4,73	-6,53	6,79
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	53,19	06 meses	-2,79	8,69	-11,48	6,02
			12 meses	2,00	16,74	-14,74	5,68
			24 meses	6,17	28,87	-22,70	9,50
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10	36 meses	25,86	41,08	-15,22	8,05
Menor rentabilidade da Carteira	-7,15	2020-03	Desde 29/12/2017	38,35	54,12	-15,78	7,38

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
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,54 1,08	-6,27 -4,79	-1,28 -1,98	-4,09 -3,73	1,05 -2,25	0,36 -6,56	32,68 1,67
NTN-B 150535 (5,290003%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,66 -1,80	11,71 13,20	4,79 4,09	8,66 9,01	13,51 10,22	17,79 10,86	20,72 -10,29
NTN-B 150555 (4,689998%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,62 -1,85	11,50 12,99	4,64 3,94	8,35 8,70	13,25 9,95	17,62 10,69	20,65 -10,36
NTN-B 150840 (5,171997%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,66 -1,81	8,76 10,24	4,76 4,06	5,76 6,11	10,50 7,21	14,71 7,78	17,61 -13,40
NTN-B 150830 (4,069994%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,57 -1,90	10,74 12,23	4,49 3,79	8,03 8,38	12,42 9,12	15,77 8,84	17,79 -13,22
NTN-B 150535 (4,423526%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,60 -1,87	11,11 12,60	4,58 3,88	8,21 8,57	12,83 9,53	16,63 9,70	19,09 -11,92
NTN-B 150535 (4,734998%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,62 -1,84	11,33 12,82	4,65 3,95	8,38 8,73	13,07 9,78	17,05 10,12	19,69 -11,32
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,51 86,14	2,58 71,60	1,26 83,09	2,04 77,84	2,69 71,16	4,56 66,38	9,73 72,74
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,44 -0,03	-1,74 -0,25	0,63 -0,07	-0,51 -0,16	3,02 -0,28	6,30 -0,63	29,85 -1,16
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,45 -0,02	-1,69 -0,21	0,65 -0,05	-0,46 -0,11	3,06 -0,24	6,39 -0,54	29,92 -1,09
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	2,47 -0,03	3,52 -0,23	2,19 -0,06	2,18 -0,12	5,40 -0,25	12,88 -0,59	27,61 -0,95
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	2,48 -0,02	3,55 -0,20	2,20 -0,05	2,20 -0,10	5,43 -0,22	13,01 -0,46	27,70 -0,86
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,77 -0,02	1,78 -0,25	0,62 -0,03	1,30 -0,12	2,10 -0,25	5,73 -0,67	12,75 -0,99
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,44 -0,03	-1,71 -0,23	0,61 -0,09	-0,53 -0,18	3,04 -0,26	6,38 -0,55	30,01 -1,00
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,80 0,01	-4,08 -0,28	-1,30 -0,09	-2,25 -0,20	-2,20 -0,27	2,67 -0,60	15,81 -0,94
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,44 -0,03	-1,82 -0,33	0,61 -0,09	-0,53 -0,18	2,92 -0,37	6,18 -0,74	29,66 -1,35
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-0,49	25,83	2,15	11,27	29,78	43,53	69,64

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.	0,75	-5,66	-8,19	-5,41	-3,14	-49,92	-71,05
BRABESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	-3,17	-13,22	-18,61	-22,89	-5,75	-5,98	28,96
Var. SMALL CAP p.p.	-0,88	6,05	1,41	3,71	7,45	3,66	-0,59
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-1,77	-14,48	-15,61	-21,00	-6,99	-5,92	16,11
Var. IGCT p.p.	-0,04	-0,66	-0,21	-0,33	-0,79	-1,80	-3,16
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-0,89	28,32	9,66	17,02	29,21	95,10	146,17
Var. Global BDRX p.p.	-0,22	-3,08	-0,55	-2,04	-3,41	-4,19	-7,16
PORTO FELIZ	1,28	-2,39	-1,80	-2,79	2,00	6,17	25,86
Var. IPCA + 5,42% p.p.	-0,09	-17,00	-6,53	-11,48	-14,70	-22,10	-13,79
CDI	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38
IBOVESPA	-1,53	-14,37	-14,20	-19,25	-6,41	-5,84	13,87
INPC + 6,00%	1,31	15,28	4,70	8,96	17,56	31,03	43,57
IPCA + 6,00%	1,42	15,18	4,87	8,99	17,33	29,67	41,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	1,00
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	1,00
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IRF-M	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,10
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	1,50
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	1,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	0,70
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,18
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,18

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	0,79	2,03	0,65	1,42	2,35	6,40	13,74	21,69	36,07
IRF-M 1+	2,19	-7,11	-2,04	-3,73	-4,28	1,46	17,30	31,09	53,93
IRF-M TOTAL	1,79	-3,81	-1,21	-2,06	-1,93	3,27	16,74	28,91	49,37
IMA-B 5	2,50	3,75	2,25	2,30	5,65	13,47	28,56	40,58	59,06
IMA-B 5+	4,47	-6,23	-0,84	-2,98	0,81	1,50	31,39	50,00	74,04
IMA-B TOTAL	3,47	-1,49	0,70	-0,35	3,30	6,93	31,01	46,92	69,13
IMA-GERAL TOTAL	1,80	0,09	0,46	0,31	2,12	6,38	20,34	32,04	50,44
IDKA 2	2,51	4,11	2,12	1,88	5,91	14,44	28,04	40,40	59,70
IDKA 20	6,09	-12,50	-3,62	-8,23	-2,56	-7,04	31,71	56,52	86,71
CDI	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38	20,72	33,50

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-1,53	-14,37	-14,20	-19,25	-6,41	-5,84	13,87	41,61	64,63
IBRX 100	-1,69	-13,88	-14,79	-20,36	-6,00	-4,38	17,37	45,94	70,57
IBRX 50	-1,81	-13,79	-14,84	-20,46	-5,66	-4,80	12,95	40,34	62,89
SMALL CAP	-2,29	-19,26	-20,02	-26,60	-13,19	-9,64	29,55	46,85	103,82
IFIX	-3,64	-10,16	-6,23	-8,45	-8,19	-10,79	12,08	16,51	40,35
Índice Consumo - ICON	-7,50	-26,09	-21,46	-28,01	-22,40	-19,51	15,50	11,72	36,98
Índice Dividendos - IDIV	0,89	-7,89	-7,71	-11,70	0,34	0,29	33,23	61,08	90,61

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	0,95	9,26	3,40	5,86	10,74	15,51	19,30	24,12	27,60
INPC	0,84	9,36	3,23	5,84	10,96	16,73	20,66	24,95	27,38
IGPM	0,02	16,77	0,02	2,08	17,89	46,79	52,62	67,39	65,94
SELIC	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38	20,73	33,53

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	-1,24	31,49	10,34	16,68	32,92	93,45	140,69	197,22	243,65
MSCI ACWI	-2,91	21,57	7,09	9,69	23,86	76,81	115,31	147,67	190,75
MSCI World									

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,26	13,21	4,38	7,95	15,13	24,86	34,11	45,07	55,08
IPCA + 5,00%	1,34	14,19	4,63	8,47	16,23	27,25	37,99	50,70	62,64
IPCA + 5,50%	1,38	14,69	4,75	8,73	16,78	28,46	39,96	53,57	66,52
IPCA + 5,89%	1,41	15,07	4,84	8,93	17,21	29,40	41,51	55,84	69,61
IPCA + 6,00%	1,42	15,18	4,87	8,99	17,33	29,67	41,95	56,48	70,48
INPC + 4,00%	1,15	13,31	4,22	7,93	15,36	26,17	35,64	46,04	54,81
INPC + 6,00%	1,31	15,28	4,70	8,96	17,56	31,03	43,57	57,53	70,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
59	05/11/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	20.420,12	0,00	9.453,30202100	2,1601044750
58	08/11/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	39.391,52	0,00	18.231,33864300	2,1606488020
57	10/11/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.399.268,86	0,00	647.290,46392800	2,1617325420
61	10/11/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.000.000,00	0,00	1.176.387,54911400	1,7001200000
62	10/11/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	17.000.000,00	4.761.883,42073400	3,5700160000
50	11/11/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	160.000,00	0,00	57.931,58654800	2,7618784420
60	11/11/2021	BRANCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	3.000.000,00	0,00	264.875,41430370	11,3260795000
63	11/11/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2.000.000,00	0,00	303.939,21945065	6,5802630000
49	11/11/2021	NTN-B 150840 (5,171997%)	9.997.717,12	0,00	2.414,00000000	4.141,5563870000
56	19/11/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	69.705,94	0,00	32.196,87326000	2,1649909740
55	23/11/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	910.001,65	0,00	420.114,09048100	2,1660821920
51	24/11/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	57.056,56	20.616,98085900	2,7674546720
54	24/11/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.410.055,46	1.112.354,79002200	2,1666247870
48	24/11/2021	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	910.000,00	0,00	25.184,91680000	36,1327380000
53	26/11/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	135.651,66	0,00	62.578,22309000	2,1677135160
52	30/11/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.322.841,64	0,00	609.942,32374100	2,1687979150
		Total				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 8.577.659,88

Value-At-Risk: 3,15%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,04	0,00	-16,20	0,51	2.870.806,78	1,05
NTN-B 150555 (4,689998%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,66	0,15	0,00	1,55	1,62	2.571.105,63	0,94
NTN-B 150535 (5,290003%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,66	0,15	0,00	1,62	1,66	9.932.429,68	3,64
NTN-B 150830 (4,069994%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,66	0,15	0,00	1,48	1,57	5.185.455,39	1,90
NTN-B 150840 (5,171997%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,66	0,27	0,00	1,61	1,66	10.085.673,64	3,70
NTN-B 150535 (4,734998%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,66	0,15	0,00	1,56	1,62	10.078.884,77	3,70
NTN-B 150535 (4,423526%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,66	0,16	0,00	1,52	1,60	2.566.428,09	0,94
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,67	0,59	0,00	0,28	0,77	4.362.095,03	1,60
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,51	1,54	0,04	0,76	2,48	14.187.770,88	5,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,52	1,51	0,06	0,75	2,47	20.320.723,89	7,45
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,84	1,84	0,00	0,32	1,80	213.520,02	0,08
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	7,54	2,70	0,07	0,38	3,45	11.780.882,97	4,32
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,54	2,71	0,20	0,38	3,44	32.844.636,64	12,04
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	7,55	2,71	0,03	0,38	3,44	4.921.839,79	1,80
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,61	2,74	0,25	0,37	3,44	40.002.960,16	14,67
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	14,67	4,65	0,10	0,27	4,54	9.224.709,95	3,38
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	15,00	7,20	0,34	-0,07	-0,49	21.610.289,89	7,92
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	19,70	8,14	0,01	-0,08	-0,89	22.320.528,73	8,18
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	23,03	12,20	0,87	-0,10	-1,77	22.725.253,44	8,33
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	30,42	14,43	1,17	-0,12	-3,17	24.933.557,03	9,14