



LDB
EMPRESAS

PORTO FELIZ
DEZEMBRO 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 31.12.2021.

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

63,19%

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	9,80	-1,41	-7,59	9.094.686,12	3,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,423526%)	2,59	1,16	6,55	2.596.153,81	0,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,734998%)	2,66	1,19	4,67	10.198.398,17	3,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290003%)	2,80	1,23	3,37	10.055.050,81	3,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (4,689998%)	2,47	1,18	6,59	2.601.489,04	0,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,069994%)	2,62	1,13	7,66	5.243.891,96	1,89
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,120004%)	3,78	0,51	0,51	10.051.037,91	3,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,171997%)	3,80	1,22	2,11	10.209.142,14	3,69
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		6,80	0,79	0,10	60.049.849,96	21,69

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	3,52	1,88	-2,28	217.527,18	0,08	4.897.855.877,38	0,00
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,77	0,77	4,35	14.297.419,76	5,16	1.459.166.400,75	0,98
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,75	0,21	-1,49	11.805.089,83	4,26	393.080.062,36	3,00
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,64	0,84	2,64	4.394.709,70	1,59	6.208.104.156,65	0,07
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,79	0,20	-1,51	40.084.320,06	14,48	7.081.253.604,41	0,57
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,77	0,20	-1,62	4.931.709,74	1,78	597.312.070,50	0,83
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,76	0,21	-1,53	16.053.244,11	5,80	4.689.992.155,11	0,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,78	0,77	4,31	20.476.672,27	7,40	12.444.051.491,75	0,16
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,79	0,44	-0,33	112.260.692,65	40,54		
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	0,13	0,67	2,70	2.654.964,93	0,96	3.073.023.342,66	0,09
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,13	0,67	2,70	2.654.964,93	0,96		
Renda Fixa			4,67	0,58	-0,06	174.965.507,54	63,19		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

27,89%

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	20,64	3,44	-11,53	23.506.744,68	8,49	994.621.415,62	2,36
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			20,64	3,44	-11,53	23.506.744,68	8,49		

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	22,59	3,89	-9,84	28.874.925,79	10,43	1.419.483.989,90	2,03
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			22,59	3,89	-9,84	28.874.925,79	10,43		

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	13,38	5,56	29,21	24.854.644,32	8,98	3.768.911.648,33	0,66
Sub-total Artigo 8º III			13,38	5,56	29,21	24.854.644,32	8,98		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			18,09	4,31	-3,20	77.236.314,79	27,89		
--	--	--	--------------	-------------	--------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

8,92%

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	17,57	1,70	20,54	24.696.738,41	8,92	3.890.658.229,39	0,63
Sub-total Artigo 9º A, III			17,57	1,70	20,54	24.696.738,41	8,92		
Investimentos no Exterior			16,99	1,70	20,54	24.696.738,41	8,92		
Total			5,76	1,64	-0,79	276.898.560,74	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	60.049.849,96	21,69	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	112.260.692,65	40,54	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	2.654.964,93	0,96	0,00	0,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	174.965.507,54	63,19					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	23.506.744,68	8,49	0,00	10,00	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	28.874.925,79	10,43	0,00	10,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	24.854.644,32	8,98	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	77.236.314,79	27,89					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	24.696.738,41	8,92	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	24.696.738,41	8,92					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	0,79 104,04	0,10 2,25	2,70 146,54	1,76 56,95	0,10 2,25	405.307,58	982.868,70
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,44 57,85	-0,33 -7,56	1,25 67,81	0,17 5,43	-0,33 -7,56	630.336,27	-2.158.262,96
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,67 87,65	2,70 80,03	1,58 85,85	2,49 80,68		30.222,45	60.431,08
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	3,44 0,59	-11,53 0,39	-6,39 -0,84	-19,00 -1,66	-11,53 0,39	781.491,24	-3.181.223,09
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	3,89 1,04	-9,84 2,09	-12,01 -6,46	-20,59 -3,26	-9,84 2,09	941.368,76	-3.802.064,97
Artigo 8º III % do CDI	5,56 728,37	29,21 691,66	13,07 709,80	14,36 465,04		1.244.354,43	3.110.929,99
Artigo 9º A, III % do CDI	1,70 222,99	20,54 500,17	11,81 641,32	20,44 662,12		376.209,68	2.696.738,41
PORTO FELIZ (Total)						4.409.290,41	-2.290.582,84

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 150535 (4,423526%)	2.566.428,09	0,00	0,00	0,00	2.596.153,81	29.725,72	162.439,43
NTN-B 150535 (4,734998%)	10.078.884,77	0,00	0,00	0,00	10.198.398,17	119.513,40	462.101,11
NTN-B 150535 (5,290003%)	9.932.429,68	0,00	0,00	0,00	10.055.050,81	122.621,13	331.854,70
NTN-B 150545	9.224.709,95	0,00	0,00	0,00	9.094.686,12	-130.023,83	-774.311,94
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.571.105,63	0,00	0,00	0,00	2.601.489,04	30.383,41	163.544,30
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.185.455,39	0,00	0,00	0,00	5.243.891,96	58.436,57	374.633,39
NTN-B 150840 (5,120004%)	0,00	9.999.855,23	0,00	0,00	10.051.037,91	51.182,68	51.182,68
NTN-B 150840 (5,171997%)	10.085.673,64	0,00	0,00	0,00	10.209.142,14	123.468,50	211.425,02
					60.049.849,96	0,00	0,00

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

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	40.002.960,16	0,00	0,00	0,00	40.084.320,06	81.359,90	-616.483,89
BB PREV RF IRF-M	213.520,02	0,00	0,00	0,00	217.527,18	4.007,16	-570.204,32
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	4.362.095,03	40.000,00	-44.073,00	0,00	4.394.709,70	36.687,67	115.756,29
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	4.921.839,79	0,00	0,00	0,00	4.931.709,74	9.869,95	-1.305.826,30
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	20.320.723,89	0,00	0,00	0,00	20.476.672,27	155.948,38	951.063,87
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	32.844.636,64	0,00	-17.000.000,00	0,00	16.053.244,11	208.607,47	-962.277,62
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	11.780.882,97	0,00	0,00	0,00	11.805.089,83	24.206,86	-178.462,44
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	14.187.770,88	0,00	0,00	0,00	14.297.419,76	109.648,88	658.246,30
					112.260.692,65	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	2.870.806,78	11.980.157,07	-12.226.221,37	0,00	2.654.964,93	30.222,45	60.431,08
					2.654.964,93	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	22.725.253,44	0,00	0,00	0,00	23.506.744,68	781.491,24	-3.181.223,09
					23.506.744,68	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	24.933.557,03	3.000.000,00	0,00	0,00	28.874.925,79	941.368,76	-3.802.064,97
					28.874.925,79	0,00	0,00

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	21.610.289,89	2.000.000,00	0,00	0,00	24.854.644,32	1.244.354,43	3.110.929,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					24.854.644,32	0,00	0,00

Artigo 9º A, III (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	22.320.528,73	2.000.000,00	0,00	0,00	24.696.738,41	376.209,68	2.696.738,41
					24.696.738,41	0,00	0,00

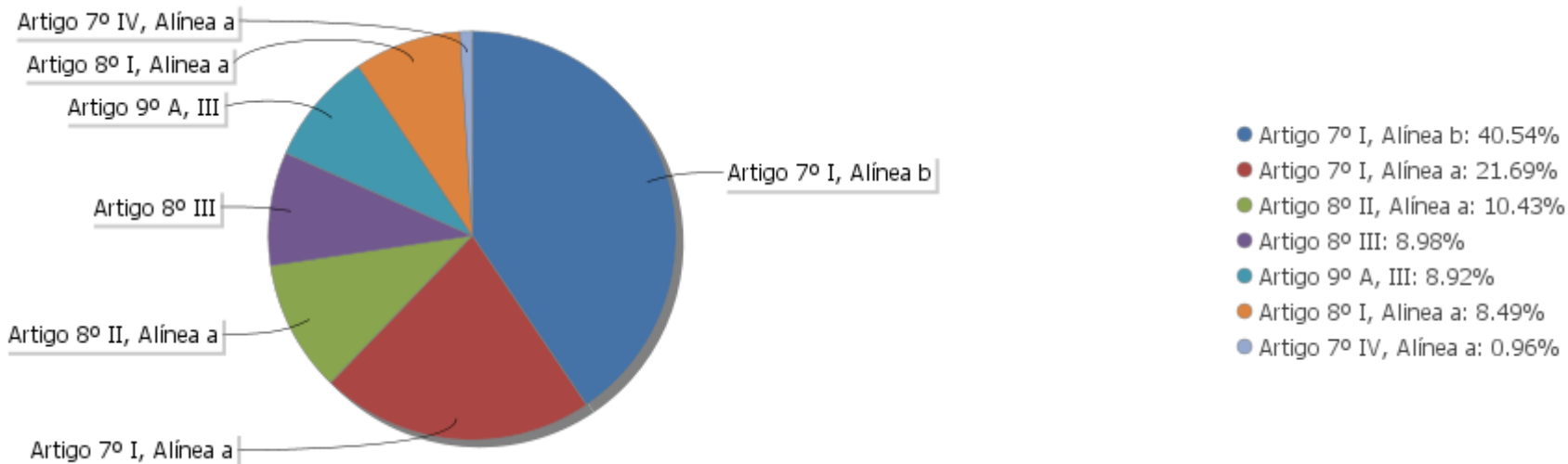
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

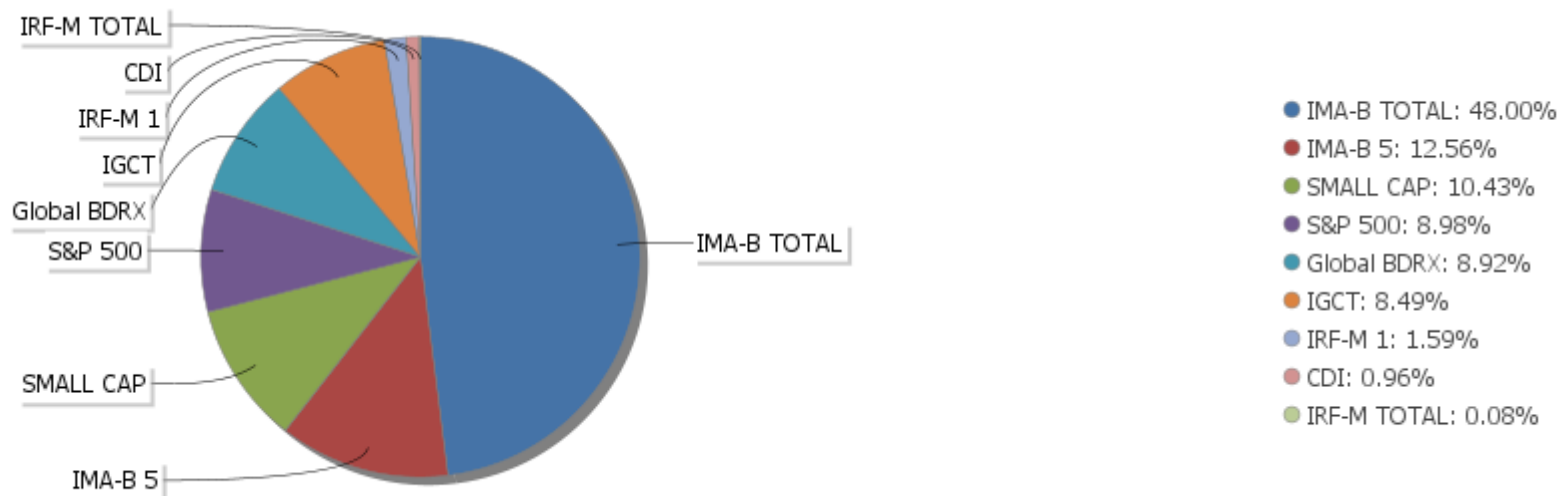
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	216.848.710,78	78,31	216.848.710,78	78,31
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	216.848.710,78	78,31
acima de 365 dias	60.049.849,96	21,69	276.898.560,74	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

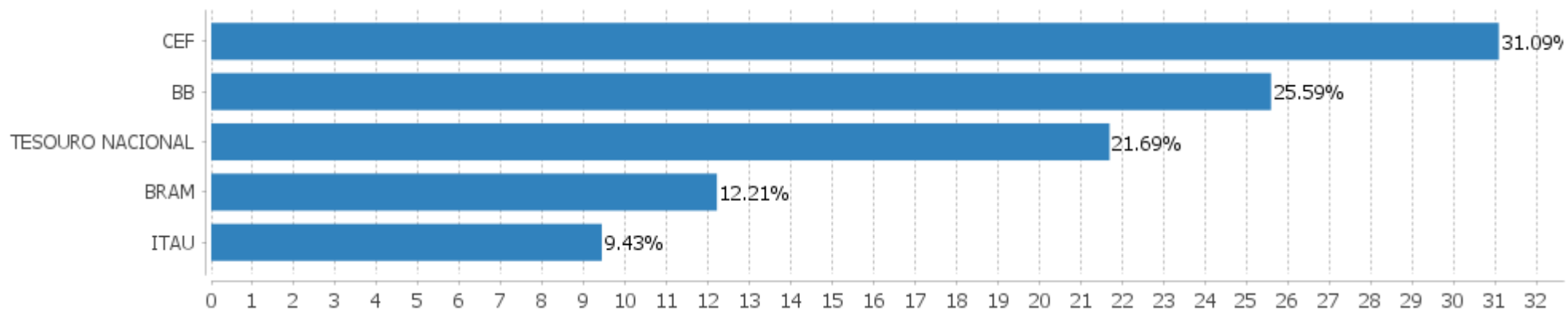


Alocação Por Estratégia



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	1,64	-0,79
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	1,22	16,00
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	0,43	-16,79
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

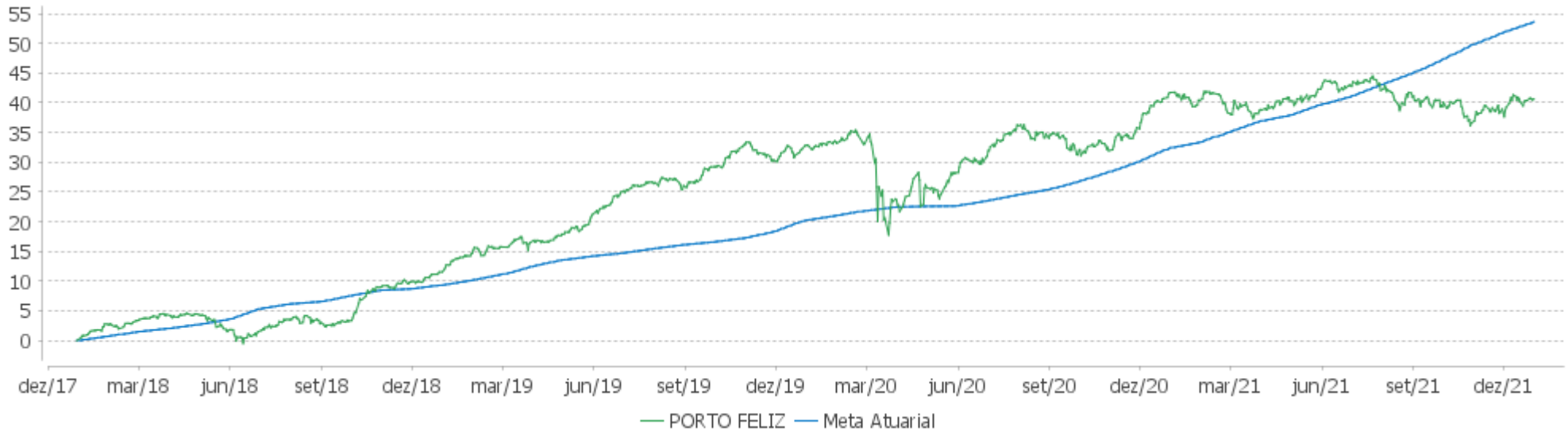
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

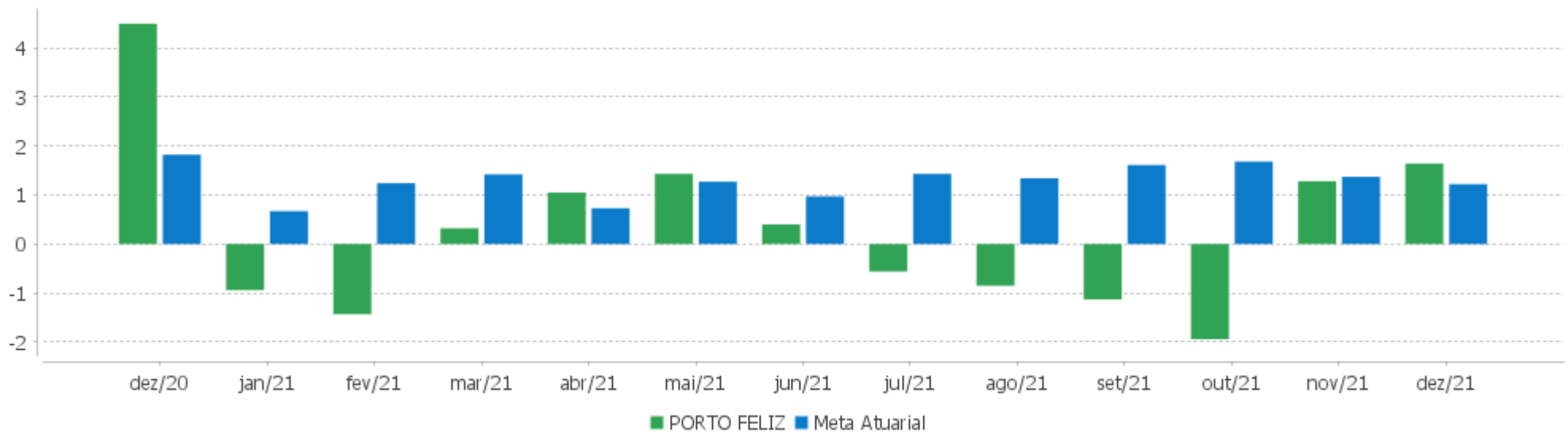
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	23	47,92	03 meses	0,95	4,33	-3,38	6,63
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	52,08	06 meses	-1,59	8,95	-10,54	6,27
			12 meses	-0,79	16,00	-16,79	5,76
			24 meses	5,86	28,33	-22,47	9,51
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10	36 meses	26,07	41,92	-15,85	8,09
Menor rentabilidade da Carteira	-7,15	2020-03	48 meses	40,62	56,00	-15,38	7,35
			Desde 29/12/2017	40,62	56,00	-15,38	7,35

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 150535 (5,290003%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,23 1,01	13,09 14,35	4,41 3,35	8,70 9,25	13,09 14,35	17,73 12,67	21,87 -7,31
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,41 -1,63	-7,59 -6,33	-1,44 -2,50	-6,06 -5,52	-7,59 -6,33	-4,01 -9,07	28,20 -0,98
NTN-B 150555 (4,689998%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,18 0,96	12,82 14,09	4,26 3,20	8,39 8,93	12,82 14,09	17,56 12,50	21,78 -7,39
NTN-B 150840 (5,120004%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,22 0,99	10,07 11,33	4,36 3,30	5,78 6,33	10,07 11,33	14,61 9,55	18,66 -10,52
NTN-B 150840 (5,171997%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,22 1,00	10,09 11,35	4,38 3,32	5,79 6,34	10,09 11,35	14,65 9,59	18,72 -10,45
NTN-B 150830 (4,069994%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,13 0,90	11,99 13,26	4,10 3,04	8,06 8,61	11,99 13,26	15,71 10,65	18,89 -10,28
NTN-B 150535 (4,423526%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,16 0,93	12,40 13,66	4,19 3,13	8,25 8,79	12,40 13,66	16,57 11,51	20,21 -8,97
NTN-B 150535 (4,734998%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,19 0,96	12,65 13,91	4,27 3,21	8,41 8,96	12,65 13,91	16,99 11,93	20,81 -8,36
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,67 87,65	3,27 74,33	1,58 85,85	2,49 80,68	3,27 74,33	4,96 68,13	10,02 73,22
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,21 -0,02	-1,49 -0,22	1,01 -0,05	-0,65 -0,10	-1,49 -0,22	4,53 -0,53	28,12 -1,05
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,21 -0,02	-1,53 -0,27	1,00 -0,06	-0,70 -0,15	-1,53 -0,27	4,44 -0,62	28,03 -1,14
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,77 -0,02	4,31 -0,25	1,97 -0,06	3,12 -0,12	4,31 -0,25	12,39 -0,58	26,84 -0,99
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,77 -0,01	4,35 -0,21	1,98 -0,05	3,14 -0,10	4,35 -0,21	12,52 -0,45	27,00 -0,83
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,84 -0,03	2,64 -0,29	1,10 -0,03	1,97 -0,12	2,64 -0,29	6,20 -0,68	13,10 -1,01
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,88 -0,01	-2,28 -0,29	0,93 -0,05	-0,59 -0,17	-2,28 -0,29	3,97 -0,60	16,22 -0,92
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,20 -0,02	-1,51 -0,25	0,97 -0,09	-0,70 -0,16	-1,51 -0,25	4,53 -0,53	28,20 -0,97
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	0,20	-1,62	0,97	-0,72	-1,62	4,33	27,84

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,36	-0,09	-0,17	-0,36	-0,73	-1,33
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	5,56 1,93	32,83 -3,44	13,07 -0,45	14,36 -9,37	32,83 -3,44	47,69 -56,56	94,62 -79,20
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	3,89 0,10	-9,84 6,36	-12,01 -0,73	-20,59 4,20	-9,84 6,36	-11,55 5,20	27,79 -3,91
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	3,44 -0,04	-11,53 -0,72	-6,39 -0,19	-19,00 -0,31	-11,53 -0,72	-9,52 -1,66	21,15 -3,27
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	1,70 -0,01	30,51 -3,14	11,81 -0,48	20,44 -0,99	30,51 -3,14	101,98 -3,86	171,58 -7,67
PORTO FELIZ Var. IPCA + 5,42% p.p.	1,64 0,43	-0,79 -16,79	0,95 -3,38	-1,59 -10,54	-0,79 -16,79	5,86 -21,92	26,07 -14,48
CDI	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69
IBOVESPA	2,85	-11,93	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27
INPC + 6,00%	1,27	16,74	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52
IPCA + 6,00%	1,27	16,64	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87

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	0,88	2,93	1,13	2,10	2,93	6,88	14,10	22,06	35,63
IRF-M 1+	2,29	-4,99	0,93	-1,74	-4,99	3,04	17,72	32,16	54,19
IRF-M TOTAL	1,89	-1,99	0,98	-0,42	-1,99	4,57	17,15	29,72	49,44
IMA-B 5	0,79	4,57	2,03	3,24	4,57	12,97	27,83	40,44	58,11
IMA-B 5+	-0,34	-6,55	0,09	-4,11	-6,55	-1,41	28,53	48,33	67,24
IMA-B TOTAL	0,22	-1,26	1,06	-0,55	-1,26	5,06	29,17	46,04	64,72
IMA-GERAL TOTAL	0,87	0,96	1,34	0,82	0,96	6,35	19,98	32,02	48,95
IDKA 2	0,83	4,97	1,84	3,05	4,97	14,02	27,50	39,94	58,99
IDKA 20	-2,28	-14,50	-2,87	-11,27	-14,50	-12,61	26,07	51,79	70,27
CDI	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	20,99	33,03

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	2,85	-11,93	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27	37,20	74,05
IBRX 100	3,14	-11,17	-5,51	-18,37	-11,17	-8,07	22,63	41,54	80,53
IBRX 50	3,76	-10,54	-4,49	-18,01	-10,54	-7,30	19,73	37,12	73,89
SMALL CAP	3,80	-16,20	-11,28	-24,79	-16,20	-16,75	31,71	42,41	112,70
IFIX	8,78	-2,28	3,28	1,81	-2,28	-12,28	19,27	25,98	50,42
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	1,60	-6,41	-1,83	-8,30	-6,41	-7,35	34,49	55,95	95,40

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	0,73	10,06	2,96	6,07	10,06	15,03	19,99	24,48	28,15
INPC	0,73	10,16	2,75	5,97	10,16	16,16	21,37	25,53	28,13
IGPM	0,87	17,78	1,54	2,35	17,78	45,04	55,63	67,36	66,49
SELIC	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	21,00	33,06

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	3,63	36,26	13,52	23,73	36,26	104,25	173,82	200,73	264,52
MSCI ACWI	3,17	25,42	9,15	16,96	25,42	84,89	138,58	148,21	206,39
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%	1,09	14,45	3,97	8,20	14,45	24,38	34,95	45,56	55,77
IPCA + 5,00%	1,18	15,54	4,22	8,73	15,54	26,77	38,87	51,22	63,36
IPCA + 5,50%	1,22	16,09	4,35	8,99	16,09	27,98	40,86	54,11	67,27
IPCA + 5,89%	1,26	16,52	4,44	9,20	16,52	28,92	42,43	56,40	70,37
IPCA + 6,00%	1,27	16,64	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87	57,04	71,26
INPC + 4,00%	1,09	14,55	3,77	8,10	14,55	25,60	36,50	46,79	55,74
INPC + 6,00%	1,27	16,74	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52	58,37	71,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
74	02/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.393,40	642,14643100	2,1699100600
73	03/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.365.579,26	0,00	629.166,15850700	2,1704588550
72	06/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	19.820,82	0,00	9.129,79145300	2,1710046830
71	07/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	134.622,12	0,00	61.993,67622300	2,1715460060
75	08/12/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	44.073,00	15.840,94606400	2,7822201920
70	09/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	776.635,54	357.461,50421600	2,1726410560
77	09/12/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	17.000.000,00	4.635.070,02905800	3,6676900000
69	10/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	10.044.984,30	0,00	4.622.005,19184400	2,1732957630
79	10/12/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.000.000,00	0,00	1.154.243,25792000	1,7327370000
78	10/12/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2.000.000,00	0,00	291.396,51781161	6,8635000000
80	13/12/2021	BRANCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	3.000.000,00	0,00	285.788,81399330	10,4972618000
68	15/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.000.000,00	4.597.073,29700600	2,1752970540
81	16/12/2021	NTN-B 150840 (5,120004%)	9.999.855,23	0,00	2.363,00000000	4.231,8473260000
67	17/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.448.192,43	665.337,43631900	2,1766285060
66	20/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	299.623,30	0,00	137.612,70418100	2,1772938900
76	21/12/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	40.000,00	0,00	14.332,70707000	2,7908196130
65	22/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	20.063,33	0,00	9.209,14668800	2,1786307330
64	30/12/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	95.463,94	0,00	43.737,79788500	2,1826416650
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 8.882.782,77

Value-At-Risk: 3,21%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PORTO FELIZ		3,21	3,21			276.898.560,74	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,70%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545		4,59	0,09	1,76			9.094.686,12	3,28
NTN-B 150535 (4,423526%)		0,16	-0,00	2,95			2.596.153,81	0,94
NTN-B 150535 (4,734998%)		0,10	-0,00	2,95			10.198.398,17	3,68
NTN-B 150535 (5,290003%)		0,10	-0,00	2,95			10.055.050,81	3,63
NTN-B 150555 (4,689998%)		0,10	-0,00	2,95			2.601.489,04	0,94
NTN-B 150830 (4,069994%)		0,10	-0,00	2,95			5.243.891,96	1,89
NTN-B 150840 (5,120004%)		0,22	0,00	2,95			10.051.037,91	3,63
NTN-B 150840 (5,171997%)		0,22	0,00	2,95			10.209.142,14	3,69
Sub-total	1,46	0,72	0,09		0,02	0,79	60.049.849,96	21,69

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M		1,78	0,00	0,02			217.527,18	0,08
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI		1,21	0,03	0,00			14.297.419,76	5,16
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI		2,96	0,07	0,01			11.805.089,83	4,26
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,62	0,00	0,03			4.394.709,70	1,59
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,99	0,25	0,04			40.084.320,06	14,48
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		2,96	0,03	0,01			4.931.709,74	1,78
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,98	0,10	0,03			16.053.244,11	5,80
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,20	0,05	0,02			20.476.672,27	7,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	3,55	2,29	0,54		-0,09	0,44	112.260.692,65	40,54
Artigo 7º IV, Alínea a								
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC		0,04	0,00	0,01			2.654.964,93	0,96
Sub-total	0,04	0,04	0,00		-2,35	0,67	2.654.964,93	0,96
Renda Variável e Investimentos Estruturados							Value-At-Risk: 9,57%	
Artigo 8º I, Alínea a								
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		10,65	0,78	0,08			23.506.744,68	8,49
Sub-total	19,33	10,65	0,78		0,14	3,44	23.506.744,68	8,49
Artigo 8º II, Alínea a								
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		14,72	1,37	4,08			28.874.925,79	10,43
Sub-total	22,63	14,72	1,37		0,14	3,89	28.874.925,79	10,43
Artigo 8º III								
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,48	0,37	5,81			24.854.644,32	8,98
Sub-total	16,74	6,48	0,37		0,29	5,56	24.854.644,32	8,98
Investimentos no Exterior							Value-At-Risk: 8,18%	
Artigo 9º A, III								
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		8,18	0,05	0,67			24.696.738,41	8,92
Sub-total	18,91	8,18	0,05		0,05	1,70	24.696.738,41	8,92