



**LDB**  
EMPRESAS

**PORTO FELIZ**  
JANEIRO 2022



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 31.01.2022.

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

63,41%

## 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	9,65	-1,46	-1,46	8.962.053,38	3,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,423526%)	2,58	1,03	1,03	2.622.946,62	0,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,734998%)	2,65	1,06	1,06	10.306.204,42	3,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290003%)	2,79	1,10	1,10	10.165.816,81	3,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (4,689998%)	2,46	1,05	1,05	2.628.896,33	0,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,069994%)	2,61	1,00	1,00	5.296.516,37	1,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,569998%)	4,03	0,58	0,58	1.526.249,29	0,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,120004%)	3,76	1,09	1,09	10.160.391,28	3,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,171997%)	3,79	1,09	1,09	10.320.636,88	3,74
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>6,27</b>	<b>0,69</b>	<b>0,69</b>	<b>61.989.711,38</b>	<b>22,47</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	3,54	-0,13	-0,13	217.250,31	0,08	4.743.847.539,71	0,00
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,76	0,10	0,10	14.311.463,35	5,19	1.441.183.712,68	0,99
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,67	-0,75	-0,75	11.717.028,00	4,25	320.131.317,42	3,66
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,68	0,61	0,61	4.350.628,27	1,58	5.049.727.685,75	0,09
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,71	-0,77	-0,77	39.776.517,63	14,42	6.778.952.570,88	0,59
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS	5,68	-0,76	-0,76	4.894.151,00	1,77	591.516.478,08	0,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
PUB									
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,68	-0,76	-0,76	15.931.699,03	5,78	4.513.989.587,78	0,35
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,77	0,09	0,09	20.495.178,62	7,43	12.040.160.059,77	0,17
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>4,72</b>	<b>-0,44</b>	<b>-0,44</b>	<b>111.693.916,21</b>	<b>40,49</b>		
Artigo 7º III, Alínea a (Fundos 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	0,65	0,65	1.239.468,72	0,45	3.101.943.229,29	0,04
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,15</b>	<b>0,65</b>	<b>0,65</b>	<b>1.239.468,72</b>	<b>0,45</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>4,54</b>	<b>-0,04</b>	<b>-0,04</b>	<b>174.923.096,31</b>	<b>63,41</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

19,97%

Artigo 8º I (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	23,10	3,96	3,96	30.018.980,95	10,88	1.385.056.471,22	2,17
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,24	6,70	6,70	25.080.802,79	9,09	1.044.534.082,64	2,40
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>24,24</b>	<b>5,19</b>	<b>5,19</b>	<b>55.099.783,74</b>	<b>19,97</b>		
Renda Variável			18,18	5,19	5,19	55.099.783,74	19,97		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

8,08%

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,35	-9,75	-9,75	22.289.785,20	8,08	3.479.303.240,79	0,64
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>17,35</b>	<b>-9,75</b>	<b>-9,75</b>	<b>22.289.785,20</b>	<b>8,08</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>17,64</b>	<b>-9,75</b>	<b>-9,75</b>	<b>22.289.785,20</b>	<b>8,08</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

8,53%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,60	-5,30	-5,30	23.536.636,92	8,53	3.506.862.313,47	0,67
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>13,60</b>	<b>-5,30</b>	<b>-5,30</b>	<b>23.536.636,92</b>	<b>8,53</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>18,08</b>	<b>-5,30</b>	<b>-5,30</b>	<b>23.536.636,92</b>	<b>8,53</b>		
<b>Total</b>			<b>5,82</b>	<b>-0,39</b>	<b>-0,39</b>	<b>275.849.302,17</b>	<b>100,00</b>		

## 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	61.989.711,38	22,47					100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	111.693.916,21	40,49					100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	1.239.468,72	0,45					60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>174.923.096,31</b>	<b>63,41</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	55.099.783,74	19,97					30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>55.099.783,74</b>	<b>19,97</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	22.289.785,20	8,08					10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>22.289.785,20</b>	<b>8,08</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	23.536.636,92	8,53					10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>23.536.636,92</b>	<b>8,53</b>					15,00



**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	0,69 94,06	0,69 94,06	3,80 181,00	2,36 67,80	2,38 47,65	422.476,76	422.476,76
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,44 -60,30	-0,44 -60,30	3,12 148,69	0,03 0,86	-0,09 -1,74	-495.776,44	-495.776,44
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,65 89,07	0,65 89,07				17.030,70	17.030,70
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,19 -1,80	5,19 -1,80				2.718.113,27	2.718.113,27
Artigo 9º III % do CDI	-9,75 -1.330,92	-9,75 -1.330,92	-9,03 -430,53	3,11 89,61		-2.406.953,21	-2.406.953,21
Artigo 10º I % do CDI	-5,30 -724,16	-5,30 -724,16				-1.318.007,40	-1.318.007,40
<b>PORTO FELIZ (Total)</b>						<b>-1.063.116,32</b>	<b>-1.063.116,32</b>

**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%)	2.596.153,81	0,00	0,00	0,00	2.622.946,62	26.792,81	26.792,81
NTN-B 150535 (4,734998%)	10.198.398,17	0,00	0,00	0,00	10.306.204,42	107.806,25	107.806,25
NTN-B 150535 (5,290003%)	10.055.050,81	0,00	0,00	0,00	10.165.816,81	110.766,00	110.766,00
NTN-B 150545	9.094.686,12	0,00	0,00	0,00	8.962.053,38	-132.632,74	-132.632,74
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.601.489,04	0,00	0,00	0,00	2.628.896,33	27.407,29	27.407,29
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.243.891,96	0,00	0,00	0,00	5.296.516,37	52.624,41	52.624,41
NTN-B 150830 (5,569998%)	0,00	1.517.384,66	0,00	0,00	1.526.249,29	8.864,63	8.864,63
NTN-B 150840 (5,120004%)	10.051.037,91	0,00	0,00	0,00	10.160.391,28	109.353,37	109.353,37
NTN-B 150840 (5,171997%)	10.209.142,14	0,00	0,00	0,00	10.320.636,88	111.494,74	111.494,74
					61.989.711,38	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	40.084.320,06	0,00	0,00	0,00	39.776.517,63	-307.802,43	-307.802,43
BB PREV RF IRF-M	217.527,18	0,00	0,00	0,00	217.250,31	-276,87	-276,87
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	4.394.709,70	0,00	-71.000,00	0,00	4.350.628,27	26.918,57	26.918,57
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	4.931.709,74	0,00	0,00	0,00	4.894.151,00	-37.558,74	-37.558,74
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	20.476.672,27	0,00	0,00	0,00	20.495.178,62	18.506,35	18.506,35
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.053.244,11	0,00	0,00	0,00	15.931.699,03	-121.545,08	-121.545,08
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	11.805.089,83	0,00	0,00	0,00	11.717.028,00	-88.061,83	-88.061,83
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	14.297.419,76	0,00	0,00	0,00	14.311.463,35	14.043,59	14.043,59
					111.693.916,21	0,00	0,00

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	2.654.964,93	1.919.049,13	-3.351.576,04	0,00	1.239.468,72	17.030,70	17.030,70
					1.239.468,72	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	23.506.744,68	0,00	0,00	0,00	25.080.802,79	1.574.058,11	1.574.058,11
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	28.874.925,79	0,00	0,00	0,00	30.018.980,95	1.144.055,16	1.144.055,16
					55.099.783,74	0,00	0,00

Artigo 9º 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	24.696.738,41	0,00	0,00	0,00	22.289.785,20	-2.406.953,21	-2.406.953,21
					22.289.785,20	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	24.854.644,32	0,00	0,00	0,00	23.536.636,92	-1.318.007,40	-1.318.007,40
					23.536.636,92	0,00	0,00

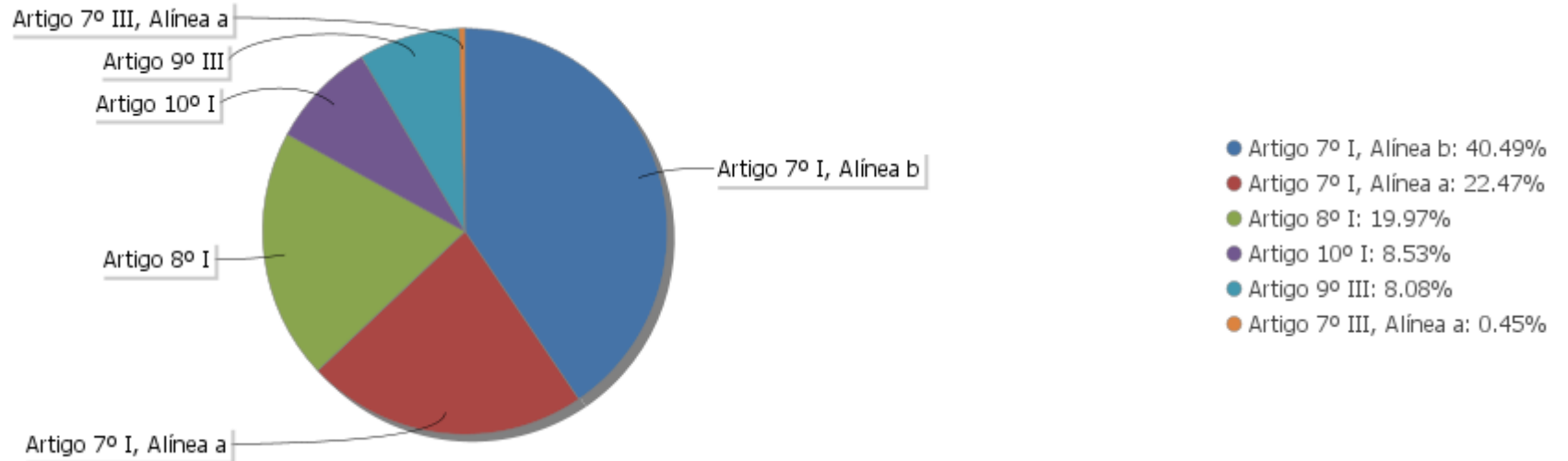
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

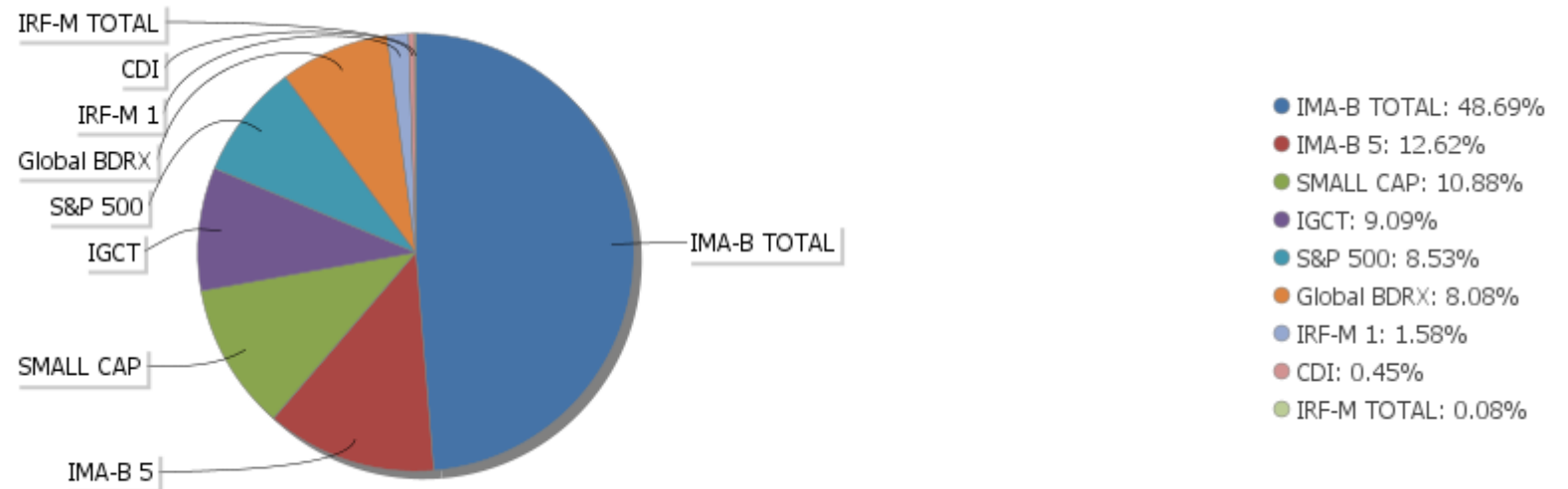
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	213.859.590,79	77,53	213.859.590,79	77,53
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	213.859.590,79	77,53
acima de 365 dias	61.989.711,38	22,47	275.849.302,17	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

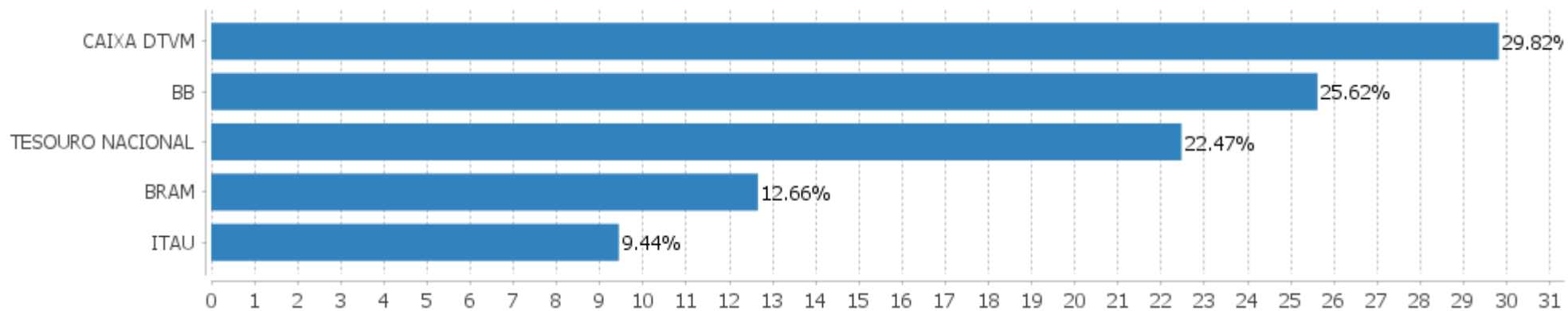


Alocação Por Estratégia



## 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
2022	-0,39												-0,39
IPCA + 5,42%	0,98												0,98
p.p. indexador	-1,37												-1,37
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**

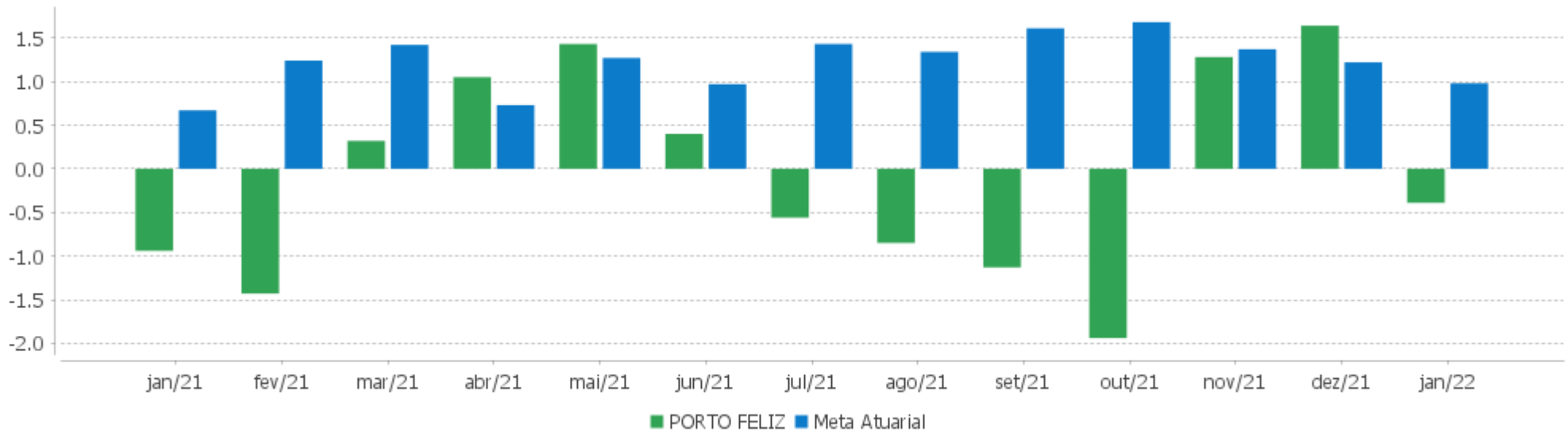
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	23	46,94	03 meses	2,55	3,62	-1,07	6,38
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	53,06	06 meses	-1,42	8,47	-9,89	6,43
			12 meses	-0,24	16,36	-16,60	5,82
			24 meses	5,18	28,68	-23,50	9,58
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10	36 meses	21,57	42,13	-20,56	8,14
Menor rentabilidade da Carteira	-7,15	2020-03	48 meses	36,39	56,28	-19,89	7,39
			Desde 29/12/2017	40,08	57,53	-17,46	7,33

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.	1,10 1,84	1,10 1,84	4,05 1,12	8,64 9,55	12,90 14,05	17,57 13,55	22,28 -0,58
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,46 -0,72	-1,46 -0,72	1,57 -1,37	-6,90 -5,99	-7,50 -6,35	-5,26 -9,28	17,45 -5,40
NTN-B 150555 (4,689998%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,05 1,79	1,05 1,79	3,90 0,96	8,33 9,23	12,63 13,78	17,40 13,38	22,20 -0,66
NTN-B 150840 (5,120004%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,09 1,82	1,09 1,82	4,01 1,07	5,72 6,63	9,88 11,03	14,45 10,43	19,06 -3,80
NTN-B 150840 (5,171997%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,09 1,83	1,09 1,83	4,02 1,09	5,73 6,64	9,90 11,05	14,49 10,47	19,12 -3,74
NTN-B 150830 (5,569998%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,12 1,86	1,12 1,86	4,12 1,19	5,75 6,66	9,94 11,08	14,56 10,54	19,23 -3,63
NTN-B 150830 (4,069994%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,00 1,74	1,00 1,74	3,75 0,81	8,00 8,91	11,80 12,95	15,55 11,53	19,30 -3,56
NTN-B 150535 (4,734998%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,06 1,79	1,06 1,79	3,91 0,98	8,35 9,26	12,46 13,61	16,83 12,81	21,23 -1,63
NTN-B 150535 (4,423526%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,03 1,77	1,03 1,77	3,83 0,90	8,19 9,09	12,21 13,36	16,40 12,39	20,62 -2,24
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,65 89,07	0,65 89,07	1,84 87,65	2,91 83,63	3,86 77,14	5,35 69,76	10,25 73,70
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,75 -0,01	-0,75 -0,01	2,88 -0,05	-1,01 -0,10	-1,36 -0,21	3,50 -0,52	21,90 -0,96
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,76 -0,02	-0,76 -0,02	2,87 -0,07	-1,06 -0,15	-1,42 -0,27	3,39 -0,62	21,71 -1,15
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,09 -0,02	0,09 -0,02	3,35 -0,08	3,20 -0,12	4,32 -0,25	11,89 -0,59	25,04 -1,00
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,10 -0,01	0,10 -0,01	3,38 -0,05	3,23 -0,09	4,37 -0,20	12,02 -0,45	25,24 -0,79
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,61 -0,01	0,61 -0,01	2,25 -0,06	2,43 -0,11	3,24 -0,29	6,41 -0,67	13,14 -1,02
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,13 -0,05	-0,13 -0,05	3,58 -0,05	-0,22 -0,19	-1,62 -0,34	2,96 -0,62	14,51 -0,94
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,77	-0,77	2,85	-1,09	-1,42	3,46	21,90

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.	-0,03	-0,03	-0,08	-0,18	-0,27	-0,56	-0,96
<b>BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB</b>	<b>-0,76</b>	<b>-0,76</b>	<b>2,86</b>	<b>-1,07</b>	<b>-1,50</b>	<b>3,29</b>	<b>21,60</b>
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,03	-0,08	-0,17	-0,35	-0,73	-1,26
<b>BB AÇÕES GOVERNANÇA FI</b>	<b>6,70</b>	<b>6,70</b>	<b>8,41</b>	<b>-9,80</b>	<b>-2,87</b>	<b>-2,40</b>	<b>17,07</b>
Var. IGCT p.p.	-0,14	-0,14	-0,22	-0,39	-0,77	-1,77	-3,15
<b>BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS</b>	<b>3,96</b>	<b>3,96</b>	<b>4,59</b>	<b>-14,52</b>	<b>-3,69</b>	<b>-9,51</b>	<b>22,86</b>
Var. SMALL CAP p.p.	0,55	0,55	-0,30	2,91	6,56	4,78	-1,63
<b>FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I</b>	<b>-9,75</b>	<b>-9,75</b>	<b>-9,03</b>	<b>3,11</b>	<b>11,35</b>	<b>71,14</b>	<b>143,50</b>
Var. Global BDRX p.p.	0,09	0,09	-0,12	-0,27	-2,22	-3,19	-6,48
<b>CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP</b>	<b>-5,30</b>	<b>-5,30</b>	<b>-0,53</b>	<b>5,52</b>	<b>25,85</b>	<b>39,39</b>	<b>71,27</b>
Var. S&P 500 p.p.	3,74	3,74	6,39	-1,95	6,91	-36,27	-73,70
<b>PORTO FELIZ</b>	<b>-0,39</b>	<b>-0,39</b>	<b>2,55</b>	<b>-1,42</b>	<b>-0,24</b>	<b>5,18</b>	<b>21,57</b>
Var. IPCA + 5,42% p.p.	-1,37	-1,37	-1,07	-9,89	-16,60	-23,00	-19,25
CDI	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90
IBOVESPA	6,98	6,98	8,35	-7,93	-2,54	-1,42	15,14
INPC + 6,00%	1,16	1,16	3,78	8,75	17,24	31,05	44,93
IPCA + 6,00%	1,03	1,03	3,76	8,77	17,00	29,59	43,15

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		1,00
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IRF-M	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,18
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		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	0,63	0,63	2,31	2,54	3,53	7,08	14,16	22,11	34,75
IRF-M 1+	-0,50	-0,50	4,01	-1,41	-4,13	1,40	15,16	29,50	49,44
IRF-M TOTAL	-0,08	-0,08	3,63	-0,03	-1,28	3,58	15,45	27,96	45,98
IMA-B 5	0,11	0,11	3,42	3,32	4,57	12,47	26,04	38,75	56,48
IMA-B 5+	-1,61	-1,61	2,45	-4,92	-6,47	-3,03	18,62	39,06	60,95
IMA-B TOTAL	-0,73	-0,73	2,94	-0,91	-1,15	4,02	22,86	40,20	60,52
IMA-GERAL TOTAL	0,21	0,21	2,90	1,13	1,42	5,98	17,98	30,01	46,61
IDKA 2	0,05	0,05	3,41	3,29	4,87	13,47	25,98	38,94	57,36
IDKA 20	-2,92	-2,92	0,64	-12,61	-14,59	-13,99	10,19	35,73	59,77
CDI	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90	21,17	32,56

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,98	6,98	8,35	-7,93	-2,54	-1,42	15,14	32,07	73,41
IBRX 100	6,87	6,87	8,36	-9,14	-2,11	-0,51	18,37	36,58	79,96
IBRX 50	7,65	7,65	9,69	-8,20	-0,93	1,71	16,71	32,14	74,76
SMALL CAP	3,42	3,42	4,89	-17,43	-10,25	-14,29	24,49	41,16	97,42
IFIX	-0,99	-0,99	3,78	-1,67	-3,56	-9,76	15,24	21,52	43,53
Índice Consumo - ICON			-5,43	-22,83	-23,46	-26,51	5,30	5,50	37,84
Índice Dividendos - IDIV	7,47	7,47	10,17	0,27	5,96	1,18	28,50	52,53	93,40

**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	0,54	0,54	2,24	5,63	10,38	15,41	20,25	24,79	28,35
INPC	0,67	0,67	2,26	5,61	10,60	16,72	21,74	26,09	28,45
IGPM	1,82	1,82	2,72	3,40	16,91	46,97	58,45	69,12	68,43
SELIC	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90	21,18	32,59

**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	-9,05	-9,05	-6,91	7,47	18,94	75,67	144,98	170,90	239,48
MSCI ACWI	-8,76	-8,76	-8,61	3,62	9,17	61,14	114,25	124,36	183,76
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%	0,87	0,87	3,26	7,73	14,79	24,77	35,22	45,90	55,99
IPCA + 5,00%	0,95	0,95	3,51	8,26	15,90	27,17	39,15	51,57	63,59
IPCA + 5,50%	0,99	0,99	3,64	8,51	16,45	28,37	41,14	54,46	67,50
IPCA + 5,89%	1,02	1,02	3,73	8,72	16,88	29,32	42,71	56,75	70,61
IPCA + 6,00%	1,03	1,03	3,76	8,77	17,00	29,59	43,15	57,40	71,49
INPC + 4,00%	1,00	1,00	3,28	7,71	15,02	26,18	36,90	47,41	56,11
INPC + 6,00%	1,16	1,16	3,78	8,75	17,24	31,05	44,93	59,03	71,61

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
95	07/01/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	53.447,47	0,00	24.442,42030100	2,1866684780
94	10/01/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.390.968,97	0,00	635.909,31044000	2,1873700340
82	10/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	12.000,00	4.285,92745400	2,7998607370
93	11/01/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.390,95	635,70983300	2,1880265600
92	13/01/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.518.775,60	693.698,21632100	2,1893895130
96	13/01/2022	NTN-B 150830 (5,569998%)	1.517.384,66	0,00	380,00000000	3.993,1175230000
91	14/01/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.390,95	635,11841600	2,1900640330
90	20/01/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	71.770,71	0,00	32.730,21421100	2,1927968310
89	21/01/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	356,00	162,29994500	2,1934696220
88	24/01/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.526,91	0,00	695,90023800	2,1941507050
87	26/01/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.829.662,54	833.354,51719700	2,1955392360
83	26/01/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	59.000,00	20.966,45294100	2,8140191460
86	27/01/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	270.988,95	0,00	123.389,13064900	2,1962141120
85	28/01/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	8.369,88	0,00	3.809,88674400	2,1968842020
84	31/01/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	121.976,24	0,00	55.505,48721000	2,1975528210
<b>Total</b>						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 9.120.993,29

Value-At-Risk: 3,31%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PORTO FELIZ		3,31	3,31			275.849.302,17	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,29%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545		3,98	0,06	1,92			8.962.053,38	3,25
NTN-B 150535 (4,423526%)		0,16	0,00	2,14			2.622.946,62	0,95
NTN-B 150535 (4,734998%)		0,16	0,00	2,14			10.306.204,42	3,74
NTN-B 150535 (5,290003%)		0,16	0,00	2,14			10.165.816,81	3,69
NTN-B 150555 (4,689998%)		0,16	0,00	2,14			2.628.896,33	0,95
NTN-B 150830 (4,069994%)		0,16	0,00	2,14			5.296.516,37	1,92
NTN-B 150830 (5,569998%)		0,16	0,00	2,14			1.526.249,29	0,55
NTN-B 150840 (5,120004%)		0,16	0,00	2,14			10.160.391,28	3,68
NTN-B 150840 (5,171997%)		0,16	0,00	2,14			10.320.636,88	3,74
<b>Sub-total</b>	1,02	0,61	0,06		-0,04	0,69	61.989.711,38	22,47

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M		1,78	0,00	0,02			217.250,31	0,08
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI		1,07	0,02	0,00			14.311.463,35	5,19
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI		2,15	0,04	0,01			11.717.028,00	4,25
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,63	0,00	0,03			4.350.628,27	1,58
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,14	0,15	0,03			39.776.517,63	14,42
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		2,15	0,02	0,01			4.894.151,00	1,77
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,15	0,06	0,01			15.931.699,03	5,78

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,06	0,03	0,01			20.495.178,62	7,43
<b>Sub-total</b>	3,31	1,70	0,33		-0,35	-0,44	111.693.916,21	40,49

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC		0,04	0,00	0,00			1.239.468,72	0,45
<b>Sub-total</b>	0,01	0,04	0,00		-10,37	0,65	1.239.468,72	0,45

Renda Variável

Value-At-Risk: 13,09%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		15,27	1,47	4,09			30.018.980,95	10,88
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		11,27	0,88	0,10			25.080.802,79	9,09
<b>Sub-total</b>	24,24	13,09	2,35		0,18	5,19	55.099.783,74	19,97

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 8,33%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		8,33	0,46	5,87			23.536.636,92	8,53
<b>Sub-total</b>	18,08	8,33	0,46		-0,33	-5,30	23.536.636,92	8,53

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,01%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		9,01	0,11	0,89			22.289.785,20	8,08
<b>Sub-total</b>	22,05	9,01	0,11		-0,48	-9,75	22.289.785,20	8,08