



LDB
EMPRESAS

PORTO FELIZ
MAIO 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 31.05.2022.

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

66,32%

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	9,52	1,30	3,21	9.125.178,95	3,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,423526%)	0,55	1,34	6,84	2.704.322,24	0,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,734998%)	0,55	1,37	6,94	10.626.271,11	3,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290003%)	0,52	1,41	7,26	10.494.321,51	3,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,877000%)	2,91	1,46	4,24	5.062.388,41	1,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (4,689998%)	0,52	1,36	7,01	2.717.908,39	0,97
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,669994%)	2,81	1,45	5,44	10.259.606,19	3,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,900000%)	2,90	1,47	4,25	5.063.679,38	1,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,069994%)	0,52	1,31	6,75	5.455.994,97	1,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,569998%)	2,88	1,44	6,81	1.575.431,44	0,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,120004%)	2,69	1,40	7,19	10.492.990,88	3,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,171997%)	2,71	1,40	7,21	10.658.567,10	3,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,481000%)	3,93	1,43	2,82	5.140.486,76	1,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,792100%)	4,06	0,88	0,88	20.164.355,65	7,19
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		3,94	1,40	6,57	109.541.502,98	39,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	3,58	0,58	1,77	221.368,69	0,08	3.694.753.029,30	0,01
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,64	0,77	6,17	15.179.999,49	5,41	1.706.174.541,94	0,89
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,45	0,07	3,73	0,00	0,00	236.426.228,07	0,00
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,74	0,92	3,90	1.323.695,53	0,47	5.107.140.425,93	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,48	0,96	4,58	12.728.067,03	4,54	6.293.749.685,70	0,20
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,46	-0,08	3,55	0,00	0,00	562.238.421,06	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,47	0,97	4,65	13.974.060,36	4,98	4.185.112.705,47	0,33
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,64	0,76	6,16	21.737.464,35	7,75	12.390.634.636,61	0,18
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,32	0,51	5,48	3.076.315,68	1,10	2.293.984.372,74	0,13
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,44	0,75	4,94	68.240.971,13	24,34		

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	0,18	0,95	3,90	8.153.378,67	2,91	3.180.026.553,36	0,26
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,18	0,95	3,90	8.153.378,67	2,91		
Renda Fixa			3,92	1,13	5,58	185.935.852,78	66,32		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

19,45%

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	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	23,43	1,54	2,82	29.689.376,50	10,59	1.136.895.114,73	2,61
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	19,75	2,93	5,66	24.836.556,38	8,86	974.253.508,27	2,55
Sub-total Artigo 8º I			20,98	2,17	4,09	54.525.932,88	19,45		
Renda Variável			18,72	2,17	4,09	54.525.932,88	19,45		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,31%

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	20,04	-4,44	-28,42	17.677.556,90	6,31	2.266.073.116,40	0,78
Sub-total Artigo 9º III			20,04	-4,44	-28,42	17.677.556,90	6,31		
Investimentos no Exterior			20,04	-4,44	-28,42	17.677.556,90	6,31		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,92%

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	18,35	0,97	-10,62	22.215.722,06	7,92	2.423.271.241,40	0,92
Sub-total Artigo 10º I			18,35	0,97	-10,62	22.215.722,06	7,92		
Investimentos Estruturados			24,19	0,97	-10,62	22.215.722,06	7,92		
Total			6,49	0,93	0,81	280.355.064,62	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	109.541.502,98	39,07	0,00	37,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	68.240.971,13	24,34	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	8.153.378,67	2,91	0,00	3,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	185.935.852,78	66,32					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	54.525.932,88	19,45	0,00	20,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	54.525.932,88	19,45					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	17.677.556,90	6,31	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	17.677.556,90	6,31					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	22.215.722,06	7,92	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	22.215.722,06	7,92					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	1,40 135,56	6,57 151,17	4,85 172,49	7,41 144,21	9,16 116,05	1.420.105,46	5.247.007,54
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,75 72,84	4,94 113,72	4,66 165,64	5,40 105,11	5,36 67,89	583.344,57	4.439.943,00
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,95 92,35	3,90 89,81	2,53 90,00			59.601,35	146.100,05
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	2,17 -1,05	4,09 -2,13	-0,63 0,96			1.157.683,91	2.144.262,41
Artigo 9º III % do CDI	-4,44 -430,35	-28,42 -654,28	-14,62 -519,25	-27,20 -529,17	-14,82 -187,70	-820.769,11	-7.019.181,51
Artigo 10º I % do CDI	0,97 94,41	-10,62 -244,42	-3,59 -127,65			214.154,94	-2.638.922,26
PORTO FELIZ (Total)						2.614.121,12	2.319.209,23

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%)	2.736.995,94	0,00	0,00	69.068,89	2.704.322,24	36.395,19	177.237,32
NTN-B 150535 (4,734998%)	10.759.607,94	0,00	0,00	279.197,26	10.626.271,11	145.860,43	707.070,20
NTN-B 150535 (5,290003%)	10.634.867,31	0,00	0,00	289.481,63	10.494.321,51	148.935,83	728.752,33
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.135.043,44	0,00	0,00	147.019,74	5.062.388,41	74.364,71	211.334,88
NTN-B 150545	9.266.147,25	0,00	0,00	261.667,08	9.125.178,95	120.698,78	292.159,91
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.746.452,34	0,00	0,00	65.679,72	2.717.908,39	37.135,77	182.099,07
NTN-B 150555 (5,669994%)	10.397.894,79	0,00	0,00	287.144,27	10.259.606,19	148.855,67	543.070,61
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.135.635,53	0,00	0,00	146.435,40	5.063.679,38	74.479,25	211.596,01
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.385.372,15	0,00	0,00	0,00	5.455.994,97	70.622,82	347.070,26
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.553.095,86	0,00	0,00	0,00	1.575.431,44	22.335,58	100.857,76
NTN-B 150840 (5,120004%)	10.348.086,59	0,00	0,00	0,00	10.492.990,88	144.904,29	708.169,68
NTN-B 150840 (5,171997%)	10.510.924,29	0,00	0,00	0,00	10.658.567,10	147.642,81	721.387,35

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.067.982,44	0,00	0,00	0,00	5.140.486,76	72.504,32	140.832,15
NTN-B 150840 (5,792100%)	0,00	19.988.985,64	0,00	0,00	20.164.355,65	175.370,01	175.370,01
					109.541.502,98	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12.607.105,99	0,00	0,00	0,00	12.728.067,03	120.961,04	643.746,97
BB PREV RF IPCA	3.148.448,78	0,00	-88.628,81	0,00	3.076.315,68	16.495,71	164.944,49
BB PREV RF IRF M	220.101,29	0,00	0,00	0,00	221.368,69	1.267,40	3.841,51
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	4.278.403,24	89.000,00	-3.067.700,00	0,00	1.323.695,53	23.992,29	148.066,83
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5.110.949,38	0,00	-5.106.884,68	0,00	0,00	-4.064,70	175.174,94
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.572.512,02	0,00	0,00	0,00	21.737.464,35	164.952,33	1.260.792,08
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.638.536,97	0,00	-2.800.000,00	0,00	13.974.060,36	135.523,39	720.816,25
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12.236.342,31	0,00	-12.245.070,03	0,00	0,00	8.727,72	439.980,20
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	15.064.510,10	0,00	0,00	0,00	15.179.999,49	115.489,39	882.579,73
					68.240.971,13	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	2.991.857,06	7.388.468,76	-2.286.548,50	0,00	8.153.378,67	59.601,35	146.100,05
					8.153.378,67	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	24.130.241,68	0,00	0,00	0,00	24.836.556,38	706.314,70	1.329.811,70
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	29.238.007,29	0,00	0,00	0,00	29.689.376,50	451.369,21	814.450,71
					54.525.932,88	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18.498.326,01	0,00	0,00	0,00	17.677.556,90	-820.769,11	-7.019.181,51
					17.677.556,90	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	22.001.567,12	0,00	0,00	0,00	22.215.722,06	214.154,94	-2.638.922,26
					22.215.722,06	0,00	0,00

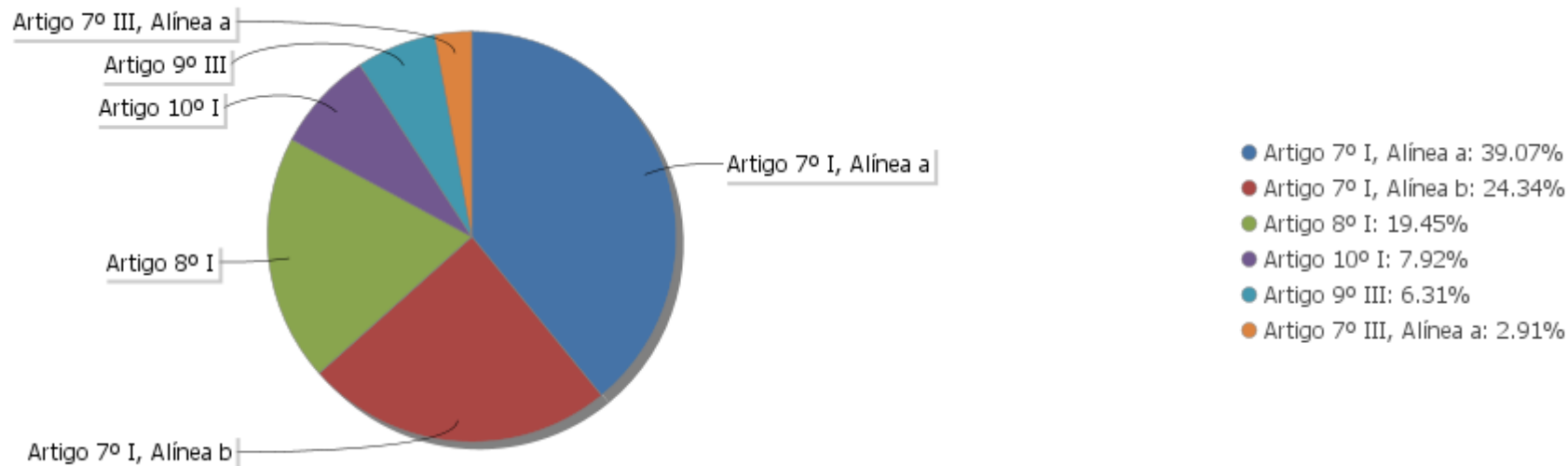
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

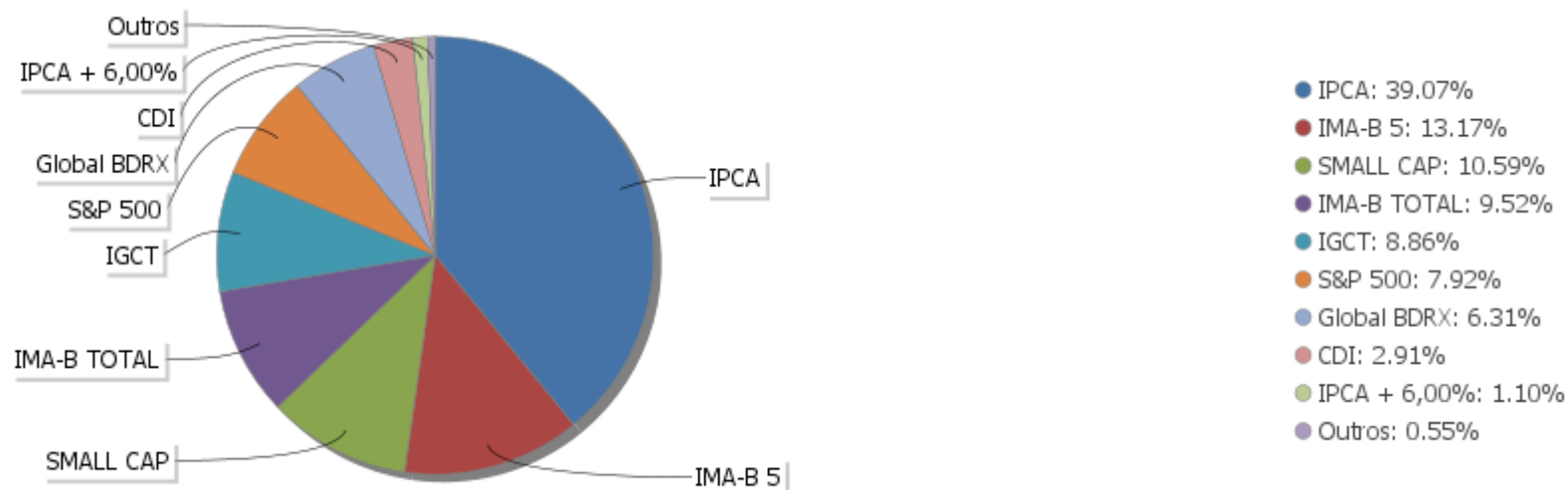
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	167.737.245,96	59,83	167.737.245,96	59,83
de 31 a 365 dias	3.076.315,68	1,10	170.813.561,64	60,93
acima de 365 dias	109.541.502,98	39,07	280.355.064,62	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

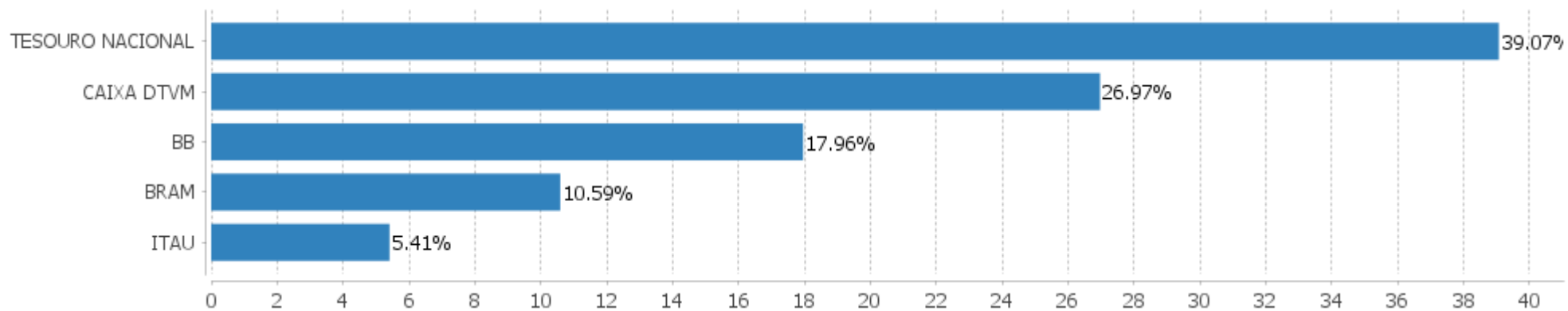


Alocação Por Estratégia



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	-0,32	3,04	-2,37	0,93								0,81
IPCA + 4,88%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89								6,85
p.p. indexador	-1,33	-1,70	1,00	-3,79	0,04								-6,03
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

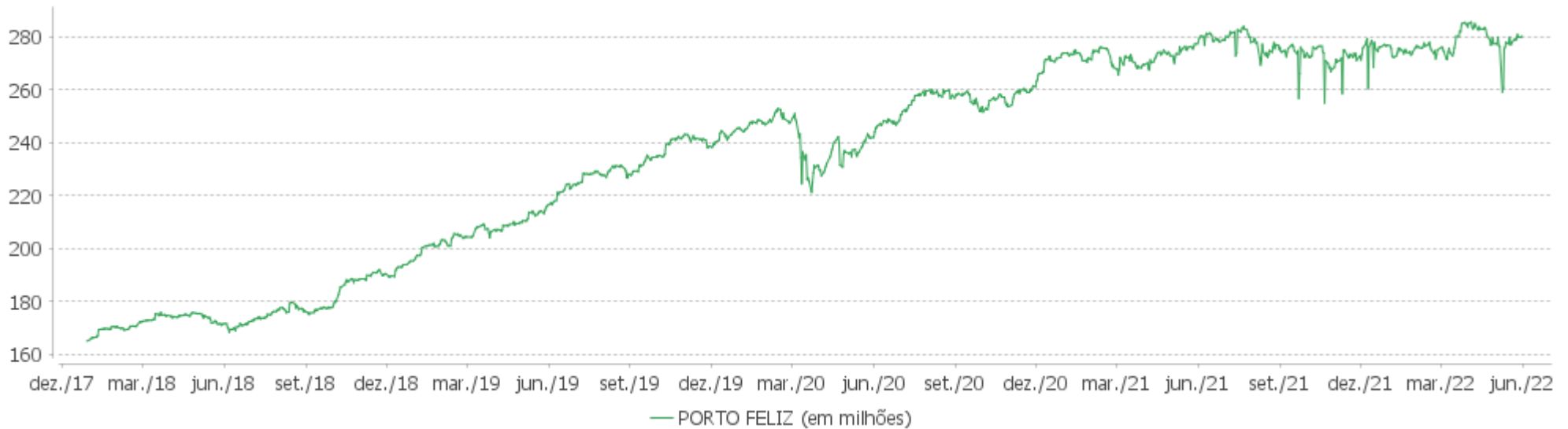
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	25	47,17	03 meses	1,53	4,42	-2,88	7,94
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	52,83	06 meses	2,47	8,15	-5,68	6,94
			12 meses	-0,39	17,54	-17,93	6,49
			24 meses	10,58	34,20	-23,63	6,10
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10	36 meses	16,90	44,82	-27,92	8,38
Menor rentabilidade da Carteira	-7,15	2020-03	48 meses	39,45	60,62	-21,17	7,62
			Desde 29/12/2017	41,76	66,68	-24,91	7,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

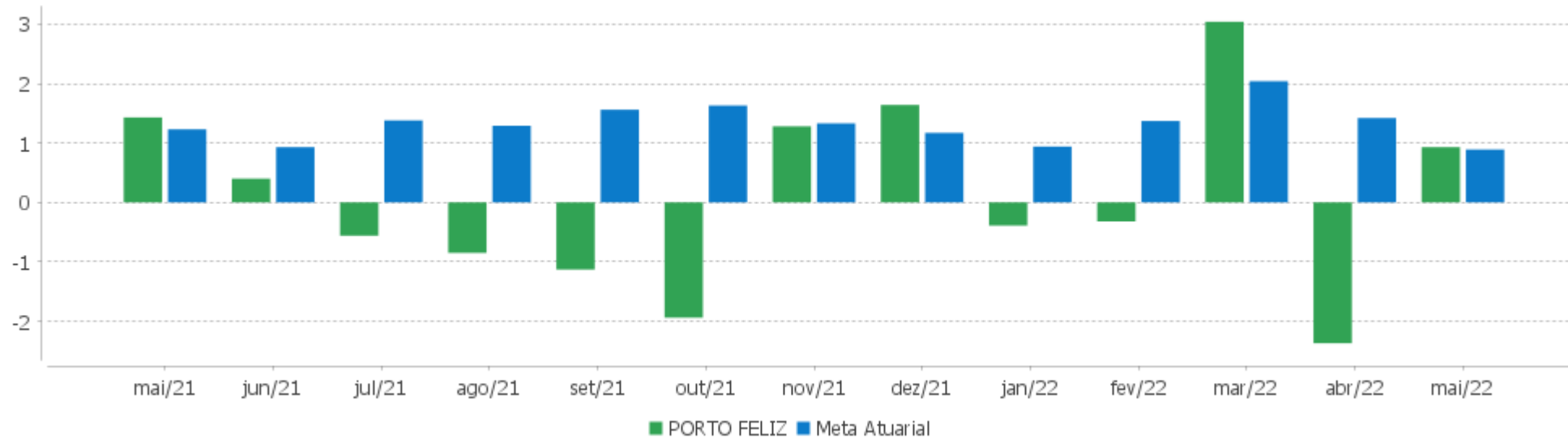


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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. IPCA p.p.	1,30 0,83	3,21 -1,58	4,55 1,37	1,75 -3,80	-2,41 -14,14	9,89 -10,84	13,00 -10,00
NTN-B 150840 (5,120004%) Var. IPCA p.p.	1,40 0,93	7,19 2,41	4,91 1,73	8,50 2,95	14,73 3,00	22,84 2,11	25,01 2,01
NTN-B 150830 (4,069994%) Var. IPCA p.p.	1,31 0,84	6,75 1,97	4,65 1,47	7,96 2,41	16,63 4,89	23,87 3,14	25,09 2,09
NTN-B 150535 (5,290003%) Var. IPCA p.p.	1,41 0,94	7,26 2,48	4,95 1,77	8,59 3,04	17,99 6,26	26,30 5,57	28,50 5,50
NTN-B 150535 (5,877000%) Var. IPCA p.p.	1,46 0,99	7,51 2,72	5,10 1,92	8,89 3,34	15,29 3,55	23,72 2,98	26,17 3,17
NTN-B 150840 (5,792100%) Var. IPCA p.p.	1,46 0,99	4,46 -0,33	5,08 1,90	5,79 0,24	12,00 0,27	20,18 -0,55	22,55 -0,45
NTN-B 150555 (4,689998%) Var. IPCA p.p.	1,36 0,89	7,01 2,23	4,80 1,62	8,28 2,73	17,32 5,59	25,70 4,97	28,00 5,00
NTN-B 150840 (5,481000%) Var. IPCA p.p.	1,43 0,96	4,43 -0,35	5,00 1,82	5,74 0,19	11,89 0,15	19,94 -0,80	22,19 -0,81
NTN-B 150840 (5,171997%) Var. IPCA p.p.	1,40 0,93	7,21 2,43	4,92 1,74	8,53 2,98	14,77 3,04	22,91 2,17	25,09 2,09
NTN-B 150555 (5,669994%) Var. IPCA p.p.	1,45 0,98	7,42 2,64	5,05 1,87	8,78 3,23	15,18 3,45	23,61 2,88	26,08 3,08
NTN-B 150830 (5,569998%) Var. IPCA p.p.	1,44 0,97	7,38 2,59	5,02 1,84	8,73 3,18	15,01 3,28	23,19 2,46	25,42 2,42
NTN-B 150555 (5,900000%) Var. IPCA p.p.	1,47 1,00	7,52 2,73	5,10 1,92	8,90 3,35	15,32 3,59	23,81 3,08	26,31 3,32
NTN-B 150535 (4,734998%) Var. IPCA p.p.	1,37 0,90	6,94 2,16	4,73 1,55	8,21 2,66	17,28 5,54	25,22 4,49	27,10 4,10
NTN-B 150535 (4,423526%) Var. IPCA p.p.	1,34 0,87	6,84 2,05	4,67 1,49	8,08 2,53	16,95 5,22	24,70 3,97	26,39 3,39
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,97 0,00	4,65 -0,08	4,89 -0,04	4,87 -0,10	4,33 -0,26	13,64 -0,54	20,72 -1,09
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,94 -0,02	4,63 -0,09	4,86 -0,07	4,85 -0,12	4,37 -0,23	13,58 -0,60	20,91 -0,90
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,76	6,16	4,96	6,97	9,31	17,06	27,78

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 5 p.p.	-0,02	-0,10	-0,06	-0,12	-0,24	-0,59	-1,00
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,77 -0,02	6,17 -0,08	4,97 -0,05	6,99 -0,10	9,35 -0,21	17,11 -0,54	28,01 -0,76
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,51 -0,47	6,78 -0,54	5,23 0,53	7,37 -1,30	9,67 -8,76	17,81 -17,82	31,37 -15,05
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,92 -0,03	3,90 -0,12	2,51 -0,10	4,78 -0,16	6,14 -0,29	7,98 -0,69	14,50 -1,04
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,58 -0,01	1,77 -0,05	1,32 0,01	3,68 -0,06	1,34 -0,26	1,85 -0,47	13,05 -0,85
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,96 -0,01	4,58 -0,14	4,83 -0,10	4,80 -0,17	4,24 -0,35	13,52 -0,66	20,88 -0,93
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,90 -0,07	4,57 -0,16	4,83 -0,10	4,78 -0,19	4,22 -0,37	13,39 -0,79	20,55 -1,26
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,95 92,35	3,90 89,81	2,53 90,00	4,60 89,42	6,73 85,24	7,86 76,73	11,92 76,28
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	2,93 -0,13	5,66 -0,56	-1,76 -0,25	9,29 -0,62	-13,66 -0,85	26,13 -2,76	15,98 -3,44
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	1,54 3,37	2,82 6,84	0,34 2,45	6,82 7,19	-17,62 9,25	16,89 1,53	20,01 6,60
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-4,44 -0,12	-28,42 -0,24	-14,62 -0,09	-27,20 -0,25	-14,82 -1,78	13,58 -3,06	74,74 -4,50
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	0,97 4,83	-10,62 15,92	-3,59 9,69	-5,65 18,22	4,99 16,16	42,87 24,59	57,03 -23,15
PORTO FELIZ Var. IPCA + 4,88% p.p.	0,93 0,04	0,81 -6,03	1,53 -2,88	2,47 -5,63	-0,39 -17,58	10,58 -22,20	16,90 -24,95
CDI	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63
IBOVESPA	3,22	6,23	-1,58	9,26	-11,78	27,40	14,76
INPC + 6,00%	0,96	7,49	4,75	8,85	18,61	36,88	48,04
IPCA + 6,00%	0,98	7,31	4,69	8,67	18,43	35,62	46,43

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 IPCA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
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	0,95	4,02	2,61	4,93	6,43	8,67	15,54	23,85	33,97
IRF-M 1+	0,39	0,65	0,67	2,95	-0,89	-1,17	12,32	30,13	44,56
IRF-M TOTAL	0,58	1,82	1,31	3,74	1,60	2,33	13,90	29,08	42,46
IMA-B 5	0,78	6,25	5,02	7,09	9,55	17,65	28,78	45,80	60,12
IMA-B 5+	1,16	3,17	4,84	2,82	-0,25	10,41	15,02	52,46	63,45
IMA-B TOTAL	0,96	4,73	4,93	4,96	4,59	14,18	21,81	50,71	63,86
IMA-GERAL TOTAL	0,92	4,04	3,06	4,94	5,26	9,68	18,01	34,24	46,62
IDKA 2	0,85	6,35	4,97	7,23	9,24	18,49	29,19	44,76	60,19
IDKA 20	1,21	0,35	3,98	-1,94	-10,01	4,21	1,84	54,09	61,61
CDI	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63	22,99	32,44

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,22	6,23	-1,58	9,26	-11,78	27,40	14,76	45,08	77,56
IBRX 100	3,23	6,61	-1,68	9,95	-12,43	29,27	17,73	50,94	83,12
IBRX 50	3,30	6,74	-2,55	10,76	-11,91	31,55	16,59	45,38	78,31
SMALL CAP	-1,82	-4,02	-2,10	-0,37	-26,87	15,36	13,41	44,72	71,86
IFIX	0,26	0,56	2,89	9,39	0,14	6,12	10,49	27,39	37,13
Índice Consumo - ICON	-3,02		-12,01	-12,30	-36,86	-19,27	-13,06	7,05	10,44
Índice Dividendos - IDIV	4,26	14,16	8,74	15,99	2,41	41,18	33,41	82,88	105,54

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	0,47	4,78	3,18	5,55	11,73	20,73	23,00	28,73	32,40
INPC	0,45	4,96	3,23	5,73	11,90	21,85	24,35	30,30	32,59
IGPM	0,52	7,54	3,71	8,47	10,72	51,73	61,61	73,96	81,38
SELIC	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63	23,00	32,46

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	-3,86	-26,53	-13,29	-23,87	-11,17	18,29	80,18	91,96	149,78
MSCI ACWI	-3,99	-26,71	-14,01	-24,39	-17,07	11,67	59,19	61,99	105,20

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,81	6,48	4,20	7,64	16,20	30,56	38,31	50,52	60,94
IPCA + 5,00%	0,90	6,90	4,45	8,16	17,32	33,08	42,33	56,38	68,79
IPCA + 5,50%	0,94	7,10	4,57	8,41	17,88	34,35	44,37	59,37	72,83
IPCA + 5,89%	0,97	7,26	4,67	8,61	18,31	35,34	45,97	61,73	76,03
IPCA + 6,00%	0,98	7,31	4,69	8,67	18,43	35,62	46,43	62,40	76,94
INPC + 4,00%	0,79	6,66	4,25	7,82	16,37	31,77	39,83	52,36	61,17
INPC + 6,00%	0,96	7,49	4,75	8,85	18,61	36,88	48,04	64,38	77,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
60	06/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	58.839,29	0,00	26.131,53307300	2,2516585550
61	09/05/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	2.800.000,00	742.190,36881700	3,7726170000
62	09/05/2022	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	0,00	12.245.070,03	310.308,49125124	39,4609570000
63	09/05/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	2.700,00	935,93697400	2,8848096340
64	10/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.694.947,93	0,00	752.081,36036200	2,2536762900
65	11/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	355.000,00	157.451,33469600	2,2546649140
66	11/05/2022	BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	0,00	5.106.884,68	1.337.028,54397190	3,8195779000
67	11/05/2022	NTN-B 150840 (5,792100%)	19.988.985,64	0,00	4.883,00000000	4,093,5870653287
68	11/05/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	89.000,00	0,00	30.826,19933300	2,8871544960
69	16/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	3.088.628,81	0,00	1.368.077,79567400	2,2576412100
70	16/05/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	3.000.000,00	1.037.780,67135900	2,8907842310
71	16/05/2022	BB PREV RF IPCA	0,00	88.628,81	31.957,26242100	2,7733542640
72	17/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.546.544,82	0,00	684.726,00590500	2,2586330980
73	20/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	517.062,13	0,00	228.624,33496800	2,2616233310
74	27/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.931.548,50	852.203,22703900	2,2665350690
75	27/05/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	65.000,00	22.384,16453600	2,9038385550
76	30/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	482.445,78	0,00	212.765,65568000	2,2674983820
Total			27.466.454,40	25.594.832,02		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 9.233.105,44

Value-At-Risk: 3,29%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PORTO FELIZ		3,29	3,29			280.355.064,62	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,68%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545		3,73	0,06	3,72			9.125.178,95	3,25
NTN-B 150535 (4,423526%)		0,30	0,00	0,30			2.704.322,24	0,96
NTN-B 150535 (4,734998%)		0,32	0,00	0,32			10.626.271,11	3,79
NTN-B 150535 (5,290003%)		0,26	-0,00	0,27			10.494.321,51	3,74
NTN-B 150535 (5,877000%)		0,26	-0,00	0,27			5.062.388,41	1,81
NTN-B 150555 (4,689998%)		0,26	-0,00	0,27			2.717.908,39	0,97
NTN-B 150555 (5,669994%)		0,26	-0,00	0,27			10.259.606,19	3,66
NTN-B 150555 (5,900000%)		0,26	-0,00	0,27			5.063.679,38	1,81
NTN-B 150830 (4,069994%)		0,26	-0,00	0,27			5.455.994,97	1,95
NTN-B 150830 (5,569998%)		0,26	-0,00	0,27			1.575.431,44	0,56
NTN-B 150840 (5,120004%)		0,26	-0,00	0,27			10.492.990,88	3,74
NTN-B 150840 (5,171997%)		0,26	-0,00	0,27			10.658.567,10	3,80
NTN-B 150840 (5,481000%)		0,39	-0,00	0,41			5.140.486,76	1,83
NTN-B 150840 (5,792100%)		0,40	-0,00	0,41			20.164.355,65	7,19
Sub-total	0,90	0,36	0,06		0,41	1,40	109.541.502,98	39,07

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF M		1,57	0,00	0,03			221.368,69	0,08
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI		1,09	0,02	0,00			15.179.999,49	5,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,31	0,00	0,01			1.323.695,53	0,47
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,07	0,05	0,03			12.728.067,03	4,54
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,09	0,05	0,02			13.974.060,36	4,98
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,08	0,03	0,02			21.737.464,35	7,75
BB PREV RF IPCA		0,88	0,00	0,85			3.076.315,68	1,10
Sub-total	2,95	1,39	0,16		-0,09	0,75	68.240.971,13	24,34

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC		0,03	-0,00	0,01			8.153.378,67	2,91
Sub-total	0,03	0,03	-0,00		-3,10	0,95	8.153.378,67	2,91

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,95%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		10,69	1,00	4,40			29.689.376,50	10,59
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		9,86	0,74	0,17			24.836.556,38	8,86
Sub-total	21,15	9,95	1,74		0,05	2,17	54.525.932,88	19,45

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 13,22%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		13,22	0,93	8,23			22.215.722,06	7,92
Sub-total	30,63	13,22	0,93		-0,00	0,97	22.215.722,06	7,92

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,80%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		10,80	0,41	1,87			17.677.556,90	6,31
Sub-total	24,56	10,80	0,41		-0,22	-4,44	17.677.556,90	6,31