



LDB
EMPRESAS

PORTO FELIZ
JULHO 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 30.07.2021.

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							75,40%		
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	9,35	-0,57	-2,19	9.887.216,13	3,56			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,069994%)	3,64	0,68	0,68	5.030.974,40	1,81			
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		9,27	0,10	-1,53	14.918.190,53	5,37			
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	3,00	-0,50	-2,19	1.674.597,11	0,60	6.941.606.073,67	0,02
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,57	0,01	1,19	16.975.296,59	6,11	1.542.726.443,57	1,10
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,63	-0,39	-1,23	11.835.995,00	4,26	410.571.085,67	2,88
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,37	0,16	0,82	4.210.458,08	1,51	6.744.375.720,34	0,06
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,65	-0,38	-1,20	40.213.009,06	14,47	7.757.107.360,64	0,52
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,64	-0,40	-1,31	43.658.589,64	15,71	683.982.144,63	6,38
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,64	-0,40	-1,23	50.387.765,54	18,13	5.838.267.480,63	0,86
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,57	0,01	1,17	24.870.995,38	8,95	11.707.172.620,85	0,21
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b		4,55	-0,30	-0,80	193.826.706,40	69,74			
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	0,15	0,25	0,45	804.143,25	0,29	2.238.891.886,28	0,04
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a		0,15	0,25	0,45	804.143,25	0,29			
Renda Fixa		4,73	-0,29	-0,83	209.549.040,18	75,40			

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

20,16%

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	20,31	-4,18	4,64	27.805.510,18	10,00	1.306.744.936,90	2,13
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			20,31	-4,18	4,64	27.805.510,18	10,00		

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	19,84	-3,42	9,66	15.470.471,33	5,57	2.255.908.284,71	0,69
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			19,84	-3,42	9,66	15.470.471,33	5,57		

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	14,92	2,63	15,96	12.743.441,82	4,59	2.736.511.998,28	0,47
Sub-total Artigo 8º III			14,92	2,63	15,96	12.743.441,82	4,59		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			19,05	-2,54	7,26	56.019.423,33	20,16		
--	--	--	--------------	--------------	-------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,45%

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	21,09	5,42	5,51	12.356.119,01	4,45	3.076.433.383,80	0,40
Sub-total Artigo 9º A, III			21,09	5,42	5,51	12.356.119,01	4,45		
Investimentos no Exterior			17,35	5,42	5,51	12.356.119,01	4,45		
Total			5,53	-0,56	0,25	277.924.582,52	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	14.918.190,53	5,37	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	193.826.706,40	69,74	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	804.143,25	0,29	0,00	0,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	209.549.040,18	75,40					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	27.805.510,18	10,00	0,00	10,00	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	15.470.471,33	5,57	0,00	10,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	12.743.441,82	4,59	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	56.019.423,33	20,16					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	12.356.119,01	4,45	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	12.356.119,01	4,45					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	0,10 28,48	-1,53 -93,48	2,67 284,63	0,03 1,87	2,08 85,01	-22.690,88	-194.574,51
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,30 -85,63	-0,80 -48,97	0,81 86,42	-0,12 -7,86	2,32 94,88	-595.467,31	-2.023.861,76
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,25 69,29	0,45 70,78				3.023,22	5.048,76
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,18 -0,24	4,64 2,31	1,99 -0,46	7,68 1,83	19,57 1,22	-1.214.102,87	1.117.542,41
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,42 0,52	9,66 7,32	5,53 3,09	12,67 6,82	17,74 -0,61	-613.944,50	353.980,57
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,63 6,57	15,96 12,95	5,92 3,48			289.826,75	999.727,49
Artigo 9º A, III % do CDI	5,42 1.524,22	5,51 405,90	0,22 22,96			552.752,86	356.119,01
PORTO FELIZ (Total)						-1.600.602,73	613.981,97

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 150545	9.943.844,10	0,00	0,00	0,00	9.887.216,13	-56.627,97	-228.511,60
NTN-B 150830 (4,069994%)	0,00	4.997.037,31	0,00	0,00	5.030.974,40	33.937,08	33.937,08
					14.918.190,53	0,00	0,00

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	40.367.836,11	0,00	0,00	0,00	40.213.009,06	-154.827,05	-487.794,89
BB PREV RF IRF-M	8.116.531,37	0,00	-6.412.342,07	0,00	1.674.597,11	-29.592,19	-561.417,38
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	4.162.643,45	102.185,66	-61.283,36	0,00	4.210.458,08	6.912,33	38.175,11
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	43.836.046,84	0,00	0,00	0,00	43.658.589,64	-177.457,20	-578.946,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	29.866.464,27	0,00	-5.000.000,00	0,00	24.870.995,38	4.531,11	345.386,98
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	50.589.435,79	0,00	0,00	0,00	50.387.765,54	-201.670,25	-627.756,19
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	11.882.333,99	0,00	0,00	0,00	11.835.995,00	-46.338,99	-147.557,27
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	20.972.321,66	0,00	-4.000.000,00	0,00	16.975.296,59	2.974,93	246.123,13
					193.826.706,40	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	420.646,35	7.058.159,34	-6.677.685,66	0,00	804.143,25	3.023,22	5.048,76
					804.143,25	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	29.019.613,05	0,00	0,00	0,00	27.805.510,18	-1.214.102,87	1.117.542,41
					27.805.510,18	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	9.514.415,83	6.570.000,00	0,00	0,00	15.470.471,33	-613.944,50	353.980,57
					15.470.471,33	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	10.453.615,07	2.000.000,00	0,00	0,00	12.743.441,82	289.826,75	999.727,49
					12.743.441,82	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

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	9.803.366,15	2.000.000,00	0,00	0,00	12.356.119,01	552.752,86	356.119,01
					12.356.119,01	0,00	0,00

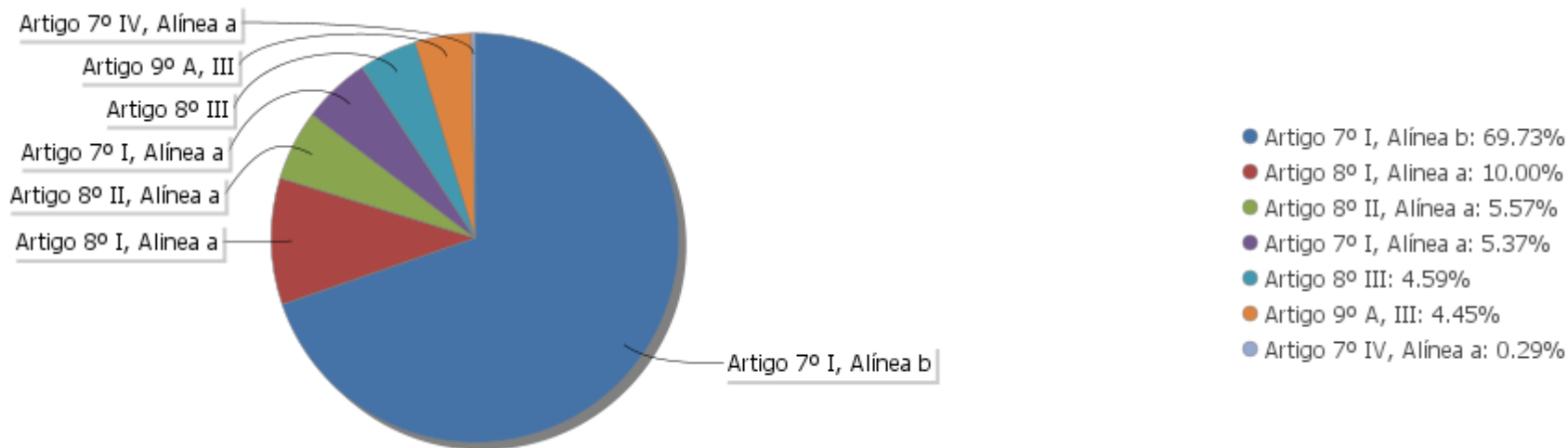
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

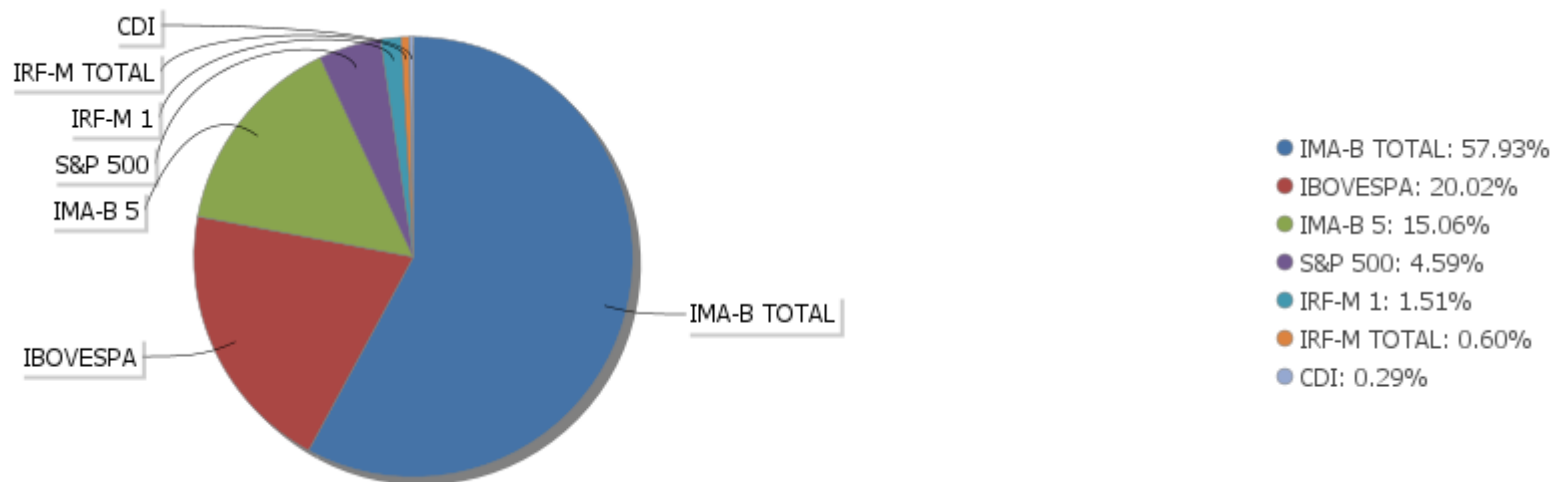
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	263.006.391,99	94,63	263.006.391,99	94,63
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	263.006.391,99	94,63
acima de 365 dias	14.918.190,53	5,37	277.924.582,52	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

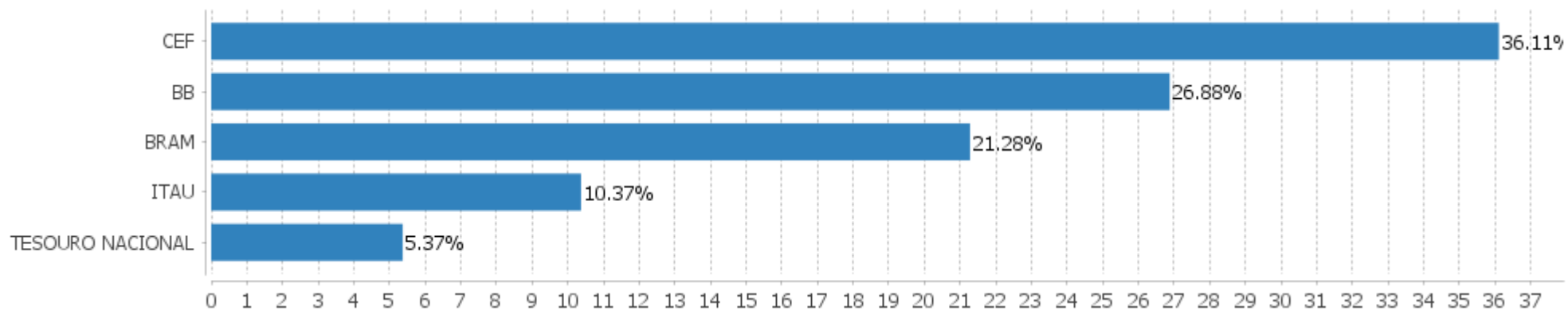


Alocação Por Estratégia



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						0,25
IPCA + 5,87%	0,70	1,27	1,46	0,77	1,31	1,01	1,46						8,26
p.p. indexador	-1,64	-2,70	-1,13	0,29	0,12	-0,60	-2,03						-8,01
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

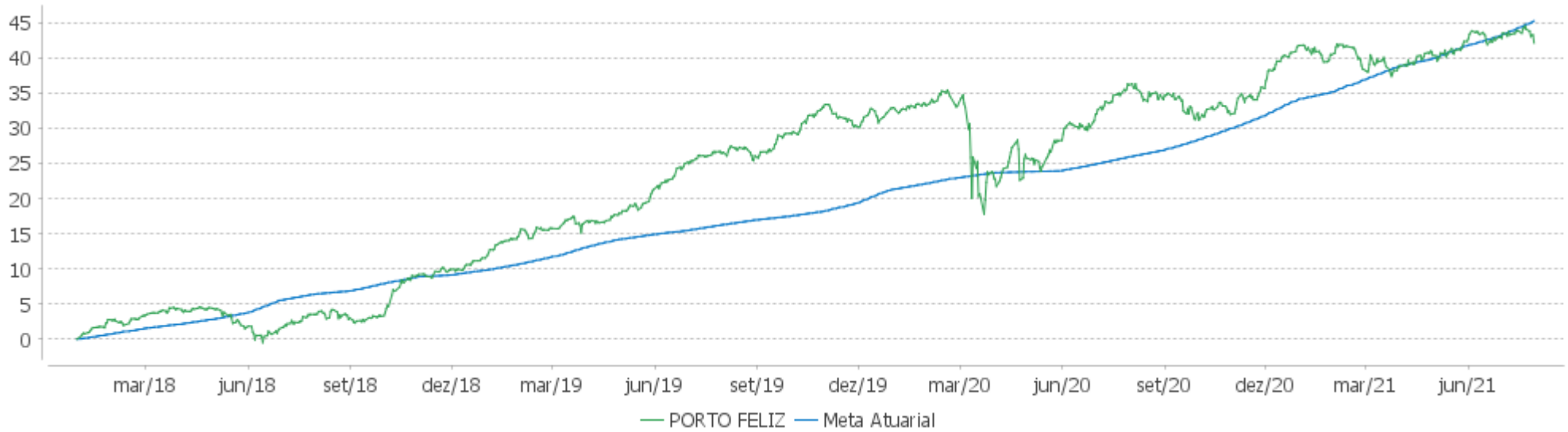
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

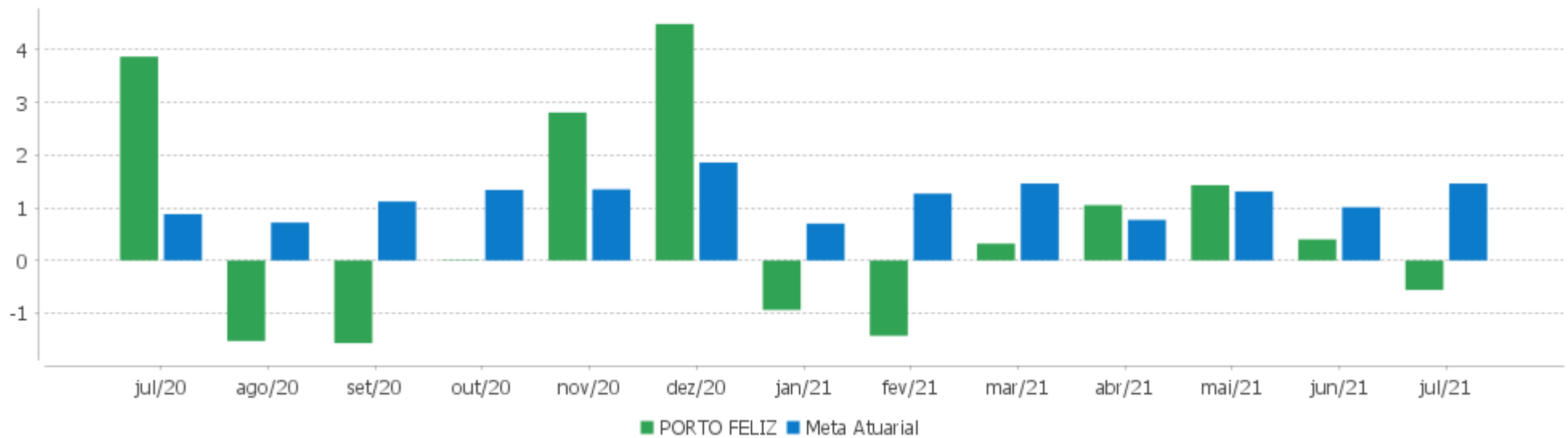
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	22	51,16	03 meses	1,27	3,83	-2,56	4,72
Meses abaixo - Meta Atuarial	21	48,84	06 meses	1,20	7,50	-6,30	5,15
			12 meses	4,38	15,34	-10,96	5,53
			24 meses	12,39	25,02	-12,63	9,22
			36 meses	37,30	36,73	0,58	7,93
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10	Desde 29/12/2017	42,09	45,58	-3,49	7,44
Menor rentabilidade da Carteira	-7,15	2020-03					

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.	-0,57 -0,20	-2,19 -1,10	1,98 0,87	-0,64 -0,40	1,39 -1,14	7,73 -3,16	50,85 9,50
NTN-B 150830 (4,069994%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,06 1,43	4,73 5,83	3,05 1,94	3,51 3,76	7,44 4,91	8,72 -2,17	11,21 -30,14
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,25 69,29	1,01 61,41	0,66 70,87	0,93 62,34	1,30 53,31	4,47 66,09	9,91 73,24
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,40 -0,03	-1,23 -0,14	1,04 -0,06	-0,36 -0,12	2,28 -0,24	10,19 -0,70	40,21 -1,14
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,39 -0,02	-1,23 -0,14	1,04 -0,06	-0,36 -0,11	2,24 -0,28	10,32 -0,57	39,96 -1,39
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,01 -0,01	1,17 -0,15	0,53 -0,05	1,08 -0,12	4,77 -0,29	13,71 -0,62	29,50 -0,93
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,01 -0,02	1,19 -0,13	0,53 -0,06	1,10 -0,10	4,80 -0,26	13,87 -0,46	29,46 -0,97
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,16 -0,02	0,82 -0,18	0,52 -0,08	0,79 -0,17	1,58 -0,40	6,89 -0,72	14,43 -1,01
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,38 -0,01	-1,20 -0,11	1,05 -0,06	-0,34 -0,09	2,27 -0,25	10,39 -0,50	40,32 -1,03
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,50 -0,02	-2,19 -0,15	-0,17 -0,11	-1,40 -0,15	-1,69 -0,29	7,71 -0,56	23,91 -0,91
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,40 -0,03	-1,31 -0,22	1,02 -0,09	-0,43 -0,18	2,17 -0,35	10,13 -0,76	39,87 -1,48
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p.	-3,42 0,52	9,66 7,32	5,53 3,09	12,67 6,82	17,74 -0,61	28,85 9,22	86,25 32,50
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	-4,18 -0,24	4,64 2,31	1,99 -0,46	7,68 1,83	19,57 1,22	23,75 4,12	62,47 8,72
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	2,63 -2,09	19,20 3,88	5,92 6,29	19,27 8,59	34,66 2,40	45,15 -55,47	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	5,42 9,36	14,23 11,89	0,22 -2,23	7,98 2,13	30,62 12,27	103,08 83,45	121,20 67,45
PORTO FELIZ Var. IPCA + 5,87% p.p.	-0,56 -2,03	0,25 -8,01	1,27 -2,56	1,20 -6,30	4,38 -10,96	12,39 -12,56	37,30 0,81
CDI	0,36	1,64	0,94	1,49	2,44	6,76	13,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	-3,94	2,34	2,44	5,85	18,35	19,63	53,75
INPC + 6,00%	1,54	8,59	4,13	7,80	16,39	26,73	38,51
IPCA + 6,00%	1,47	8,33	3,86	7,56	15,48	25,26	36,99

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	0,19	1,00	0,60	0,96	1,99	7,60	15,44	23,97	40,68
IRF-M 1+	-0,83	-4,11	-0,42	-2,76	-3,34	8,28	28,38	38,97	66,27
IRF-M TOTAL	-0,47	-2,04	-0,06	-1,25	-1,40	8,27	24,82	34,87	59,02
IMA-B 5	0,03	1,31	0,59	1,21	5,06	14,34	30,43	41,23	60,61
IMA-B 5+	-0,76	-3,29	1,44	-1,63	0,34	8,18	49,88	56,72	81,63
IMA-B TOTAL	-0,37	-1,09	1,10	-0,24	2,53	10,89	41,35	50,46	72,98
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,10	-0,44	0,72	-0,00	0,96	8,10	24,45	33,52	54,06
IMA-GERAL TOTAL	-0,10	0,04	0,87	0,28	1,67	9,12	25,92	35,34	55,62
IDKA 2	-0,18	1,68	0,38	1,54	5,88	15,07	29,57	41,20	61,95
IDKA 20	-1,44	-5,02	1,98	-2,27	-1,21	3,68	67,33	69,21	99,56
CDI	0,36	1,64	0,94	1,49	2,44	6,76	13,53	21,57	36,78

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,94	2,34	2,44	5,85	18,35	19,63	53,75	84,77	112,54
IBRX 100	-3,99	4,47	2,33	7,73	20,73	23,34	61,40	92,00	121,47
IBRX 50	-3,85	4,91	2,77	7,91	22,23	22,51	54,85	86,08	113,55
SMALL CAP	-5,80	4,96	1,45	8,69	20,13	29,57	86,53	106,58	160,32
IFIX	2,51	-1,60	-1,29	-1,92	3,33	6,19	31,08	36,68	62,68
Índice Consumo - ICON	-5,22	-2,08	1,59	-0,81	2,95	15,45	58,99	62,68	71,63
Índice Dividendos - IDIV	-1,72	0,31	1,58	5,67	14,21	18,21	67,31	86,37	136,91

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	0,96	4,76	2,34	4,50	8,99	11,51	15,10	20,26	23,52
INPC	1,02	5,01	2,60	4,73	9,85	12,81	16,38	20,58	23,08
IGPM	0,78	15,98	5,54	13,06	33,83	46,23	55,58	68,40	65,60
SELIC	0,36	1,64	0,94	1,49	2,44	6,76	13,54	21,59	36,81

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	4,72	15,33	-0,37	10,68	32,26	100,62	112,87	191,07	219,74
MSCI ACWI	2,99	10,44	-2,20	5,36	29,16	87,89	90,03	148,07	175,22
MSCI World	4,15	12,45	-1,01	7,85	31,07	90,86	94,44	156,03	181,87

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,31	7,15	3,36	6,55	13,32	20,59	29,41	40,58	50,15
IPCA + 5,00%	1,39	7,74	3,61	7,06	14,40	22,91	33,17	46,04	57,47
IPCA + 5,50%	1,43	8,04	3,74	7,31	14,94	24,08	35,07	48,83	61,23
IPCA + 5,89%	1,47	8,27	3,84	7,51	15,36	25,00	36,57	51,03	64,22
IPCA + 6,00%	1,47	8,33	3,86	7,56	15,48	25,26	36,99	51,65	65,07
INPC + 4,00%	1,37	7,41	3,63	6,79	14,21	22,00	30,85	40,95	49,61
INPC + 6,00%	1,54	8,59	4,13	7,80	16,39	26,73	38,51	52,05	64,49

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

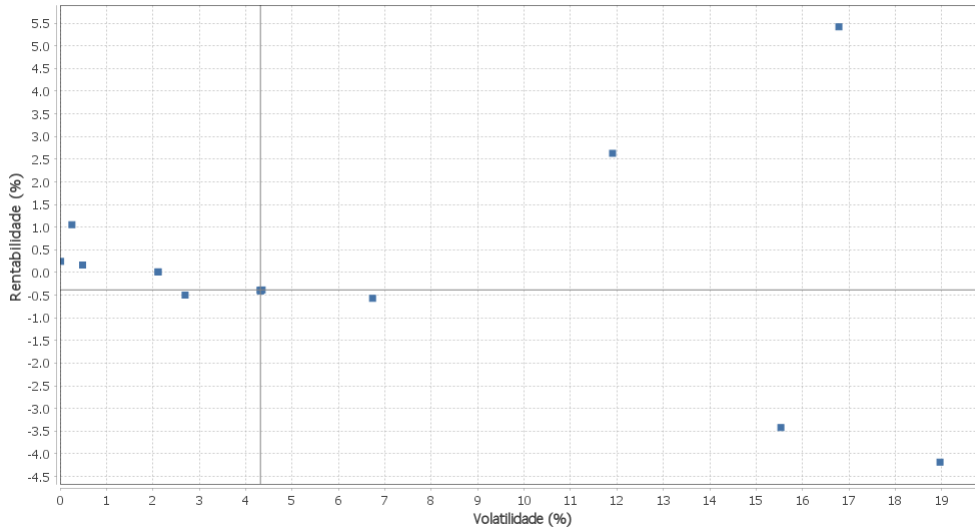
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
66	01/07/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	60.992,20	0,00	28.627,59693000	2,1305385900
67	05/07/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	10.800,00	3.936,58019900	2,7434980250
68	05/07/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.500,00	1.173,15634700	2,1310032600
69	06/07/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.434.656,36	0,00	673.158,19391400	2,1312321130
70	08/07/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	367.285,39	0,00	172.297,24030300	2,1316963020
71	12/07/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	102.185,66	0,00	37.227,07584200	2,7449284610
72	12/07/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	105.185,66	49.333,49129100	2,1321349300
73	13/07/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	5.000.000,00	0,00	2.344.802,64235800	2,1323756250
74	13/07/2021	BB PREV RF IRF-M	0,00	5.000.000,00	830.389,49957700	6,0212707441
75	13/07/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.000.000,00	1.530.544,62074100	3,2668110000
76	13/07/2021	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	0,00	4.000.000,00	112.681,51583682	35,4982800000
77	14/07/2021	NTN-B 150830 (4,069994%)	4.997.037,31	0,00	1.198,00000000	4.171,1496810000
78	14/07/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.570.000,00	3.080.730,33010600	2,1326111980
79	14/07/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.000.000,00	0,00	1.268.882,55857400	1,5761900000
80	15/07/2021	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	5.000.000,00	0,00	378.125,03991580	13,2231391000
81	15/07/2021	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	1.570.000,00	0,00	118.731,26253350	13,2231391000
82	15/07/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2.000.000,00	0,00	337.119,18174432	5,9326200000
83	20/07/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	65.125,42	0,00	30.524,24840300	2,1335634260
84	27/07/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	50.483,36	18.377,29280200	2,7470509690
85	28/07/2021	BB PREV RF IRF-M	0,00	1.412.342,07	234.162,47049300	6,0314621170
86	29/07/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	12.384,18	0,00	5.799,81386700	2,1352719730
87	30/07/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	117.715,79	0,00	55.123,12792900	2,1355063550

Total

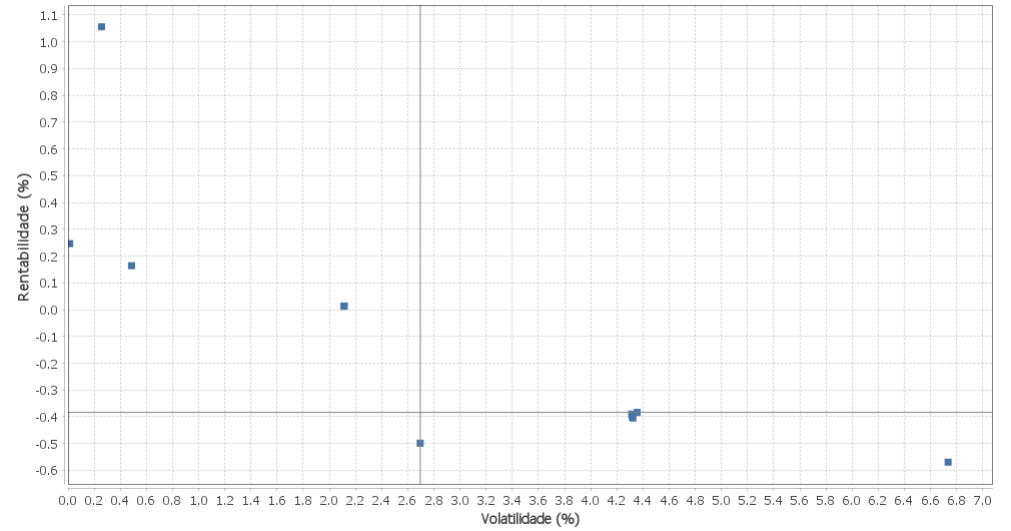
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

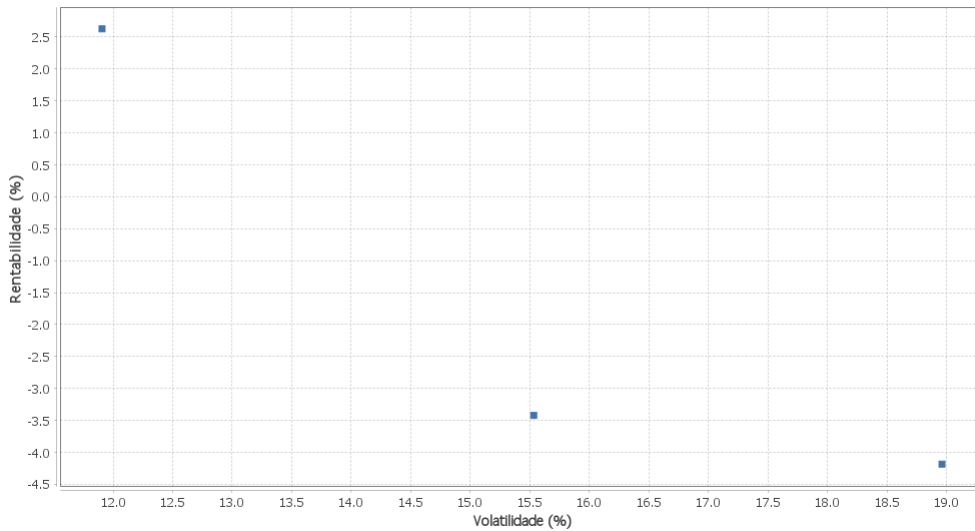
PORTO FELIZ - No Mês



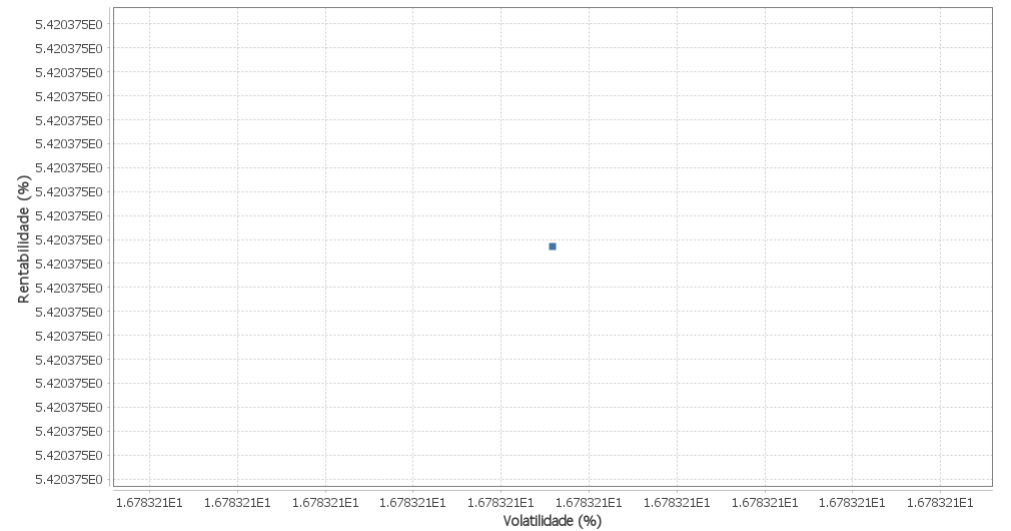
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 6.386.618,62

Value-At-Risk: 2,30%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,02	-0,00	-8,58	0,25	804.143,25	0,29
NTN-B 150830 (4,069994%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,26	0,09	0,00	2,74	1,06	5.030.974,40	1,81
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,49	0,17	0,00	-0,39	0,16	4.210.458,08	1,51
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,11	1,34	0,06	-0,16	0,01	16.975.296,59	6,11
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,11	1,34	0,09	-0,16	0,01	24.870.995,38	8,95
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,70	1,25	0,01	-0,32	-0,50	1.674.597,11	0,60
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	4,31	2,38	0,09	-0,17	-0,39	11.835.995,00	4,26
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,32	2,40	0,38	-0,17	-0,40	50.387.765,54	18,13
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	4,32	2,38	0,32	-0,18	-0,40	43.658.589,64	15,71
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,36	2,32	0,29	-0,17	-0,38	40.213.009,06	14,47
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	6,73	3,69	0,11	-0,14	-0,57	9.887.216,13	3,56
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	11,91	6,36	0,17	0,19	2,63	12.743.441,82	4,59
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	15,53	7,06	0,27	-0,24	-3,42	15.470.471,33	5,57
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	16,78	7,66	0,01	0,30	5,42	12.356.119,01	4,45
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	18,96	6,51	0,50	-0,24	-4,18	27.805.510,18	10,00