



LDB
EMPRESAS

PORTO FELIZ
AGOSTO 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 31.08.2021.

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

73,34%

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	9,51	-2,93	-5,05	9.597.814,25	3,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,423526%)	3,58	0,72	0,72	2.516.780,16	0,91
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (4,689998%)	3,42	0,67	0,67	2.516.626,83	0,91
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,069994%)	2,60	1,19	1,88	4.962.525,37	1,80
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		8,85	-1,37	-2,88	19.593.746,61	7,11

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	2,99	-0,65	-2,82	216.325,82	0,08	6.426.609.886,30	0,00
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,62	0,14	1,32	12.987.368,54	4,72	1.537.702.216,54	0,84
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,72	-1,11	-2,33	11.704.759,65	4,25	474.837.001,82	2,47
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,37	0,33	1,16	4.242.465,27	1,54	7.563.467.815,66	0,06
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,74	-1,13	-2,31	39.758.615,18	14,44	7.360.711.745,51	0,54
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,73	-1,12	-2,41	43.171.312,13	15,68	673.531.762,90	6,41
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,73	-1,14	-2,35	49.814.794,36	18,09	5.489.990.227,20	0,91
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,62	0,13	1,30	19.886.049,15	7,22	11.104.044.700,21	0,18
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,67	-0,85	-1,64	181.781.690,10	66,01		

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	0,16	0,30	0,75	597.039,17	0,22	2.195.853.513,66	0,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
		Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a	0,16	0,30	0,75	597.039,17	0,22		
		Renda Fixa	4,82	-0,87	-1,70	201.972.475,88	73,34		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

21,34%

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	19,98	-3,15	1,35	26.929.079,26	9,78	1.253.858.965,59	2,15
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			19,98	-3,15	1,35	26.929.079,26	9,78		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BEM	BRANDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	19,64	-2,76	6,63	16.635.928,54	6,04	2.170.284.029,75	0,77
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			19,64	-2,76	6,63	16.635.928,54	6,04		

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	14,89	3,34	19,83	15.210.532,06	5,52	3.077.448.003,82	0,49
Sub-total Artigo 8º III			14,89	3,34	19,83	15.210.532,06	5,52		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			18,47	-1,40	5,76	58.775.539,86	21,34		
--	--	--	--------------	--------------	-------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,32%

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	20,09	2,44	8,08	14.655.049,56	5,32	3.230.077.335,87	0,45
Sub-total Artigo 9º A, III			20,09	2,44	8,08	14.655.049,56	5,32		
Investimentos no Exterior			16,67	2,44	8,08	14.655.049,56	5,32		
Total			5,55	-0,85	-0,60	275.403.065,30	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	19.593.746,61	7,11	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	181.781.690,10	66,01	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	597.039,17	0,22	0,00	0,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	201.972.475,88	73,34					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	26.929.079,26	9,78	0,00	10,00	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	16.635.928,54	6,04	0,00	10,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	15.210.532,06	5,52	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	58.775.539,86	21,34					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	14.655.049,56	5,32	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	14.655.049,56	5,32					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	-1,37 -323,53	-2,88 -139,91	-0,62 -56,66	0,53 30,13	4,98 184,27	-195.380,70	-389.955,21
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,85 -199,27	-1,64 -79,63	-0,92 -84,41	0,31 17,58	2,75 101,82	-1.614.533,31	-3.638.395,07
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,30 70,31	0,75 70,73				2.169,92	7.218,68
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,15 -0,67	1,35 1,54	-6,39 -0,50	7,82 -0,12	19,71 0,18	-876.430,92	241.111,49
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,76 -0,28	6,63 6,83	-5,25 0,64	10,42 2,47	16,33 -3,20	-395.042,79	-41.062,22
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	3,34 5,82	19,83 19,37	8,93 14,82	20,01 12,07		467.090,24	1.466.817,73
Artigo 9º A, III % do CDI	2,44 574,20	8,08 454,28	6,70 615,90	6,82 385,40		298.930,55	655.049,56
PORTO FELIZ (Total)						-2.313.197,01	-1.699.215,04

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (4,423526%)	0,00	2.498.840,43	0,00	0,00	2.516.780,16	17.939,73	17.939,73
NTN-B 150545	9.887.216,13	0,00	0,00	0,00	9.597.814,25	-289.401,88	-517.913,48
NTN-B 150555 (4,689998%)	0,00	2.499.875,10	0,00	0,00	2.516.626,83	16.751,73	16.751,73
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.030.974,40	0,00	0,00	127.778,75	4.962.525,37	59.329,72	93.266,80
					19.593.746,61	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	40.213.009,06	0,00	0,00	0,00	39.758.615,18	-454.393,88	-942.188,77
BB PREV RF IRF-M	1.674.597,11	0,00	-1.448.282,99	0,00	216.325,82	-9.988,30	-571.405,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	4.210.458,08	98.000,00	-80.200,00	0,00	4.242.465,27	14.207,19	52.382,30
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	43.658.589,64	0,00	0,00	0,00	43.171.312,13	-487.277,51	-1.066.223,91
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	24.870.995,38	0,00	-5.000.000,00	0,00	19.886.049,15	15.053,77	360.440,75
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	50.387.765,54	0,00	0,00	0,00	49.814.794,36	-572.971,18	-1.200.727,37
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	11.835.995,00	0,00	0,00	0,00	11.704.759,65	-131.235,35	-278.792,62
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	16.975.296,59	0,00	-4.000.000,00	0,00	12.987.368,54	12.071,95	258.195,08
					181.781.690,10	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	804.143,25	1.771.978,57	-1.981.252,57	0,00	597.039,17	2.169,92	7.218,68
					597.039,17	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	27.805.510,18	0,00	0,00	0,00	26.929.079,26	-876.430,92	241.111,49
					26.929.079,26	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	15.470.471,33	1.560.500,00	0,00	0,00	16.635.928,54	-395.042,79	-41.062,22
					16.635.928,54	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	12.743.441,82	2.000.000,00	0,00	0,00	15.210.532,06	467.090,24	1.466.817,73
					15.210.532,06	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	12.356.119,01	2.000.000,00	0,00	0,00	14.655.049,56	298.930,55	655.049,56
					14.655.049,56	0,00	0,00

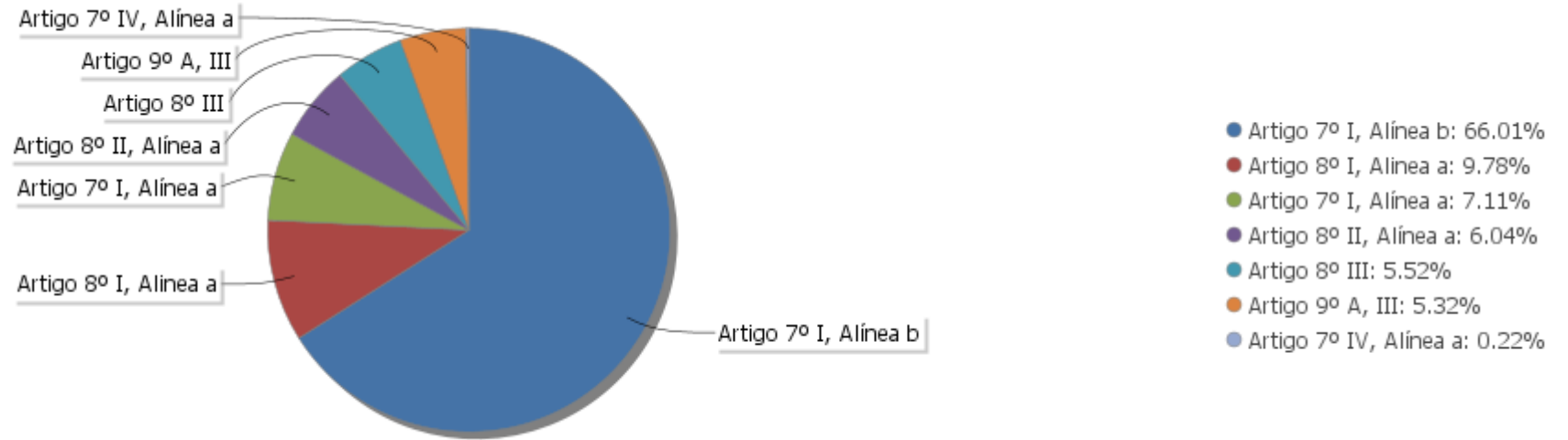
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

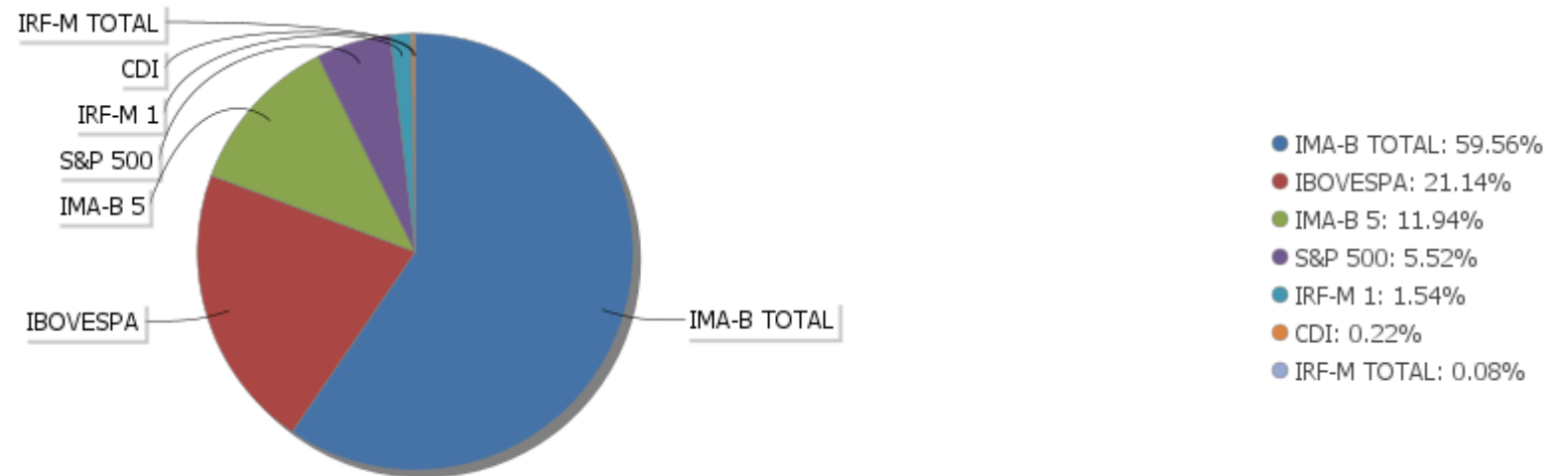
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	255.809.318,69	92,89	255.809.318,69	92,89
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	255.809.318,69	92,89
acima de 365 dias	19.593.746,61	7,11	275.403.065,30	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

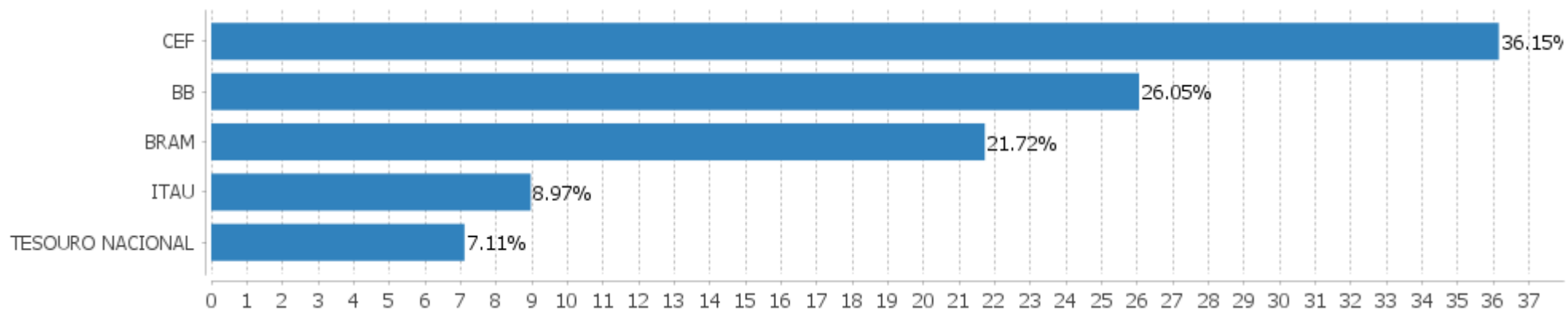


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

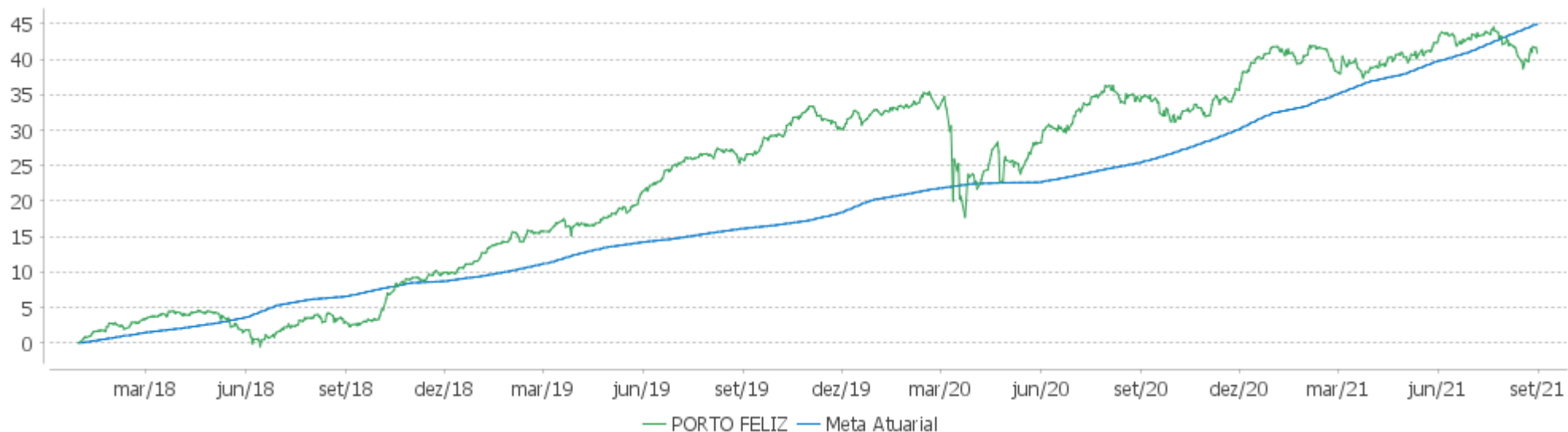
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,94	-1,43	0,32	1,05	1,43	0,40	-0,56	-0,85					-0,60
IPCA + 5,42%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34					9,43
p.p. indexador	-1,61	-2,67	-1,09	0,32	0,16	-0,57	-1,99	-2,18					-10,03
2020	0,26	-0,04	-7,15	1,74	1,95	2,22	3,87	-1,53	-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

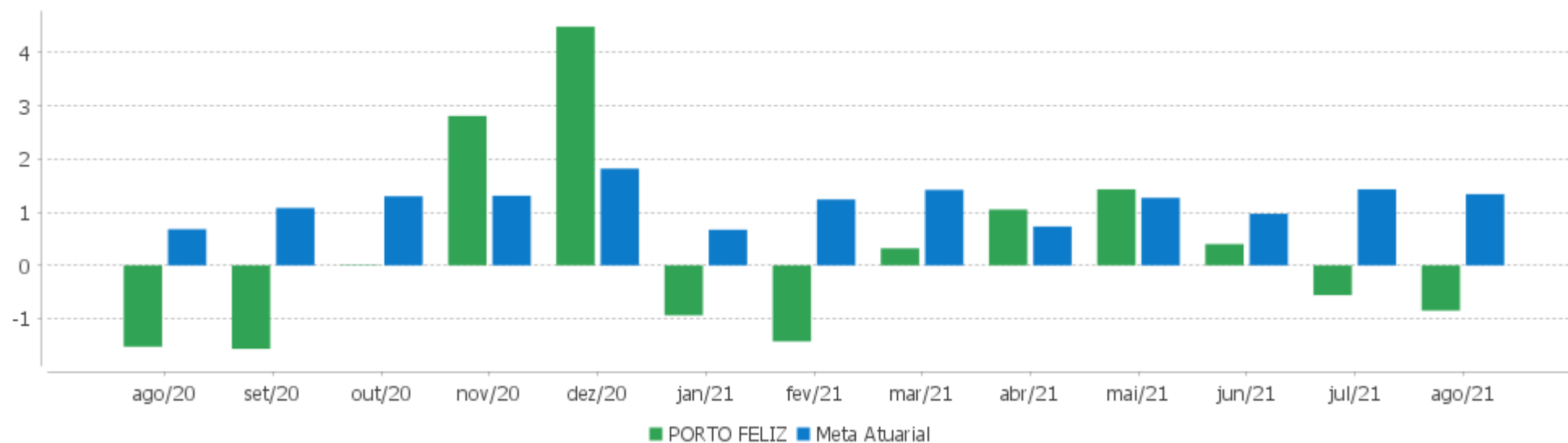
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	22	50,00	03 meses	-1,01	3,78	-4,79	5,25
Meses abaixo - Meta Atuarial	22	50,00	06 meses	1,80	7,37	-5,58	5,33
			12 meses	5,11	15,76	-10,66	5,55
			24 meses	11,78	25,60	-13,82	9,27
			36 meses	36,74	37,61	-0,87	7,94
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10	Desde 29/12/2017	40,89	47,17	-6,28	7,42
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
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,30 70,31	1,31 63,44	0,77 70,82	1,18 66,58	1,53 56,51	4,35 65,14	9,73 72,68
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,93 -1,84	-5,05 -2,88	-2,84 -1,79	-1,71 -1,90	2,63 -0,63	5,78 -4,35	47,49 7,06
NTN-B 150555 (4,689998%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,24 2,33	6,56 8,73	3,55 4,59	4,54 4,35	9,02 5,75	11,36 1,24	14,75 -25,68
NTN-B 150830 (4,069994%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,19 2,28	5,98 8,15	3,39 4,43	6,75 6,56	10,83 7,57	12,25 2,12	14,73 -25,70
NTN-B 150535 (4,423526%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,22 2,31	6,25 8,42	3,48 4,52	4,28 4,09	8,49 5,22	10,31 0,18	13,17 -27,27
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,11 -0,02	-2,33 -0,16	-1,10 -0,06	0,07 -0,12	2,98 -0,29	9,55 -0,57	39,09 -1,34
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,14 -0,05	-2,35 -0,18	-1,14 -0,09	0,05 -0,14	3,01 -0,26	9,40 -0,73	39,26 -1,18
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,13 -0,02	1,30 -0,16	-0,00 -0,05	1,85 -0,12	4,50 -0,27	13,83 -0,63	30,03 -0,94
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,14 -0,02	1,32 -0,15	-0,00 -0,05	1,86 -0,11	4,51 -0,25	13,99 -0,46	30,02 -0,95
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,33 -0,03	1,16 -0,22	0,68 -0,09	1,12 -0,17	1,83 -0,40	6,69 -0,72	14,37 -0,99
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,65 -0,05	-2,82 -0,20	-0,97 -0,11	-0,86 -0,19	-1,54 -0,29	6,76 -0,59	24,30 -0,94
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,13 -0,04	-2,31 -0,14	-1,14 -0,09	0,07 -0,12	3,03 -0,24	9,60 -0,52	39,38 -1,06
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,12 -0,03	-2,41 -0,24	-1,13 -0,09	0,00 -0,19	2,90 -0,36	9,37 -0,75	38,97 -1,46
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	-3,15 -0,67	1,35 1,54	-6,39 -0,50	7,82 -0,12	19,71 0,18	19,25 1,80	62,65 7,74
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	3,34 0,00	23,18 4,01	8,93 3,18	20,01 9,65	30,11 8,65	52,19 -39,88	
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p.	-2,76 -0,28	6,63 6,83	-5,25 0,64	10,42 2,47	16,33 -3,20	23,54 6,09	84,21 29,30
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2,44	17,01	6,70	6,82	16,19	96,21	100,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	4,91	17,21	12,59	-1,12	-3,35	78,76	45,82
PORTO FELIZ	-0,85	-0,60	-1,01	1,80	5,11	11,78	36,74
Var. IPCA + 5,42% p.p.	-2,18	-10,03	-4,79	-5,58	-10,49	-13,06	0,71
CDI	0,42	2,06	1,09	1,77	2,70	6,68	13,38
IBOVESPA	-2,48	-0,20	-5,89	7,95	19,54	17,45	54,91
INPC + 6,00%	1,39	10,11	4,07	7,96	17,02	27,69	39,70
IPCA + 6,00%	1,38	9,83	3,93	7,68	16,23	26,21	38,28

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	0,37	1,37	0,77	1,29	2,24	7,41	15,36	23,32	39,53
IRF-M 1+	-1,11	-5,18	-1,73	-1,87	-3,32	6,96	28,83	35,92	63,00
IRF-M TOTAL	-0,60	-2,63	-0,86	-0,67	-1,25	7,35	25,24	32,67	56,55
IMA-B 5	0,15	1,47	0,05	1,97	4,77	14,45	30,97	39,69	59,11
IMA-B 5+	-2,22	-5,44	-2,16	-1,52	1,80	6,60	47,32	51,19	76,06
IMA-B TOTAL	-1,09	-2,17	-1,04	0,19	3,27	10,12	40,44	46,85	69,60
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,34	-0,78	-0,12	0,49	1,31	7,55	24,32	31,67	51,95
IMA-GERAL TOTAL	-0,41	-0,37	-0,16	0,57	1,87	8,50	25,67	33,36	53,41
IDKA 2	0,26	1,95	-0,23	2,29	5,08	15,28	29,79	40,22	60,31
IDKA 20	-4,42	-9,21	-4,78	-4,01	0,70	0,45	60,91	59,85	88,93
CDI	0,42	2,06	1,09	1,77	2,70	6,68	13,38	21,14	35,76

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,48	-0,20	-5,89	7,95	19,54	17,45	54,91	67,69	105,15
IBRX 100	-3,25	1,07	-6,53	7,96	20,88	19,52	61,19	73,03	111,89
IBRX 50	-3,50	1,23	-6,61	8,25	22,12	19,45	54,17	67,38	104,18
SMALL CAP	-3,82	0,95	-8,23	6,49	16,98	24,03	87,36	82,99	149,92
IFIX	-2,63	-4,19	-2,37	-4,74	-1,16	3,51	28,53	31,95	55,61
Índice Consumo - ICON	-3,90	-5,90	-8,34	0,65	0,42	6,20	60,80	43,37	64,23
Índice Dividendos - IDIV	-0,50	-0,20	-4,33	10,92	19,40	15,05	72,87	73,37	131,37

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	0,87	5,67	2,38	4,51	9,68	12,35	16,21	21,08	24,05
INPC	0,88	5,94	2,52	4,79	10,42	13,67	17,40	21,68	23,78
IGPM	0,66	16,75	2,06	11,01	31,12	48,19	55,53	69,35	66,46
SELIC	0,42	2,06	1,09	1,77	2,70	6,68	13,38	21,15	35,79

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	3,34	19,17	5,75	10,37	21,46	92,07	93,87	199,05	230,68
MSCI ACWI	2,79	13,52	2,42	4,91	19,14	80,33	76,32	153,23	182,42
MSCI World	2,78	15,58	3,77	7,14	20,26	82,56	79,59	161,97	189,98

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,22	8,46	3,42	6,63	14,05	21,50	30,63	41,51	50,76
IPCA + 5,00%	1,30	9,15	3,67	7,15	15,14	23,85	34,42	47,00	58,11
IPCA + 5,50%	1,34	9,49	3,80	7,41	15,69	25,03	36,34	49,80	61,89
IPCA + 5,89%	1,38	9,76	3,90	7,62	16,11	25,95	37,85	52,02	64,89
IPCA + 6,00%	1,38	9,83	3,93	7,68	16,23	26,21	38,28	52,65	65,74
INPC + 4,00%	1,23	8,73	3,56	6,92	14,82	22,92	31,98	42,21	50,44
INPC + 6,00%	1,39	10,11	4,07	7,96	17,02	27,69	39,70	53,40	65,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

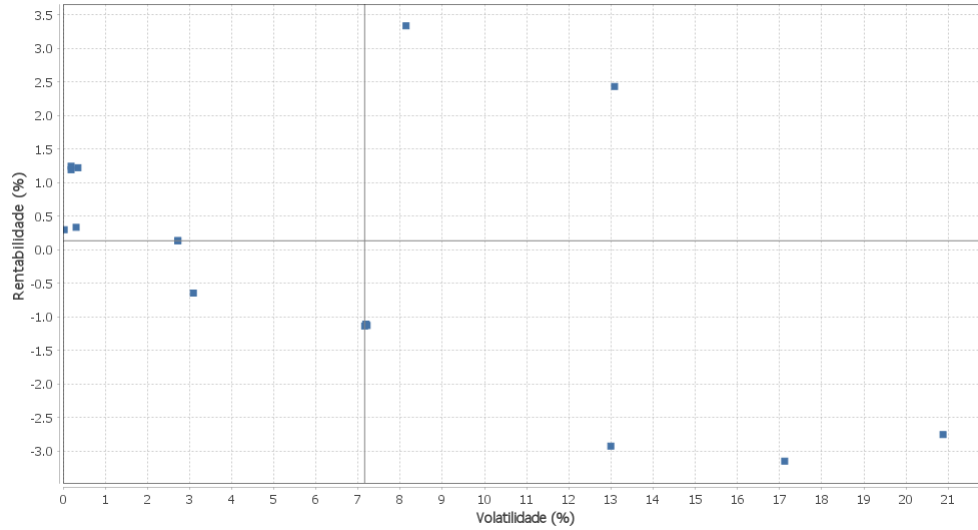
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
88	03/08/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	16.000,00	5.822,00539200	2,7481939510
89	03/08/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	20.820,67	0,00	9.747,53686700	2,1359929470
90	04/08/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.984,33	928,89821900	2,1362189740
91	06/08/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	223.698,99	104.692,96045600	2,1367147230
92	09/08/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	2.700,00	982,48433900	2,7481354080
93	09/08/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.000.000,00	1.534.189,41262100	3,2590500000
94	10/08/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.422.088,99	0,00	665.355,90803100	2,1373357820
95	10/08/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	0,00	4.000.000,00	112.850,02020721	35,4452750000
96	11/08/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	98.000,00	0,00	35.636,96517500	2,7499535810
97	11/08/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.000.000,00	0,00	1.244.052,65079600	1,6076490000
98	12/08/2021	NTN-B 150535 (4,423526%)	2.498.840,43	0,00	591,00000000	4.228,1563940000
99	12/08/2021	NTN-B 150555 (4,689998%)	2.499.875,10	0,00	562,00000000	4.448,1763390000
100	12/08/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	545,27	255,04431300	2,1379422010
101	12/08/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2.000.000,00	0,00	325.300,26027273	6,1481660000
102	13/08/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.755.023,98	820.765,51402800	2,1382769500
103	17/08/2021	BRANCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	1.560.500,00	0,00	129.481,68212970	12,0518978000
104	20/08/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	66.178,03	0,00	30.928,33885500	2,1397214480
105	25/08/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	61.500,00	22.330,09155600	2,7541311170
106	25/08/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	130.418,91	0,00	60.924,49259800	2,1406646890
107	26/08/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	119.706,83	0,00	55.912,21713300	2,1409780570
108	26/08/2021	BB PREV RF IRF-M	0,00	1.448.282,99	242.274,53757100	5,9778588560
109	27/08/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	12.408,35	0,00	5.794,83838800	2,1412762820
110	31/08/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	356,79	0,00	166,57837100	2,1418747090
Total						

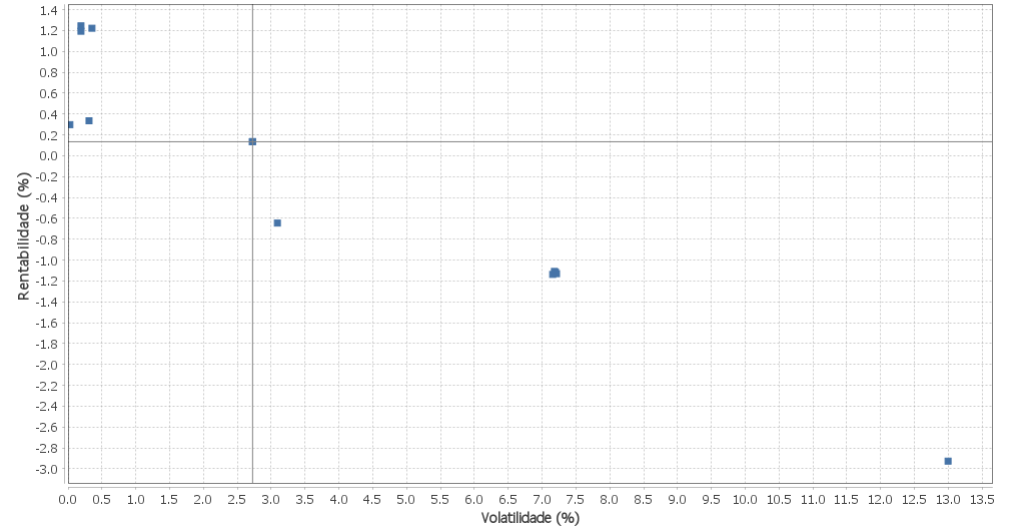
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

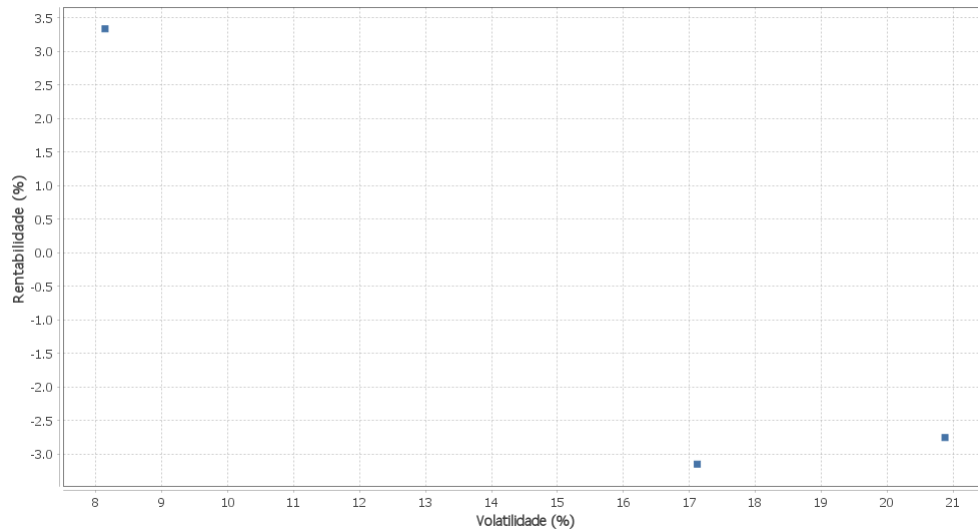
PORTO FELIZ - No Mês



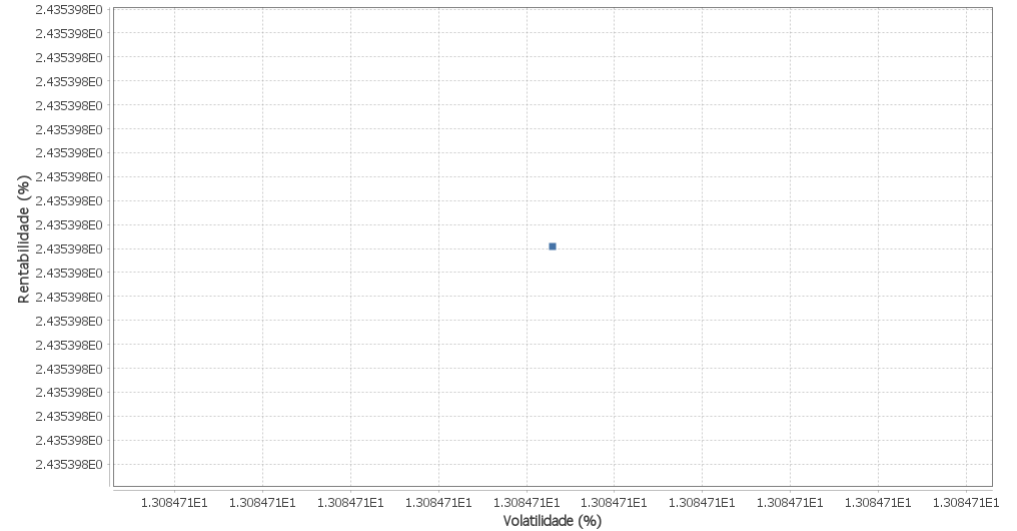
Renda Fixa - No Mês



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\$): 7.192.665,11

Value-At-Risk: 2,61%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	-0,00	-4,67	0,30	597.039,17	0,22
NTN-B 150830 (4,069994%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,19	0,08	-0,00	4,03	1,19	4.962.525,37	1,80
NTN-B 150555 (4,689998%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,19	0,17	-0,00	4,30	1,24	2.516.626,83	0,91
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,31	0,17	0,00	-0,29	0,33	4.242.465,27	1,54
NTN-B 150535 (4,423526%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,35	0,18	-0,00	2,26	1,22	2.516.780,16	0,91
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,72	1,25	0,07	-0,11	0,13	19.886.049,15	7,22
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,73	1,25	0,05	-0,11	0,14	12.987.368,54	4,72
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,09	1,23	0,00	-0,35	-0,65	216.325,82	0,08
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,16	3,02	0,49	-0,22	-1,14	49.814.794,36	18,09
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	7,18	3,01	0,12	-0,21	-1,11	11.704.759,65	4,25
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	7,20	3,02	0,43	-0,21	-1,12	43.171.312,13	15,68
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,21	3,03	0,39	-0,22	-1,13	39.758.615,18	14,44
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	8,14	5,46	0,16	0,36	3,34	15.210.532,06	5,52
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	13,00	4,42	0,13	-0,26	-2,93	9.597.814,25	3,49
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	13,08	7,38	-0,05	0,15	2,44	14.655.049,56	5,32
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	17,12	6,52	0,50	-0,21	-3,15	26.929.079,26	9,78
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	20,88	7,30	0,32	-0,15	-2,76	16.635.928,54	6,04