



LDB
EMPRESAS

PORTO FELIZ
SETEMBRO 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 30.09.2022.

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 67,96%

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	9,60	2,89	5,46	9.324.545,10	3,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,423526%)	0,69	0,07	8,09	2.736.085,61	0,98
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,734998%)	0,72	0,12	8,33	10.764.405,65	3,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290003%)	0,66	0,08	8,77	10.641.315,29	3,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,877000%)	2,92	0,13	5,91	5.143.048,30	1,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (4,689998%)	0,66	0,03	8,30	2.750.610,52	0,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,669994%)	2,82	0,11	7,05	10.416.127,64	3,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,900000%)	2,91	0,13	5,92	5.144.739,04	1,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,069994%)	0,66	-0,02	7,82	5.369.824,62	1,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,569998%)	0,66	0,10	8,40	1.554.254,13	0,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,120004%)	0,66	0,07	8,63	10.356.334,89	3,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,171997%)	0,66	0,07	8,67	10.519.955,97	3,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,481000%)	2,83	0,10	4,32	5.074.125,69	1,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,792100%)	2,92	0,12	2,46	19.905.561,50	7,13
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		1,67	0,32	8,15	109.700.933,95	39,31

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	3,73	1,38	6,83	232.394,44	0,08	4.037.691.715,74	0,01
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,69	0,41	6,94	15.289.803,43	5,48	1.288.891.540,11	1,19
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,73	1,09	8,39	1.436.497,71	0,51	6.071.749.354,31	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,46	1,45	5,92	12.890.420,58	4,62	5.858.339.074,80	0,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,49	1,50	6,09	14.166.284,67	5,08	3.871.147.074,69	0,37
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,68	0,43	7,04	21.918.094,63	7,85	8.885.835.879,64	0,25
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,24	0,08	5,85	3.087.010,61	1,11	3.601.305.672,83	0,09
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,08	0,83	6,06	69.020.506,07	24,73		

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	0,14	0,99	8,07	3.196.198,87	1,15	3.459.949.589,95	0,09
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,14	1,12	4,05	7.715.074,73	2,76	2.713.701.445,40	0,28
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,10	1,08	8,28	10.911.273,60	3,91		
Renda Fixa			3,01	0,55	7,14	189.632.713,62	67,96		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

18,79%

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	BRANCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	25,11	-1,34	-2,76	28.077.329,75	10,06	1.002.602.097,35	2,80
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,30	-0,13	3,58	24.349.334,37	8,73	882.000.687,94	2,76
Sub-total Artigo 8º I			21,41	-0,78	0,09	52.426.664,12	18,79		
Renda Variável			20,84	-0,78	0,09	52.426.664,12	18,79		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,11%

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	22,78	-7,72	-30,97	17.048.794,43	6,11	2.057.509.929,37	0,83
Sub-total Artigo 9º III			22,78	-7,72	-30,97	17.048.794,43	6,11		
Investimentos no Exterior			22,78	-7,72	-30,97	17.048.794,43	6,11		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,15%

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	21,98	-8,62	-19,76	19.944.478,75	7,15	1.721.873.439,88	1,16
Sub-total Artigo 10º I			21,98	-8,62	-19,76	19.944.478,75	7,15		
Investimentos Estruturados			23,79	-8,62	-19,76	19.944.478,75	7,15		
Total			6,80	-0,95	0,01	279.052.650,92	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	109.700.933,95	39,31	0,00	37,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	69.020.506,07	24,73	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	10.911.273,60	3,91	0,00	3,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	189.632.713,62	67,96					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	52.426.664,12	18,79	0,00	20,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	52.426.664,12	18,79					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	17.048.794,43	6,11	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	17.048.794,43	6,11					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	19.944.478,75	7,15	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	19.944.478,75	7,15					15,00
Total		279.052.650,92	100,00					

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	0,32 30,29	8,15 91,62	0,73 22,19	4,49 71,11	11,06 101,54	355.061,18	6.867.130,48
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,83 77,64	6,06 68,13	1,00 30,06	3,00 47,45	7,38 67,74	569.727,31	5.166.477,94
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,08 101,05	8,28 93,19	3,24 97,86	5,98 94,67		116.923,64	564.528,51
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,78 -1,25	0,09 -4,89	11,37 -0,29	-11,29 -2,99		-412.154,45	44.993,65
Artigo 9º III % do CDI	-7,72 -720,14	-30,97 -348,32	-4,35 -131,36	-14,12 -223,69	-22,81 -209,38	-1.426.239,37	-7.647.943,98
Artigo 10º I % do CDI	-8,62 -804,56	-19,76 -222,21	-2,65 -80,04	-17,23 -272,95		-1.882.512,39	-4.910.165,57
PORTO FELIZ (Total)						-2.679.194,08	85.021,03

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%)	2.734.180,08	0,00	0,00	0,00	2.736.085,61	1.905,53	209.000,69
NTN-B 150535 (4,734998%)	10.751.922,69	0,00	0,00	0,00	10.764.405,65	12.482,96	845.204,74
NTN-B 150535 (5,290003%)	10.632.659,65	0,00	0,00	0,00	10.641.315,29	8.655,64	875.746,11
NTN-B 150535 (5,877000%)	5.136.480,04	0,00	0,00	0,00	5.143.048,30	6.568,26	291.994,77
NTN-B 150545	9.062.670,05	0,00	0,00	0,00	9.324.545,10	261.875,05	491.526,06
NTN-B 150555 (4,689998%)	2.749.680,35	0,00	0,00	0,00	2.750.610,52	930,17	214.801,20
NTN-B 150555 (5,669994%)	10.404.512,72	0,00	0,00	0,00	10.416.127,64	11.614,92	699.592,06
NTN-B 150555 (5,900000%)	5.138.078,20	0,00	0,00	0,00	5.144.739,04	6.660,84	292.655,67
NTN-B 150830 (4,069994%)	5.370.666,27	0,00	0,00	0,00	5.369.824,62	-841,65	401.545,22
NTN-B 150830 (5,569998%)	1.552.644,51	0,00	0,00	0,00	1.554.254,13	1.609,62	124.292,49
NTN-B 150840 (5,120004%)	10.349.307,38	0,00	0,00	0,00	10.356.334,89	7.027,51	848.930,11
NTN-B 150840 (5,171997%)	10.512.368,86	0,00	0,00	0,00	10.519.955,97	7.587,11	866.180,05

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150840 (5,481000%)	5.069.231,98	0,00	0,00	0,00	5.074.125,69	4.893,71	215.820,79
NTN-B 150840 (5,792100%)	19.881.469,99	0,00	0,00	0,00	19.905.561,50	24.091,51	489.840,52
					109.700.933,95	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	12.706.124,72	0,00	0,00	0,00	12.890.420,58	184.295,86	806.100,52
BB PREV RF IPCA	3.084.430,83	0,00	0,00	0,00	3.087.010,61	2.579,78	175.639,42
BB PREV RF IRF M	229.239,55	0,00	0,00	0,00	232.394,44	3.154,89	14.867,26
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.421.067,48	0,00	0,00	0,00	1.436.497,71	15.430,23	207.869,01
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.824.872,38	0,00	0,00	0,00	21.918.094,63	93.222,25	1.441.422,36
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	13.957.419,97	0,00	0,00	0,00	14.166.284,67	208.864,70	913.040,56
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	15.227.623,83	0,00	0,00	0,00	15.289.803,43	62.179,60	992.383,67
					69.020.506,07	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	3.164.733,24	0,00	0,00	0,00	3.196.198,87	31.465,63	371.911,36
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	7.629.616,72	0,00	0,00	0,00	7.715.074,73	85.458,01	192.617,15
					10.911.273,60	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	24.381.379,14	0,00	0,00	0,00	24.349.334,37	-32.044,77	842.589,69
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	28.457.439,43	0,00	0,00	0,00	28.077.329,75	-380.109,68	-797.596,04
					52.426.664,12	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	18.475.033,80	0,00	0,00	0,00	17.048.794,43	-1.426.239,37	-7.647.943,98
					17.048.794,43	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	21.826.991,14	0,00	0,00	0,00	19.944.478,75	-1.882.512,39	-4.910.165,57
					19.944.478,75	0,00	0,00

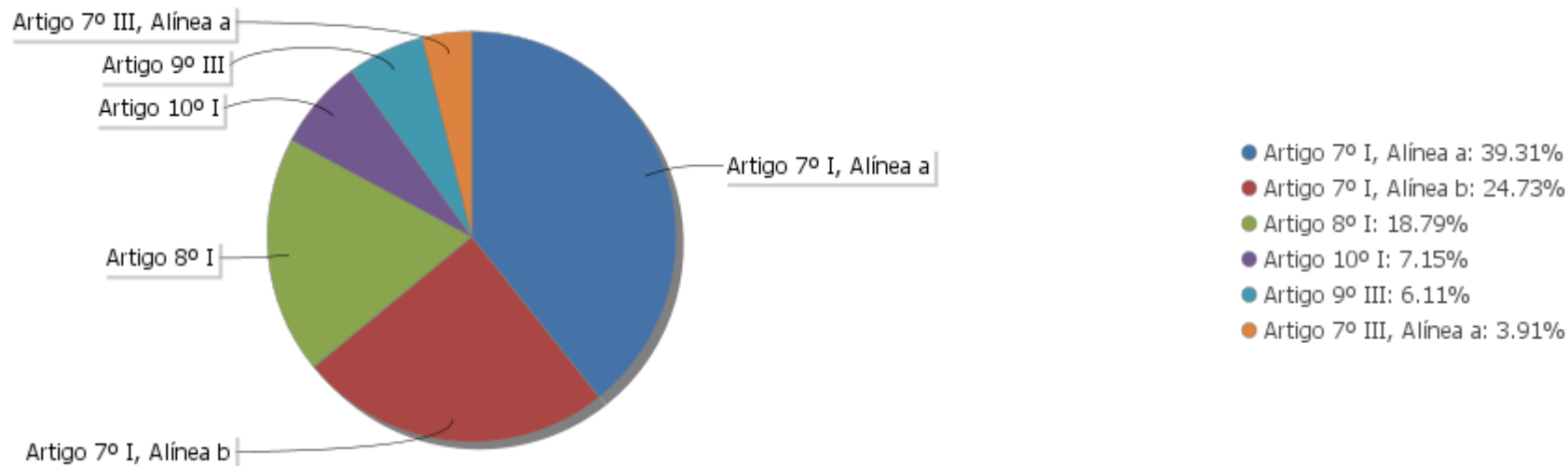
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

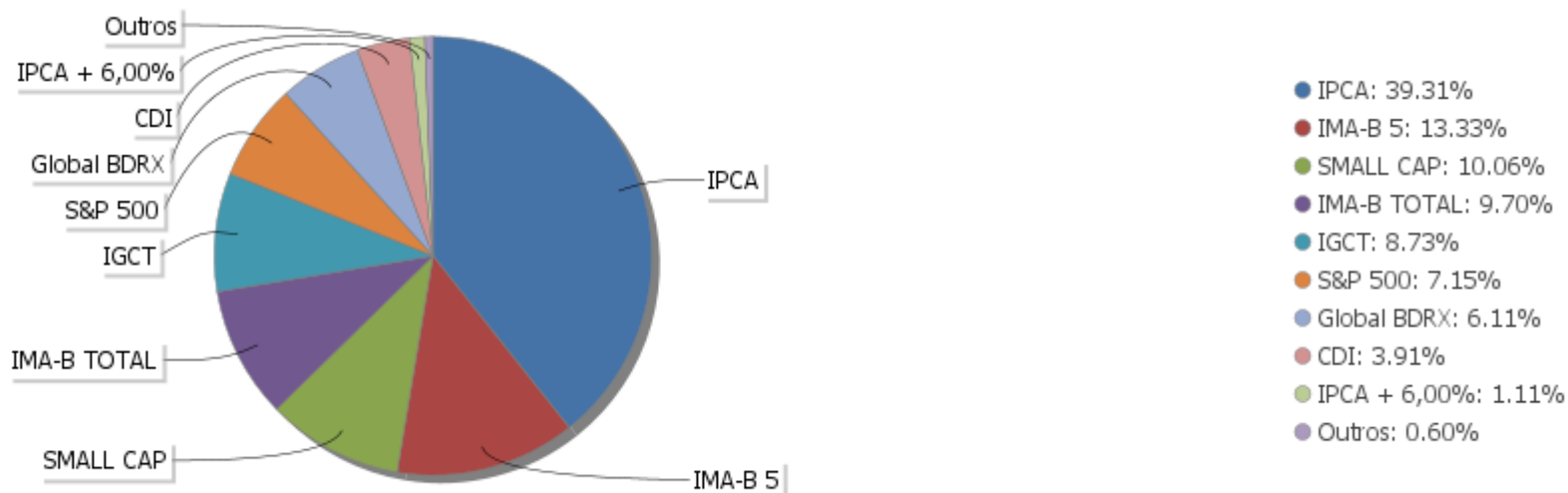
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	166.264.706,36	59,58	166.264.706,36	59,58
de 31 a 365 dias	3.087.010,61	1,11	169.351.716,97	60,69
acima de 365 dias	109.700.933,95	39,31	279.052.650,92	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

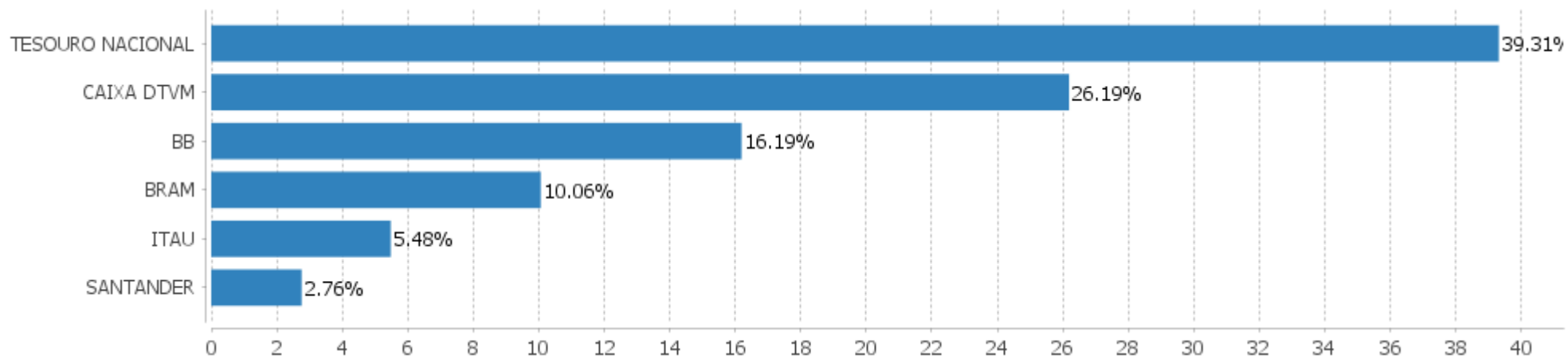


Alocação Por Estratégia



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	-2,88	2,21	0,90	-0,95				0,01
IPCA + 4,88%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,28	0,07	0,11				7,88
p.p. indexador	-1,33	-1,70	1,00	-3,79	0,04	-3,95	2,50	0,82	-1,06				-7,87
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	27	47,37	03 meses	2,15	-0,10	2,25	6,40
Meses abaixo - Meta Atuarial	30	52,63	06 meses	-2,25	3,31	-5,56	6,86
			12 meses	0,96	12,54	-11,58	6,80
			24 meses	6,60	30,91	-24,31	6,12
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10	36 meses	8,84	42,99	-34,15	8,57
Menor rentabilidade da Carteira	-7,15	2020-03	48 meses	36,21	55,91	-19,70	7,71
			Desde 29/12/2017	40,64	68,29	-27,65	7,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

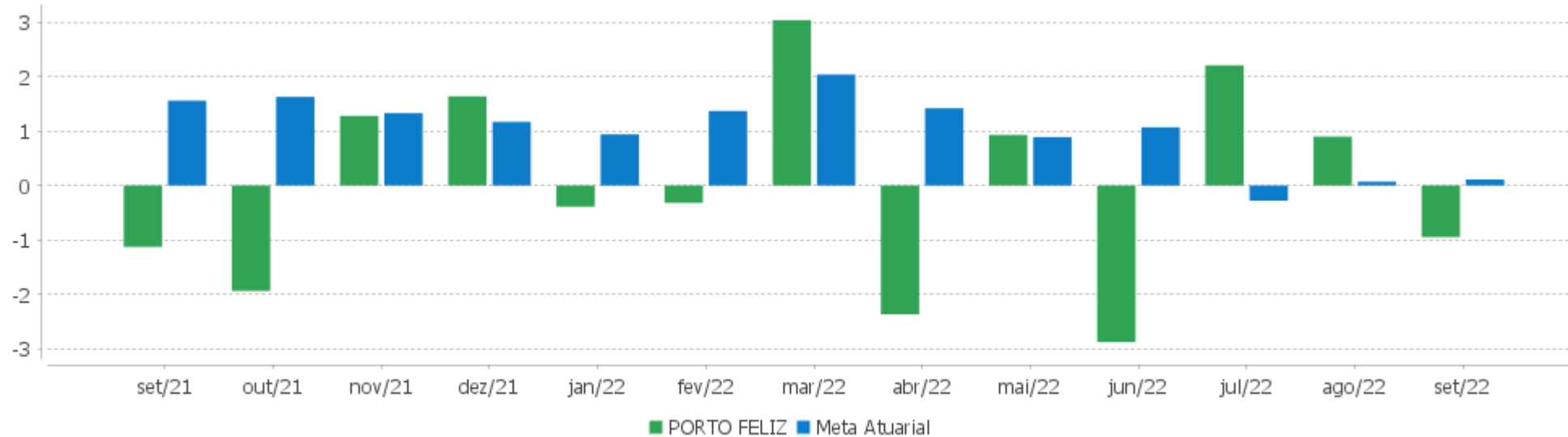


Patrimônio Líquido



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.	2,89 3,18	5,46 1,37	3,87 5,20	3,38 2,52	3,94 -3,23	8,21 -9,94	4,44 -17,41
NTN-B 150840 (5,120004%) Var. IPCA p.p.	0,07 0,36	8,63 4,54	0,40 1,72	4,54 3,68	13,37 6,21	24,45 6,30	27,46 5,61
NTN-B 150830 (4,069994%) Var. IPCA p.p.	-0,02 0,27	7,82 3,73	0,14 1,46	4,01 3,15	12,24 5,07	25,36 7,21	27,39 5,53
NTN-B 150535 (5,290003%) Var. IPCA p.p.	0,08 0,37	8,77 4,68	0,44 1,77	4,63 3,76	13,56 6,39	24,64 6,49	27,64 5,78
NTN-B 150535 (5,877000%) Var. IPCA p.p.	0,13 0,42	9,22 5,13	0,59 1,91	4,92 4,06	10,95 3,78	22,08 3,93	25,32 3,47
NTN-B 150840 (5,792100%) Var. IPCA p.p.	0,12 0,41	6,09 2,00	0,56 1,89	4,88 4,02	10,90 3,73	22,01 3,86	25,23 3,38
NTN-B 150555 (4,689998%) Var. IPCA p.p.	0,03 0,32	8,30 4,21	0,29 1,62	4,32 3,46	12,91 5,74	24,04 5,89	27,13 5,28
NTN-B 150840 (5,481000%) Var. IPCA p.p.	0,10 0,39	5,96 1,87	0,49 1,81	4,72 3,86	10,68 3,51	21,64 3,50	24,73 2,88
NTN-B 150830 (5,569998%) Var. IPCA p.p.	0,10 0,39	8,98 4,89	0,51 1,83	4,77 3,90	13,86 6,69	25,05 6,90	28,13 6,28
NTN-B 150840 (5,171997%) Var. IPCA p.p.	0,07 0,36	8,67 4,58	0,41 1,74	4,57 3,71	13,43 6,26	24,54 6,39	27,57 5,72
NTN-B 150555 (5,669994%) Var. IPCA p.p.	0,11 0,40	9,06 4,97	0,53 1,86	4,82 3,95	10,85 3,68	21,98 3,83	25,23 3,37
NTN-B 150555 (5,900000%) Var. IPCA p.p.	0,13 0,42	9,24 5,15	0,59 1,92	4,93 4,07	10,99 3,82	22,18 4,03	25,46 3,61
NTN-B 150535 (4,423526%) Var. IPCA p.p.	0,07 0,36	8,09 4,00	0,29 1,61	4,25 3,39	12,62 5,45	23,13 4,98	25,61 3,76
NTN-B 150535 (4,734998%) Var. IPCA p.p.	0,12 0,41	8,33 4,25	0,38 1,71	4,43 3,57	12,96 5,79	23,67 5,52	26,34 4,49
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,50 0,02	6,09 -0,03	1,76 0,06	3,18 0,02	7,15 -0,10	11,91 -0,38	13,79 -0,88
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,43 0,00	7,04 -0,03	0,50 0,06	3,16 0,02	9,15 -0,10	15,36 -0,39	23,34 -0,79
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	0,41	6,94	0,40	3,06	9,06	15,28	23,42

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.	-0,01	-0,13	-0,03	-0,08	-0,18	-0,46	-0,71
BB PREV RF IPCA	0,08	7,15	0,02	3,10	8,79	15,18	24,85
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,11	-1,59	-0,15	-0,76	-4,81	-17,55	-20,25
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1,09	8,39	3,37	6,02	9,57	11,94	16,61
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,21	-0,06	-0,16	-0,24	-0,61	-1,05
BB PREV RF IRF M	1,38	6,83	4,63	5,48	7,83	6,48	13,09
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,02	-0,12	-0,04	-0,06	-0,18	-0,44	-0,84
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,45	5,92	1,63	3,07	6,95	11,76	13,80
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,20	-0,07	-0,09	-0,30	-0,54	-0,87
BB PREV RF FLUXO FIC	0,99	8,07	3,06	5,77	9,78	11,85	14,54
% do CDI	92,75	90,82	92,31	91,41	89,79	83,36	79,54
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	1,12	9,30	3,41	6,53	11,54	15,48	18,47
% do CDI	104,49	104,59	103,01	103,43	105,92	108,94	101,05
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-0,13	3,58	11,14	-9,22	-3,03	14,00	4,65
Var. IGCT p.p.	0,05	-0,68	-0,19	-0,26	-0,83	-2,06	-2,93
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	-1,34	-2,76	11,58	-13,01	-14,44	0,72	-0,96
Var. SMALL CAP p.p.	0,50	5,30	-2,90	0,81	3,99	6,30	6,31
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-7,72	-30,97	-4,35	-14,12	-22,81	-8,72	47,15
Var. Global BDRX p.p.	0,66	-0,19	0,03	0,08	-0,54	-2,81	-3,67
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-8,62	-19,76	-2,65	-17,23	-9,27	18,60	28,89
Var. S&P 500 p.p.	-3,27	7,36	-0,42	-7,55	8,00	16,41	-27,50
PORTO FELIZ	-0,95	0,01	2,15	-2,25	0,96	6,60	8,84
Var. IPCA + 4,88% p.p.	-1,06	-7,87	2,25	-5,56	-11,44	-23,34	-31,71
CDI	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28
IBOVESPA	0,47	4,97	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05
INPC + 6,00%	0,17	8,98	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90
IPCA + 6,00%	0,20	8,74	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10

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
BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
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
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,18
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

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	1,11	8,59	3,43	6,17	9,81	12,55	17,67	26,42	34,96
IRF-M 1+	1,58	6,25	5,47	5,41	7,24	3,87	11,78	35,04	42,24
IRF-M TOTAL	1,40	6,96	4,66	5,53	8,01	6,91	13,92	33,10	40,74
IMA-B 5	0,42	7,07	0,43	3,14	9,25	15,75	24,13	43,24	52,60
IMA-B 5+	2,39	5,10	3,01	3,14	5,19	8,56	6,75	54,62	53,36
IMA-B TOTAL	1,48	6,12	1,70	3,16	7,25	12,30	14,67	50,64	54,48
IMA-GERAL TOTAL	1,26	7,80	3,17	5,13	9,24	11,95	16,81	36,41	43,76
IDKA 2	0,62	6,94	0,09	2,94	8,91	15,68	24,94	40,99	52,99
IDKA 20	5,00	3,97	6,75	3,59	0,98	3,03	-6,12	61,55	50,87
CDI	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,07

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,47	4,97	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05	38,69	48,11
IBRX 100	-0,05	4,43	10,77	-9,10	-1,33	16,26	6,28	43,30	51,68
IBRX 50	0,48	5,31	11,70	-8,80	0,58	19,15	7,21	38,32	48,42
SMALL CAP	-1,84	-8,06	14,47	-13,82	-18,43	-5,58	-7,27	45,86	34,71
IFIX	0,49	6,63	6,98	7,58	10,13	7,01	11,42	40,10	34,66
Índice Consumo - ICON	-1,18		15,08	-17,92	-27,77	-28,97	-29,71	8,70	-9,15
Índice Dividendos - IDIV	-1,80	9,21	4,42	-5,43	7,21	28,20	15,63	76,72	67,29

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	-0,29	4,09	-1,32	0,86	7,17	18,15	21,85	25,38	31,05
INPC	-0,32	4,32	-1,23	0,87	7,19	18,75	23,37	26,97	32,02
IGPM	-0,95	6,61	-1,43	1,07	8,25	35,16	59,40	64,77	81,31
SELIC	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,08

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	-5,36	-27,11	-2,23	-9,68	-17,26	2,19	56,39	66,16	142,89
MSCI ACWI	-5,78	-28,97	-4,29	-11,25	-22,48	-6,15	37,99	42,53	93,97

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,04	7,20	-0,32	2,87	11,46	27,77	37,05	46,63	59,32
IPCA + 5,00%	0,12	7,97	-0,07	3,37	12,53	30,23	41,03	52,34	67,10
IPCA + 5,50%	0,16	8,35	0,05	3,62	13,06	31,48	43,06	55,26	71,10
IPCA + 5,89%	0,19	8,65	0,14	3,81	13,48	32,45	44,65	57,56	74,27
IPCA + 6,00%	0,20	8,74	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10	58,22	75,18
INPC + 4,00%	0,01	7,43	-0,22	2,89	11,48	28,42	38,75	48,49	60,50
INPC + 6,00%	0,17	8,98	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90	60,23	76,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
	Total		0,00	0,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 9.399.078,92

Value-At-Risk: 3,37%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PORTO FELIZ		3,37	3,37			279.052.650,92	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,79%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545		4,86	0,07	4,86			9.324.545,10	3,34
NTN-B 150535 (4,423526%)		0,25	-0,00	0,23			2.736.085,61	0,98
NTN-B 150535 (4,734998%)		0,25	-0,00	0,24			10.764.405,65	3,86
NTN-B 150535 (5,290003%)		0,19	-0,00	0,17			10.641.315,29	3,81
NTN-B 150535 (5,877000%)		0,19	-0,00	0,17			5.143.048,30	1,84
NTN-B 150555 (4,689998%)		0,19	-0,00	0,17			2.750.610,52	0,99
NTN-B 150555 (5,669994%)		0,19	-0,00	0,17			10.416.127,64	3,73
NTN-B 150555 (5,900000%)		0,19	-0,00	0,17			5.144.739,04	1,84
NTN-B 150830 (4,069994%)		0,19	-0,00	0,17			5.369.824,62	1,92
NTN-B 150830 (5,569998%)		0,19	-0,00	0,17			1.554.254,13	0,56
NTN-B 150840 (5,120004%)		0,19	-0,00	0,17			10.356.334,89	3,71
NTN-B 150840 (5,171997%)		0,19	-0,00	0,17			10.519.955,97	3,77
NTN-B 150840 (5,481000%)		0,19	-0,00	0,17			5.074.125,69	1,82
NTN-B 150840 (5,792100%)		0,19	-0,00	0,17			19.905.561,50	7,13
Sub-total	0,83	0,44	0,06		-0,90	0,32	109.700.933,95	39,31

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF M		1,67	0,00	0,02			232.394,44	0,08
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI		1,17	0,03	0,01			15.289.803,43	5,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,18	0,00	0,01			1.436.497,71	0,51
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,44	0,05	0,05			12.890.420,58	4,62
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,46	0,06	0,06			14.166.284,67	5,08
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,14	0,04	0,04			21.918.094,63	7,85
BB PREV RF IPCA		0,99	0,00	1,00			3.087.010,61	1,11
Sub-total	3,36	1,55	0,17		-0,07	0,83	69.020.506,07	24,73

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,00			3.196.198,87	1,15
SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,01	-0,00	0,01			7.715.074,73	2,76
Sub-total	0,03	0,01	-0,00		0,45	1,08	10.911.273,60	3,91

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,24%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		12,40	1,15	3,35			28.077.329,75	10,06
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		10,63	0,80	0,15			24.349.334,37	8,73
Sub-total	24,72	11,24	1,95		-0,07	-0,78	52.426.664,12	18,79

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 13,40%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		13,40	0,82	7,87			19.944.478,75	7,15
Sub-total	24,81	13,40	0,82		-0,39	-8,62	19.944.478,75	7,15

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 11,01%

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		11,01	0,36	2,09			17.048.794,43	6,11
Sub-total	20,19	11,01	0,36		-0,44	-7,72	17.048.794,43	6,11