



LDB
EMPRESAS

HOLAMBRA
NOVIEMBRE 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 30.11.2021.

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

97,81%

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-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,62	0,77	1,78	8.193.107,63	10,24	7.084.325.912,32	0,12
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,86	3,44	-1,71	12.746.457,53	15,94	7.086.428.606,24	0,18
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,84	3,44	-1,74	3.245.959,17	4,06	4.821.319.332,60	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,62	0,78	1,84	2.124.504,86	2,66	6.377.941.010,36	0,03
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,62	0,78	1,79	2.371.369,61	2,97	627.194.535,73	0,38
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,76	2,47	3,52	2.166.710,84	2,71	11.929.906.744,63	0,02
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,57	2,43	3,91	13.238.612,21	16,55	9.400.574.561,59	0,14
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	9,16	4,44	-6,47	1.813.670,31	2,27	994.051.545,66	0,18
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,75	2,48	3,56	2.375.185,24	2,97	1.116.384.945,96	0,21
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,36	0,91	-0,93	1.427.690,91	1,79	13.063.702.370,09	0,01
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,63	2,36	0,39	49.703.268,31	62,15		

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
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,12	0,57	3,52	2.803.709,74	3,51	9.224.307.985,11	0,03
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,14	0,64	4,10	5.121.158,82	6,40	3.516.484.081,03	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,13	0,59	0,99	5.049.687,23	6,31	8.445.398.597,24	0,06
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	6,00	3,40	-2,50	695.550,20	0,87	1.008.373.423,94	0,07
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	5,87	3,46	-1,68	3.235.437,68	4,05	1.115.095.105,78	0,29
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,13	0,63	3,79	7.547.400,65	9,44	6.797.782.473,23	0,11
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,91	2,47	2,87	492.631,63	0,62	1.234.041.082,90	0,04
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	2,79	1,45	-0,93	1.014.182,14	1,27	1.191.144.678,26	0,09
GRAPHEN	RJI	LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	2,31	-0,72	-2,95	1.487.986,31	1,86	68.902.654,54	2,16
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			3,14	1,00	-0,24	27.447.744,40	34,32		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º VII, Alínea a (Cota Sênior de FIDC)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	2,95	0,66	-0,94	1.072.439,32	1,34	71.175.905,32	1,51
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			2,95	0,66	-0,94	1.072.439,32	1,34		
Renda Fixa			3,38	1,86	0,26	78.223.452,03	97,81		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,19%

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO FI LP	1,30	0,54	2,34	1.753.589,25	2,19	308.006.119,23	0,57
Sub-total Artigo 8º III			1,30	0,54	2,34	1.753.589,25	2,19		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			1,30	0,54	2,34	1.753.589,25	2,19		
Total			3,32	1,83	0,30	79.977.041,28	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 b	Fundos 100% Títulos Públicos	49.703.268,31	62,15	0,00	76,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	27.447.744,40	34,32	0,00	20,00	40,00	0,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	1.072.439,32	1,34	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	78.223.452,03	97,81					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	1.753.589,25	2,19	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	1.753.589,25	2,19					30,00

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 b % do CDI	2,36 401,99	0,39 10,76	1,02 67,24	0,45 17,30	3,33 88,25	1.149.241,85	202.759,50
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,00 170,71	-0,24 -6,67	0,99 65,57	0,41 15,59	2,57 68,02	272.191,10	10.230,66
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	0,66 112,29	-0,94 -26,07	1,16 76,57	1,31 49,90	-0,46 -12,27	7.019,49	-10.173,69
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,54 2,07	2,34 16,71	0,78 14,98	1,27 20,52	3,47 9,87	9.348,30	40.105,20
HOLAMBRA (Total)						1.437.800,74	242.921,67

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IDKA2	12.924.649,07	0,00	0,00	0,00	13.238.612,21	313.963,14	498.378,98
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12.322.519,81	0,00	0,00	0,00	12.746.457,53	423.937,72	-203.343,68
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	1.736.598,56	0,00	0,00	0,00	1.813.670,31	77.071,75	-260.923,74
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	7.738.992,10	428.684,23	-36.818,99	0,00	8.193.107,63	62.250,29	127.489,44
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	2.353.077,06	0,00	0,00	0,00	2.371.369,61	18.292,55	41.743,07
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.448.830,85	12.167,86	-352.940,16	0,00	2.166.710,84	58.652,29	107.653,18
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.149.886,24	0,00	-12.167,86	0,00	3.245.959,17	108.240,79	-161.119,45
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.108.060,57	0,00	0,00	0,00	2.124.504,86	16.444,29	4.218,77
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1.414.873,06	0,00	0,00	0,00	1.427.690,91	12.817,85	-32.919,62
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2.317.614,06	0,00	0,00	0,00	2.375.185,24	57.571,18	81.582,55
					49.703.268,31	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 IMA-B	3.127.224,35	0,00	0,00	0,00	3.235.437,68	108.213,33	-129.700,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.498.456,07	1.655,32	0,00	0,00	7.547.400,65	47.289,26	86.693,27
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	2.787.861,53	0,00	0,00	0,00	2.803.709,74	15.848,21	64.160,41
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	5.088.647,61	0,00	0,00	0,00	5.121.158,82	32.511,21	126.346,05
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	999.639,38	0,00	0,00	0,00	1.014.182,14	14.542,76	-24.761,00
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	480.734,31	0,00	0,00	0,00	492.631,63	11.897,32	13.758,11
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	672.666,04	0,00	0,00	0,00	695.550,20	22.884,16	-59.572,93
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.019.860,92	0,00	0,00	0,00	5.049.687,23	29.826,31	49.687,23
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.498.807,77	0,00	0,00	0,00	1.487.986,31	-10.821,46	-45.285,29
					27.447.744,40	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1.065.419,83	0,00	0,00	0,00	1.072.439,32	7.019,49	-10.173,69
					1.072.439,32	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	1.744.240,95	0,00	0,00	0,00	1.753.589,25	9.348,30	40.105,20
					1.753.589,25	0,00	0,00

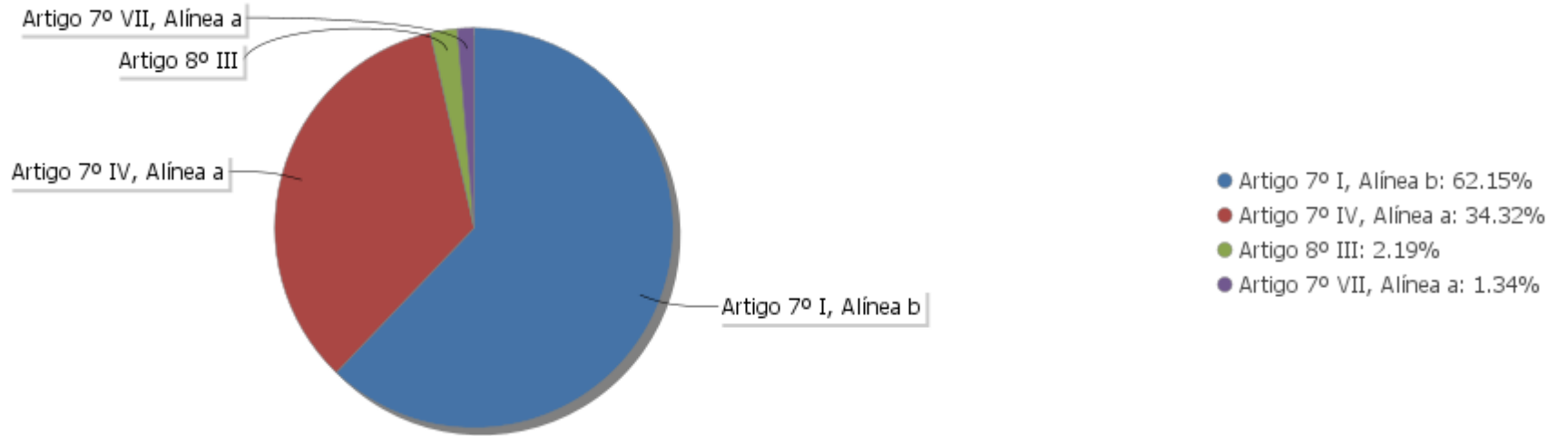
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

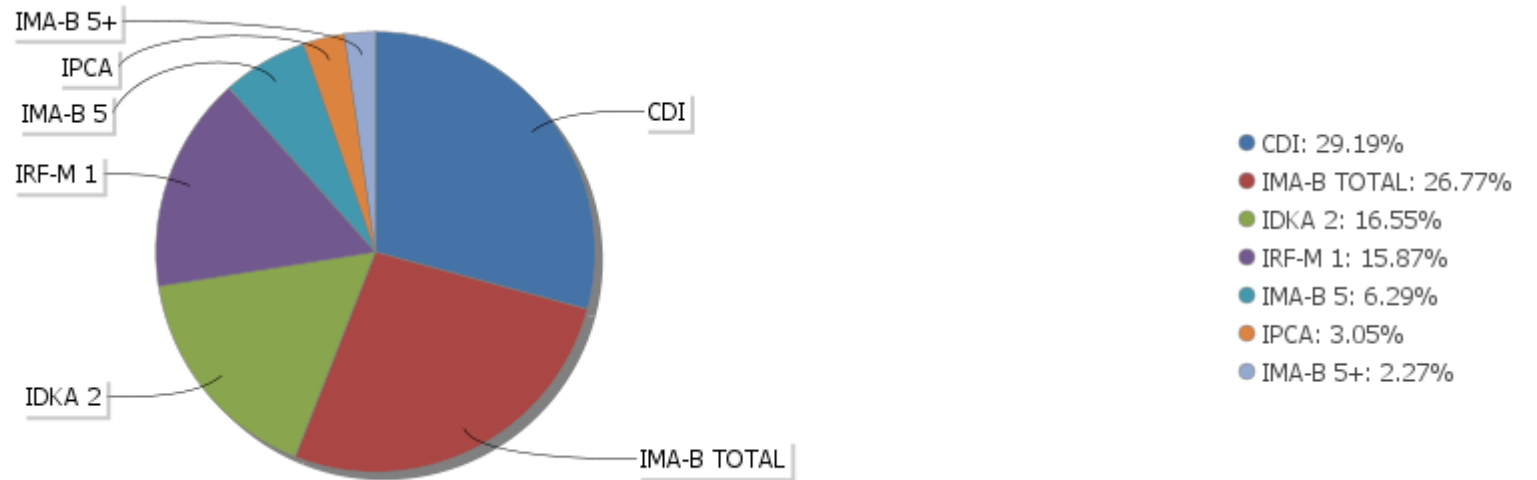
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	78.489.054,97	98,14	78.489.054,97	98,14
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	78.489.054,97	98,14
acima de 365 dias	1.487.986,31	1,86	79.977.041,28	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

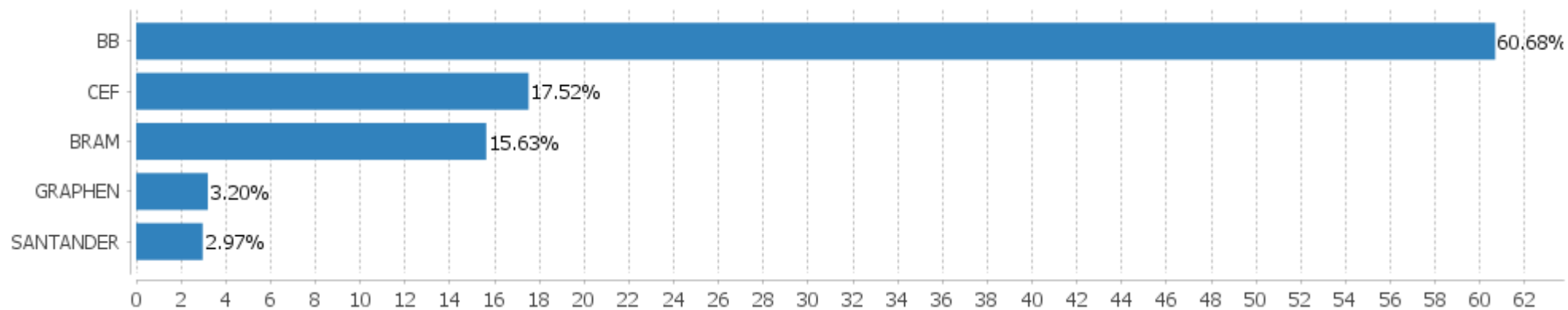


Alocação Por Estratégia



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	-0,40	-0,96	-0,15	0,60	0,73	0,23	-0,18	-0,59	0,19	-0,96	1,83		0,30
IPCA + 5,89%	0,71	1,27	1,46	0,77	1,31	1,01	1,47	1,38	1,64	1,71	1,41		15,07
p.p. indexador	-1,10	-2,23	-1,61	-0,17	-0,58	-0,78	-1,65	-1,96	-1,46	-2,67	0,42		-14,77
2020	0,34	0,42	-3,58	0,77	1,31	1,28	2,29	-0,74	-0,80	0,16	1,32	2,83	5,58
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,65
p.p. indexador	-0,37	-0,24	-4,15	0,63	1,23	0,54	1,41	-1,46	-1,92	-1,18	-0,03	0,98	-5,06
2019	1,30	0,44	0,54	0,92	1,53	1,62	0,95	-0,04	1,82	2,02	-1,07	1,27	11,86
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	0,46	-0,46	-0,65	-0,14	0,89	1,17	0,23	-0,66	1,37	1,39	-2,04	-0,37	1,27
2018	1,05	0,52	0,97	0,44	-0,69	0,36	1,07	1,13	0,63	2,13	0,42	0,91	9,28
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	0,25	-0,22	0,39	-0,26	-1,58	-1,40	0,23	0,69	-0,29	1,17	0,16	0,29	-0,64

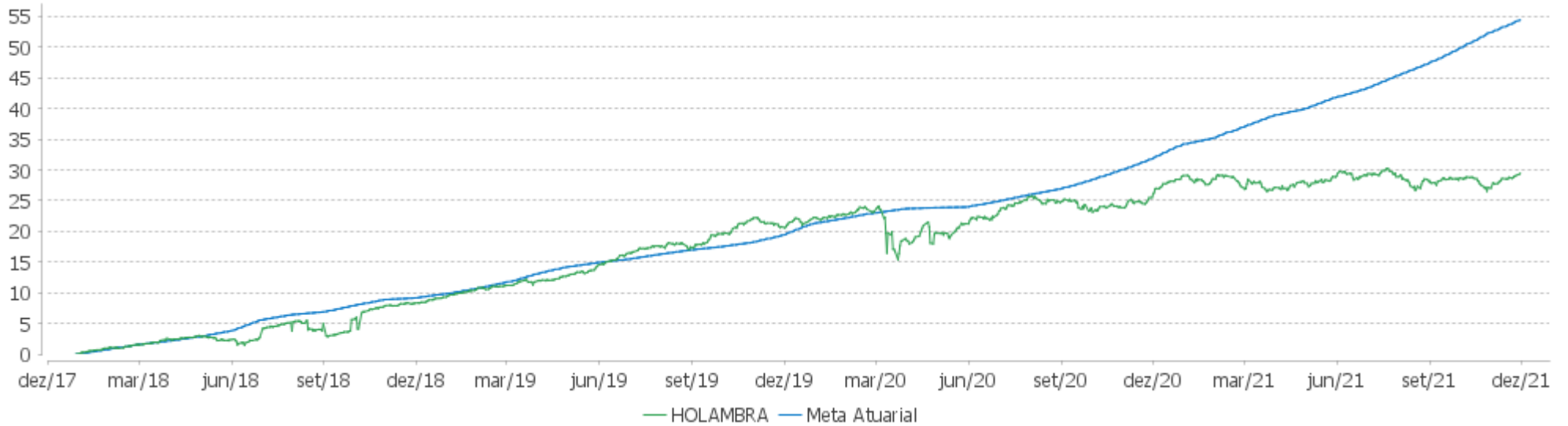
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

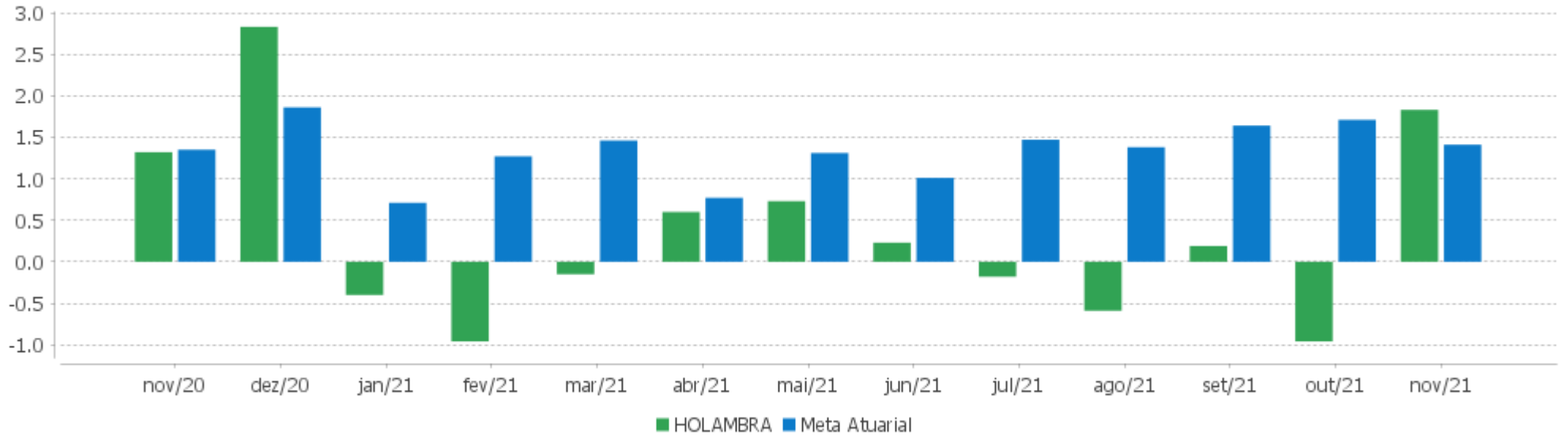
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	19	40,43	03 meses	1,03	4,84	-3,80	3,07
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	59,57	06 meses	0,49	8,93	-8,44	3,32
			12 meses	3,14	17,21	-14,06	3,32
			24 meses	7,25	29,41	-22,16	5,46
			36 meses	19,54	41,67	-22,13	4,59
Maior rentabilidade da Carteira	2,83	2020-12	Desde 29/12/2017	29,45	54,77	-25,32	4,80
Menor rentabilidade da Carteira	-3,58	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
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,44 -0,03	-1,74 -0,25	0,63 -0,07	-0,51 -0,16	3,02 -0,28	6,30 -0,63	29,85 -1,16
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	2,48 -0,02	3,56 -0,19	2,20 -0,05	2,18 -0,11	5,43 -0,22	13,03 -0,45	27,77 -0,80
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	2,47 -0,03	3,52 -0,23	2,19 -0,06	2,18 -0,12	5,40 -0,25	12,88 -0,59	27,61 -0,95
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	2,43 -0,08	3,91 -0,20	2,19 0,08	2,36 0,48	5,50 -0,42	13,43 -1,01	26,22 -1,81
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,78 -0,01	1,79 -0,24	0,62 -0,03	1,37 -0,05	2,12 -0,23	5,75 -0,65	12,76 -0,98
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,77 -0,02	1,78 -0,25	0,62 -0,03	1,30 -0,12	2,10 -0,25	5,73 -0,67	12,75 -0,99
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,91 -0,04	-0,93 -10,19	0,59 -2,80	-1,64 -7,49	0,38 -10,36	6,30 -9,21	24,67 5,38
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,44 -0,03	-1,71 -0,23	0,61 -0,09	-0,53 -0,18	3,04 -0,26	6,38 -0,55	30,01 -1,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,78 -0,01	1,84 -0,20	0,62 -0,03	1,32 -0,10	2,13 -0,22	5,96 -0,44	13,06 -0,69
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	4,44 -0,04	-6,47 -0,24	-0,97 -0,13	-3,20 -0,22	0,52 -0,29	0,94 -0,56	30,14 -1,24
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,40 -0,06	-2,50 -1,01	0,46 -0,24	-0,71 -0,36	2,32 -0,97	5,73 -1,20	29,50 -1,50
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	2,47 -0,03	2,87 -0,88	2,12 -0,13	2,04 -0,26	4,70 -0,95	12,32 -1,16	27,00 -1,56
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,64 108,89	4,10 113,73	1,72 113,75	2,98 113,71	4,32 114,55	6,70 97,56	13,06 97,60
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,46 -0,01	-1,68 -0,19	0,65 -0,05	-0,46 -0,11	3,05 -0,25	6,23 -0,70	29,65 -1,36
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA % do CDI	0,57 96,88	3,52 97,63	1,53 101,21	2,66 101,47	3,73 98,95	6,37 92,74	12,65 94,56
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,63 107,47	3,79 105,29	1,59 104,89	2,78 106,16	4,06 107,46	6,66 96,93	12,91 96,50
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,59	3,53	1,55	2,67	3,80	6,48	12,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	101,26	98,06	102,67	101,87	100,61	94,23	96,35
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,72 -4,19	-2,95 -1,47	-1,46 -2,16	-2,63 -2,28	-1,95 -5,24	-4,47 -11,39	7,60 -23,41
BRANCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA Var. IPCA p.p.	1,45 0,50	-0,93 -10,19	0,57 -2,82	0,20 -5,66	1,53 -9,21	4,57 -10,95	18,02 -1,28
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	0,66 112,29	-0,94 -26,07	1,16 76,57	1,31 49,90	-0,46 -12,27	-6,02 -87,53	-4,83 -36,08
BB PREV MULTIMERCADO FI LP % do CDI	0,54 91,34	2,34 64,94	0,78 51,64	1,27 48,48	3,47 91,84	5,22 75,88	14,32 106,99
HOLAMBRA Var. IPCA + 5,89% p.p.	1,83 0,42	0,30 -14,77	1,03 -3,80	0,49 -8,44	3,14 -14,06	7,25 -22,15	19,54 -21,98
CDI	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38
IBOVESPA	-1,53	-14,37	-14,20	-19,25	-6,41	-5,84	13,87
INPC + 6,00%	1,31	15,28	4,70	8,96	17,56	31,03	43,57
IPCA + 6,00%	1,42	15,18	4,87	8,99	17,33	29,67	41,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	D+0	D+0	D+0	D+4 du	0,00	0,60
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IMA-B	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,30
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+2 du	D+2 du	0,00	0,20
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,10
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,15
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	D+0	D+0	D+3 du	D+4 du		0,40
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,40
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	D+0	D+0				
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1008 du	D+1009 du	20.000000000000 PERÍODO SEMESTRAL,C /VENCIMENTO NO ÚLTIMO DIA ÚTIL DE DEZEMBRO E JUNHO.	0,00
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,10

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	0,79	2,03	0,65	1,42	2,35	6,40	13,74	21,69	36,07
IRF-M 1+	2,19	-7,11	-2,04	-3,73	-4,28	1,46	17,30	31,09	53,93
IRF-M TOTAL	1,79	-3,81	-1,21	-2,06	-1,93	3,27	16,74	28,91	49,37
IMA-B 5	2,50	3,75	2,25	2,30	5,65	13,47	28,56	40,58	59,06
IMA-B 5+	4,47	-6,23	-0,84	-2,98	0,81	1,50	31,39	50,00	74,04
IMA-B TOTAL	3,47	-1,49	0,70	-0,35	3,30	6,93	31,01	46,92	69,13
IMA-GERAL TOTAL	1,80	0,09	0,46	0,31	2,12	6,38	20,34	32,04	50,44
IDKA 2	2,51	4,11	2,12	1,88	5,91	14,44	28,04	40,40	59,70
IDKA 20	6,09	-12,50	-3,62	-8,23	-2,56	-7,04	31,71	56,52	86,71
CDI	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38	20,72	33,50

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-1,53	-14,37	-14,20	-19,25	-6,41	-5,84	13,87	41,61	64,63
IBRX 100	-1,69	-13,88	-14,79	-20,36	-6,00	-4,38	17,37	45,94	70,57
IBRX 50	-1,81	-13,79	-14,84	-20,46	-5,66	-4,80	12,95	40,34	62,89
SMALL CAP	-2,29	-19,26	-20,02	-26,60	-13,19	-9,64	29,55	46,85	103,82
IFIX	-3,64	-10,16	-6,23	-8,45	-8,19	-10,79	12,08	16,51	40,35
Índice Consumo - ICON	-7,50	-26,09	-21,46	-28,01	-22,40	-19,51	15,50	11,72	36,98
Índice Dividendos - IDIV	0,89	-7,89	-7,71	-11,70	0,34	0,29	33,23	61,08	90,61

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	0,95	9,26	3,40	5,86	10,74	15,51	19,30	24,12	27,60
INPC	0,84	9,36	3,23	5,84	10,96	16,73	20,66	24,95	27,38
IGPM	0,02	16,77	0,02	2,08	17,89	46,79	52,62	67,39	65,94
SELIC	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38	20,73	33,53

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	-1,24	31,49	10,34	16,68	32,92	93,45	140,69	197,22	243,65
MSCI ACWI	-2,91	21,57	7,09	9,69	23,86	76,81	115,31	147,67	190,75
MSCI World									

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,26	13,21	4,38	7,95	15,13	24,86	34,11	45,07	55,08
IPCA + 5,00%	1,34	14,19	4,63	8,47	16,23	27,25	37,99	50,70	62,64
IPCA + 5,50%	1,38	14,69	4,75	8,73	16,78	28,46	39,96	53,57	66,52
IPCA + 5,89%	1,41	15,07	4,84	8,93	17,21	29,40	41,51	55,84	69,61
IPCA + 6,00%	1,42	15,18	4,87	8,99	17,33	29,67	41,95	56,48	70,48
INPC + 4,00%	1,15	13,31	4,22	7,93	15,36	26,17	35,64	46,04	54,81
INPC + 6,00%	1,31	15,28	4,70	8,96	17,56	31,03	43,57	57,53	70,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
131	08/11/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	425.504,58	0,00	154.339,60748600	2,7569370360
132	10/11/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	3.179,65	0,00	1.152,54174200	2,7588154790
133	10/11/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	11.941,72	4.328,56785500	2,7588154790
130	12/11/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	17.501,82	6.334,82547800	2,7627943440
134	12/11/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	2.834,08	1.025,80201300	2,7627943440
135	17/11/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	4.541,37	1.643,13240600	2,7638490870
136	17/11/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.655,32	0,00	694,79800200	2,3824478400
137	25/11/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	352.940,16	106.129,57631100	3,3255590000
139	25/11/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	12.167,86	3.377,58181600	3,6025360000
138	29/11/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12.167,86	0,00	3.643,64240200	3,3394770000

Total

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 945.344,97

Value-At-Risk: 1,18%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
HOLAMBRA		1,18	1,18			79.977.041,28	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,20%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,59	0,04	0,03			8.193.107,63	10,24
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,74	0,43	0,04			12.746.457,53	15,94
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,71	0,11	0,02			3.245.959,17	4,06
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,59	0,01	0,02			2.124.504,86	2,66
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS		0,59	0,01	0,02			2.371.369,61	2,97
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,51	0,04	0,03			2.166.710,84	2,71
BB PREV RF IDKA2		1,34	0,21	0,61			13.238.612,21	16,55
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		4,03	0,09	0,20			1.813.670,31	2,27
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,54	0,04	0,01			2.375.185,24	2,97
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,46	0,02	1,46			1.427.690,91	1,79
Sub-total	3,76	1,60	1,00		0,47	2,36	49.703.268,31	62,15

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA		0,03	0,00	0,01			2.803.709,74	3,51
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,07	-0,00	0,06			5.121.158,82	6,40
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,04	0,00	0,02			5.049.687,23	6,31
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B		2,92	0,02	0,30			695.550,20	0,87
BB PREV RF IMA-B		2,76	0,11	0,06			3.235.437,68	4,05
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,05	0,00	0,03			7.547.400,65	9,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5		1,55	0,01	0,04			492.631,63	0,62
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA		1,34	0,02	1,35			1.014.182,14	1,27
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA		1,60	0,02	2,29			1.487.986,31	1,86
Sub-total	1,15	0,53	0,18		0,36	1,00	27.447.744,40	34,32

Artigo 7º VII, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC		0,05	-0,00	0,06			1.072.439,32	1,34
Sub-total	2,33	0,05	-0,00		0,03	0,66	1.072.439,32	1,34

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,65%

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV MULTIMERCADO FI LP		0,65	0,01	0,65			1.753.589,25	2,19
Sub-total	1,57	0,65	0,01		-0,03	0,54	1.753.589,25	2,19