



LDB
EMPRESAS

HORTOLÂNDIA
OUTUBRO 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 29.10.2021.

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 78,48%

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 150824	3,85	-1,48	-0,42	34.780.399,44	5,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	9,34	-4,38	-10,35	15.041.323,14	2,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,020001%)	3,74	0,95	0,95	46.435.859,15	7,38
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		4,08	-0,55	3,21	96.257.581,73	15,29

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	0,58	-0,52	1,00	68.022.145,98	10,81	6.857.913.148,95	0,99
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,61	-2,58	-4,98	68.807.359,40	10,93	6.948.438.281,62	0,99
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,65	-1,29	1,46	97.476.942,56	15,49	11.036.712.361,17	0,88
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,84	-1,63	-2,98	47.029.513,83	7,47	7.937.028.591,03	0,59
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,40	-0,66	-1,82	60.055.292,87	9,54	13.374.488.418,39	0,45
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,60	-1,34	-1,64	341.391.254,64	54,24		

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
QUELUZ	ORLA	BRA1 FI RENDA FIXA	1,42	-0,99	-2,65	437.203,21	0,07	10.482.476,66	4,17
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,95	-0,36	1,96	48.082.426,11	7,64	2.956.661.982,44	1,63
VERITAS	RJI	FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	44,81	-0,01	-40,42	603.383,45	0,10	91.993.709,69	0,66
GRAPHEN	RJI	LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	2,28	-0,38	-2,25	3.662.909,84	0,58	69.403.753,05	5,28
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,16	-0,36	0,74	52.785.922,61	8,39		

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	2,89	0,01	-1,59	1.806.706,20	0,29	71.175.905,32	2,54
FINAXIS	FINAXIS	FIDC PREMIUM	3,50	-0,17	-5,03	1.681.897,35	0,27	81.898.860,94	2,05
BRPP	BRPP	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
BRPP	GENIAL	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4.957,59	0,00
BRPP	GENIAL	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	7.125,27	0,00
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			2,26	-0,08	-3,28	3.488.603,55	0,55		
Renda Fixa			2,50	-1,09	-0,52	493.923.362,53	78,48		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

16,52%

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
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	19,39	-6,61	-8,04	46.688.889,96	7,42	1.454.533.508,81	3,21
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	19,98	-8,24	-16,79	24.722.818,02	3,93	230.759.980,78	10,71
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,04	-7,54	-8,06	26.002.704,28	4,13	2.833.533.744,77	0,92
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			18,27	-7,28	-12,12	97.414.412,26	15,48		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GRAPHEN	ORLA	LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	0,19	-0,43	-4,00	221.101,39	0,04	1.565.840,52	14,12
Sub-total Artigo 8º III			0,19	-0,43	-4,00	221.101,39	0,04		

Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRPP	BNY MELLON	GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	93,17	-0,31	144,31	532.628,55	0,08	19.624.814,12	2,71
QUELUZ	BNY MELLON	BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	0,40	-0,11	-1,07	1.514.614,00	0,24	27.978.870,59	5,41
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			17,23	-0,16	17,04	2.047.242,55	0,33		

Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	10,21	-6,27	-7,90	2.020.600,00	0,32	1.322.246.699,64	0,15
QUELUZ	PLANNER	VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	59,99	-1,33	0,63	838.357,41	0,13	31.376.185,18	2,67
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BRCR11	14,78	-8,34	-19,85	218.196,12	0,03	2.861.919.636,26	0,01
AQUILLA	ÍNDIGO	ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	52,68	0,57	-41,53	1.192.886,26	0,19	87.671.937,45	1,36
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			25,69	-3,65	-15,47	4.270.039,79	0,68		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

17,14

-6,99

-11,76

103.952.795,99

16,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,01%

Artigo 9º A, II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21,03	7,38	-0,50	14.924.876,59	2,37	1.633.422.031,43	0,91
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	19,23	7,56	29,42	16.578.494,39	2,63	299.258.149,20	5,54
Sub-total Artigo 9º A, II			17,79	7,47	23,90	31.503.370,98	5,01		
Investimentos no Exterior			17,79	7,47	23,90	31.503.370,98	5,01		
Total			4,30	-1,71	-2,06	629.379.529,50	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	96.257.581,73	15,29	5,00	10,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	341.391.254,64	54,24	10,00	52,50	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	52.785.922,61	8,39	0,00	10,00	40,00	0,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	3.488.603,55	0,55	0,00	0,50	3,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	493.923.362,53	78,48					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	97.414.412,26	15,48	5,00	17,50	20,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	221.101,39	0,04	0,00	0,50	5,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	2.047.242,55	0,33	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	4.270.039,79	0,68	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	103.952.795,99	16,52					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	31.503.370,98	5,01	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	31.503.370,98	5,01					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	-0,55 -113,77	3,21 106,97	-1,17 -86,94	-0,51 -22,28	7,87 236,72	-772.361,40	2.226.965,03
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-1,34 -278,42	-1,64 -54,52	-1,34 -99,15	-1,00 -43,75	1,48 44,59	-4.596.192,89	-5.246.648,55
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,36 -74,60	0,74 24,80	-0,26 -18,95	0,39 17,23	1,11 33,49	-189.983,28	391.016,51
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-0,08 -15,71	-3,28 -109,20	-0,18 -13,64	-1,80 -78,67	-3,03 -91,32	-2.634,98	-118.150,78
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-7,28 -0,54	-12,12 0,91	-16,12 -1,09	-14,24 -1,29	5,57 -4,60	-7.647.047,05	-12.724.803,00
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,43 6,31	-4,00 9,04	-1,24 13,79	-2,42 10,53	-4,74 -14,90	-962,46	-9.204,19
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,16 6,58	17,04 30,08	-0,47 14,56	17,78 30,72	16,29 6,12	-3.256,09	298.100,41
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-3,65 3,08	-15,47 -2,44	-17,49 -2,47	-15,16 -2,21	-13,44 -23,60	-162.727,99	-750.379,65
Artigo 9º A, II % do CDI	7,47 1.555,95	23,90 796,73	10,50 778,55	7,91 345,25		2.191.009,39	2.263.031,80
HORTOLÂNDIA (Total)						-11.184.156,75	-13.670.072,42

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	15.730.011,01	0,00	0,00	0,00	15.041.323,14	-688.687,87	-1.747.441,58
NTN-B 150824	35.302.295,31	0,00	0,00	0,00	34.780.399,44	-521.895,87	-152.290,32
NTN-B 150840 (5,020001%)	0,00	45.997.636,81	0,00	0,00	46.435.859,15	438.222,34	438.222,34
					96.257.581,73	0,00	0,00

Artigo 7º I, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	47.807.014,78	0,00	0,00	0,00	47.029.513,83	-777.500,95	-1.445.975,30
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	70.631.202,66	0,00	0,00	0,00	68.807.359,40	-1.823.843,26	-3.608.839,96
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	112.137.063,13	8.700.000,00	-52.495.952,19	0,00	68.022.145,98	-318.964,96	1.129.290,90
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	98.753.079,41	0,00	0,00	0,00	97.476.942,56	-1.276.136,85	961.088,82
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	60.455.039,74	0,00	0,00	0,00	60.055.292,87	-399.746,87	-1.136.886,26
					341.391.254,64	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRA1 FI RENDA FIXA	441.591,69	0,00	0,00	0,00	437.203,21	-4.388,48	-14.017,38
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	623.118,74	0,00	0,00	19.676,89	603.383,45	-58,40	-435.123,35
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	48.253.872,14	0,00	0,00	0,00	48.082.426,11	-171.446,03	924.382,77
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.677.000,21	0,00	0,00	0,00	3.662.909,84	-14.090,37	-84.225,53
					52.785.922,61	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC PREMIUM	1.684.764,18	0,00	0,00	0,00	1.681.897,35	-2.866,83	-88.995,11
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
LEME MULTISETORIAL IPCA FIDC	1.806.474,35	0,00	0,00	0,00	1.806.706,20	231,85	-29.155,67
					3.488.603,55	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	49.996.045,58	0,00	0,00	0,00	46.688.889,96	-3.307.155,62	-3.731.878,95
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	26.943.291,51	0,00	0,00	0,00	24.722.818,02	-2.220.473,49	-4.987.927,44
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	28.122.122,22	0,00	0,00	0,00	26.002.704,28	-2.119.417,94	-2.279.512,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					97.414.412,26	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	222.063,85	0,00	0,00	0,00	221.101,39	-962,46	-9.204,19
					221.101,39	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	1.516.236,69	0,00	0,00	0,00	1.514.614,00	-1.622,69	-16.437,33
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	534.261,95	0,00	0,00	0,00	532.628,55	-1.633,40	314.616,50
					2.047.242,55	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRCR11	239.522,34	0,00	0,00	0,00	1.493,16	218.196,12	-19.833,06	-54.629,35
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	2.155.800,00	0,00	0,00	0,00	0,00	2.020.600,00	-135.200,00	-174.600,00
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	1.093.590,41	0,00	0,00	0,00	240.739,36	838.357,41	-14.493,64	326.249,40
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	1.186.087,55	0,00	0,00	0,00	0,00	1.192.886,26	6.798,71	-847.399,70
						4.270.039,79	0,00	0,00

Artigo 9º A, II

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	13.899.292,45	0,00	0,00	0,00	14.924.876,59	1.025.584,14	-75.123,41
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	15.413.069,14	0,00	0,00	0,00	16.578.494,39	1.165.425,25	2.338.155,21
					31.503.370,98	0,00	0,00

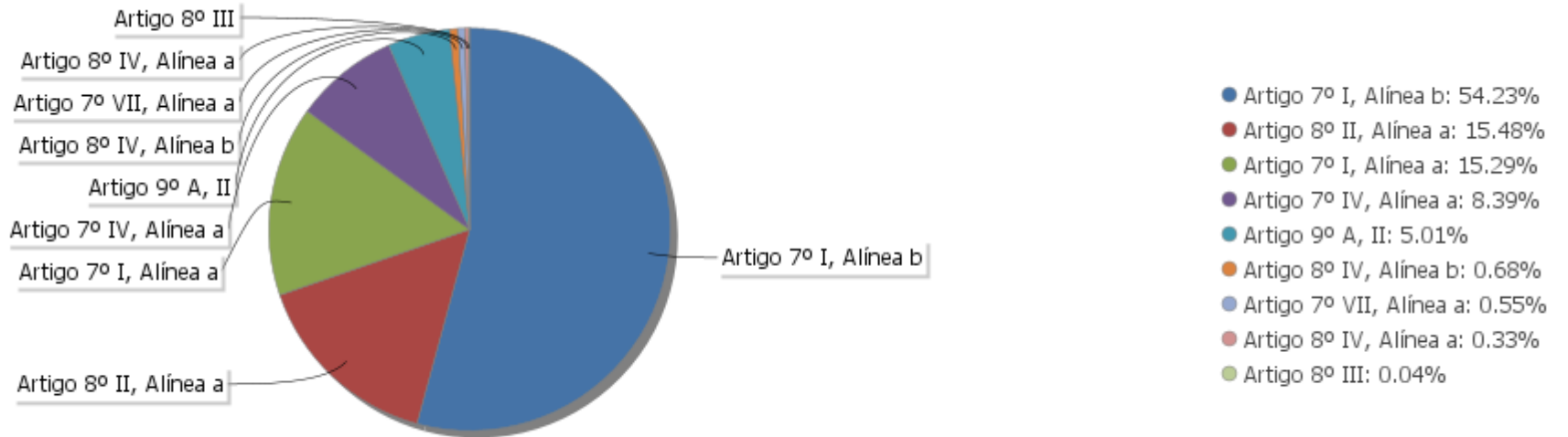
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

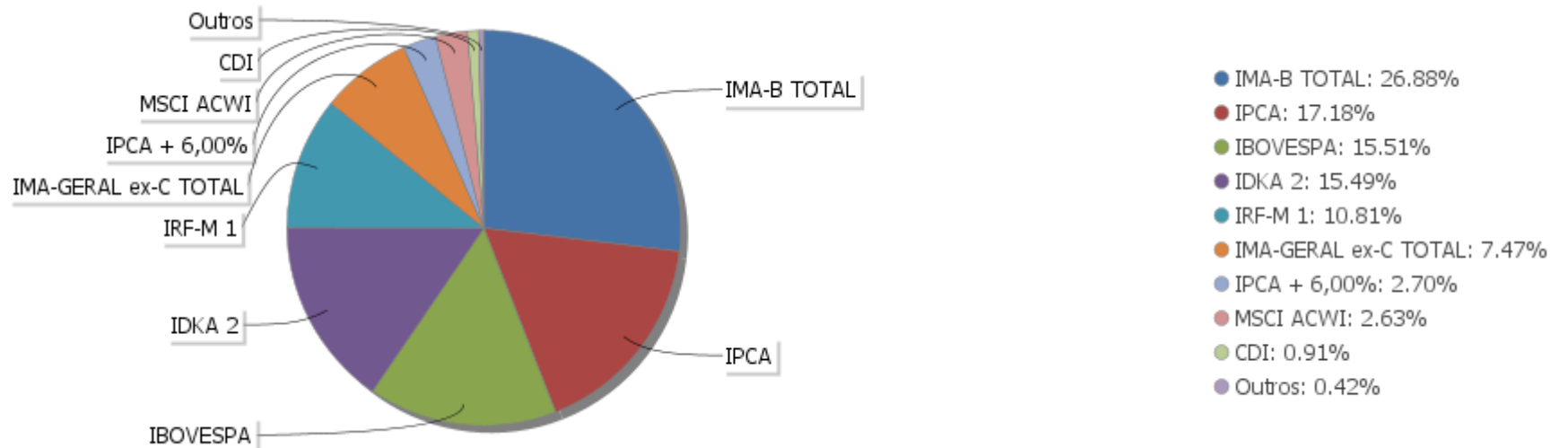
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	498.363.903,32	79,18	498.363.903,32	79,18
de 31 a 365 dias	26.002.704,28	4,13	524.366.607,60	83,31
acima de 365 dias	105.012.921,90	16,69	629.379.529,50	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

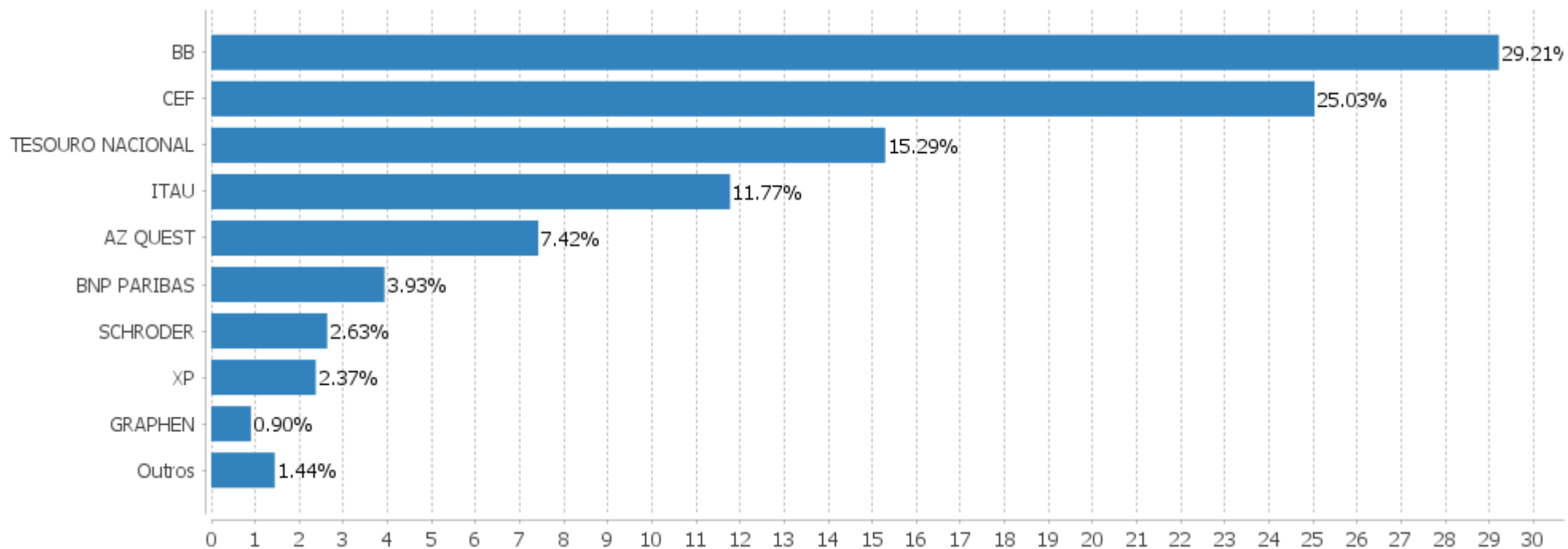


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

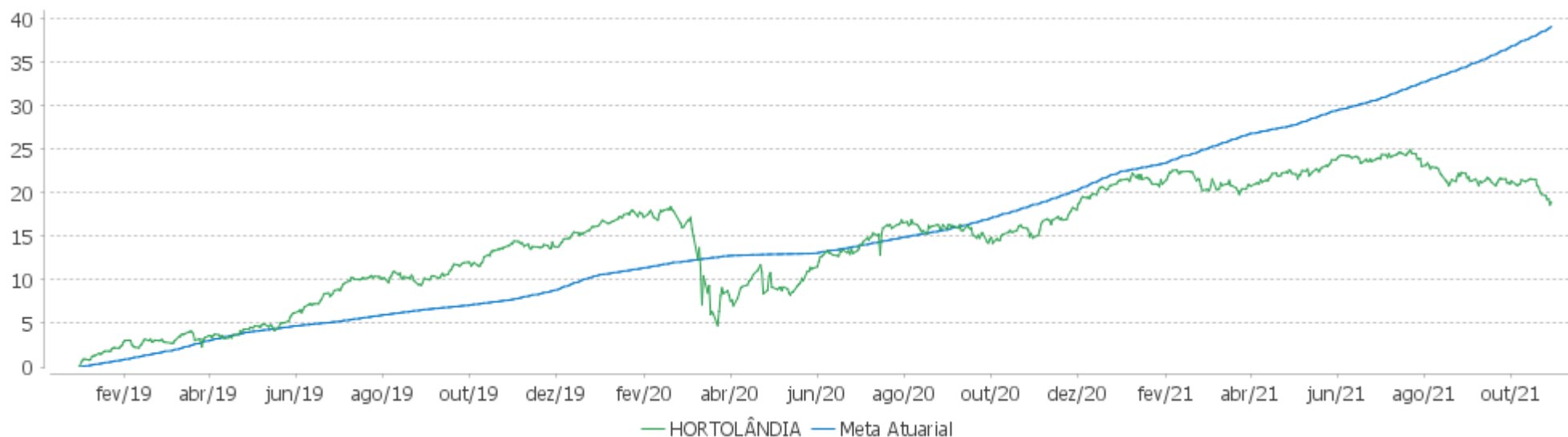
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,37	-0,60	0,51	1,09	1,28	0,17	-0,77	-1,12	-0,53	-1,71			-2,06
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,67			13,05
p.p. indexador	-1,04	-1,84	-0,90	0,36	0,01	-0,80	-2,19	-2,46	-2,14	-3,38			-15,11
2020	0,74	-0,95	-6,76	0,85	2,01	1,95	2,67	-0,62	-1,01	0,15	2,81	2,88	4,40
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	0,03	-1,61	-7,33	0,71	1,94	1,21	1,79	-1,34	-2,13	-1,19	1,46	1,02	-6,22
2019	2,83	0,10	0,40	1,16	1,59	2,44	1,21	0,05	1,70	1,87	-0,25	2,19	16,35
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	2,00	-0,79	-0,79	0,10	0,95	1,99	0,49	-0,57	1,25	1,24	-1,23	0,55	5,76

Performance Sobre a Meta Atuarial
Relatório

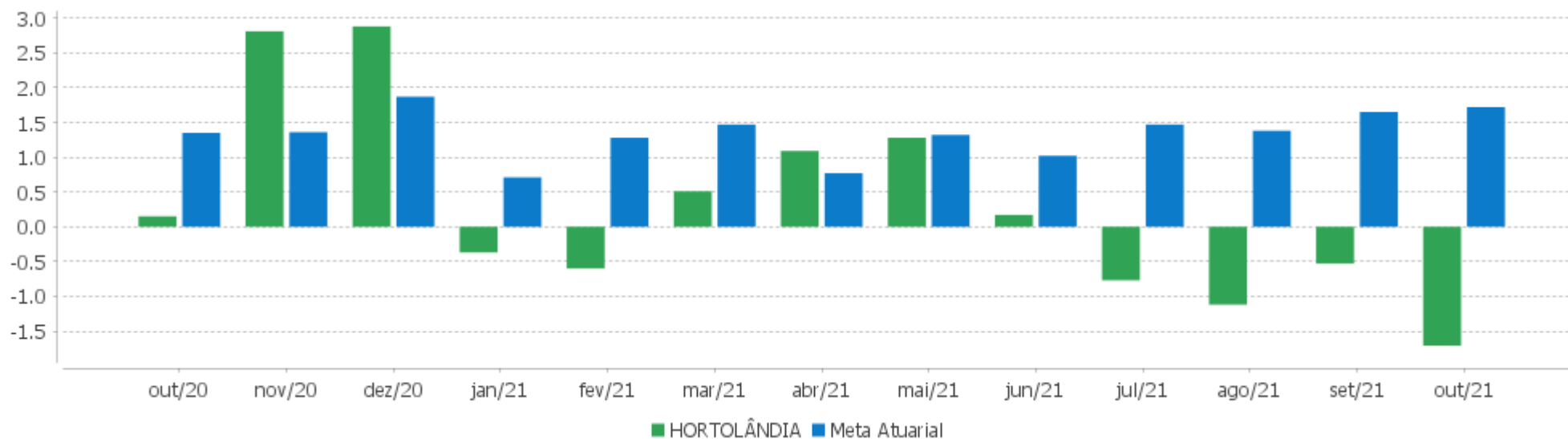
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	17	50,00	03 meses	-3,33	4,69	-8,02	4,27
Meses abaixo - Meta Atuarial	17	50,00	06 meses	-2,68	8,58	-11,25	4,01
			12 meses	3,59	16,70	-13,11	4,30
			24 meses	4,23	28,35	-24,13	7,64
Maior rentabilidade da Carteira	2,88	2020-12	Desde 31/12/2018	18,96	38,30	-19,34	6,70
Menor rentabilidade da Carteira	-6,76	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
BRA1 FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,99 1,55	-2,65 2,14	-0,70 3,04	-1,62 1,05	-1,75 -3,58	-45,91 -46,71	-68,28 -96,04
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	-0,36 -1,61	1,96 -6,28	0,79 -2,53	1,51 -4,22	2,27 -8,40	5,61 -9,40	20,03 2,10
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,38 2,16	-2,25 2,54	-2,14 1,59	-1,63 1,04	-0,75 -2,58	-4,93 -5,74	8,38 -19,38
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-0,01 1,23	-40,42 -41,64	-40,03 -39,93	-40,53 -41,02	-41,14 -45,57	-39,75 -50,14	-49,70 -75,30
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-1,63 -0,27	-2,98 -0,88	-2,07 -0,40	-1,74 -0,78	0,17 -0,50	1,97 -0,88	17,51 -0,37
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,66 -1,91	-1,82 -10,05	-1,75 -5,07	-2,29 -8,02	0,30 -10,38	4,82 -10,19	24,02 6,09
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	-0,52 0,02	1,00 -0,23	0,18 -0,05	0,70 -0,12	1,52 -0,26	5,24 -0,67	12,47 -1,00
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-1,29 0,17	1,46 -0,10	-0,03 0,09	0,46 0,21	4,40 -0,22	10,83 -0,83	23,45 -1,67
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,58 -0,04	-4,98 -0,20	-3,83 -0,10	-2,83 -0,15	1,60 -0,23	0,29 -0,52	26,82 -0,94
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-4,38 -1,83	-10,35 -5,56	-8,34 -4,60	-6,52 -3,85	-0,76 -2,59	-8,16 -8,97	26,05 -1,71
NTN-B 150824 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,48 1,07	-0,42 4,37	-0,51 3,23	-0,43 2,24	3,74 1,91	9,13 8,32	30,37 2,61
NTN-B 150840 (5,020001%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,42 3,97	6,96 11,74	1,65 5,39	4,99 7,67	9,96 8,12	13,45 12,65	16,11 -11,65
FIDC PREMIUM % do CDI	-0,17 -35,42	-5,03 -167,53	-0,65 -48,22	-4,36 -190,34	-5,31 -159,82	-9,94 -149,44	-18,20 -137,04
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3 % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-90,81 -1.364,94	-97,89 -737,25
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4 % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-90,81 -1.364,94	-97,89 -737,25
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2 % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-90,81 -1.364,94	-97,89 -737,25
LEME MULTISETORIAL IPCA FIDC	0,01	-1,59	0,25	0,71	-0,81	-6,80	-5,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	2,67	-52,94	18,83	30,80	-24,52	-102,18	-41,06
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,31 -2,03	144,31 130,74	-0,91 -5,74	148,54 139,66	137,37 120,12	-92,68 -121,79	-92,61 -132,93
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,11 -1,83	-1,07 -14,64	-0,31 -5,14	-0,61 -9,49	-1,38 -18,64	30,94 1,83	-22,00 -62,32
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-8,24 -1,50	-16,79 -3,75	-17,25 -2,22	-15,37 -2,42	3,37 -6,79	-8,42 -4,95	28,75 10,36
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,61 0,12	-8,04 4,99	-15,05 -0,03	-13,66 -0,72	9,74 -0,42	2,78 6,25	46,54 28,15
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	-7,54 -0,80	-8,06 4,98	-15,47 -0,45	-11,98 0,97	9,73 -0,44	-3,63 -0,16	30,82 12,43
BRCR11 Var. IBOVESPA p.p.	-8,34 -1,60	-19,85 -6,81	-15,53 -0,51	-18,60 -5,65	-16,85 -27,02	-18,26 -14,79	-11,78 -30,17
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII Var. IFIX p.p.	0,57 2,05	-41,53 -34,76	-40,29 -35,03	-40,75 -34,27	-41,93 -38,64	-39,95 -35,78	-48,70 -68,02
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII % do CDI	-6,27 -1.305,48	-7,90 -263,32	-10,70 -793,43	-3,44 -150,16	-8,56 -257,72	-15,09 -226,82	-88,19 -664,18
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII Var. IFIX p.p.	-1,33 0,15	0,63 7,41	1,98 7,23	-0,59 5,90	7,56 10,85	7,05 11,22	13,79 -5,53
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V % do CDI	-0,43 -90,22	-4,00 -133,23	-1,24 -91,67	-2,42 -105,62	-4,74 -142,55	-1,97 -29,62	1,29 9,73
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	7,56 -1,40	29,42 4,20	11,33 -2,05	12,03 1,14	36,11 3,87		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	7,38 5,66	13,32 -0,25	9,59 4,76	3,68 -5,20	17,60 0,34		
HORTOLÂNDIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,71 -3,43	-2,06 -15,63	-3,33 -8,16	-2,68 -11,56	3,59 -13,67	4,23 -24,88	
CDI	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28
IBOVESPA	-6,74	-13,04	-15,02	-12,95	10,16	-3,47	18,39
INPC + 6,00%	1,63	13,79	4,79	9,12	17,69	30,64	42,02
IPCA + 6,00%	1,72	13,57	4,83	8,88	17,26	29,10	40,32

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	-0,54	1,23	0,23	0,83	1,78	5,91	13,47	21,48	36,42
IRF-M 1+	-3,44	-9,10	-5,21	-5,61	-5,90	-1,54	16,13	28,17	50,67
IRF-M TOTAL	-2,63	-5,50	-3,53	-3,59	-3,30	0,99	15,83	26,75	47,22
IMA-B 5	-1,24	1,22	-0,10	0,49	4,43	10,39	25,61	37,29	55,80
IMA-B 5+	-3,87	-10,25	-7,19	-5,85	-1,01	-6,80	27,68	41,57	63,18
IMA-B TOTAL	-2,54	-4,79	-3,73	-2,67	1,83	0,81	27,76	40,92	61,47
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-1,35	-2,10	-1,67	-0,96	0,67	2,85	17,88	28,05	46,14
IMA-GERAL TOTAL	-1,31	-1,68	-1,71	-0,86	1,05	3,75	19,11	29,71	47,78
IDKA 2	-1,47	1,56	-0,12	0,25	4,62	11,66	25,12	37,32	56,68
IDKA 20	-6,31	-17,52	-13,17	-11,45	-5,06	-17,66	27,75	43,34	67,23
CDI	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28	20,70	34,10

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-6,74	-13,04	-15,02	-12,95	10,16	-3,47	18,39	39,29	59,42
IBRX 100	-6,81	-12,40	-16,15	-14,19	10,40	-1,79	22,56	43,44	64,83
IBRX 50	-6,27	-12,20	-16,31	-13,99	11,64	-2,23	17,51	38,33	58,04
SMALL CAP	-12,53	-17,37	-21,28	-20,14	3,62	-2,77	38,93	46,64	90,99
IFIX	-1,47	-6,78	-5,26	-6,48	-3,29	-4,17	19,32	20,19	41,88
Índice Consumo - ICON	-9,73	-20,10	-18,41	-17,11	-8,62	-10,39	29,95	16,52	35,92
Índice Dividendos - IDIV	-4,23	-8,71	-8,99	-7,55	13,78	1,74	41,65	49,00	84,75

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	1,25	8,24	3,32	5,73	10,67	15,01	17,92	23,30	26,63
INPC	1,16	8,45	3,27	5,96	11,08	16,38	19,35	24,13	26,41
IGPM	0,64	16,74	0,66	6,24	21,73	47,21	51,84	68,23	65,87
SELIC	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28	20,71	34,13

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	10,92	33,14	15,45	15,03	37,70	113,67	157,78	207,96	284,24
MSCI ACWI	8,97	25,22	13,38	10,89	32,23	96,53	133,44	158,41	221,64
MSCI World	9,54	28,15	13,97	12,82	35,37	100,32	138,32	168,41	233,05

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,57	11,80	4,33	7,84	15,06	24,32	32,57	44,11	53,90
IPCA + 5,00%	1,64	12,68	4,58	8,36	16,16	26,70	36,41	49,70	61,40
IPCA + 5,50%	1,68	13,13	4,71	8,62	16,71	27,90	38,35	52,55	65,25
IPCA + 5,89%	1,71	13,47	4,80	8,82	17,14	28,84	39,89	54,81	68,31
IPCA + 6,00%	1,72	13,57	4,83	8,88	17,26	29,10	40,32	55,45	69,18
INPC + 4,00%	1,48	12,02	4,29	8,08	15,49	25,80	34,17	45,08	53,62
INPC + 6,00%	1,63	13,79	4,79	9,12	17,69	30,64	42,02	56,50	68,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

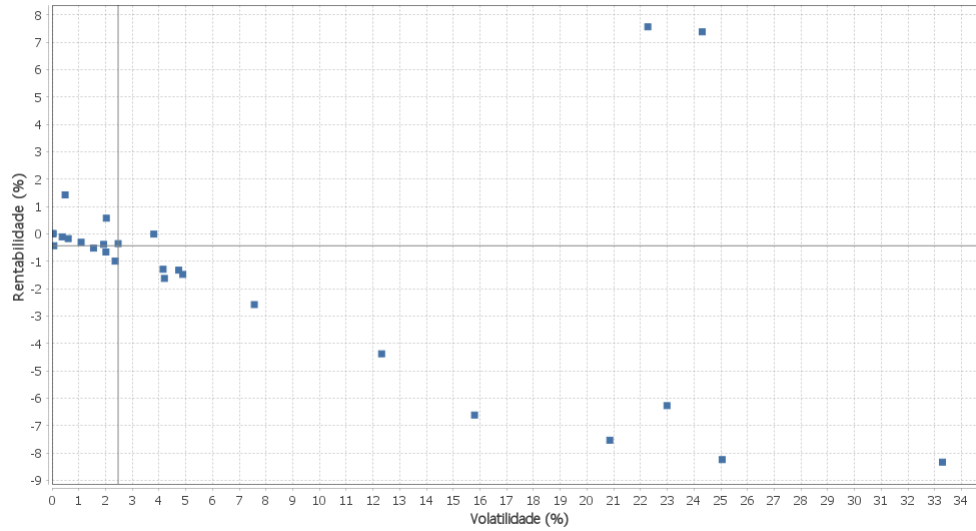
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
78	07/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	48.995.952,19	17.684.294,02849700	2,7705913570
77	08/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	8.300.000,00	0,00	2.992.948,75480800	2,7731848020
80	08/10/2021	NTN-B 150840 (5,020001%)	45.997.636,81	0,00	11.107,00000000	4.141,3196010000
75	13/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	400.000,00	0,00	144.201,36225700	2,7738988990
76	25/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	100.000,00	36.264,50079700	2,7575176220
79	25/10/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	3.400.000,00	1.232.993,02708900	2,7575176220

Total

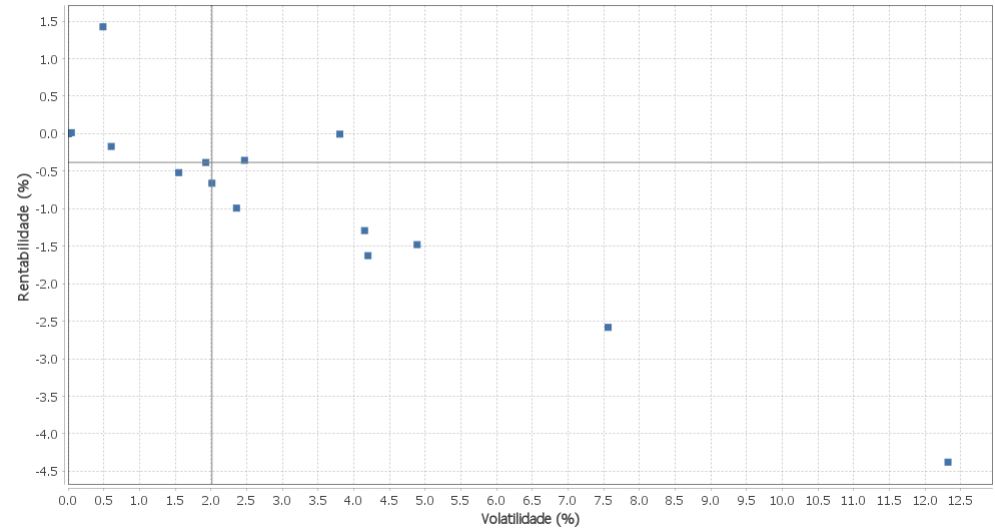
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

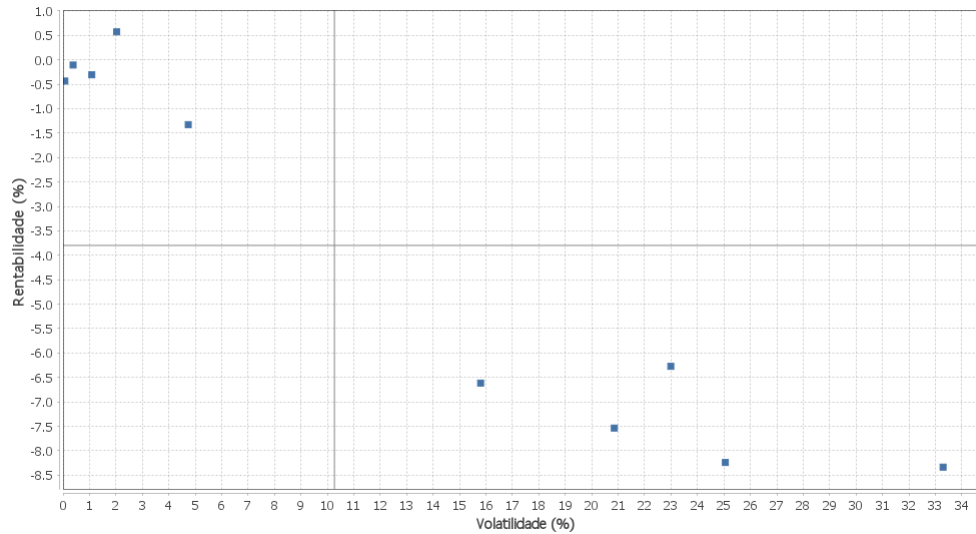
HORTOLÂNDIA - No Mês



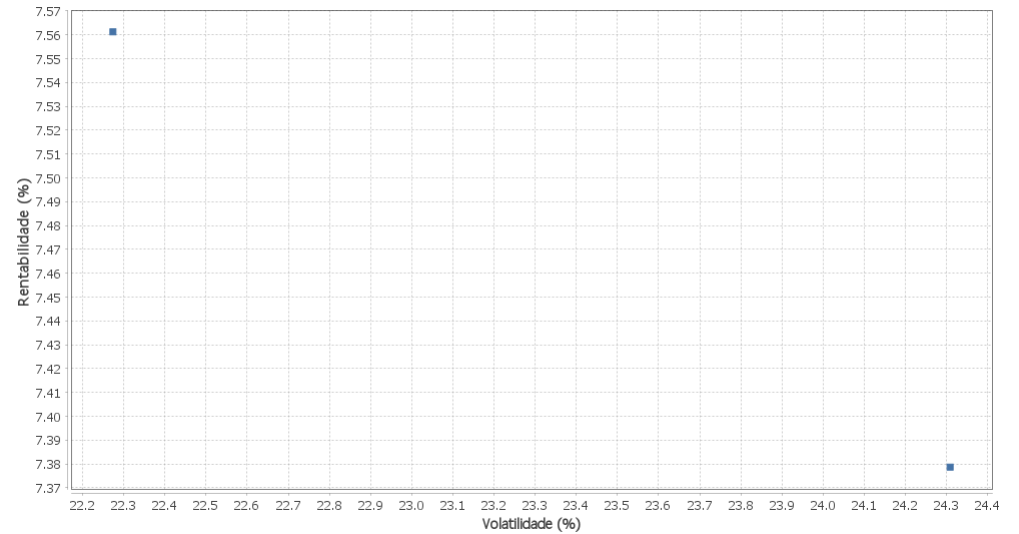
Renda Fixa - No Mês



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\$): 11.808.009,86

Value-At-Risk: 1,88%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3	Artigo 7º VII, Alínea a	0,00	NaN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4	Artigo 7º VII, Alínea a	0,00	NaN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	Artigo 7º VII, Alínea a	0,00	NaN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	Artigo 7º VII, Alínea a	0,05	0,03	-0,00	-10,26	0,01	1.806.706,20	0,29
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	Artigo 8º III	0,07	0,01	0,00	-13,44	-0,43	221.101,39	0,04
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	Artigo 8º IV, Alínea a	0,38	0,02	0,00	-1,55	-0,11	1.514.614,00	0,24
NTN-B 150840 (5,020001%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,49	0,23	0,00	1,93	1,42	46.435.859,15	7,38
FIDC PREMIUM	Artigo 7º VII, Alínea a	0,60	0,05	0,00	-1,08	-0,17	1.681.897,35	0,27
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	Artigo 8º IV, Alínea a	1,09	4,19	0,00	-0,72	-0,31	532.628,55	0,08
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,55	0,56	0,03	-0,64	-0,52	68.022.145,98	10,81
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	Artigo 7º IV, Alínea a	1,93	1,63	0,01	-0,45	-0,38	3.662.909,84	0,58
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,42	0,09	-0,57	-0,66	60.055.292,87	9,54
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	Artigo 8º IV, Alínea b	2,03	2,38	0,00	0,05	0,57	1.192.886,26	0,19
BRA1 FI RENDA FIXA	Artigo 7º IV, Alínea a	2,36	0,77	0,00	-0,62	-0,99	437.203,21	0,07
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	2,47	0,61	0,03	-0,34	-0,36	48.082.426,11	7,64
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	3,81	4,16	-0,00	-0,13	-0,01	603.383,45	0,10
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,15	1,56	0,17	-0,43	-1,29	97.476.942,56	15,49
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,20	1,64	0,10	-0,50	-1,63	47.029.513,83	7,47
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	Artigo 8º IV, Alínea b	4,74	0,10	0,00	-0,38	-1,33	838.357,41	0,13
NTN-B 150824	Artigo 7º I, Alínea a	4,89	1,71	0,07	-0,40	-1,48	34.780.399,44	5,53
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,56	2,76	0,24	-0,40	-2,58	68.807.359,40	10,93
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	12,32	3,95	0,07	-0,39	-4,38	15.041.323,14	2,39
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,80	8,72	0,57	-0,45	-6,61	46.688.889,96	7,42
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	20,85	8,01	0,27	-0,38	-7,54	26.002.704,28	4,13
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	Artigo 9º A, II	22,27	8,49	-0,08	0,32	7,56	16.578.494,39	2,63
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	Artigo 8º IV, Alínea b	22,99	3,65	-0,00	-0,29	-6,27	2.020.600,00	0,32
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	24,31	8,43	-0,04	0,28	7,38	14.924.876,59	2,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	25,05	10,17	0,33	-0,35	-8,24	24.722.818,02	3,93
BRCR11	Artigo 8º IV, Alínea b	33,29	1,01	-0,00	-0,26	-8,34	218.196,12	0,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de outubro de 2021, vale observar que:

- O Instituto está com 14,12% do Patrimônio Líquido do fundo LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V, percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- O Instituto está com 5,41% do Patrimônio Líquido do fundo BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP, percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;