



CARAGUATATUBA
1º TRIMESTRE 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 31.03.2021.

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

78,37%

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	4,15	-0,85	-2,82	16.035.955,27	3,03	7.393.196.134,71	0,22
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,46	-0,01	0,10	24.953.841,15	4,71	239.684.905,74	10,41
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	7,89	-0,48	-2,86	16.505.499,94	3,12	383.111.308,48	4,31
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,45	0,02	0,05	5.595.827,06	1,06	7.884.684.396,22	0,07
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	7,89	-0,48	-2,85	16.130.801,79	3,05	7.644.309.269,72	0,21
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,90	-0,47	-2,86	44.918.176,82	8,48	5.996.206.078,69	0,75
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,49	-1,19	-5,12	25.205.908,11	4,76	1.420.869.422,66	1,77
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	7,90	-0,49	-2,87	4.410.920,98	0,83	1.193.793.207,38	0,37
ITAU	ITAU	ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	12,44	-1,19	-5,15	4.273.253,68	0,81	111.185.132,08	3,84
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,53	-1,20	-5,15	52.951.850,69	10,00	1.580.616.679,30	3,35
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	6,21	-1,49	-4,79	32.856.482,04	6,21	2.256.982.371,87	1,46
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,74	0,37	-0,02	16.199.293,45	3,06	10.861.361.928,62	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,14	-0,89	-2,79	4.859.376,18	0,92	1.953.428.365,60	0,25
BB	BB	BB PREV RF VII	1,69	0,39	0,67	464.668,86	0,09	240.972.949,54	0,19
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,78	0,30	-0,18	51.846.256,93	9,79	15.491.489.347,05	0,33
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,42	-0,57	-2,85	317.208.112,95	59,91		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,22	0,21	0,48	6.929.641,49	1,31	872.176.663,20	0,79
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	8,53	-0,74	-3,39	40.269.931,88	7,61	700.314.494,78	5,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,37	0,10	0,34	421.347,30	0,08	5.408.705.211,16	0,01
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,65	0,14	0,34	48.690.532,35	9,20	3.580.849.195,10	1,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			4,23	-0,22	-1,22	96.311.453,02	18,19		
Artigo 7º VII, Alínea a (Cota Sênior de FIDC)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	240,77	-0,00	-0,49	1.382.401,88	0,26	54.337.440,04	2,54
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			240,77	-0,00	-0,49	1.382.401,88	0,26		
Renda Fixa			5,85	-0,49	-2,46	414.901.967,85	78,37		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

18,73%

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	26,19	5,72	-0,63	25.405.365,49	4,80	1.206.597.607,28	2,11
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			26,19	5,72	-0,63	25.405.365,49	4,80		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	25,49	0,16	-5,50	5.677.934,43	1,07	736.778.248,58	0,77
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	24,62	5,87	-3,57	1.540.880,52	0,29	1.002.558.255,25	0,15
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	25,39	3,12	-0,41	6.695.869,98	1,26	2.141.846.289,54	0,31
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	25,48	3,89	-2,44	16.363.271,11	3,09	981.481.248,05	1,67
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	25,46	5,08	-2,68	7.763.209,36	1,47	756.630.034,01	1,03
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	24,71	5,62	-2,74	13.503.002,85	2,55	979.013.916,36	1,38
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	26,05	-1,18	-6,76	11.560.841,58	2,18	2.066.276.030,96	0,56
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	26,61	2,12	1,10	6.394.754,70	1,21	3.385.715.282,16	0,19
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			24,61	2,96	-3,05	69.499.764,53	13,13		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	21,01	4,16	6,79	4.239.552,48	0,80	2.216.604.138,65	0,19
Sub-total Artigo 8º III			21,01	4,16	6,79	4.239.552,48	0,80		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			24,81	3,71	-2,22	99.144.682,50	18,73		
--	--	--	--------------	-------------	--------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,91%

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	24,18	3,43	13,29	15.385.057,02	2,91	2.719.540.696,03	0,57
Sub-total Artigo 9º A, III			24,18	3,43	13,29	15.385.057,02	2,91		
Investimentos no Exterior			21,57	3,43	13,29	15.385.057,02	2,91		
Total			7,95	0,38	-2,00	529.431.707,37	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos			
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	317.208.112,95	59,91	20,00	40,00	80,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	96.311.453,02	18,19	10,00	19,50	35,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	1.382.401,88	0,26	0,00	0,50	1,00	5,00
	Total Renda Fixa	414.901.967,85	78,37				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	25.405.365,49	4,80	0,00	5,00	5,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	69.499.764,53	13,13	5,00	15,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	4.239.552,48	0,80	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	99.144.682,50	18,73				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	15.385.057,02	2,91	0,00	5,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	15.385.057,02	2,91				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

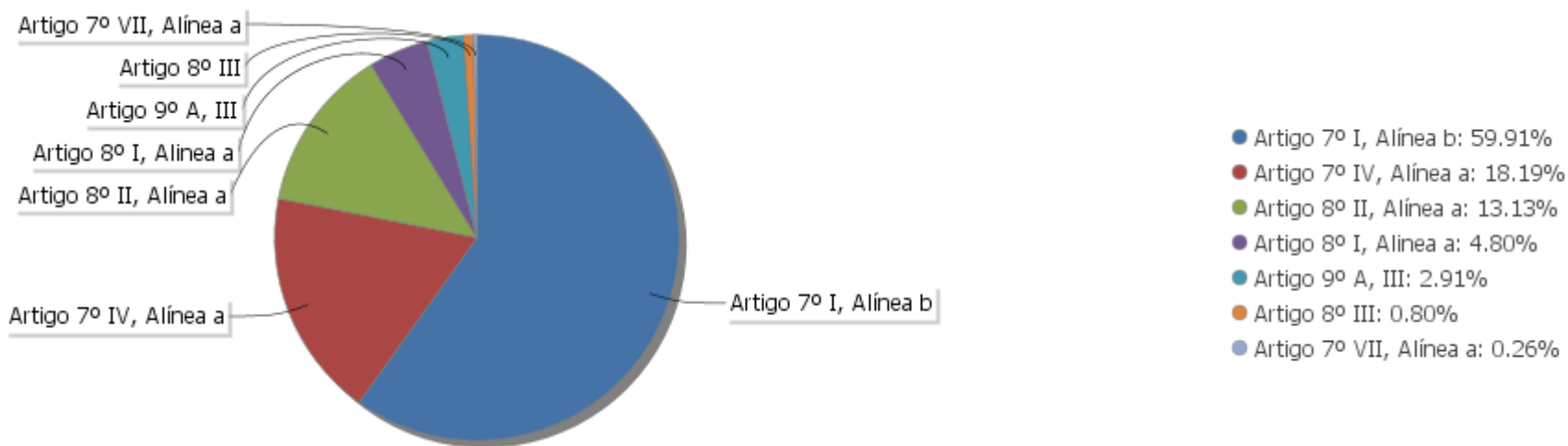
Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,57 -284,24	-2,85 -586,83	-2,85 -586,83	2,67 278,59	7,31 328,80	-1.851.234,59	-9.210.890,79
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,22 -111,73	-1,22 -251,38	-1,22 -251,38	1,90 198,37	5,13 230,84	-216.547,30	-1.209.889,39
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-0,00 -1,20	-0,49 -101,02	-0,49 -101,02	37,22 3.877,76	1.315,60 59.194,64	-33,28	-6.256,87
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	5,72 -0,27	-0,63 1,37	-0,63 1,37	23,62 0,33	61,04 1,31	1.375.355,15	-160.763,34
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	2,96 -3,04	-3,05 -1,05	-3,05 -1,05	17,14 -6,15	51,54 -8,19	1.998.396,21	-2.187.935,73
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	4,16 -1,84	6,79 8,79	6,79 8,79			169.299,12	220.207,82
Artigo 9º A, III % do CDI	3,43 1.704,61	13,29 2.735,98	13,29 2.735,98	14,78 1.539,99		509.886,83	1.805.253,20
CARAGUATATUBA (Total)						1.985.122,14	-10.750.275,10

Análise de Liquidez

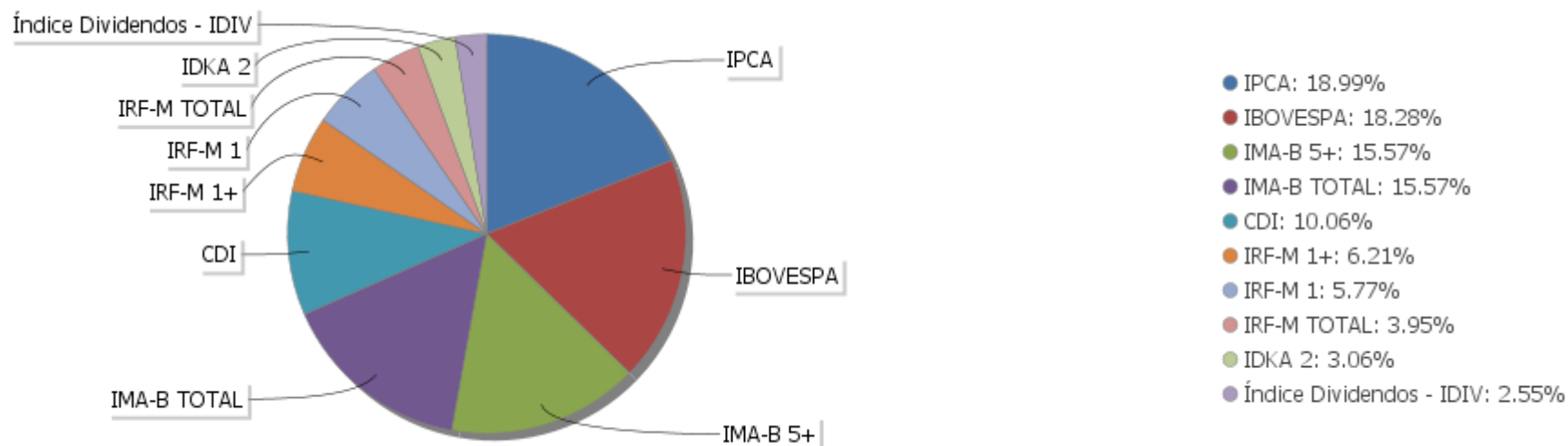
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	488.362.828,14	92,24	488.362.828,14	92,24
de 31 a 365 dias	39.221.808,49	7,41	527.584.636,63	99,65
acima de 365 dias	1.847.070,74	0,35	529.431.707,37	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

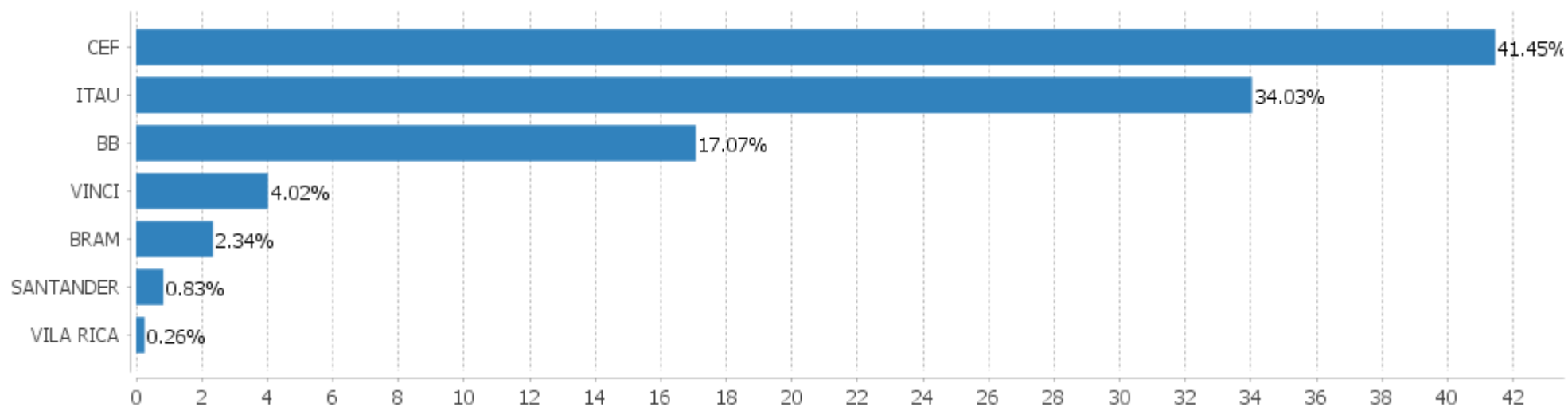


Alocação Por Estratégia



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	-1,45	0,38										-2,00
IPCA + 5,89%	0,71	1,27	1,46										3,48
p.p. indexador	-1,65	-2,72	-1,08										-5,48
2020	0,26	-1,20	-8,82	2,26	2,04	2,60	3,94	-1,32	-1,68	-0,06	3,29	4,43	5,12
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	-0,45	-1,86	-9,40	2,11	1,97	1,86	3,06	-2,04	-2,80	-1,40	1,94	2,58	-5,52
2019	1,51	0,37	0,41	0,94	1,99	2,58	1,16	0,11	1,85	2,11	-0,78	2,17	15,34
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	0,68	-0,53	-0,78	-0,12	1,35	2,13	0,44	-0,51	1,40	1,47	-1,75	0,52	4,75

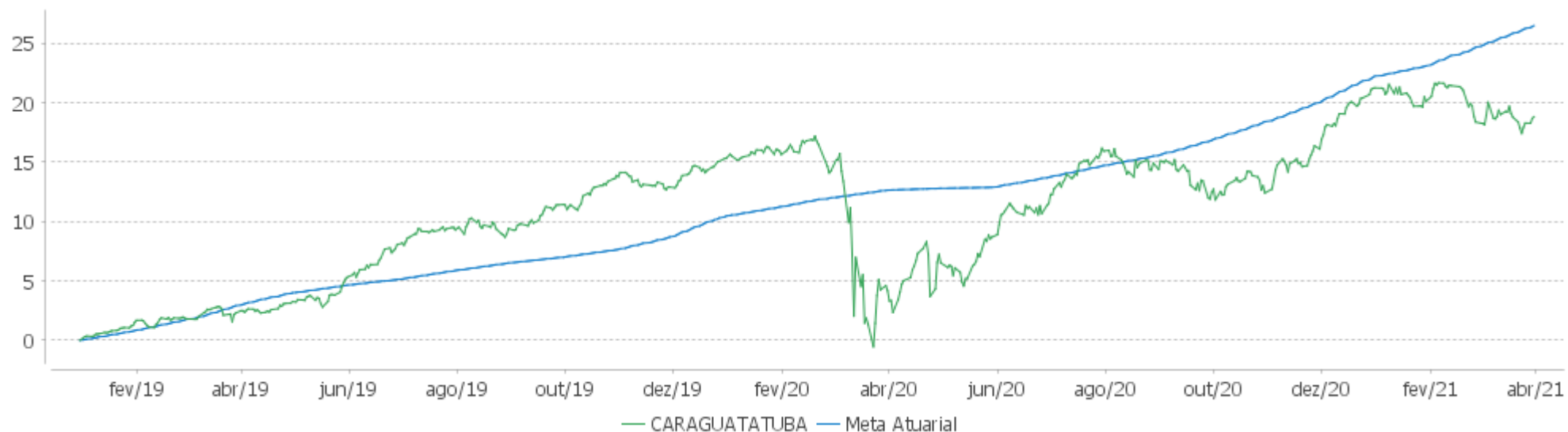
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

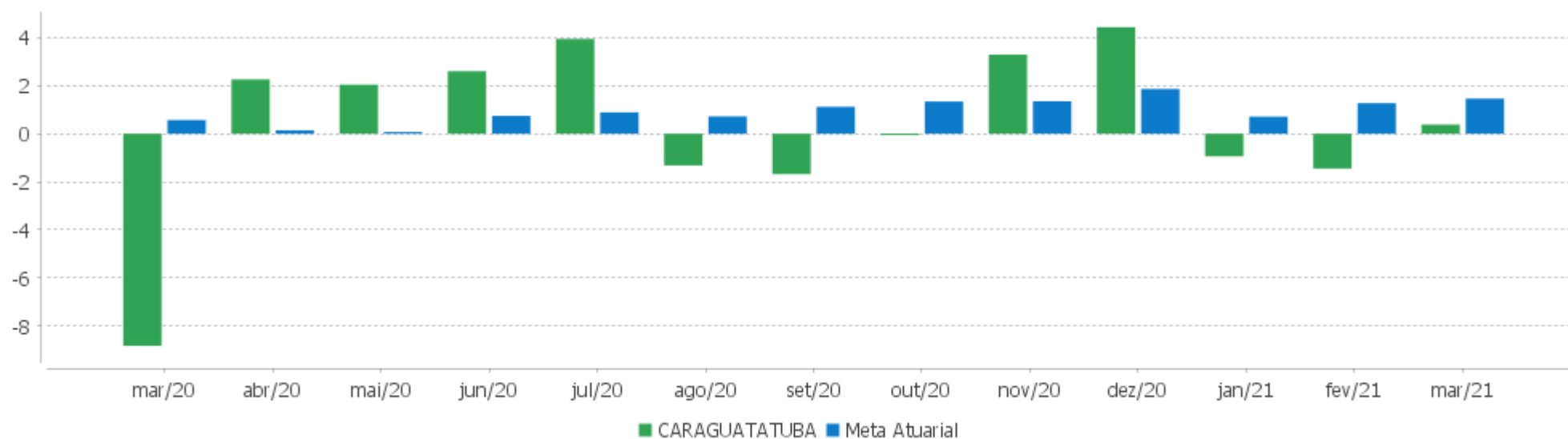
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	13	48,15	03 meses	-2,00	3,48	-5,48	6,30
Meses abaixo da Meta Atuarial	14	51,85	06 meses	5,65	8,25	-2,61	5,98
			12 meses	14,06	12,30	1,77	7,95
			24 meses	16,15	22,99	-6,85	9,69
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	4,43	2020-12	Desde 31/12/2018	18,82	26,62	-7,80	9,20
Menor rentabilidade da Carteira	-8,82	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 Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,21 104,83	0,48 99,52	0,48 99,52	0,98 101,71	2,11 95,10	7,36 94,63	14,03 95,97
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	-0,74 -369,78	-3,39 -697,59	-3,39 -697,59	3,49 363,35	9,66 434,57	22,62 290,73	38,90 266,10
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,10 49,18	0,34 69,73	0,34 69,73	0,98 102,09	1,96 88,11	7,05 90,55	13,66 93,48
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,14 -0,79	0,34 -1,71	0,34 -1,71	0,72 -4,52	2,06 -4,04	12,01 2,41	21,02 6,40
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	-0,00 -1,20	-0,49 -101,02	-0,49 -101,02	37,22 3.877,75	1.315,60 59.194,64	10.924,07 140.404,90	25.668,88 175.616,09
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	-0,01 -0,05	0,10 -0,03	0,10 -0,03	0,75 -0,08	2,22 -0,28	8,74 -0,60	15,75 -0,89
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,47 -0,01	-2,86 -0,06	-2,86 -0,06	4,06 -0,11	10,15 -0,24	19,69 -0,79	35,87 -1,12
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,02 -0,03	0,05 -0,07	0,05 -0,07	0,68 -0,15	2,12 -0,39	8,66 -0,68	15,66 -0,98
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,89 -0,04	-2,79 0,01	-2,79 0,01	-0,91 -0,04	2,08 -0,17	13,08 -0,51	23,14 -0,84
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,20 -0,03	-5,15 -0,05	-5,15 -0,05	4,87 -0,03	11,75 -0,26	20,41 -0,83	40,66 -1,53
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,19 -0,02	-5,15 -0,05	-5,15 -0,05	4,73 -0,17	11,54 -0,47	20,26 -0,98	40,18 -2,01
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	-1,49 -0,04	-4,79 -0,01	-4,79 -0,01	-2,02 -0,01	1,60 -0,21	14,51 -0,50	25,89 -0,86
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,48 -0,02	-2,86 -0,06	-2,86 -0,06	4,02 -0,15	10,02 -0,37	19,85 -0,62	35,54 -1,45
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,39 0,85	0,67 3,47	0,67 3,47	3,58 -0,59	7,11 -3,28	14,53 -5,95	25,28 -11,71
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,30 -0,63	-0,18 -2,24	-0,18 -2,24	1,85 -3,39	5,09 -1,01	19,24 9,64	29,94 15,33
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,37 0,08	-0,02 0,02	-0,02 0,02	3,02 0,02	8,45 -0,13	17,15 -1,31	27,36 -2,00
BB PREV RF IRF-M	-0,85	-2,82	-2,82	-0,88	1,99	13,08	23,16

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,01	-0,02	-0,02	-0,01	-0,26	-0,52	-0,82
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,48	-2,85	-2,85	4,08	10,09	19,91	35,98
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,05	-0,05	-0,09	-0,30	-0,56	-1,01
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	-1,19	-5,12	-5,12	4,73	11,48	20,58	41,05
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,02	-0,02	-0,02	-0,16	-0,53	-0,66	-1,14
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	-0,49	-2,87	-2,87	4,03	10,01	19,49	35,53
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,07	-0,07	-0,14	-0,38	-0,98	-1,46
BRADESCO F I A SELECTION	0,16	-5,50	-5,50	14,00	51,45	10,58	25,01
Var. IBOVESPA p.p.	-5,84	-3,49	-3,49	-9,28	-8,28	-11,66	-11,62
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	-1,18	-6,76	-6,76	11,03	50,86	25,29	47,94
Var. IBOVESPA p.p.	-7,18	-4,76	-4,76	-12,26	-8,86	3,05	11,31
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	5,08	-2,68	-2,68	17,77	52,19	37,89	58,07
Var. IBOVESPA p.p.	-0,91	-0,68	-0,68	-5,51	-7,53	15,65	21,44
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	2,12	1,10	1,10	21,26	58,11	30,49	51,12
Var. IBOVESPA p.p.	-3,88	3,10	3,10	-2,03	-1,62	8,25	14,50
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	5,62	-2,74	-2,74	21,61	45,22	27,27	47,73
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,95	0,47	0,47	0,20	5,87	-1,25	1,59
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	3,89	-2,44	-2,44	18,66	56,32	25,45	41,04
Var. IBOVESPA p.p.	-2,10	-0,44	-0,44	-4,63	-3,41	3,21	4,41
BB AÇÕES DIVIDENDOS	5,87	-3,57	-3,57	16,25	38,32	8,99	19,75
Var. IBOVESPA p.p.	-0,13	-1,57	-1,57	-7,04	-21,41	-13,25	-16,88
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	3,12	-0,41	-0,41	14,41	52,73	33,63	61,51
Var. IBOVESPA p.p.	-2,88	1,59	1,59	-8,88	-7,00	11,40	24,88
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	4,16	6,79	6,79	18,92	52,87	40,59	56,61
% do CDI	2.068,46	1.396,50	1.396,50	1.971,17	2.378,63	521,63	387,30
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	5,72	-0,63	-0,63	23,62	61,04	25,76	45,01
Var. IBOVESPA p.p.	-0,27	1,37	1,37	0,33	1,31	3,53	8,38
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	3,43	13,29	13,29	14,78	64,18	108,61	166,72
Var. IBOVESPA p.p.	-2,57	15,30	15,30	-8,51	4,45	86,37	130,09
CARAGUATATUBA	0,38	-2,00	-2,00	5,65	14,06	16,15	
Var. IPCA + 5,89% p.p.	-1,08	-5,48	-5,48	-2,61	1,77	-6,75	
CDI	0,20	0,49	0,49	0,96	2,22	7,78	14,62
IBOVESPA	6,00	-2,00	-2,00	23,29	59,73	22,24	36,63
INPC + 6,00%	1,40	3,41	3,41	8,43	13,30	24,13	37,66
IPCA + 6,00%	1,47	3,50	3,50	8,31	12,41	23,15	36,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,04	0,13	0,13	0,83	2,51	9,33	16,64
IRF-M 1+	-1,45	-4,77	-4,77	-2,02	1,81	15,01	26,76
IRF-M TOTAL	-0,84	-2,80	-2,80	-0,87	2,25	13,59	23,98
IMA-B 5	0,34	-0,15	-0,15	3,23	8,50	18,63	29,54
IMA-B 5+	-1,17	-5,10	-5,10	4,90	12,01	21,24	42,19
IMA-B TOTAL	-0,46	-2,81	-2,81	4,17	10,39	20,48	36,99
IMA-C TOTAL	-0,72	9,62	9,62	13,61	34,42	51,98	77,98
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,38	-1,64	-1,64	1,15	4,18	12,86	23,35
IMA-GERAL TOTAL	-0,39	-1,32	-1,32	1,50	4,98	13,88	24,71
IDKA 2	0,29	-0,05	-0,05	3,00	8,57	18,47	29,35
IDKA 20	-1,89	-7,21	-7,21	7,55	15,19	22,04	53,40
CDI	0,20	0,49	0,49	0,96	2,22	7,78	14,62
Renda Variável							
IBOVESPA	6,00	-2,00	-2,00	23,29	59,73	22,24	36,63
IBRX 100	6,04	-0,72	-0,72	24,43	62,17	26,16	42,14
IBRX 50	6,08	-0,80	-0,80	25,46	64,73	22,50	35,45
SMALL CAP	4,56	-0,88	-0,88	21,46	64,58	44,87	61,92
IFIX	-1,38	-0,81	-0,81	1,86	14,14	14,65	20,75
Índice Consumo - ICON	2,32	-4,34	-4,34	6,29	50,94	40,41	39,42
Índice Dividendos - IDIV	7,57	-3,21	-3,21	21,41	39,35	28,51	46,14
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,93	2,05	2,05	5,25	6,10	9,60	14,62
INPC	0,86	1,96	1,96	5,36	6,94	10,48	15,64
IGPM	2,94	8,26	8,26	16,52	31,10	40,02	51,60
SELIC	0,20	0,49	0,49	0,96	2,22	7,78	14,62
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	04/01/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	46.280,85	0,00	14,50299282	3.191,1241070000
2	13/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	33.000,00	8.819,66201300	3,7416400000
3	15/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.207,61	0,00	810,51233400	2,7237216590
4	15/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	4.000,00	1.068,85766600	3,7423130000
5	19/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	316.501,58	0,00	116.145,89484100	2,7250345820
6	19/01/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	5.308.021,56	0,00	157.188,14995689	33,7685860000
7	20/01/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	1.329.604,01	0,00	39.364,53148577	33,7767010000
8	22/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	12.309,62	0,00	4.517,81117000	2,7246866980
9	22/01/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	301.356,48	0,00	8.923,75122804	33,7701570000
10	27/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.314,51	0,00	849,50916400	2,7245262270
11	27/01/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	1.600,30	0,00	47,38609135	33,7715130000
12	27/01/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	306.447,94	0,00	9.074,15489499	33,7715130000
13	28/01/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	13.725,88	0,00	4,29655500	3.194,6245280000
14	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	149.147,86	39.825,36435800	3,7450470000
15	28/01/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,00	2.383.823,96	70.582,56590838	33,7735520000
16	29/01/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	502,00	0,00	0,15712367	3.194,9355200000
17	29/01/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1.044,80	0,00	0,32701755	3.194,9355200000
18	29/01/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	106.462,49	0,00	33,32226561	3.194,9355200000
19	05/02/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	27.985,84	0,00	8,75480470	3.196,6264200000
20	09/02/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	106.992,90	0,00	39.238,42957700	2,7267375670
21	10/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	45.000,00	12.008,31628400	3,7474030000
22	10/02/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.207,61	0,00	809,44799500	2,7273030670
23	17/02/2021	BB PREV RF VII	0,00	12.596,18	6.802,06768700	1,8518163270
24	18/02/2021	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12.596,18	0,00	1.935,90346300	6,5066157690
25	18/02/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	22.058,48	0,00	6,89689791	3.198,3190530000
26	18/02/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	316.501,58	0,00	116.025,67167300	2,7278582010
27	22/02/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	2.857.712,38	0,00	84.515,32517912	33,8129490000
28	22/02/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	12.309,62	0,00	4.513,72931500	2,7271506860

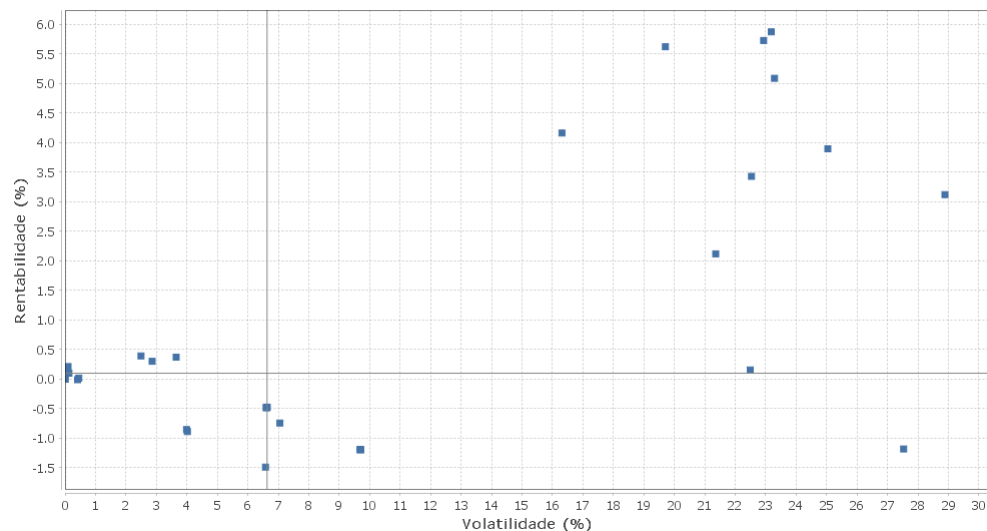
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
29	23/02/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	305.719,62	0,00	9.043,13368931	33,8068230000
30	23/02/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.314,51	0,00	848,51191100	2,7277283540
31	24/02/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	508.520,74	0,00	15.038,80948826	33,8138960000
32	25/02/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,00	2.410.711,12	71.300,40098342	33,8106250000
33	25/02/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	13.725,88	0,00	4,29010945	3.199,4242000000
34	25/02/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	2.000.000,00	110.739,15674015	18,0604590000
35	25/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	146.414,37	39.061,90490300	3,7482650000
36	26/02/2021	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	2.000.000,00	0,00	105.266,70926109	18,9993590000
37	26/02/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1.044,80	0,00	0,32654410	3.199,5678840000
46	02/03/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	105.857,20	0,00	33,08072792	3.199,9658610000
38	05/03/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	225.159,80	0,00	82.566,15218700	2,7270230480
39	10/03/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.207,61	0,00	809,79474400	2,7261352510
40	10/03/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.314,51	0,00	849,00776600	2,7261352510
51	10/03/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	46.000,00	12.272,54109100	3,7482050000
41	15/03/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	12.309,62	0,00	4.517,01241200	2,7251685130
47	16/03/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	22.058,50	0,00	6,88697722	3.202,9291370000
42	18/03/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	316.501,58	0,00	116.212,49061900	2,7234729960
43	18/03/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	3.153.155,84	0,00	93.295,82748303	33,7973940000
44	22/03/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	486.956,25	0,00	14.419,35274682	33,7710200000
48	26/03/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	105.857,20	0,00	33,02637140	3.205,2325310000
45	30/03/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,00	2.418.318,66	71.578,10886430	33,7857300000
49	30/03/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	13.725,88	0,00	4,28151705	3.205,8449940000
52	30/03/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	142.203,61	37.905,32601300	3,7515470000
50	31/03/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1.044,80	0,00	0,32585718	3.206,3126160000
Total						

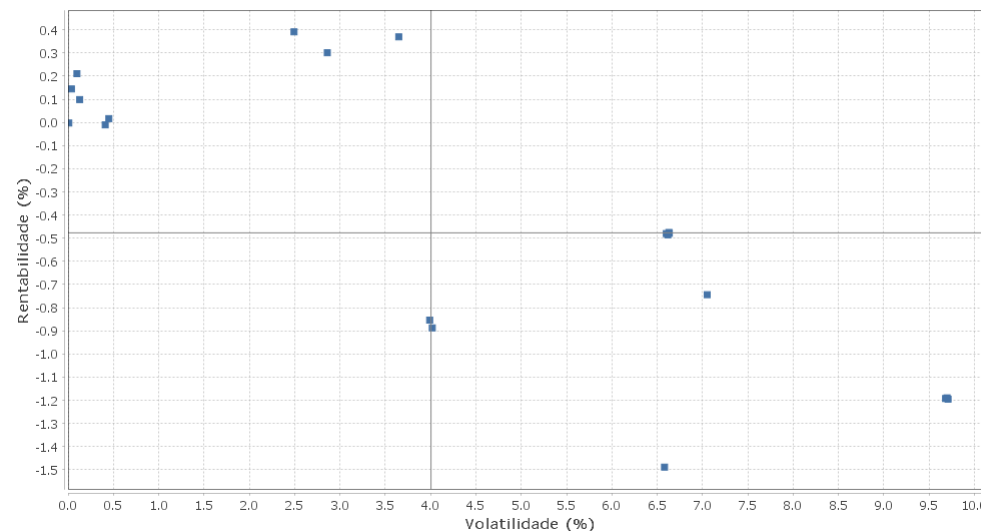
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

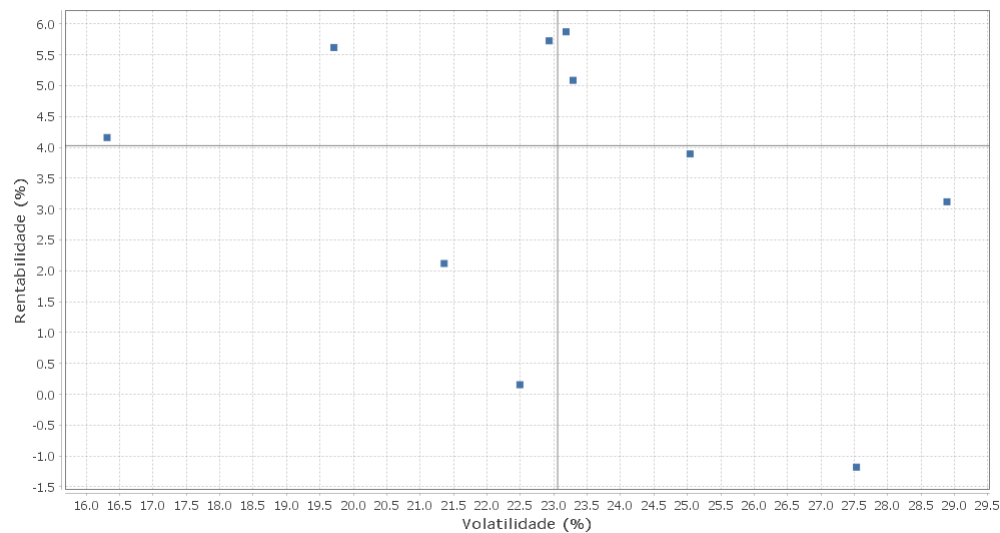
CARAGUATATUBA - No Mês



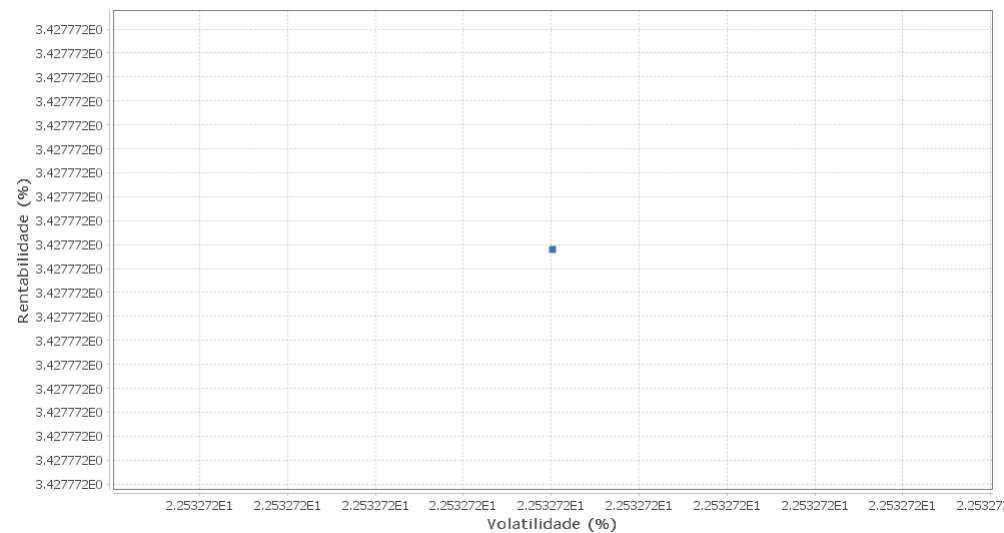
Renda Fixa - No Mês



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\$): 15.216.763,72

Value-At-Risk: 2,87%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR	Artigo 7º VII, Alínea a	0,01	0,05	0,00	-25,53	-0,00	1.382.401,88	0,26
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,02	0,00	-1,52	0,14	48.690.532,35	9,20
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,10	0,02	0,00	0,10	0,21	6.929.641,49	1,31
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,13	0,04	0,00	-0,79	0,10	421.347,30	0,08
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,41	0,14	0,00	-0,52	-0,01	24.953.841,15	4,71
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,45	0,15	0,00	-0,41	0,02	5.595.827,06	1,06
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	2,49	0,79	0,00	0,08	0,39	464.668,86	0,09
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,86	0,94	0,07	0,03	0,30	51.846.256,93	9,79
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,65	1,45	0,03	0,05	0,37	16.199.293,45	3,06
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,99	1,30	0,03	-0,26	-0,85	16.035.955,27	3,03
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,02	1,34	0,01	-0,27	-0,89	4.859.376,18	0,92
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,58	2,09	0,09	-0,26	-1,49	32.856.482,04	6,21
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	6,60	2,80	0,07	-0,10	-0,48	16.505.499,94	3,12
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,62	2,82	0,02	-0,10	-0,49	4.410.920,98	0,83
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,63	2,82	0,19	-0,10	-0,47	44.918.176,82	8,48
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,63	2,84	0,07	-0,10	-0,48	16.130.801,79	3,05
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	7,05	2,96	0,18	-0,13	-0,74	40.269.931,88	7,61
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	Artigo 7º I, Alínea b	9,68	4,75	0,03	-0,14	-1,19	4.273.253,68	0,81
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	9,70	4,68	0,17	-0,14	-1,19	25.205.908,11	4,76
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	9,71	4,78	0,37	-0,14	-1,20	52.951.850,69	10,00
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	Artigo 8º III	16,31	6,78	0,03	0,24	4,16	4.239.552,48	0,80
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	19,71	10,02	0,21	0,27	5,62	13.503.002,85	2,55
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	21,36	8,95	0,09	0,09	2,12	6.394.754,70	1,21
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	22,49	11,01	0,09	-0,00	0,16	5.677.934,43	1,07
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	22,53	10,08	-0,02	0,14	3,43	15.385.057,02	2,91
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	22,93	10,76	0,44	0,24	5,72	25.405.365,49	4,80
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	23,18	9,55	0,02	0,24	5,87	1.540.880,52	0,29
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	23,29	9,33	0,12	0,21	5,08	7.763.209,36	1,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	25,04	9,71	0,26	0,15	3,89	16.363.271,11	3,09
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	27,53	10,55	0,18	-0,05	-1,18	11.560.841,58	2,18
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	28,89	10,47	0,10	0,10	3,12	6.695.869,98	1,26