



**LDB**  
EMPRESAS

**CARAGUATATUBA**  
ABRIL 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 30.04.2021.

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

75,26%

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	3,08	0,81	-2,03	16.166.481,24	3,01	7.263.040.941,75	0,22
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,37	0,26	0,36	16.048.530,65	2,99	222.829.140,53	7,20
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	6,03	0,63	-2,25	16.609.711,42	3,10	398.688.469,96	4,17
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,36	0,24	0,30	6.168.867,27	1,15	7.571.217.894,67	0,08
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	6,04	0,65	-2,22	16.235.440,21	3,03	7.329.081.978,43	0,22
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,04	0,63	-2,25	45.201.271,31	8,43	5.864.609.190,92	0,77
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	9,47	0,48	-4,67	25.325.824,35	4,72	1.372.166.331,50	1,85
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	6,03	0,63	-2,26	4.438.597,44	0,83	1.159.872.469,58	0,38
ITAU	ITAU	ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	9,44	0,43	-4,74	4.291.480,24	0,80	136.404.531,49	3,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9,51	0,45	-4,73	53.190.172,12	9,92	1.544.644.172,77	3,44
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	4,72	1,11	-3,74	33.219.566,55	6,19	1.932.581.186,97	1,72
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,36	1,02	0,99	11.327.122,57	2,11	11.053.033.773,31	0,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,08	0,78	-2,03	4.897.110,53	0,91	1.814.422.370,50	0,27
BB	BB	BB PREV RF VII	1,59	0,40	1,07	466.550,70	0,09	241.948.851,94	0,19
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,49	0,66	0,48	49.423.995,00	9,21	15.772.466.647,51	0,31
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>5,05</b>	<b>0,64</b>	<b>-2,23</b>	<b>303.010.721,60</b>	<b>56,49</b>		

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
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,10	0,25	0,74	7.088.722,07	1,32	924.280.043,07	0,77
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,43	0,81	-2,60	40.597.463,55	7,57	719.853.813,85	5,64
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,26	0,26	0,60	2.995.571,12	0,56	5.677.715.007,21	0,05
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,67	0,11	0,45	48.742.843,23	9,09	3.564.171.265,99	1,37

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>2,92</b>	<b>0,42</b>	<b>-0,81</b>	<b>99.424.599,97</b>	<b>18,54</b>		

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
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	233,14	-9,09	-9,54	1.256.758,19	0,23	54.336.131,79	2,31
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a</b>			<b>233,14</b>	<b>-9,09</b>	<b>-9,54</b>	<b>1.256.758,19</b>	<b>0,23</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>4,51</b>	<b>0,56</b>	<b>-1,92</b>	<b>403.692.079,76</b>	<b>75,26</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

20,95%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	22,88	3,25	2,60	26.231.574,96	4,89	1.248.321.295,25	2,10
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b>			<b>22,88</b>	<b>3,25</b>	<b>2,60</b>	<b>26.231.574,96</b>	<b>4,89</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	22,43	3,39	-2,29	5.870.698,67	1,09	749.896.824,62	0,78
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	21,68	2,61	-1,05	1.581.145,21	0,29	1.012.584.854,10	0,16
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	21,79	4,34	3,91	6.986.528,70	1,30	2.207.865.211,79	0,32
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	21,99	2,83	0,32	16.826.861,29	3,14	1.009.388.057,17	1,67
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	22,33	2,51	-0,24	7.958.352,39	1,48	776.275.923,33	1,03
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	21,65	2,52	-0,29	13.843.401,22	2,58	1.009.047.125,12	1,37
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	22,82	3,58	-3,43	11.974.196,47	2,23	2.114.738.249,20	0,57
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	22,09	3,31	4,45	6.606.588,72	1,23	3.432.293.082,37	0,19
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>21,21</b>	<b>3,09</b>	<b>-0,06</b>	<b>71.647.772,67</b>	<b>13,36</b>		

## Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	17,61	5,50	12,66	14.520.168,63	2,71	1.798.618.527,30	0,81
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>17,61</b>	<b>5,50</b>	<b>12,66</b>	<b>14.520.168,63</b>	<b>2,71</b>		

## Renda Variável e Investimentos Estruturados

21,37 3,31 1,02 112.399.516,26 20,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,78%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	22,82	0,61	13,99	20.294.404,18	3,78	3.039.632.406,38	0,67
<b>Sub-total Artigo 9º A, III</b>			<b>22,82</b>	<b>0,61</b>	<b>13,99</b>	<b>20.294.404,18</b>	<b>3,78</b>		
Investimentos no Exterior			21,48	0,61	13,99	20.294.404,18	3,78		
Total			6,45	1,02	-1,00	536.386.000,20	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	303.010.721,60	56,49	20,00	40,00	80,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	99.424.599,97	18,54	10,00	19,50	35,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	1.256.758,19	0,23	0,00	0,50	1,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>403.692.079,76</b>	<b>75,26</b>				100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	26.231.574,96	4,89	0,00	5,00	5,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	71.647.772,67	13,36	5,00	15,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	14.520.168,63	2,71	0,00	5,00	10,00	10,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>112.399.516,26</b>	<b>20,95</b>				30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	20.294.404,18	3,78	0,00	5,00	5,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>20.294.404,18</b>	<b>3,78</b>				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 b % do CDI	0,64 309,64	-2,23 -320,47	-1,34 -247,05	3,32 327,88	6,79 316,69	1.965.411,40	-7.245.479,39
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,42 200,56	-0,81 -116,56	-0,45 -82,37	2,28 225,25	4,84 225,92	399.431,29	-810.458,10
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-9,09 -4.373,93	-9,54 -1.372,56	-9,60 -1.763,59	-9,52 -941,15	1.461,23 68.157,96	-125.643,69	-131.900,56
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	3,25 1,31	2,60 2,71	5,58 2,25	28,69 2,14	49,82 2,13	826.209,47	665.446,13
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	3,09 1,15	-0,06 0,05	2,68 -0,65	21,69 -4,86	41,94 -5,75	2.148.008,14	-39.927,59
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	5,50 3,56	12,66 12,76	12,86 9,53			280.616,15	500.823,97
Artigo 9º A, III % do CDI	0,61 294,68	13,99 2.013,48	7,75 1.423,95	17,57 1.737,51		-90.652,84	1.714.600,36
<b>CARAGUATATUBA (Total)</b>						<b>5.403.379,92</b>	<b>-5.346.895,18</b>

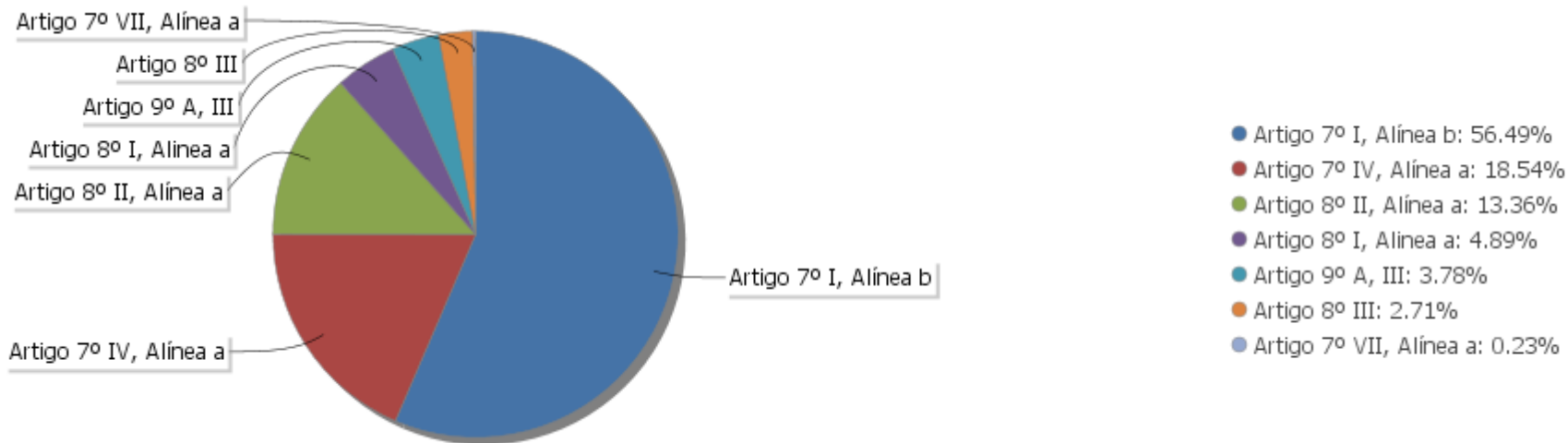
## Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	494.280.152,51	92,15	494.280.152,51	92,15
de 31 a 365 dias	40.382.538,80	7,53	534.662.691,31	99,68
acima de 365 dias	1.723.308,89	0,32	536.386.000,20	100,00

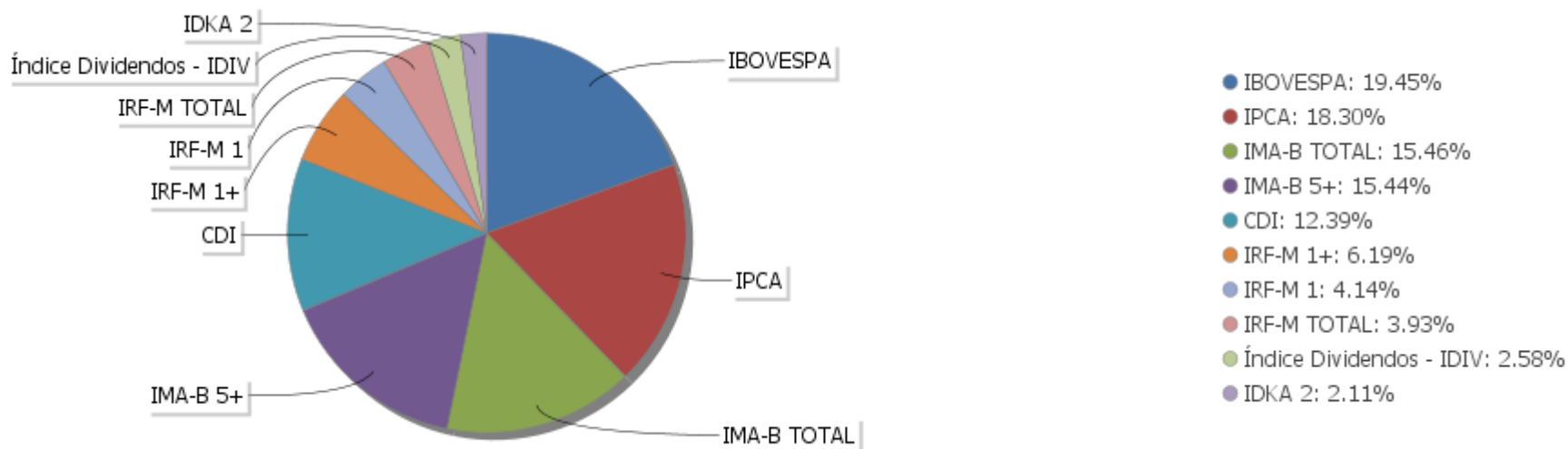


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

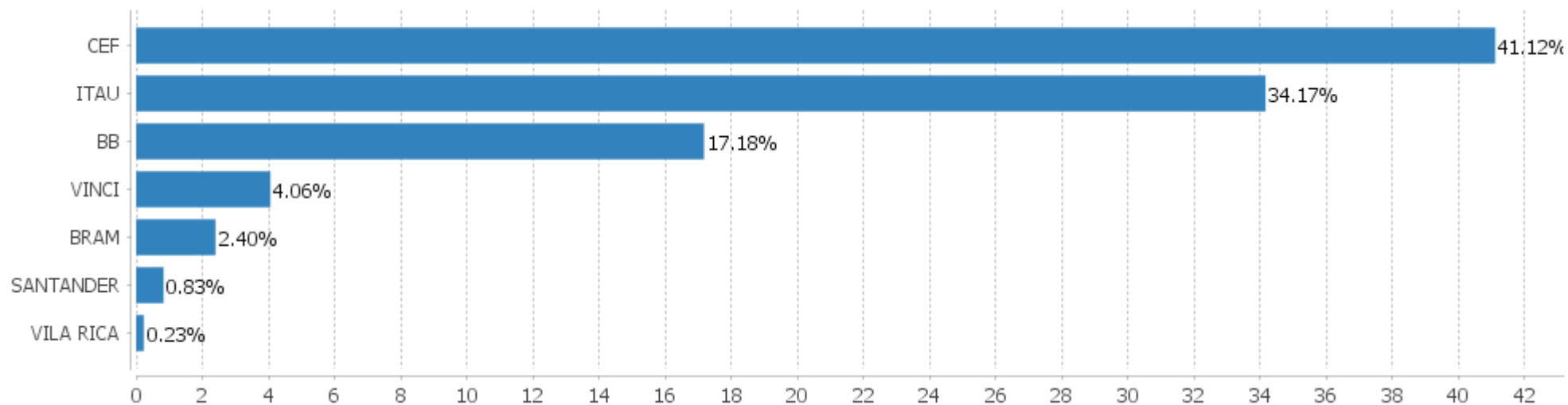


Alocação Por Estratégia



## 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	1,02									-1,00
IPCA + 5,89%	0,71	1,27	1,46	0,77									4,27
p.p. indexador	-1,65	-2,72	-1,08	0,26									-5,27
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**

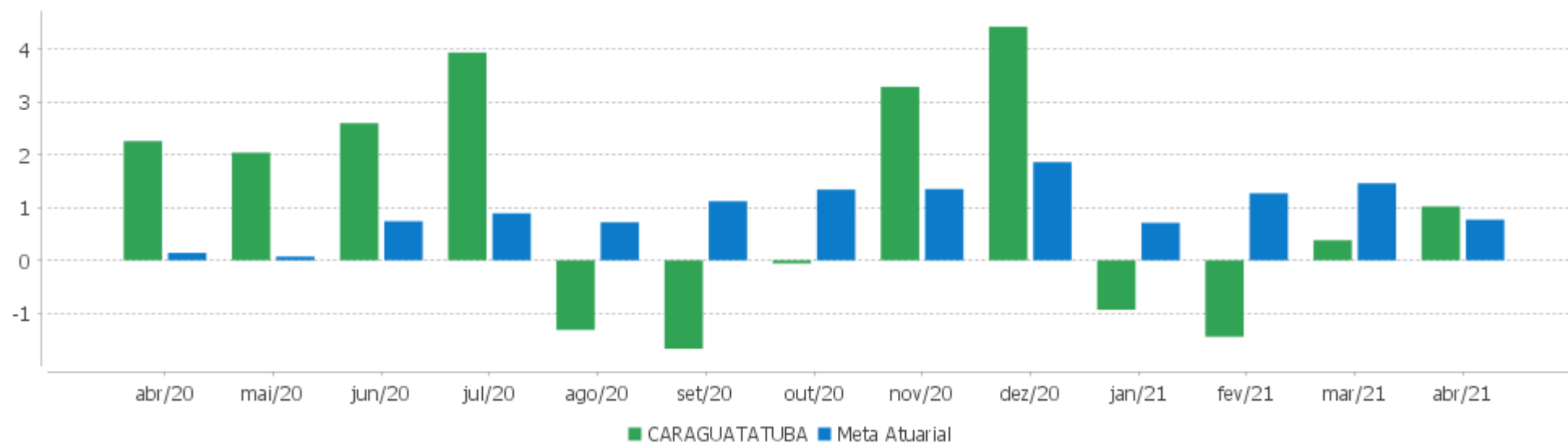
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	14	50,00	03 meses	-0,06	3,54	-3,60	5,95
Meses abaixo da Meta Atuarial	14	50,00	06 meses	6,79	7,64	-0,85	5,69
			12 meses	12,69	13,00	-0,31	6,45
			24 meses	16,24	22,64	-6,39	9,73
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	4,43	2020-12					
Menor rentabilidade da Carteira	-8,82	2020-03	Desde 31/12/2018	20,04	27,59	-7,55	9,07

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
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	-9,09 -4.373,93	-9,54 -1.372,56	-9,60 -1.763,59	-9,52 -941,15	1.461,23 68.157,96	1.855,61 24.916,05	23.720,42 166.303,78
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,25 122,51	0,74 106,43	0,61 112,34	1,08 107,11	2,29 106,82	7,09 95,24	13,74 96,36
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	0,81 391,42	-2,60 -374,80	-1,57 -287,67	4,33 428,24	8,88 414,39	21,59 289,86	40,33 282,73
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,26 126,95	0,60 86,87	0,44 81,03	1,12 111,24	2,22 103,72	6,79 91,13	13,38 93,84
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,11 -0,20	0,45 -1,92	0,31 -1,80	0,75 -3,92	2,02 -4,74	11,39 2,07	20,76 6,04
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,26 -0,01	0,36 -0,04	0,30 -0,06	0,89 -0,05	2,05 -0,28	8,50 -0,58	15,48 -0,89
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,63 -0,02	-2,25 -0,08	-1,39 -0,06	4,52 -0,11	9,41 -0,25	18,68 -0,78	36,95 -1,13
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,24 -0,03	0,30 -0,11	0,26 -0,09	0,81 -0,13	1,94 -0,39	8,38 -0,71	15,39 -0,98
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,78 -0,06	-2,03 -0,05	-1,27 -0,08	0,22 -0,08	1,72 -0,22	13,32 -0,54	23,66 -0,78
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	0,45 -0,00	-4,73 -0,06	-3,08 -0,05	5,11 -0,03	10,11 -0,19	18,85 -0,79	42,20 -1,54
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	0,43 -0,03	-4,74 -0,07	-3,09 -0,06	4,95 -0,19	9,86 -0,43	18,68 -0,96	41,74 -2,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	1,11 -0,02	-3,74 -0,03	-2,38 -0,03	-0,38 -0,07	1,27 -0,17	15,09 -0,46	26,90 -0,71
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,63 -0,02	-2,25 -0,08	-1,39 -0,05	4,48 -0,14	9,30 -0,37	18,82 -0,64	36,64 -1,45
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,40 -0,25	1,07 3,25	0,79 2,12	3,49 -1,14	7,39 -2,27	13,80 -5,66	25,07 -13,01
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,66 0,35	0,48 -1,89	0,46 -1,66	2,64 -2,03	4,63 -2,13	18,72 9,40	30,38 15,66
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,02 -0,33	0,99 -0,31	0,86 -0,30	3,91 -0,44	9,09 -0,32	17,10 -1,74	27,65 -2,37
BB PREV RF IRF-M	0,81	-2,03	-1,24	0,24	1,73	13,33	23,64

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,03	-0,04	-0,05	-0,06	-0,21	-0,53	-0,80
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,65	-2,22	-1,37	4,55	9,38	18,91	37,07
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,00	-0,05	-0,04	-0,08	-0,28	-0,55	-1,01
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,48	-4,67	-3,02	5,02	9,90	19,07	42,63
Var. IMA-B 5+ p.p.	0,02	0,00	0,01	-0,12	-0,40	-0,57	-1,10
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	0,63	-2,26	-1,39	4,48	9,33	18,48	36,61
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,09	-0,06	-0,14	-0,34	-0,98	-1,48
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	5,50	12,66	12,86	28,64	44,04	41,93	64,29
% do CDI	2.646,98	1.822,24	2.362,31	2.833,13	2.054,16	563,08	450,70
BRADERCO F I A SELECTION	3,39	-2,29	0,20	14,08	46,56	13,03	28,76
Var. IBOVESPA p.p.	1,46	-2,18	-3,13	-12,47	-1,12	-10,36	-9,30
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	3,58	-3,43	-1,42	17,08	40,82	28,39	50,15
Var. IBOVESPA p.p.	1,64	-3,32	-4,74	-9,46	-6,87	4,99	12,08
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	2,51	-0,24	3,00	22,93	42,15	39,65	61,25
Var. IBOVESPA p.p.	0,58	-0,13	-0,33	-3,62	-5,53	16,25	23,18
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	3,31	4,45	6,00	24,65	47,13	33,10	51,64
Var. IBOVESPA p.p.	1,37	4,55	2,67	-1,89	-0,56	9,71	13,58
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	2,52	-0,29	3,61	24,61	38,83	27,74	52,38
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,49	0,96	-0,42	1,54	1,81	0,56	1,13
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	2,83	0,32	2,72	23,66	44,07	27,77	44,38
Var. IBOVESPA p.p.	0,90	0,43	-0,60	-2,88	-3,61	4,38	6,32
BB AÇÕES DIVIDENDOS	2,61	-1,05	3,49	21,04	30,96	8,83	22,63
Var. IBOVESPA p.p.	0,68	-0,94	0,17	-5,50	-16,72	-14,56	-15,43
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	4,34	3,91	6,76	22,39	39,11	35,14	63,50
Var. IBOVESPA p.p.	2,40	4,01	3,44	-4,16	-8,57	11,74	25,43
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	3,25	2,60	5,58	28,69	49,82	28,94	48,68
Var. IBOVESPA p.p.	1,31	2,71	2,25	2,14	2,13	5,55	10,62
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,61	13,99	7,75	17,57	42,44	98,93	151,36
Var. IBOVESPA p.p.	-1,33	14,09	4,43	-8,98	-5,24	75,53	113,29
CARAGUATATUBA	1,02	-1,00	-0,06	6,79	12,69	16,24	
Var. IPCA + 5,89% p.p.	0,26	-5,27	-3,60	-0,85	-0,31	-6,31	
CDI	0,21	0,69	0,54	1,01	2,14	7,45	14,26
IBOVESPA	1,94	-0,10	3,33	26,55	47,68	23,39	38,06
INPC + 6,00%	0,85	4,28	3,52	7,85	13,99	23,83	37,86
IPCA + 6,00%	0,77	4,30	3,56	7,69	13,11	22,80	36,54

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
<b>Renda Fixa</b>							
IRF-M 1	0,27	0,40	0,36	0,94	2,33	9,09	16,37
IRF-M 1+	1,12	-3,70	-2,35	-0,31	1,43	15,56	27,60
IRF-M TOTAL	0,84	-1,98	-1,19	0,30	1,94	13,86	24,44
IMA-B 5	0,87	0,72	0,62	3,92	8,92	18,36	30,12
IMA-B 5+	0,45	-4,67	-3,03	5,14	10,30	19,64	43,74
IMA-B TOTAL	0,65	-2,17	-1,33	4,63	9,66	19,46	38,08
IMA-C TOTAL							
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,49	-1,16	-0,72	1,64	3,81	12,47	23,58
IMA-GERAL TOTAL	0,51	-0,82	-0,58	1,93	4,62	13,48	24,94
IDKA 2	1,35	1,30	1,16	4,35	9,41	18,84	30,03
IDKA 20	0,37	-6,86	-4,17	7,21	13,61	19,99	56,00
CDI	0,21	0,69	0,54	1,01	2,14	7,45	14,26
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	1,94	-0,10	3,33	26,55	47,68	23,39	38,06
IBRX 100	2,84	2,09	5,28	28,66	51,24	28,38	44,99
IBRX 50	2,90	2,08	5,01	29,80	53,43	25,21	38,51
SMALL CAP	4,38	3,46	7,14	29,74	55,90	48,74	65,09
IFIX	0,51	-0,31	-0,64	3,41	9,89	14,06	22,42
Índice Consumo - ICON	0,76	-3,61	-2,36	10,24	29,24	30,56	42,01
Índice Dividendos - IDIV	2,03	-1,25	4,03	23,07	37,02	27,18	51,25
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	0,31	2,37	2,11	4,67	6,76	9,32	14,72
INPC	0,38	2,35	2,07	4,83	7,59	10,24	15,83
IGPM	1,51	9,89	7,13	14,58	32,02	40,84	53,01
SELIC	0,21	0,69	0,54	1,01	2,14	7,45	14,27
<b>Meta Atuarial</b>							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

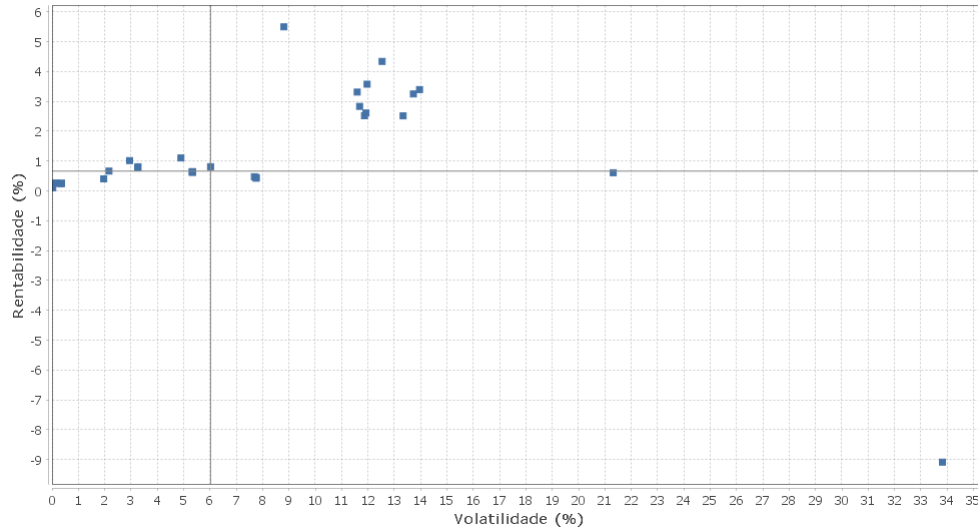
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
53	09/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	225.159,80	0,00	82.572,87420400	2,7268010490
54	09/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.207,61	0,00	809,59701800	2,7268010490
61	09/04/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,00	17.610,45	520,82959024	33,8123070000
73	09/04/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	45.000,00	11.981,60251000	3,7557580000
65	13/04/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	22.058,50	0,00	6,87372676	3.209,1034100000
59	14/04/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	300.214,08	0,00	8.880,40264851	33,8063590000
58	15/04/2021	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	10.000.000,00	0,00	481.242,30583786	20,7795530000
62	15/04/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,00	10.000.000,00	295.705,14884762	33,8174700000
70	15/04/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.000.000,00	2.080.636,30877300	2,4031110000
74	15/04/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	6.000,00	1.596,76472100	3,7575980000
55	16/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	12.309,62	0,00	4.509,64553800	2,7296202980
56	16/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	316.501,58	0,00	115.950,77169900	2,7296202980
60	16/04/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	3.331.119,34	0,00	98.463,51111730	33,8310030000
71	16/04/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5.000.000,00	0,00	804.782,85670873	6,2128560000
57	22/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.314,51	0,00	847,46223100	2,7311069620
66	27/04/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	103.658,21	0,00	32,26750047	3.212,4648170000
69	27/04/2021	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	2.765.587,53	1.818.293,15819200	1,5209800000
72	27/04/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.765.587,53	0,00	735.358,25344700	3,7608710000
63	29/04/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,00	2.560.471,00	75.574,48400608	33,8800990000
67	29/04/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	13.725,88	0,00	4,27178731	3.213,1468660000
75	29/04/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	142.203,61	37.802,41449900	3,7617600000
64	30/04/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,00	8.960,31	264,41776514	33,8869440000
68	30/04/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1.889,15	0,00	0,58770091	3.214,4752070000
<b>Total</b>						



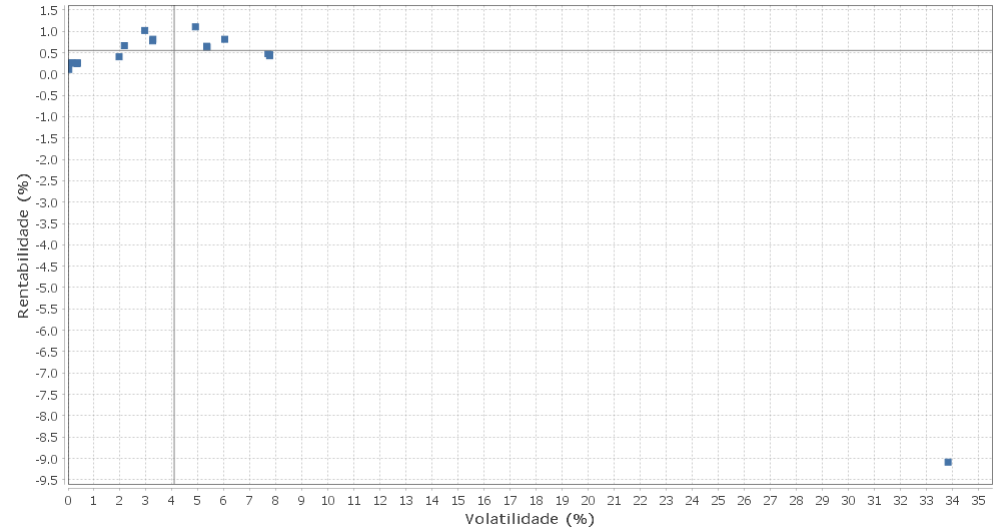
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

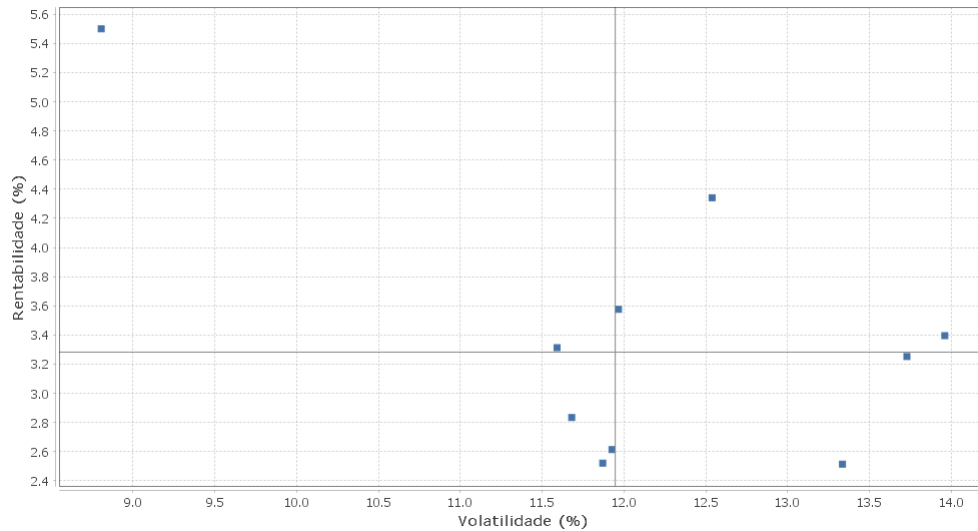
CARAGUATATUBA - No Mês



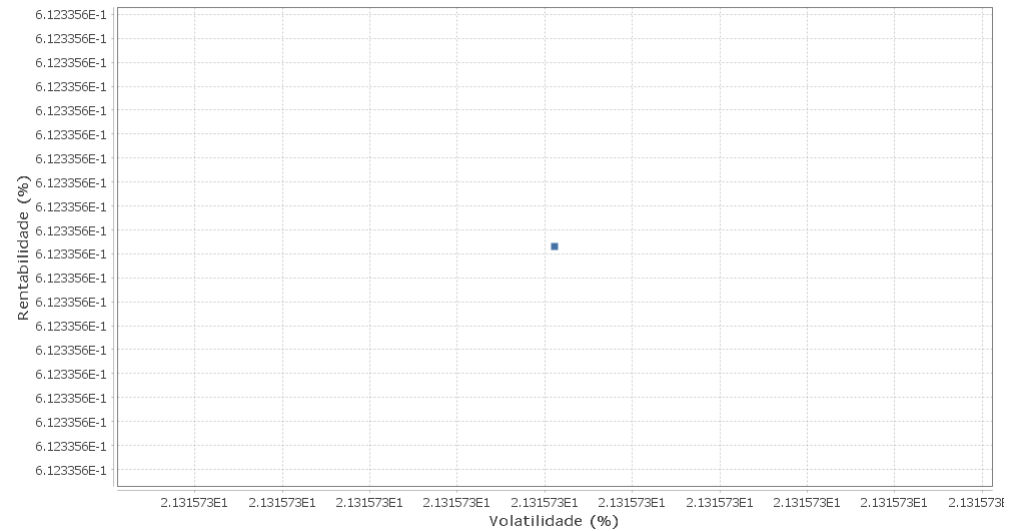
Renda Fixa - No Mês



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\$): 14.990.880,31

Value-At-Risk: 2,79%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	0,00	-3,67	0,11	48.742.843,23	9,09
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,11	0,03	-0,00	0,42	0,25	7.088.722,07	1,32
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,16	0,04	0,00	0,35	0,26	2.995.571,12	0,56
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,35	0,15	0,00	0,10	0,24	6.168.867,27	1,15
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,36	0,14	0,00	0,15	0,26	16.048.530,65	2,99
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,96	0,83	0,00	0,10	0,40	466.550,70	0,09
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,16	1,14	0,08	0,21	0,66	49.423.995,00	9,21
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,95	1,44	0,02	0,28	1,02	11.327.122,57	2,11
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,25	1,44	0,01	0,17	0,78	4.897.110,53	0,91
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,26	1,46	0,03	0,19	0,81	16.166.481,24	3,01
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,90	2,35	0,10	0,18	1,11	33.219.566,55	6,19
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,33	2,90	0,07	0,08	0,65	16.235.440,21	3,03
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	5,33	2,89	0,07	0,08	0,63	16.609.711,42	3,10
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,34	2,89	0,02	0,08	0,63	4.438.597,44	0,83
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,34	2,89	0,19	0,08	0,63	45.201.271,31	8,43
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	6,02	3,06	0,18	0,10	0,81	40.597.463,55	7,57
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,69	4,48	0,16	0,03	0,48	25.325.824,35	4,72
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,75	4,44	0,03	0,03	0,43	4.291.480,24	0,80
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,75	4,49	0,33	0,03	0,45	53.190.172,12	9,92
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	Artigo 8º III	8,81	6,39	0,08	0,60	5,50	14.520.168,63	2,71
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	11,59	8,73	0,09	0,27	3,31	6.606.588,72	1,23
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	11,68	9,43	0,25	0,22	2,83	16.826.861,29	3,14
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	11,87	9,16	0,19	0,19	2,52	13.843.401,22	2,58
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	11,93	8,58	0,02	0,20	2,61	1.581.145,21	0,29
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	11,97	10,49	0,18	0,28	3,58	11.974.196,47	2,23
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	12,54	10,51	0,11	0,33	4,34	6.986.528,70	1,30
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	13,33	9,09	0,12	0,17	2,51	7.958.352,39	1,48
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	13,73	9,40	0,39	0,22	3,25	26.231.574,96	4,89

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRDESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	13,96	9,88	0,08	0,23	3,39	5.870.698,67	1,09
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	21,32	10,26	-0,01	0,02	0,61	20.294.404,18	3,78
FIDC ITALIA SENIOR	Artigo 7º VII, Alínea a	33,82	0,45	0,00	-0,27	-9,09	1.256.758,19	0,23