



CARAGUATATUBA
AGOSTO 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 31.08.2021.

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

REDA FIXA **71,57%**

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	2,99	-0,65	-2,82	16.035.089,83	2,96	6.426.609.886,30	0,25
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,38	0,28	1,29	342.382,24	0,06	151.987.979,03	0,23
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,72	-1,11	-2,33	16.596.920,00	3,06	474.837.001,82	3,50
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,37	0,33	1,16	8.466.702,24	1,56	7.563.467.815,66	0,11
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,74	-1,13	-2,31	16.233.071,73	2,99	7.360.711.745,51	0,22
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,73	-1,14	-2,35	45.153.702,93	8,32	5.489.990.227,20	0,82
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,78	-2,24	-5,55	25.089.570,72	4,62	1.109.310.892,98	2,26
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	5,72	-1,11	-2,35	4.434.471,30	0,82	1.202.361.921,84	0,37
ITAU	ITAU	ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	8,79	-2,23	-5,59	4.253.217,64	0,78	223.279.048,12	1,90
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,83	-2,36	-5,68	52.659.960,05	9,71	1.380.467.864,45	3,81
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	4,61	-1,16	-5,38	32.652.308,65	6,02	1.536.789.095,50	2,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,54	0,19	1,69	11.405.739,22	2,10	11.382.462.168,68	0,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,99	-0,63	-2,77	4.860.335,45	0,90	1.494.910.220,59	0,33
BB	BB	BB PREV RF VII	1,68	0,45	3,32	463.726,17	0,09	240.484.283,62	0,19
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,62	-1,45	-1,51	48.443.663,85	8,93	15.341.053.159,31	0,32
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,99	-1,34	-2,99	287.090.862,02	52,91		

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	0,12	0,52	2,42	7.798.318,43	1,44	1.132.803.539,51	0,69
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,16	-1,00	-2,09	40.810.116,65	7,52	681.209.377,68	5,99
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,27	0,49	2,11	2.147.763,01	0,40	6.449.234.050,26	0,03
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,66	0,31	1,47	49.241.708,06	9,08	3.275.640.848,90	1,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,75	-0,21	0,06	99.997.906,15	18,43		
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	33,20	-0,07	-9,88	1.251.905,70	0,23	49.243.590,33	2,54
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			33,20	-0,07	-9,88	1.251.905,70	0,23		
Renda Fixa			4,42	-1,06	-2,28	388.340.673,87	71,57		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

24,59%

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	19,98	-3,15	1,35	25.910.196,78	4,78	1.253.858.965,59	2,07
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			19,98	-3,15	1,35	25.910.196,78	4,78		

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	20,16	-2,27	-1,70	5.906.080,06	1,09	705.518.161,69	0,84
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	18,51	-3,91	-5,20	1.514.823,08	0,28	814.440.020,06	0,19
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	19,64	-2,76	6,63	7.169.732,54	1,32	2.170.284.029,75	0,33
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	19,18	-3,13	-1,93	16.448.782,29	3,03	984.203.936,75	1,67
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	19,26	-2,88	-1,82	7.832.189,76	1,44	807.828.698,00	0,97
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,09	-1,32	-0,83	13.767.887,24	2,54	1.063.389.651,86	1,29
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	20,49	-1,37	-2,56	12.081.813,58	2,23	2.126.061.463,94	0,57
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,15	-2,21	6,37	6.728.232,04	1,24	3.356.109.147,78	0,20
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			18,36	-2,28	-0,33	71.449.540,59	13,17		

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	14,91	3,36	23,12	36.053.449,66	6,64	2.487.417.356,50	1,45
Sub-total Artigo 8º III			14,91	3,36	23,12	36.053.449,66	6,64		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			18,05	-1,16	2,36	133.413.187,03	24,59		
--	--	--	--------------	--------------	-------------	-----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,84%

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	20,09	2,44	17,01	20.833.364,05	3,84	3.230.077.335,87	0,64
Sub-total Artigo 9º A, III			20,09	2,44	17,01	20.833.364,05	3,84		
Investimentos no Exterior			18,95	2,44	17,01	20.833.364,05	3,84		
Total			5,87	-0,98	-0,94	542.587.224,95	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								Pró-Gestão Nível 1
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	287.090.862,02	52,91	20,00	40,00	80,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	99.997.906,15	18,43	10,00	19,50	35,00	0,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	1.251.905,70	0,23	0,00	0,50	1,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	388.340.673,87	71,57					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	25.910.196,78	4,78	0,00	5,00	10,00	0,00	35,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	71.449.540,59	13,17	5,00	15,00	20,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	36.053.449,66	6,64	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	133.413.187,03	24,59					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	20.833.364,05	3,84	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	20.833.364,05	3,84					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	-1,34 -313,76	-2,99 -144,24	-1,54 -140,27	-0,71 -39,99	1,17 42,99	-4.053.975,17	-9.566.191,86
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,21 -49,28	0,06 2,89	0,17 15,93	1,07 59,97	2,40 88,23	-211.630,35	61.422,49
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-0,07 -17,41	-9,88 -476,87	0,32 28,80	-9,44 -529,42	25,02 921,32	-933,42	-136.753,05
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,15 -0,67	1,35 1,54	-6,39 -0,50	7,82 -0,12	19,71 0,18	-843.270,48	344.067,95
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,28 0,20	-0,33 -0,13	-5,88 0,01	5,85 -2,10	15,35 -4,19	-1.669.376,16	-238.159,67
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	3,36 5,84	23,12 23,32	8,86 14,75	20,09 12,15		920.194,32	2.254.105,00
Artigo 9º A, III % do CDI	2,44 569,09	17,01 820,87	6,70 612,12	6,82 382,66		495.312,60	2.253.560,23
CARAGUATATUBA (Total)						-5.363.678,66	-5.027.948,91

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	16.405.151,41	13.163,07	0,00	0,00	16.233.071,73	-185.242,75	-384.174,43
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	25.664.822,27	0,00	0,00	0,00	25.089.570,72	-575.251,55	-1.475.565,39
BB PREV RF IRF-M	16.139.267,61	0,00	0,00	0,00	16.035.089,83	-104.177,78	-465.611,55
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	7.880.795,22	558.328,63	0,00	0,00	8.466.702,24	27.578,39	81.162,44
BB PREV RF VII	474.773,17	0,00	-13.163,07	0,00	463.726,17	2.116,07	15.385,30
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11.383.618,20	0,00	0,00	0,00	11.405.739,22	22.121,02	202.417,18
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	53.930.908,36	0,00	0,00	0,00	52.659.960,05	-1.270.948,31	-3.168.882,66
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	45.673.062,10	0,00	0,00	0,00	45.153.702,93	-519.359,17	-1.088.377,21
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	33.034.772,24	0,00	0,00	0,00	32.652.308,65	-382.463,59	-1.856.459,78
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.891.312,11	0,00	0,00	0,00	4.860.335,45	-30.976,66	-138.288,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	49.156.224,47	0,00	0,00	0,00	48.443.663,85	-712.560,62	-731.945,04
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	16.783.006,93	0,00	0,00	0,00	16.596.920,00	-186.086,93	-395.317,73
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	4.350.422,61	0,00	0,00	0,00	4.253.217,64	-97.204,97	-251.864,13
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	19.019.614,36	314.431,02	-19.000.000,00	0,00	342.382,24	8.336,86	198.235,85
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	4.484.326,48	0,00	0,00	0,00	4.434.471,30	-49.855,18	-106.906,70
					287.090.862,02	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.333.109,26	0,00	-196.584,93	0,00	2.147.763,01	11.238,68	42.403,41
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	49.091.233,45	0,00	0,00	0,00	49.241.708,06	150.474,61	719.311,43
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	7.492.861,20	265.580,58	0,00	0,00	7.798.318,43	39.876,65	172.348,53
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	41.223.336,94	0,00	0,00	0,00	40.810.116,65	-413.220,29	-872.640,88
					99.997.906,15	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 ITALIA SENIOR	1.252.839,12	0,00	0,00	0,00	1.251.905,70	-933,42	-136.753,05
					1.251.905,70	0,00	0,00

Artigo 8º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	26.753.467,26	0,00	0,00	0,00	25.910.196,78	-843.270,48	344.067,95
					25.910.196,78	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1.576.503,50	0,00	0,00	0,00	1.514.823,08	-61.680,42	-83.070,78

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO F I A SELECTION	6.043.101,79	0,00	0,00	0,00	5.906.080,06	-137.021,73	-102.099,41
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	7.372.947,58	0,00	0,00	0,00	7.169.732,54	-203.215,04	445.993,86
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	13.952.194,27	0,00	0,00	0,00	13.767.887,24	-184.307,03	-115.533,67
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	8.064.226,17	0,00	0,00	0,00	7.832.189,76	-232.036,41	-145.007,06
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	6.879.949,57	0,00	0,00	0,00	6.728.232,04	-151.717,53	402.995,85
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	16.980.756,65	0,00	0,00	0,00	16.448.782,29	-531.974,36	-324.164,29
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	12.249.237,22	0,00	0,00	0,00	12.081.813,58	-167.423,64	-317.274,17
					71.449.540,59	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	15.353.255,34	19.780.000,00	0,00	0,00	36.053.449,66	920.194,32	2.254.105,00
					36.053.449,66	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	20.338.051,45	0,00	0,00	0,00	20.833.364,05	495.312,60	2.253.560,23
					20.833.364,05	0,00	0,00

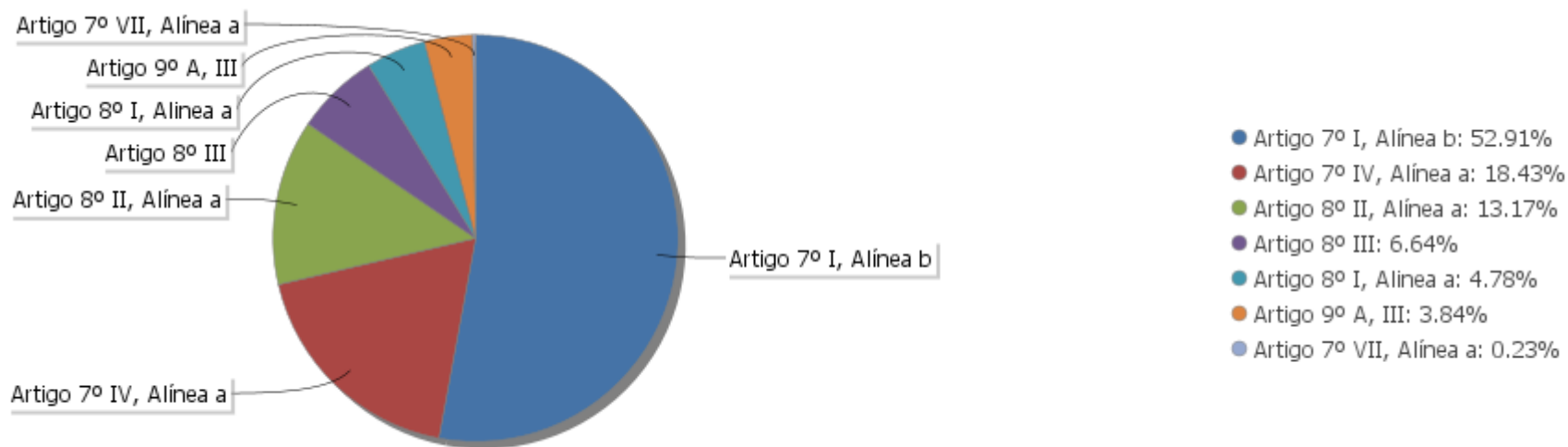
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

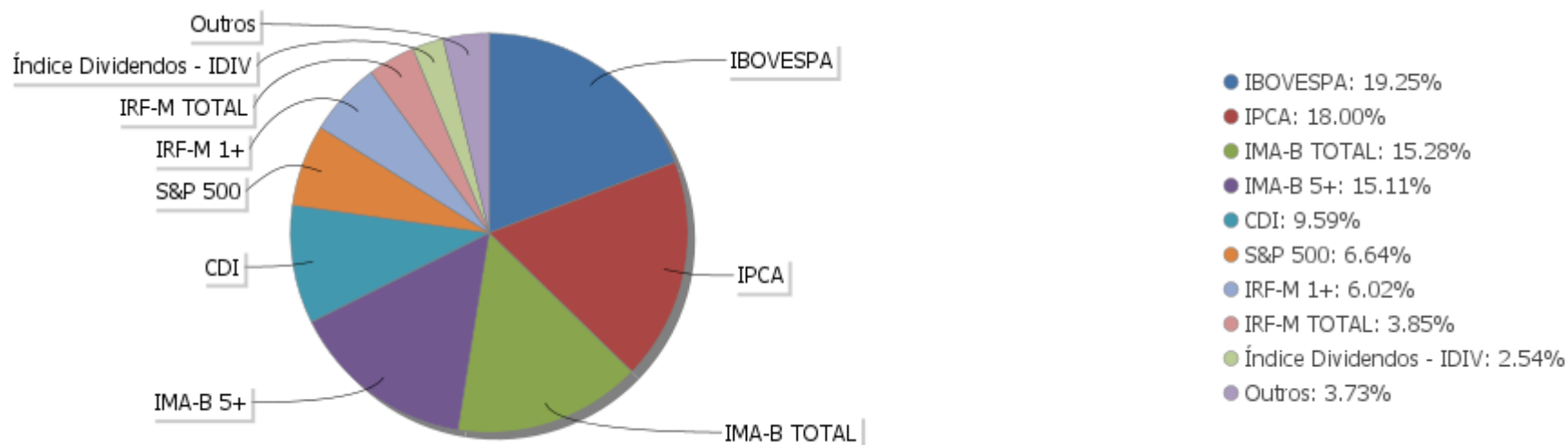
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	500.461.470,46	92,24	500.461.470,46	92,24
de 31 a 365 dias	40.873.848,79	7,53	541.335.319,25	99,77
acima de 365 dias	1.251.905,70	0,23	542.587.224,95	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

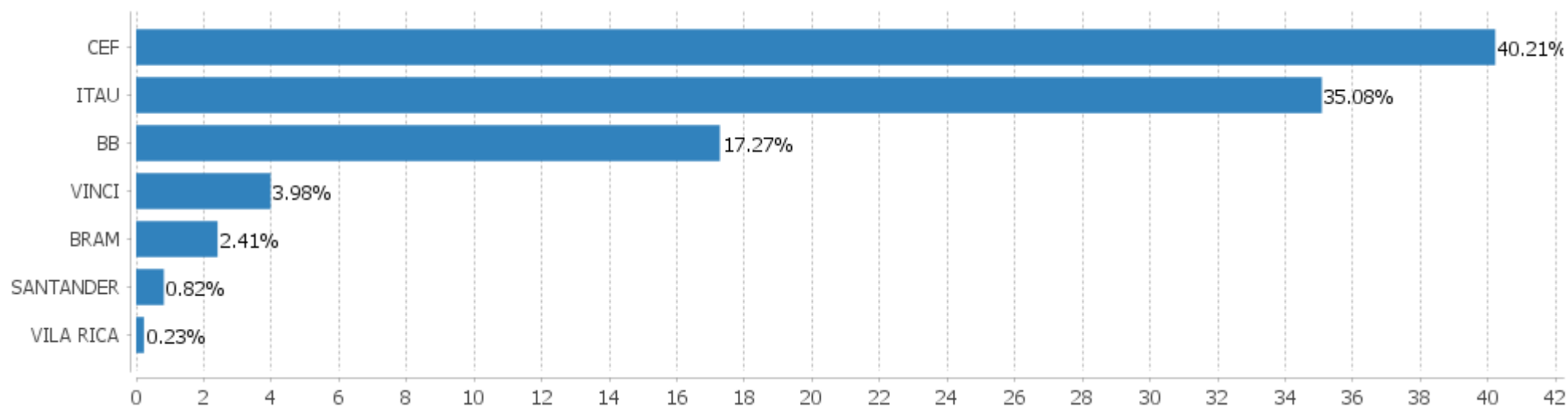


Alocação Por Estratégia



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	1,49	0,37	-0,80	-0,98					-0,94
IPCA + 5,46%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,98	1,43	1,34					9,46
p.p. indexador	-1,61	-2,69	-1,04	0,29	0,21	-0,60	-2,23	-2,32					-10,40
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

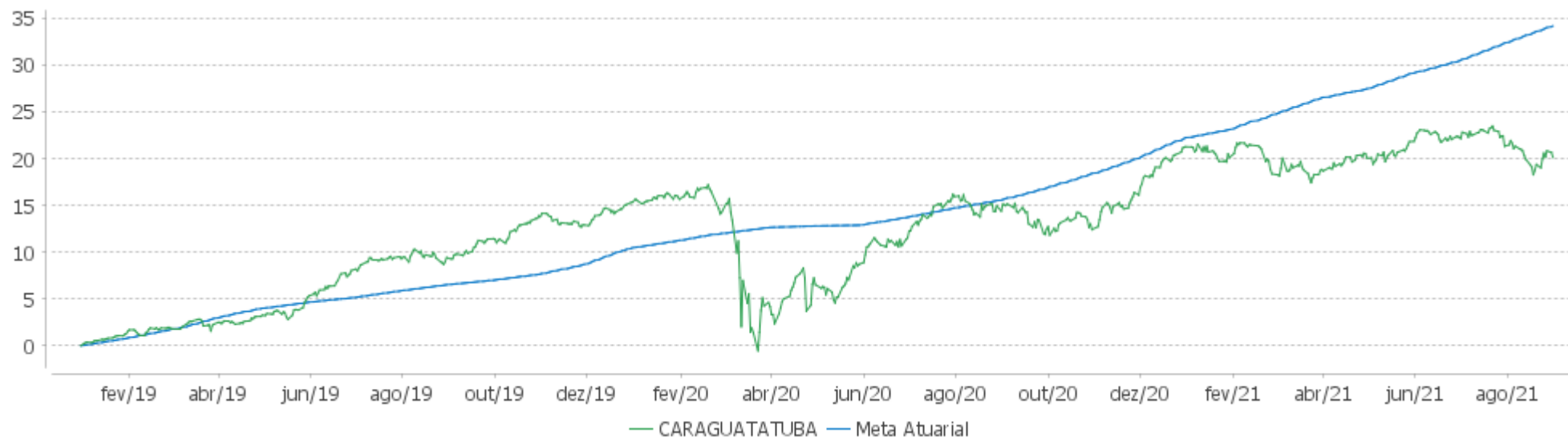
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

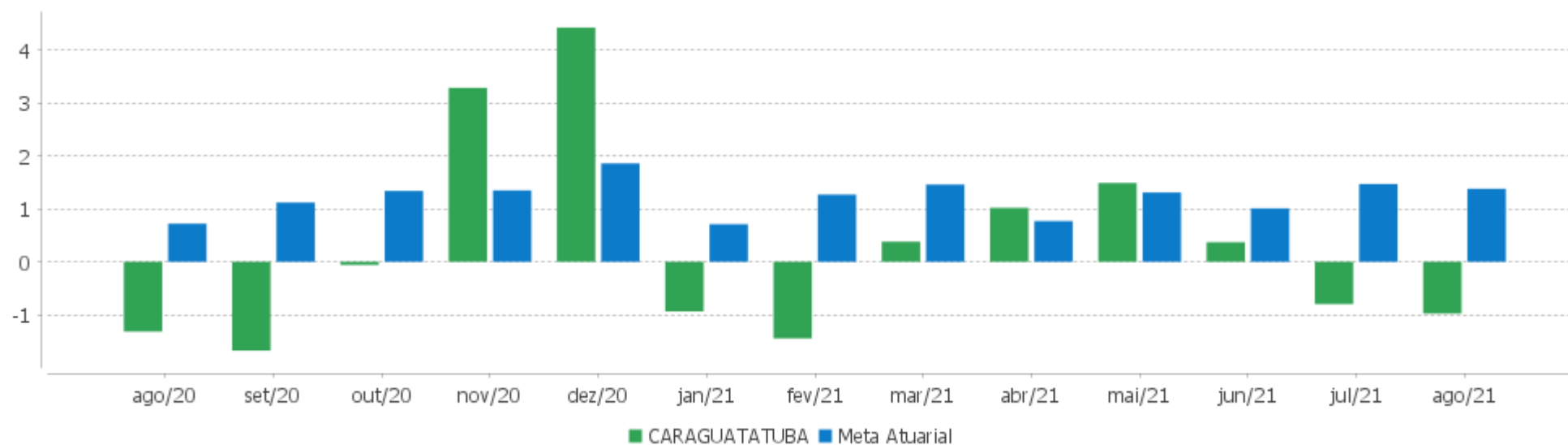
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	15	46,88	03 meses	-1,41	3,79	-5,20	5,28
Meses abaixo - Meta Atuarial	17	53,13	06 meses	1,47	7,39	-5,92	5,46
			12 meses	5,00	15,80	-10,80	5,87
			24 meses	9,78	25,66	-15,87	9,83
			Desde 31/12/2018	20,12	33,94	-13,83	8,68
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	4,43	2020-12					
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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,52 122,21	2,42 116,65	1,37 124,90	2,14 119,99	3,06 112,81	6,68 100,06	13,24 98,99
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	-1,00 -234,23	-2,09 -101,00	-0,79 -71,89	0,59 32,96	3,13 115,14	11,60 173,66	43,67 326,46
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,49 114,70	2,11 101,92	1,25 114,45	1,87 104,77	2,76 101,74	6,22 93,04	12,72 95,09
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,31 -0,56	1,47 -4,20	0,75 -1,63	1,28 -3,23	1,63 -8,05	6,45 -5,90	20,57 4,36
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,28 -0,08	1,29 -0,08	0,73 -0,04	1,18 -0,11	1,96 -0,28	6,90 -0,51	14,57 -0,79
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,14 -0,05	-2,35 -0,18	-1,14 -0,09	0,05 -0,14	3,01 -0,26	9,40 -0,73	39,26 -1,18
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,33 -0,03	1,16 -0,22	0,68 -0,09	1,12 -0,17	1,83 -0,40	6,69 -0,72	14,37 -0,99
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,63 -0,04	-2,77 -0,14	-0,92 -0,06	-0,87 -0,20	-1,50 -0,25	6,86 -0,48	24,47 -0,77
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-2,36 -0,14	-5,68 -0,24	-2,36 -0,19	-1,74 -0,21	1,53 -0,27	5,86 -0,74	45,50 -1,82
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-2,23 -0,01	-5,59 -0,15	-2,22 -0,06	-1,66 -0,13	1,51 -0,29	5,82 -0,78	45,48 -1,85
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	-1,16 -0,04	-5,38 -0,20	-1,85 -0,13	-2,10 -0,23	-3,58 -0,26	6,45 -0,52	28,06 -0,77
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,11 -0,02	-2,33 -0,16	-1,10 -0,06	0,07 -0,12	2,98 -0,29	9,55 -0,57	39,09 -1,34
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,45 1,54	3,32 5,49	1,47 2,51	3,04 2,85	6,51 3,25	12,96 2,84	26,54 -13,90
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-1,45 -2,32	-1,51 -7,19	-2,22 -4,60	-1,04 -5,55	-0,01 -9,69	9,20 -3,15	27,34 11,13
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,19 -0,07	1,69 -0,26	-0,15 0,08	2,10 -0,20	4,83 -0,25	14,10 -1,18	27,77 -2,02
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,65 -0,05	-2,82 -0,20	-0,97 -0,11	-0,86 -0,19	-1,54 -0,29	6,76 -0,59	24,30 -0,94
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	-1,13	-2,31	-1,14	0,07	3,03	9,60	39,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,04	-0,14	-0,09	-0,12	-0,24	-0,52	-1,06
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	-2,24	-5,55	-2,26	-1,65	1,49	6,09	46,05
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,02	-0,11	-0,09	-0,12	-0,31	-0,50	-1,27
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	-1,11	-2,35	-1,11	0,05	2,97	9,25	38,97
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,18	-0,07	-0,14	-0,29	-0,87	-1,46
FIDC ITALIA SENIOR	-0,07	-9,88	0,32	-9,44	25,02	1.570,45	42.559,47
% do CDI	-17,41	-476,87	28,80	-529,42	921,32	23.509,24	318.166,96
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-3,15	1,35	-6,39	7,82	19,71	19,25	62,65
Var. IBOVESPA p.p.	-0,67	1,54	-0,50	-0,12	0,18	1,80	7,74
BRADESCO F I A SELECTION	-2,27	-1,70	-5,08	4,18	15,34	3,86	42,46
Var. IBOVESPA p.p.	0,21	-1,50	0,81	-3,77	-4,20	-13,59	-12,45
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	-1,37	-2,56	-3,44	3,27	11,39	15,54	65,72
Var. IBOVESPA p.p.	1,11	-2,36	2,45	-4,68	-8,14	-1,91	10,81
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	-2,88	-1,82	-7,47	6,02	15,38	20,49	84,31
Var. IBOVESPA p.p.	-0,40	-1,62	-1,58	-1,93	-4,16	3,04	29,40
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-2,21	6,37	-5,41	7,44	21,25	18,06	72,78
Var. IBOVESPA p.p.	0,27	6,57	0,48	-0,51	1,72	0,61	17,87
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	-3,13	-1,93	-7,00	4,44	14,19	15,31	58,97
Var. IBOVESPA p.p.	-0,65	-1,73	-1,11	-3,51	-5,34	-2,14	4,06
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-1,32	-0,83	-6,13	7,69	17,88	16,54	75,29
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,82	-0,64	-1,80	-3,23	-1,51	1,49	2,42
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-3,91	-5,20	-9,88	4,08	8,91	-2,85	33,27
Var. IBOVESPA p.p.	-1,43	-5,00	-3,99	-3,87	-10,62	-20,30	-21,64
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	-2,76	6,63	-5,25	10,42	16,33	23,54	84,21
Var. IBOVESPA p.p.	-0,28	6,83	0,64	2,47	-3,20	6,09	29,30
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	3,36	23,12	8,86	20,09	30,77	54,73	61,08
Var. S&P 500 p.p.	0,02	3,95	3,11	9,73	9,30	-37,34	-32,79
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2,44	17,01	6,70	6,82	16,19	96,21	100,73
Var. IBOVESPA p.p.	4,91	17,21	12,59	-1,12	-3,35	78,76	45,82
CARAGUATATUBA	-0,98	-0,94	-1,41	1,47	5,00	9,78	
Var. IPCA + 5,89% p.p.	-2,36	-10,69	-5,31	-6,15	-11,11	-16,17	
CDI	0,43	2,07	1,10	1,78	2,72	6,68	13,38
IBOVESPA	-2,48	-0,20	-5,89	7,95	19,54	17,45	54,91
INPC + 6,00%	1,39	10,11	4,07	7,96	17,02	27,69	39,70
IPCA + 6,00%	1,38	9,83	3,93	7,68	16,23	26,21	38,28

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	0,37	1,37	0,77	1,29	2,24	7,41	15,36	23,32	39,53
IRF-M 1+	-1,11	-5,18	-1,73	-1,87	-3,32	6,96	28,83	35,92	63,00
IRF-M TOTAL	-0,60	-2,63	-0,86	-0,67	-1,25	7,35	25,24	32,67	56,55
IMA-B 5	0,15	1,47	0,05	1,97	4,77	14,45	30,97	39,69	59,11
IMA-B 5+	-2,22	-5,44	-2,16	-1,52	1,80	6,60	47,32	51,19	76,06
IMA-B TOTAL	-1,09	-2,17	-1,04	0,19	3,27	10,12	40,44	46,85	69,60
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,34	-0,78	-0,12	0,49	1,31	7,55	24,32	31,67	51,95
IMA-GERAL TOTAL	-0,41	-0,37	-0,16	0,57	1,87	8,50	25,67	33,36	53,41
IDKA 2	0,26	1,95	-0,23	2,29	5,08	15,28	29,79	40,22	60,31
IDKA 20	-4,42	-9,21	-4,78	-4,01	0,70	0,45	60,91	59,85	88,93
CDI	0,43	2,07	1,10	1,78	2,72	6,68	13,38	21,12	35,71

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,48	-0,20	-5,89	7,95	19,54	17,45	54,91	67,69	105,15
IBRX 100	-3,25	1,07	-6,53	7,96	20,88	19,52	61,19	73,03	111,89
IBRX 50	-3,50	1,23	-6,61	8,25	22,12	19,45	54,17	67,38	104,18
SMALL CAP	-3,82	0,95	-8,23	6,49	16,98	24,03	87,36	82,99	149,92
IFIX	-2,63	-4,19	-2,37	-4,74	-1,16	3,51	28,53	31,95	55,61
Índice Consumo - ICON	-3,90	-5,90	-8,34	0,65	0,42	6,20	60,80	43,37	64,23
Índice Dividendos - IDIV	-0,50	-0,20	-4,33	10,92	19,40	15,05	72,87	73,37	131,37

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	0,87	5,67	2,38	4,51	9,68	12,35	16,21	21,08	24,05
INPC	0,88	5,94	2,52	4,79	10,42	13,67	17,40	21,68	23,78
IGPM	0,66	16,75	2,06	11,01	31,12	48,19	55,53	69,35	66,46
SELIC	0,41	2,05	1,08	1,76	2,69	6,66	13,35	21,11	35,72

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	3,34	19,17	5,75	10,37	21,46	92,07	93,87	199,05	230,68
MSCI ACWI	2,79	13,52	2,42	4,91	19,14	80,33	76,32	153,23	182,42
MSCI World	2,78	15,58	3,77	7,14	20,26	82,56	79,59	161,97	189,98

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,22	8,46	3,42	6,63	14,05	21,50	30,63	41,51	50,76
IPCA + 5,00%	1,30	9,15	3,67	7,15	15,14	23,85	34,42	47,00	58,11
IPCA + 5,50%	1,34	9,49	3,80	7,41	15,69	25,03	36,34	49,80	61,89
IPCA + 5,89%	1,38	9,76	3,90	7,62	16,11	25,95	37,85	52,02	64,89
IPCA + 6,00%	1,38	9,83	3,93	7,68	16,23	26,21	38,28	52,65	65,74
INPC + 4,00%	1,23	8,73	3,56	6,92	14,82	22,92	31,98	42,21	50,44
INPC + 6,00%	1,39	10,11	4,07	7,96	17,02	27,69	39,70	53,40	65,38

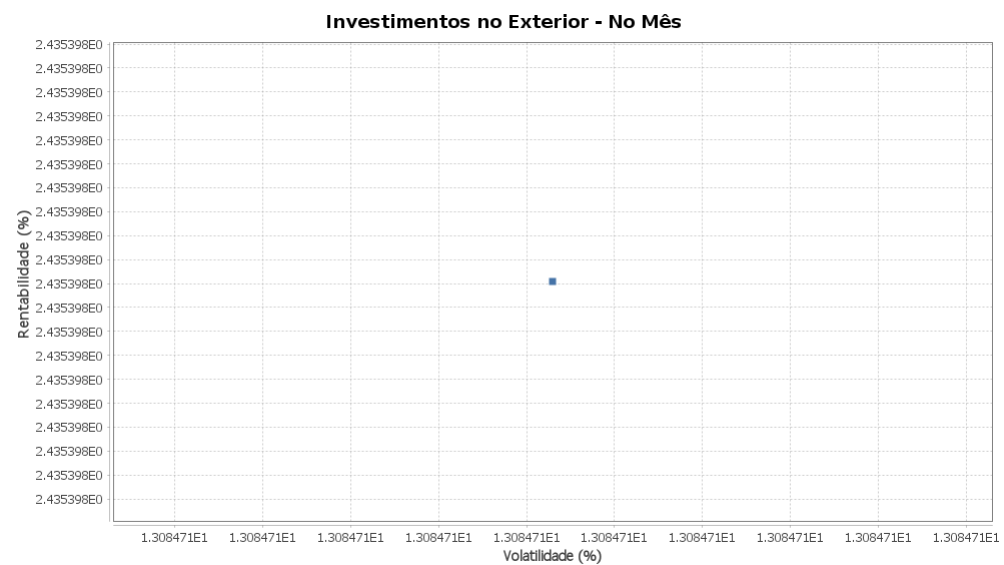
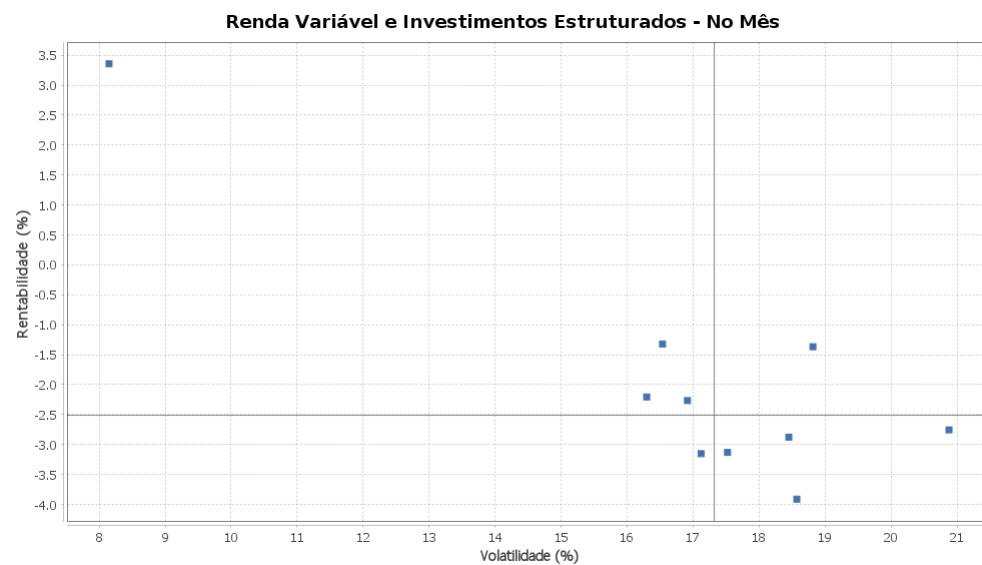
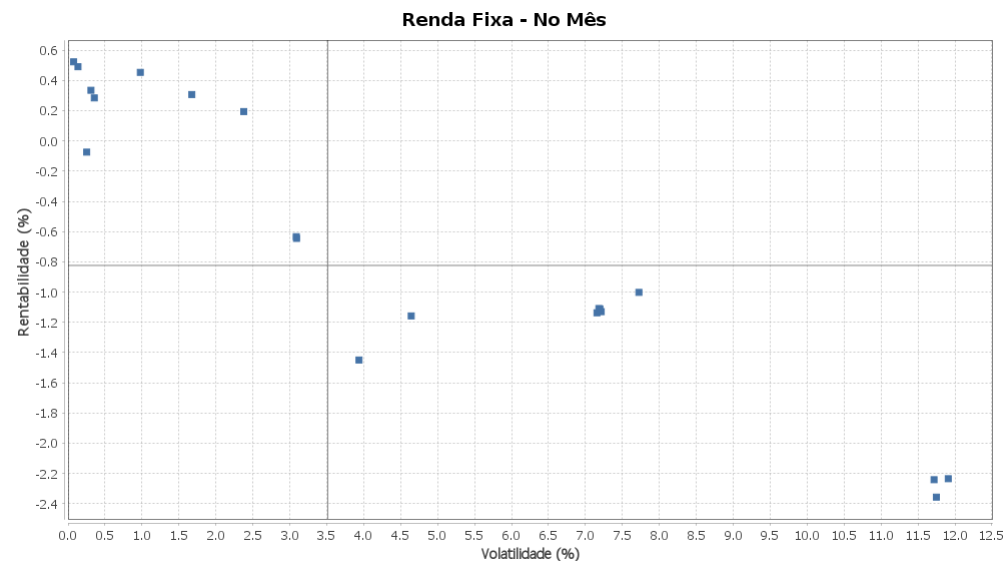
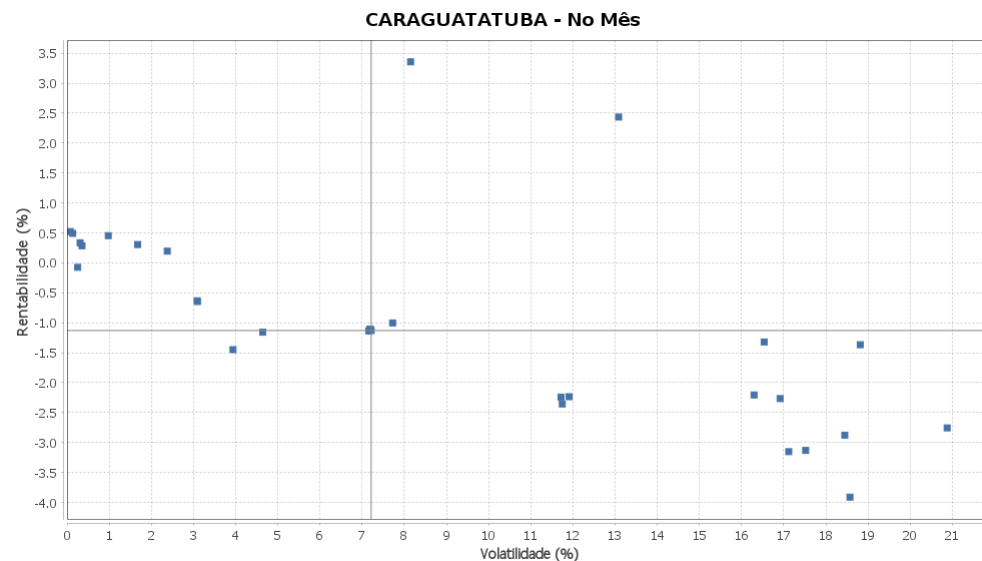
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
134	02/08/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	400,00	0,00	11,73325283	34,0911430000
140	03/08/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	113.462,64	0,00	34,88786820	3.252,2090300000
123	09/08/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.314,21	0,00	842,10188200	2,7481354080
133	09/08/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	224.995,61	0,00	81.872,09747500	2,7481354080
124	10/08/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.207,61	0,00	802,90007000	2,7495451550
130	10/08/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	51.000,00	13.405,14278600	3,8045100000
141	10/08/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	24.340,39	0,00	7,47608010	3.255,7690210000
138	11/08/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,00	19.000.000,00	556.907,86463528	34,1169540000
145	11/08/2021	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	19.000.000,00	0,00	850.067,20452357	22,3511740000
135	13/08/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	295.659,14	0,00	8.665,08758766	34,1207330000
129	16/08/2021	BB PREV RF VII	0,00	13.163,07	6.945,41971100	1,8952159190
132	17/08/2021	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	13.163,07	0,00	2.080,31960500	6,3274267890
125	20/08/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	12.309,62	0,00	4.472,31900200	2,7524020520
126	20/08/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	316.501,58	0,00	114.991,04201300	2,7524020520
146	23/08/2021	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	780.000,00	0,00	34.568,39716358	22,5639620000
136	25/08/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	17.854,88	0,00	522,50469628	34,1717120000
142	27/08/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	111.636,19	0,00	34,17366988	3.266,7310940000
131	30/08/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	145.584,93	38.134,08864300	3,8177110000
137	30/08/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	517,00	0,00	15,12222620	34,1880880000
143	30/08/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	13.737,00	0,00	4,20428406	3.267,3815110000
144	31/08/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.404,36	0,00	0,73572035	3.268,0351890000
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 13.867.933,81

Value-At-Risk: 2,56%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,08	0,05	-0,00	1,26	0,52	7.798.318,43	1,44
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,13	0,05	0,00	0,47	0,49	2.147.763,01	0,40
FIDC ITALIA SENIOR	Artigo 7º VII, Alínea a	0,25	0,45	0,00	-1,99	-0,07	1.251.905,70	0,23
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,31	0,17	0,00	-0,30	0,33	8.466.702,24	1,56
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,36	0,16	-0,00	-0,41	0,28	342.382,24	0,06
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	0,98	0,61	0,00	0,03	0,45	463.726,17	0,09
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	1,67	0,47	0,02	-0,07	0,31	49.241.708,06	9,08
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,38	1,14	0,02	-0,10	0,19	11.405.739,22	2,10
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,09	1,23	0,01	-0,34	-0,63	4.860.335,45	0,90
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,09	1,23	0,03	-0,35	-0,65	16.035.089,83	2,96
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,94	1,48	0,10	-0,48	-1,45	48.443.663,85	8,93
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,64	1,84	0,09	-0,34	-1,16	32.652.308,65	6,02
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,16	3,02	0,22	-0,22	-1,14	45.153.702,93	8,32
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	7,18	3,01	0,08	-0,21	-1,11	16.596.920,00	3,06
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	Artigo 7º I, Alínea b	7,20	3,02	0,02	-0,21	-1,11	4.434.471,30	0,82
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,21	3,03	0,08	-0,22	-1,13	16.233.071,73	2,99
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	7,72	3,08	0,20	-0,19	-1,00	40.810.116,65	7,52
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	Artigo 8º III	8,15	5,55	0,21	0,36	3,36	36.053.449,66	6,64
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	11,72	4,21	0,17	-0,23	-2,24	25.089.570,72	4,62
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	11,75	4,18	0,35	-0,24	-2,36	52.659.960,05	9,71
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	Artigo 7º I, Alínea b	11,91	4,17	0,03	-0,22	-2,23	4.253.217,64	0,78
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	13,08	7,38	-0,04	0,15	2,44	20.833.364,05	3,84
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	16,30	7,51	0,07	-0,16	-2,21	6.728.232,04	1,24
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	16,54	6,70	0,13	-0,11	-1,32	13.767.887,24	2,54
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	16,91	6,78	0,06	-0,16	-2,27	5.906.080,06	1,09
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	17,12	6,52	0,26	-0,21	-3,15	25.910.196,78	4,78
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	17,52	6,44	0,16	-0,20	-3,13	16.448.782,29	3,03
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	18,45	7,39	0,09	-0,18	-2,88	7.832.189,76	1,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	18,57	6,79	0,02	-0,23	-3,91	1.514.823,08	0,28
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	18,82	6,83	0,12	-0,10	-1,37	12.081.813,58	2,23
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	20,88	7,30	0,07	-0,15	-2,76	7.169.732,54	1,32