



TOLEDO  
MARÇO 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									86,14%
------------	--	--	--	--	--	--	--	--	--------

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
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,90	-0,47	-2,86	60.996.235,07	15,46	5.996.206.078,69	1,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,43	0,01	0,05	38.713.104,33	9,81	9.801.758.898,12	0,39
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,04	0,31	-0,23	33.650.662,83	8,53	13.551.415.614,90	0,25
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,53	-1,20	-5,15	6.565.774,18	1,66	1.580.616.679,30	0,42
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,74	0,37	-0,02	35.488.248,97	8,99	10.861.361.928,62	0,33
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,14	-0,89	-2,79	37.767.565,06	9,57	1.953.428.365,60	1,93
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	4,08	-0,42	-1,88	20.471.187,66	5,19	9.507.617.903,00	0,22
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,78	0,30	-0,18	66.870.403,74	16,95	15.491.489.347,05	0,43
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	5,25	0,07	-1,53	9.081.528,00	2,30	174.884.520,39	5,19
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>4,06</b>	<b>-0,13</b>	<b>-1,30</b>	<b>309.604.709,84</b>	<b>78,46</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
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,48	0,16	0,43	15.421.308,41	3,91	5.035.220.681,40	0,31
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,37	0,10	0,34	3.151.696,84	0,80	5.408.705.211,16	0,06
CEF	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	3,70	0,33	-0,11	11.732.070,81	2,97	852.735.010,80	1,38
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>0,73</b>	<b>0,22</b>	<b>0,22</b>	<b>30.305.076,06</b>	<b>7,68</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>3,75</b>	<b>-0,10</b>	<b>-1,16</b>	<b>339.909.785,90</b>	<b>86,14</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

11,32%

#### 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
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	43,81	9,55	-8,53	1.318.660,99	0,33	431.633.256,76	0,31
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	25,35	2,91	-0,00	5.611.784,83	1,42	988.569.327,17	0,57
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	27,27	2,13	-4,67	1.510.746,94	0,38	630.846.852,38	0,24
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	24,71	5,62	-2,74	4.204.574,82	1,07	979.013.916,36	0,43
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	28,90	4,73	-0,93	1.876.875,96	0,48	1.134.931.034,81	0,17
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	26,05	-1,18	-6,76	3.130.370,15	0,79	2.066.276.030,96	0,15
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	26,61	2,12	1,10	4.782.006,00	1,21	3.385.715.282,16	0,14
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	25,19	3,18	-2,28	6.555.398,93	1,66	1.025.557.184,19	0,64
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>25,84</b>	<b>3,13</b>	<b>-2,23</b>	<b>28.990.418,62</b>	<b>7,35</b>		

#### Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	4,60	1,37	0,71	4.825.552,19	1,22	4.658.610.325,77	0,10
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	20,92	4,05	6,80	10.849.194,70	2,75	1.178.826.435,94	0,92
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>6,55</b>	<b>3,04</b>	<b>4,23</b>	<b>15.674.746,89</b>	<b>3,97</b>		
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>			<b>19,59</b>	<b>3,05</b>	<b>-0,53</b>	<b>44.665.165,51</b>	<b>11,32</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**INVESTIMENTOS NO EXTERIOR**
**2,54%**
**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	24,18	3,43	13,29	10.021.091,96	2,54	2.719.540.696,03	0,37
		<b>Sub-total Artigo 9º A, III</b>	<b>24,18</b>	<b>3,43</b>	<b>13,29</b>	<b>10.021.091,96</b>	<b>2,54</b>		
		<b>Investimentos no Exterior</b>	<b>24,18</b>	<b>3,43</b>	<b>13,29</b>	<b>10.021.091,96</b>	<b>2,54</b>		
		<b>Total</b>	<b>4,56</b>	<b>0,32</b>	<b>-0,80</b>	<b>394.596.043,37</b>	<b>100,00</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2
				Mínimo	Objetivo	Máximo	
<b>Renda Fixa</b>							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	309.604.709,84	78,46	60,00	67,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	30.305.076,06	7,68	0,00	7,00	40,00	50,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>339.909.785,90</b>	<b>86,14</b>				100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	28.990.418,62	7,35	0,00	15,00	20,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	15.674.746,89	3,97	0,00	5,00	10,00	10,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>44.665.165,51</b>	<b>11,32</b>				40,00
<b>Investimentos no Exterior</b>							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	10.021.091,96	2,54	0,00	6,00	10,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>10.021.091,96</b>	<b>2,54</b>				10,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades por Artigo

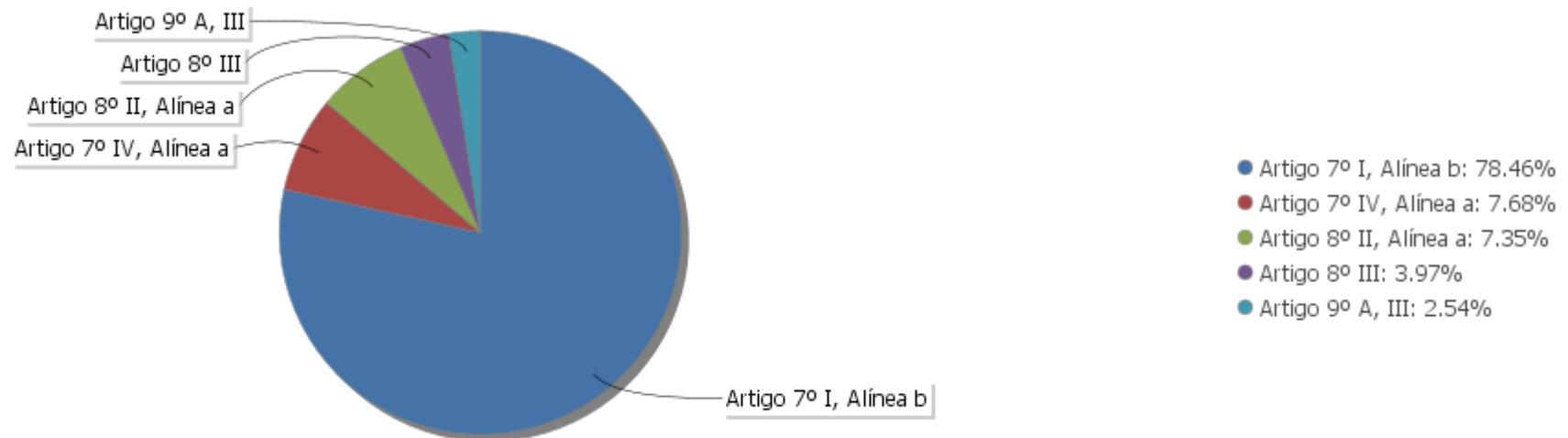
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,13 -62,52	-1,30 -266,60	-1,30 -266,60	2,00 208,77	5,99 269,40	-441.261,61	-4.179.189,14
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,22 107,36	0,22 45,08	0,22 45,08	1,10 114,24	2,02 90,97	65.281,25	66.312,84
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	3,13 -2,87	-2,23 -0,23	-2,23 -0,23	18,21 -5,08	53,13 -6,60	883.828,95	-637.190,06
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	3,04 -2,96	4,23 6,23	4,23 6,23	10,09 -13,20	13,73 -46,00	393.225,90	509.083,74
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	64,18 2.887,68	332.115,95	1.021.876,66
<b>TOLEDO (Total)</b>						<b>1.233.190,44</b>	<b>-3.219.105,96</b>

### Análise de Liquidez

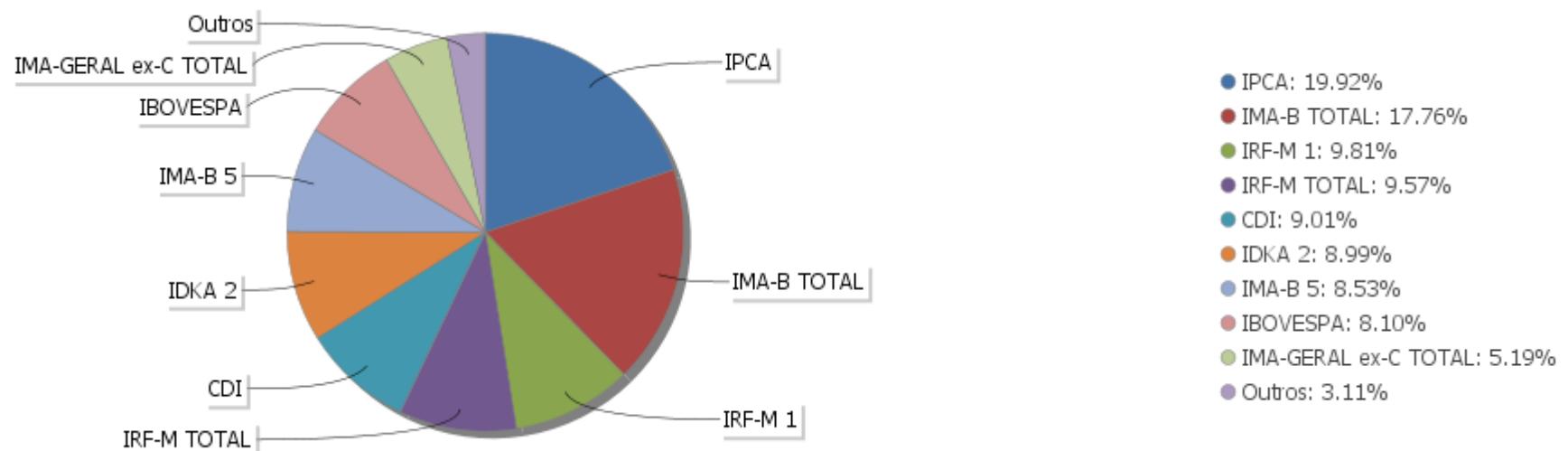
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	361.230.380,64	91,54	361.230.380,64	91,54
de 31 a 365 dias	24.284.134,73	6,15	385.514.515,37	97,70
acima de 365 dias	9.081.528,00	2,30	394.596.043,37	100,00

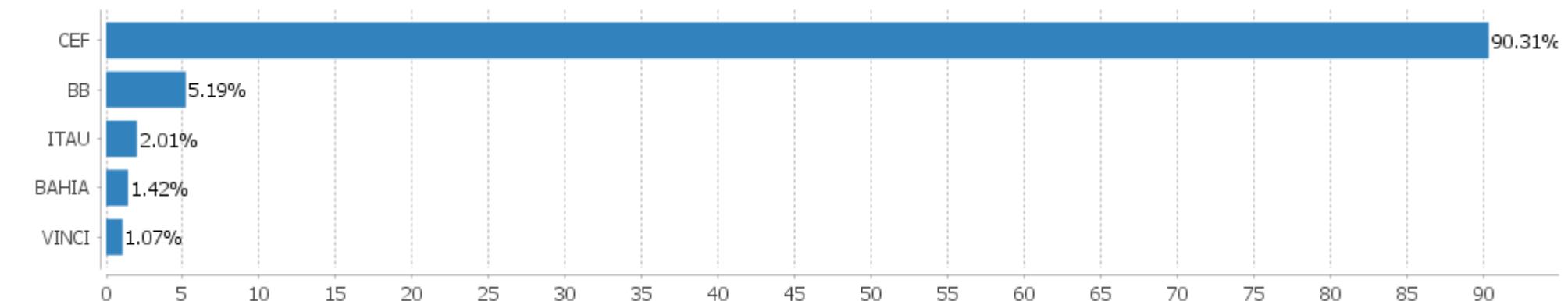
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### 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	-0,35	-0,77	0,32										-0,80
INPC + 5,42%	0,69	1,20	1,35										3,27
p.p. indexador	-1,04	-1,97	-1,02										-4,07
2020	0,52	-0,14	-3,86	1,35	1,57	1,44	1,98	-0,63	-0,87	-0,13	1,81	2,48	5,48
INPC + 5,87%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,96	0,84	1,35	1,37	1,41	1,97	11,61
p.p. indexador	-0,17	-0,72	-4,54	1,12	1,37	0,66	1,02	-1,47	-2,22	-1,50	0,40	0,51	-6,13

### PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

### RELATÓRIO TRIMESTRAL

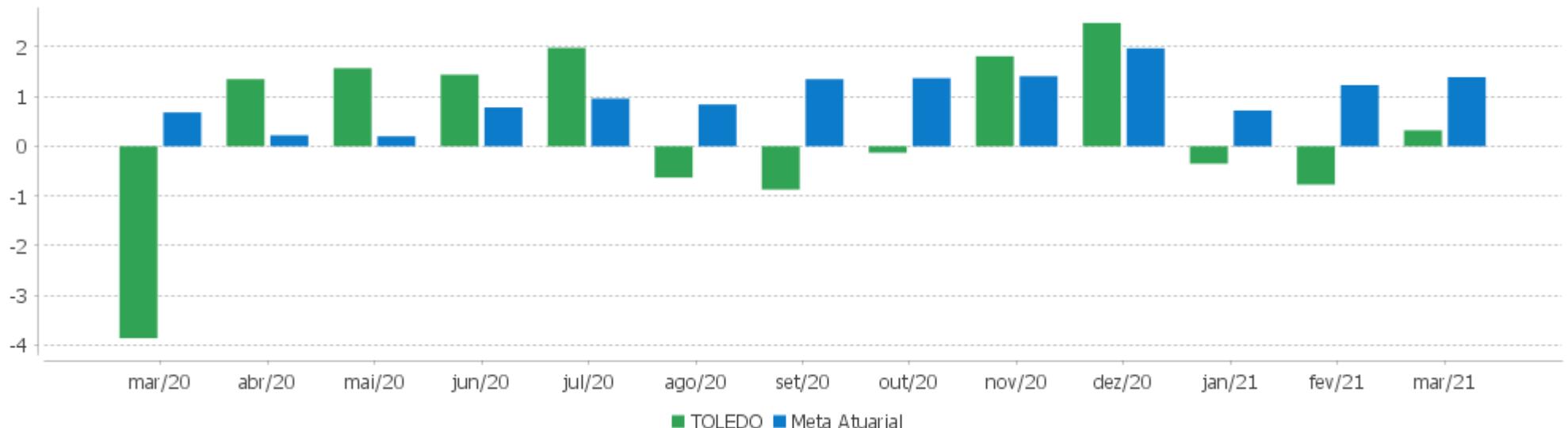
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	6	40,00	03 meses	-0,80	3,27	-4,07	3,67
Meses abaixo da Meta Atuarial	9	60,00	06 meses	3,37	8,25	-4,88	3,39
			12 meses	8,43	13,05	-4,62	4,56
	Rentabilidade	Mês	24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,48	2020-12	36 meses				
Menor rentabilidade da Carteira	-3,86	2020-03	Desde 31/12/2019	4,64	15,26	-10,63	6,89

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução



### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,16 77,21	0,43 88,79	0,43 88,79	0,90 93,57	1,84 82,91	7,41 95,28	13,96 95,48
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
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,33 -0,60	-0,11 -2,16	-0,11 -2,16	1,45 -3,79			
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,07 0,53	-1,53 1,28	-1,53 1,28	2,34 -1,83	8,41 -1,97	18,41 -2,07	
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
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,31 -0,03	-0,23 -0,08	-0,23 -0,08	3,08 -0,14	8,20 -0,30	17,97 -0,67	28,58 -0,95
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,42 -0,04	-1,88 -0,24	-1,88 -0,24	1,24 0,09	4,35 0,17	13,27 0,41	23,79 0,44
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
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,01 -0,04	0,05 -0,07	0,05 -0,07	0,70 -0,13	2,27 -0,23	8,88 -0,45	15,96 -0,68
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
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	1,37 683,41	0,71 145,20	0,71 145,20	4,97 517,72	11,02 495,95	18,17 233,57	30,30 207,27
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP % do CDI	4,05 2.013,14	6,80 1.398,84	6,80 1.398,84	18,84 1.962,63	51,15 2.301,64	38,08 489,46	
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	2,13 -0,19	-4,67 -0,91	-4,67 -0,91	5,38 -2,73	48,20 -1,52	38,89 -6,46	32,97
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-1,18 -7,18	-6,76 -4,76	-6,76 -4,76	11,03 -12,26	50,86 -8,86	25,29 3,05	47,94 11,31
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	4,73	-0,93	-0,93	20,40	60,71	38,55	50,22

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/03/2021

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-1,27	1,07	1,07	-2,89	0,98	16,31	13,60
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	2,91	-0,00	-0,00	25,37	65,44	29,81	49,74
Var. IBOVESPA p.p.	-3,08	2,00	2,00	2,08	5,71	7,57	13,11
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	9,55	-8,53	-8,53	8,14	25,03	13,55	21,57
% do CDI	4.750,58	-1.754,82	-1.754,82	847,57	1.126,21	174,19	147,60
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
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	3,18	-2,28	-2,28	16,12	54,35		
Var. IBOVESPA p.p.	-2,82	-0,27	-0,27	-7,17	-5,38		
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
TOLEDO	0,32	-0,80	-0,80	3,37	8,43		
Var. INPC + 5,87% p.p.	-1,06	-4,18	-4,18	-4,99	-4,74		
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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
<b>Renda Fixa</b>							
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
<b>Renda Variável</b>							
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			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
<b>Indicadores Econômicos</b>							
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
<b>Meta Atuarial</b>							

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/03/2021

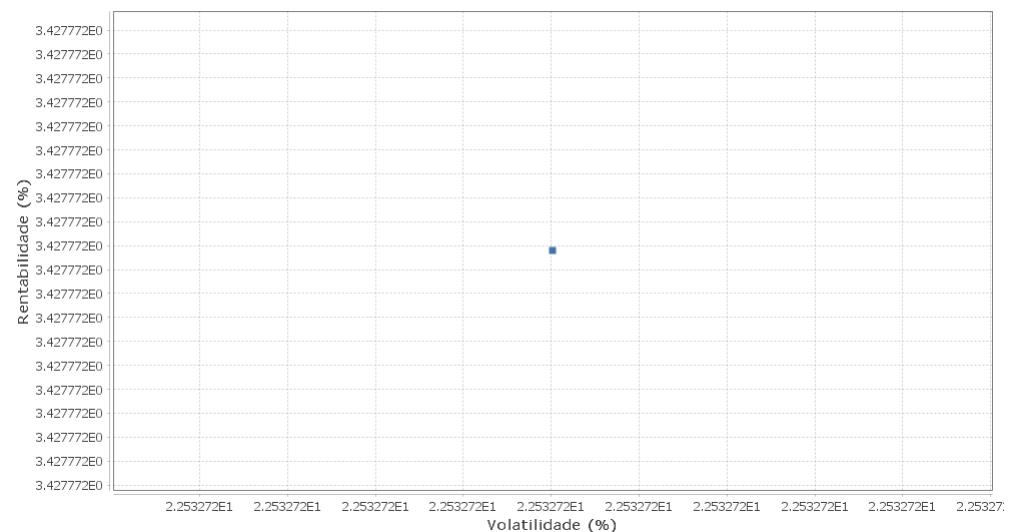
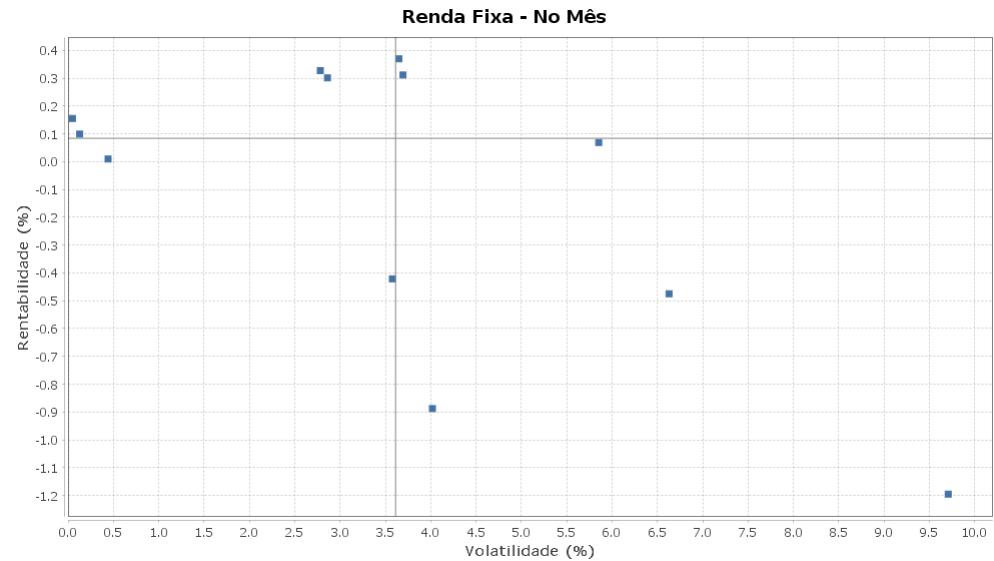
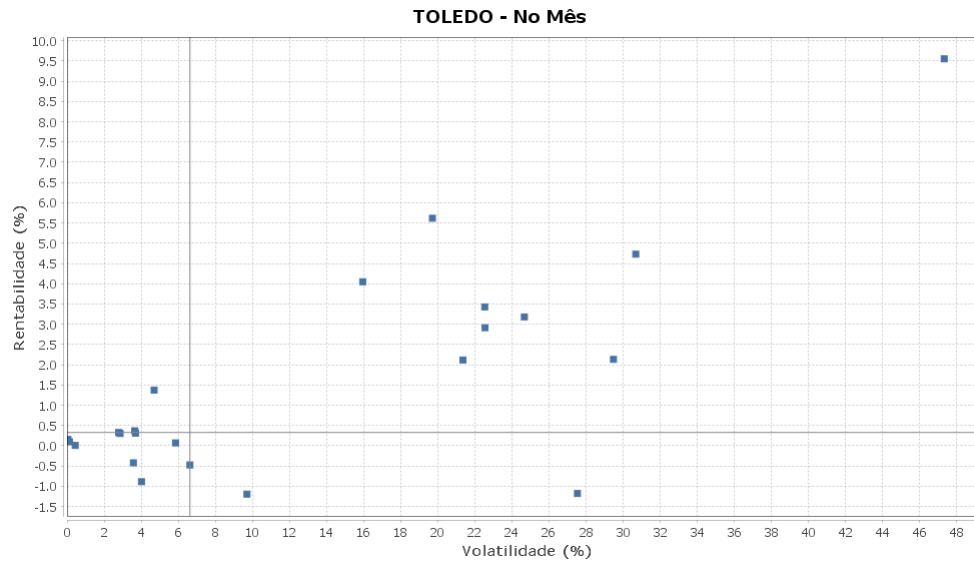
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
15	04/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.000.000,00	2.163.158,38429374	2,3114350000
16	04/03/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.000.000,00	0,00	1.550.839,14355218	3,2240610000
17	05/03/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.937.677,07	0,00	1.635.542,73070811	2,4075660000
18	09/03/2021	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	363.674,09	0,00	312.308,41300470	1,1644710000
19	16/03/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12.440,78	0,00	5.173,84742515	2,4045510000
20	26/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.472.524,78	563.631,39395085	2,6125670000
21	29/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	3.360.115,95	1.472.697,71818623	2,2816060000
22	29/03/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.470.929,80	0,00	1.738.031,47396431	1,4216830000
<b>Total</b>						

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Risco - Dispersão



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 6.682.809,62

Value-At-Risk: 1,69%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,04	0,00	-0,95	0,16	15.421.308,41	3,91
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,13	0,04	0,00	-0,79	0,10	3.151.696,84	0,80
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,44	0,14	0,01	-0,43	0,01	38.713.104,33	9,81
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	Artigo 7º IV, Alínea a	2,78	0,95	0,02	0,05	0,33	11.732.070,81	2,97
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,86	0,94	0,14	0,03	0,30	66.870.403,74	16,95
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,58	1,36	0,06	-0,17	-0,42	20.471.187,66	5,19
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,65	1,45	0,11	0,05	0,37	35.488.248,97	8,99
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,70	1,43	0,10	0,03	0,31	33.650.662,83	8,53
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,02	1,34	0,10	-0,27	-0,89	37.767.565,06	9,57
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	4,70	2,15	0,02	0,25	1,37	4.825.552,19	1,22
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,85	2,01	0,04	-0,02	0,07	9.081.528,00	2,30
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,63	2,82	0,35	-0,10	-0,47	60.996.235,07	15,46
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	9,71	4,78	0,06	-0,14	-1,20	6.565.774,18	1,66
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	15,95	6,77	0,10	0,24	4,05	10.849.194,70	2,75
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	19,71	10,02	0,08	0,27	5,62	4.204.574,82	1,07
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	21,36	8,95	0,09	0,09	2,12	4.782.006,00	1,21
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	22,53	10,08	-0,00	0,14	3,43	10.021.091,96	2,54
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,55	9,68	0,11	0,12	2,91	5.611.784,83	1,42
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	24,67	9,88	0,13	0,12	3,18	6.555.398,93	1,66
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	27,53	10,55	0,06	-0,05	-1,18	3.130.370,15	0,79
FIA CAIXA CONSUMO	Artigo 8º II, Alínea a	29,47	10,84	0,03	0,07	2,13	1.510.746,94	0,38
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	30,68	10,54	0,04	0,15	4,73	1.876.875,96	0,48
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	Artigo 8º II, Alínea a	47,32	18,47	0,05	0,20	9,55	1.318.660,99	0,33