



LDB
EMPRESAS

TOLEDO
JUNHO 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 30.06.2021.

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

RENTA FIXA

78,75%

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	5,72	0,40	-0,84	62.269.556,79	15,29	5.867.854.510,24	1,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,33	0,19	0,70	38.961.888,68	9,56	8.267.613.291,28	0,47
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,55	-0,15	1,15	34.116.654,02	8,37	14.363.834.668,17	0,24
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,88	0,77	-2,65	6.738.715,85	1,65	1.599.152.888,14	0,42
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,47	-0,28	1,56	32.563.057,61	7,99	11.796.463.834,87	0,28
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,97	0,18	-1,69	18.191.689,67	4,47	1.645.783.274,49	1,11
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,94	0,11	-0,68	20.720.525,39	5,09	9.201.718.777,36	0,23
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,33	-0,00	0,72	67.473.414,51	16,56	16.058.908.177,46	0,42
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,00	-0,33	0,14	9.234.780,00	2,27	177.835.742,01	5,19
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,92	0,08	0,03	290.270.282,52	71,26		

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	0,47	0,31	1,16	15.532.846,92	3,81	5.225.006.230,82	0,30
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,26	0,31	1,16	3.177.392,83	0,78	5.582.841.841,27	0,06
CEF	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,13	0,11	0,72	11.829.332,84	2,90	1.001.985.294,49	1,18
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,79	0,23	0,99	30.539.572,59	7,50		

Renda Fixa			2,70	0,10	0,11	320.809.855,11	78,75		
------------	--	--	------	------	------	----------------	-------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

15,03%

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	33,64	-3,46	-7,63	1.331.616,61	0,33	406.327.856,78	0,33
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	20,03	-0,56	7,86	6.052.949,31	1,49	1.093.616.523,63	0,55
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	21,85	0,52	2,70	1.627.572,38	0,40	575.413.760,97	0,28
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,69	-1,76	3,78	4.486.631,58	1,10	1.018.349.879,65	0,44
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	21,68	1,09	11,45	2.111.422,99	0,52	1.246.438.857,80	0,17
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	20,91	1,80	2,73	3.448.938,17	0,85	2.253.324.643,65	0,15
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,97	-0,21	12,22	5.308.133,58	1,30	3.594.423.115,17	0,15
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	18,75	1,66	7,83	8.363.627,62	2,05	1.144.591.390,81	0,73
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			19,31	0,16	6,62	32.730.892,24	8,03		

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	3,67	-0,17	3,12	4.941.195,63	1,21	4.432.831.656,33	0,11
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	15,05	2,71	16,15	23.566.589,34	5,79	2.298.502.554,43	1,03
Sub-total Artigo 8º III			7,76	2,16	11,51	28.507.784,97	7,00		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			15,43	1,05	7,66	61.238.677,21	15,03		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,22%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	19,83	5,86	7,11	10.711.451,14	2,63	560.062.356,02	1,91
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	24,39	-1,15	0,45	5.022.726,51	1,23	1.609.258.405,72	0,31
Sub-total Artigo 9º A, II			8,19	3,51	4,89	15.734.177,65	3,86		

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	21,15	-1,19	8,36	9.584.616,92	2,35	2.860.128.891,15	0,34
Sub-total Artigo 9º A, III			21,15	-1,19	8,36	9.584.616,92	2,35		
Investimentos no Exterior			20,95	1,68	12,21	25.318.794,57	6,22		
Total			3,38	0,33	1,32	407.367.326,89	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								Pró-Gestão Nível 2
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	290.270.282,52	71,26	60,00	67,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	30.539.572,59	7,50	0,00	7,00	40,00	0,00	50,00
	Total Renda Fixa	320.809.855,11	78,75					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	32.730.892,24	8,03	0,00	15,00	20,00	0,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	28.507.784,97	7,00	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	61.238.677,21	15,03					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	15.734.177,65	3,86	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	9.584.616,92	2,35	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	25.318.794,57	6,22					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	0,08 26,63	0,03 2,02	1,34 169,87	0,03 2,02	3,85 169,03	214.922,27	-148.217,24
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,23 74,86	0,99 77,84	0,77 98,21	0,99 77,84	2,05 90,09	70.201,42	300.809,37
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,16 -0,30	6,62 0,08	9,05 0,34	6,62 0,08	29,70 -3,70	49.726,14	2.016.671,27
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,16 1,69	11,51 4,97	6,99 -1,73	11,51 4,97	17,82 -15,58	554.016,08	1.791.170,61
Artigo 9º A, II % do CDI	3,51 1.141,95	4,89 1.220,64				534.224,09	734.177,65
Artigo 9º A, III % do CDI	-1,19 -386,15	8,36 654,26	-4,36 -552,79	8,36 654,26	26,23 1.152,26	-115.280,48	585.401,62
TOLEDO (Total)						1.307.809,52	5.280.013,28

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 ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	20.697.448,53	0,00	0,00	0,00	20.720.525,39	23.076,86	-142.093,85
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.265.074,00	0,00	0,00	0,00	9.234.780,00	-30.294,00	12.729,08
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	35.454.868,84	4.137.003,40	-6.897.120,65	0,00	32.563.057,61	-131.693,98	556.723,26
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.687.081,52	0,00	0,00	0,00	6.738.715,85	51.634,33	-183.791,46
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	34.167.806,40	0,00	0,00	0,00	34.116.654,02	-51.152,38	396.764,00
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	62.020.627,81	0,00	0,00	0,00	62.269.556,79	248.928,98	-524.460,93
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	38.888.531,27	0,00	0,00	0,00	38.961.888,68	73.357,41	268.827,50
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	18.158.589,68	0,00	0,00	0,00	18.191.689,67	33.099,99	-1.013.474,29
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	67.475.449,45	0,00	0,00	0,00	67.473.414,51	-2.034,94	480.559,45
					290.270.282,52	214.922,27	0,05

Artigo 7º IV, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.167.706,13	0,00	0,00	0,00	3.177.392,83	9.686,70	38.620,05
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.484.787,43	0,00	0,00	0,00	15.532.846,92	48.059,49	177.781,42
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	11.816.877,61	0,00	0,00	0,00	11.829.332,84	12.455,23	84.407,90
					30.539.572,59	70.201,42	0,02

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	6.086.901,11	0,00	0,00	0,00	6.052.949,31	-33.951,80	441.080,41
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	1.379.325,47	0,00	0,00	0,00	1.331.616,61	-47.708,86	-109.958,65
FIA CAIXA CONSUMO	1.619.174,48	0,00	0,00	0,00	1.627.572,38	8.397,90	42.768,31
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	2.088.727,12	0,00	0,00	0,00	2.111.422,99	22.695,87	216.944,80
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.566.870,68	0,00	0,00	0,00	4.486.631,58	-80.239,10	163.601,91
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	7.873.537,97	359.264,11	0,00	0,00	8.363.627,62	130.825,54	592.527,77
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	5.319.358,98	0,00	0,00	0,00	5.308.133,58	-11.225,40	578.113,60
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	3.388.006,18	0,00	0,00	0,00	3.448.938,17	60.931,99	91.593,12
					32.730.892,24	49.726,14	0,01

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	20.533.292,59	2.470.929,80	0,00	0,00	23.566.589,34	562.366,95	1.641.721,47
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	4.949.546,50	0,00	0,00	0,00	4.941.195,63	-8.350,87	149.449,14
					28.507.784,97	554.016,08	0,14

Artigo 9º A, II

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	10.118.799,13	0,00	0,00	0,00	10.711.451,14	592.652,01	711.451,14
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	5.081.154,43	0,00	0,00	0,00	5.022.726,51	-58.427,92	22.726,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					15.734.177,65	534.224,09	0,13

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	9.699.897,40	0,00	0,00	0,00	9.584.616,92	-115.280,48	585.401,62
					9.584.616,92	-115.280,48	-0,03

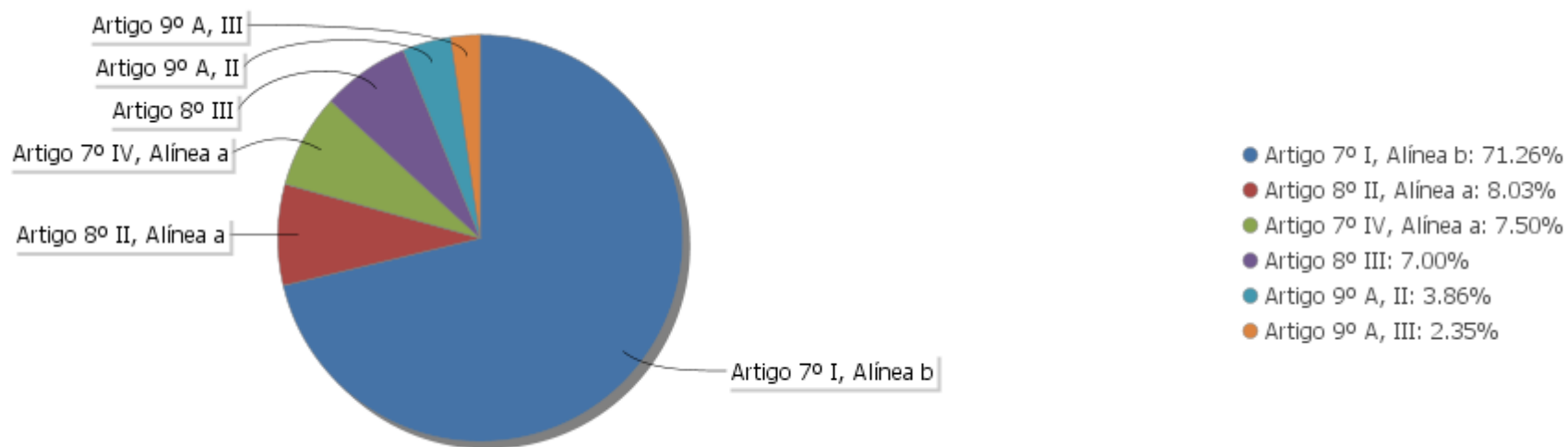
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

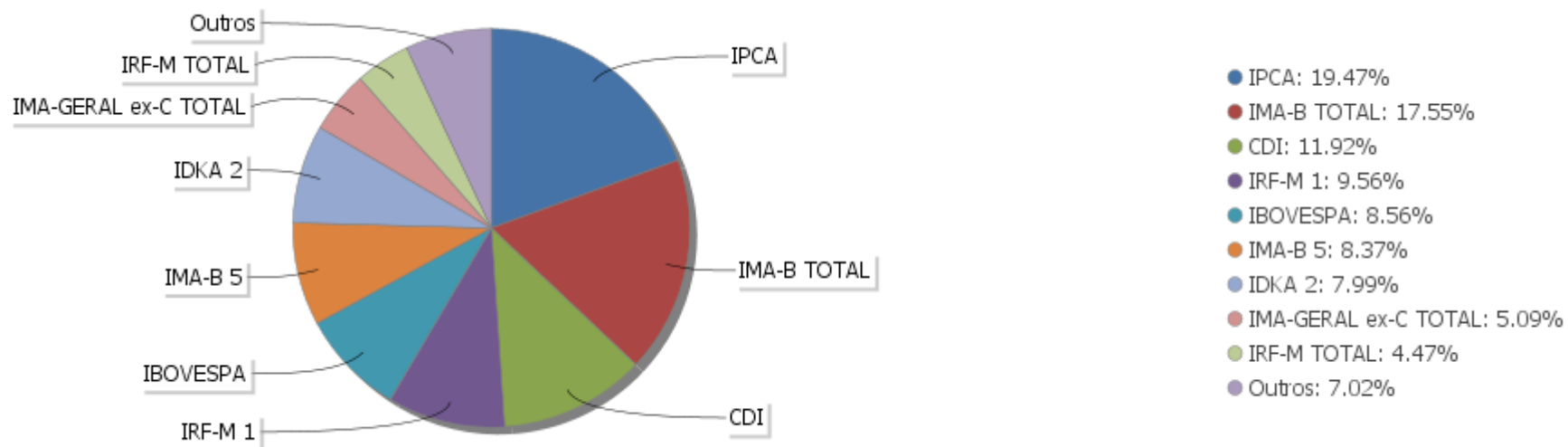
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	370.472.266,63	90,94	370.472.266,63	90,94
de 31 a 365 dias	27.660.280,26	6,79	398.132.546,89	97,73
acima de 365 dias	9.234.780,00	2,27	407.367.326,89	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

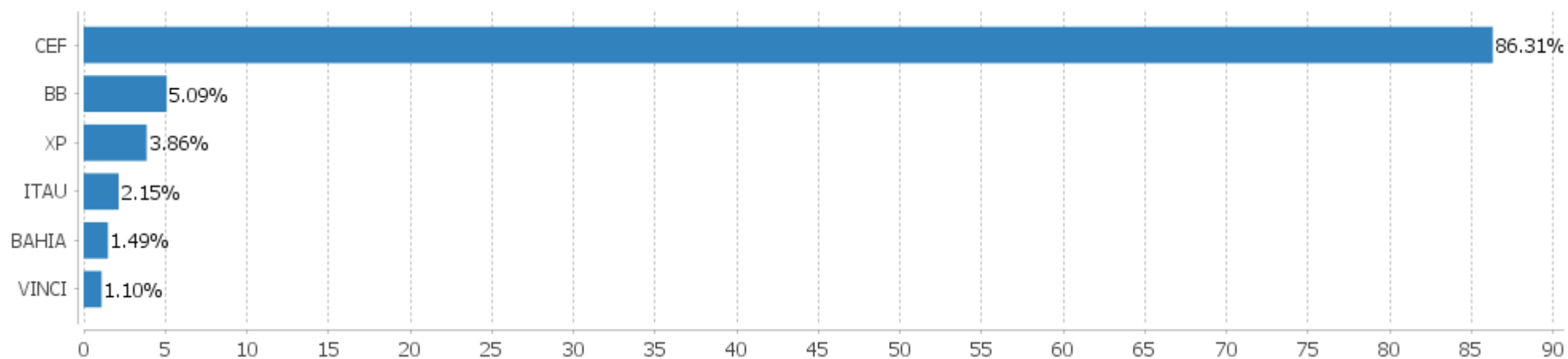


Alocação Por Estratégia



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	0,99	0,81	0,33							1,32
INPC + 5,42%	0,69	1,20	1,35	0,80	1,41	1,04							6,66
p.p. indexador	-1,04	-1,97	-1,02	0,19	-0,60	-0,72							-5,34
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

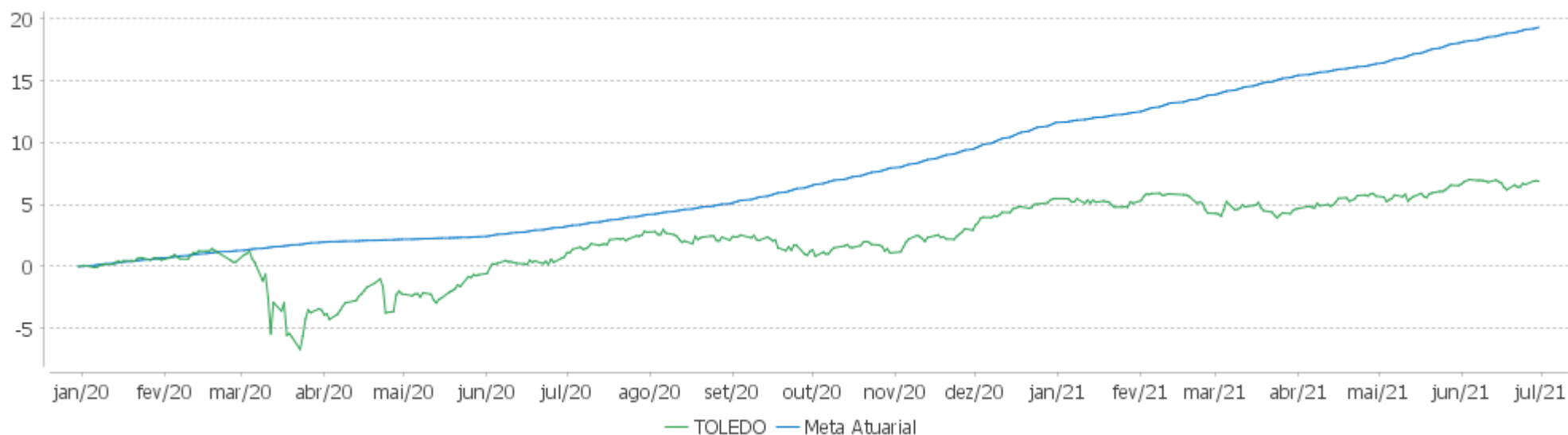
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

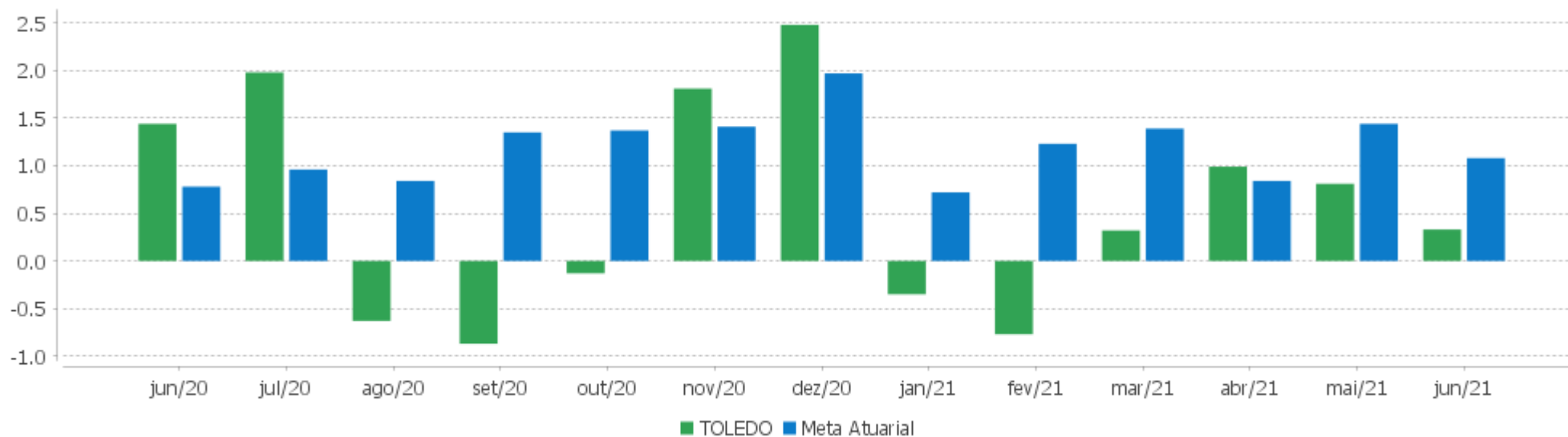
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	7	38,89	03 meses	2,14	3,28	-1,14	2,87
Meses abaixo - Meta Atuarial	11	61,11	06 meses	1,32	6,66	-5,34	3,30
			12 meses	6,06	15,37	-9,31	3,38
			24 meses				
Desde 31/12/2019				6,88	19,05	-12,17	6,39
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	2,48	2020-12					
Menor rentabilidade da Carteira	-3,86	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
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,31 99,36	1,16 90,55	0,82 103,48	1,16 90,55	2,20 96,71	6,32 90,47	12,88 93,68
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,31 100,84	1,16 90,62	0,72 91,79	1,16 90,62	1,78 78,25	6,51 93,19	13,13 95,54
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,11 -0,42	0,72 -3,05	0,83 -0,85	0,72 -3,05	2,29 -6,06		
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,33 -0,75	0,14 0,86	1,69 -0,46	0,14 0,86	4,84 -2,59	12,85 0,11	
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,40 -0,02	-0,84 -0,11	2,09 -0,06	-0,84 -0,11	7,19 -0,24	12,04 -0,70	44,01 -1,16
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,15 -0,02	1,15 -0,13	1,38 -0,05	1,15 -0,13	5,77 -0,29	14,77 -0,64	31,38 -0,95
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,11 -0,21	-0,68 -0,34	1,22 -0,10	-0,68 -0,34	2,58 -0,16	9,05 -0,18	26,47 0,17
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,00 -0,53	0,72 -3,05	0,90 -0,78	0,72 -3,05	2,68 -5,67	12,77 2,11	31,64 17,26
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,28 0,04	1,56 -0,30	1,59 -0,32	1,56 -0,30	6,40 -0,66	15,12 -1,34	29,13 -2,74
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,19 -0,02	0,70 -0,12	0,64 -0,04	0,70 -0,12	1,82 -0,21	7,71 -0,46	15,35 -0,64
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,18 -0,03	-1,69 -0,11	1,13 -0,13	-1,69 -0,11	-0,09 -0,23	9,44 -0,53	26,47 -0,79
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	0,77 -0,06	-2,65 -0,11	2,63 -0,05	-2,65 -0,11	8,33 -0,19	10,03 -0,63	53,95 -1,83
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	-0,17 -54,82	3,12 244,11	2,40 304,15	3,12 244,11	7,86 345,16	14,62 209,29	35,05 255,01
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP % do CDI	2,71 882,02	16,15 1.264,12	8,76 1.111,63	16,15 1.264,12	38,60 1.695,81	43,45 622,14	
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	0,52 -0,12	2,70 -0,62	7,73 -0,27	2,70 -0,62	15,13 -1,76	31,80 -1,45	72,37 -6,41
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	1,09 0,62	11,45 4,91	12,50 3,78	11,45 4,91	37,31 3,91	42,22 16,63	95,16 20,90
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	1,80	2,73	10,18	2,73	26,66	27,74	79,85

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.	1,33	-3,81	1,46	-3,81	-6,74	2,15	5,58
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	-0,56	7,86	7,86	7,86	38,13	31,71	80,59
Var. IBOVESPA p.p.	-1,02	1,32	-0,86	1,32	4,74	6,12	6,33
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	-3,46	-7,63	0,98	-7,63	-1,27	-6,81	51,34
% do CDI	-1.123,82	-597,01	124,69	-597,01	-55,66	-97,52	373,53
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-0,21	12,22	11,00	12,22	37,29	31,25	87,46
Var. IBOVESPA p.p.	-0,68	5,68	2,28	5,68	3,90	5,66	13,19
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-1,76	3,78	6,71	3,78	28,53	25,52	87,37
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,41	1,73	1,26	1,73	4,74	1,93	4,76
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	1,66	7,83	10,34	7,83	27,85	34,45	
Var. IBOVESPA p.p.	1,19	1,29	1,63	1,29	-5,55	8,87	
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	5,86	12,14	12,34	12,14	39,95		
Var. MSCI ACWI p.p.	9,11	4,91	18,45	4,91	14,65		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-1,15	2,21	-4,10	2,21	28,74		
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-2,17	-4,55	-7,24	-4,55	13,92		
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-1,19	8,36	-4,36	8,36	26,23	95,14	110,45
Var. IBOVESPA p.p.	-1,65	1,82	-13,07	1,82	-7,17	69,55	36,18
TOLEDO	0,33	1,32	2,14	1,32	6,06		
Var. INPC + 5,87% p.p.	-0,75	-5,56	-1,25	-5,56	-9,55		
CDI	0,31	1,28	0,79	1,28	2,28	6,98	13,74
IBOVESPA	0,46	6,54	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27
INPC + 6,00%	1,09	6,95	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46
IPCA + 6,00%	1,02	6,76	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14

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	0,21	0,81	0,68	0,81	2,04	8,17	15,99	25,04	41,88
IRF-M 1+	0,22	-3,30	1,54	-3,30	-1,09	10,57	31,78	44,01	70,12
IRF-M TOTAL	0,21	-1,58	1,26	-1,58	0,14	9,97	27,26	38,64	61,89
IMA-B 5	-0,13	1,29	1,44	1,29	6,07	15,42	32,32	45,20	62,50
IMA-B 5+	0,83	-2,55	2,69	-2,55	8,52	10,66	55,78	65,31	89,15
IMA-B TOTAL	0,42	-0,72	2,14	-0,72	7,42	12,74	45,16	57,06	77,99
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,32	-0,34	1,32	-0,34	2,74	9,23	26,31	36,75	56,76
IMA-GERAL TOTAL	0,35	0,14	1,48	0,14	3,55	10,30	27,83	38,65	58,38
IDKA 2	-0,32	1,87	1,91	1,87	7,06	16,45	31,87	45,03	63,71
IDKA 20	1,07	-3,63	3,85	-3,63	12,34	7,07	77,65	82,49	113,49
CDI	0,31	1,28	0,79	1,28	2,28	6,98	13,74	22,11	37,80

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,46	6,54	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27	101,60	146,09
IBRX 100	0,63	8,82	9,61	8,82	36,33	29,97	82,97	109,81	156,78
IBRX 50	0,66	9,11	9,99	9,11	37,48	27,96	75,42	102,75	146,44
SMALL CAP	1,29	11,42	12,41	11,42	39,64	46,83	108,08	137,16	216,68
IFIX	-2,19	-4,02	-3,23	-4,02	-1,83	4,90	29,63	32,82	68,17
Índice Consumo - ICON	0,64	3,32	8,00	3,32	16,90	33,24	78,77	81,45	99,34
Índice Dividendos - IDIV	-2,17	2,06	5,45	2,06	23,79	23,60	82,61	98,77	171,68

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	0,53	3,77	1,68	3,77	8,35	10,66	14,38	19,40	22,99
INPC	0,60	3,95	1,95	3,95	9,22	11,78	15,49	19,56	22,62
IGPM	0,60	15,08	6,30	15,08	35,75	45,68	55,16	65,90	64,61
SELIC	0,31	1,28	0,79	1,28	2,28	6,98	13,75	22,12	37,84

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	-2,27	10,13	-5,03	10,13	26,62	90,69	105,09	168,14	219,09
MSCI ACWI	-3,25	7,23	-6,11	7,23	25,29	79,54	84,88	134,07	181,00
MSCI World	-3,06	7,96	-5,78	7,96	25,18	80,80	87,35	138,06	184,42

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,86	5,77	2,66	5,77	12,66	19,69	28,60	39,56	49,47
IPCA + 5,00%	0,94	6,27	2,91	6,27	13,74	22,00	32,33	44,97	56,75
IPCA + 5,50%	0,98	6,51	3,03	6,51	14,28	23,16	34,23	47,73	60,50
IPCA + 5,89%	1,01	6,71	3,12	6,71	14,70	24,08	35,71	49,92	63,47
IPCA + 6,00%	1,02	6,76	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14	50,54	64,32
INPC + 4,00%	0,93	5,96	2,94	5,96	13,57	20,91	29,85	39,74	49,03
INPC + 6,00%	1,09	6,95	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46	50,74	63,83

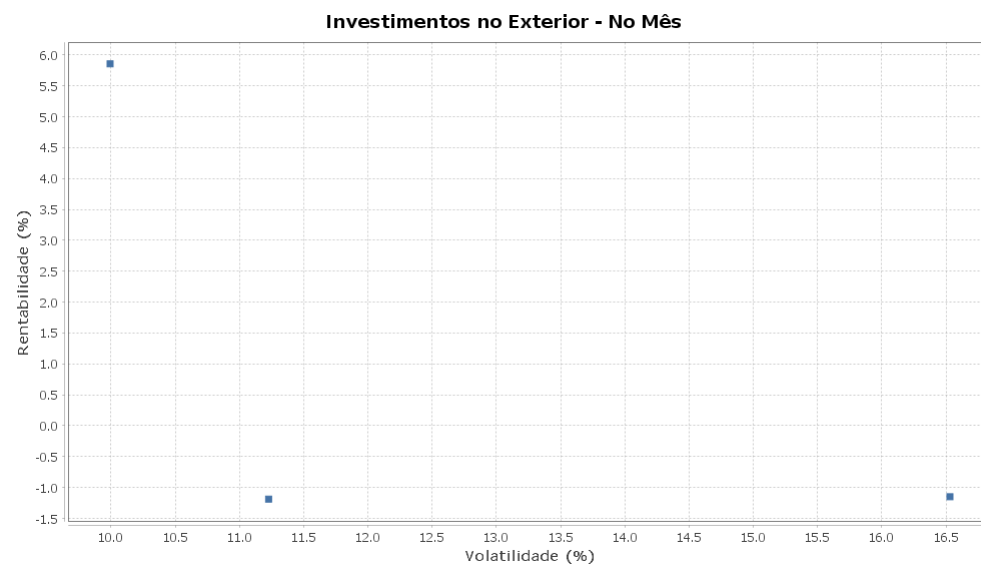
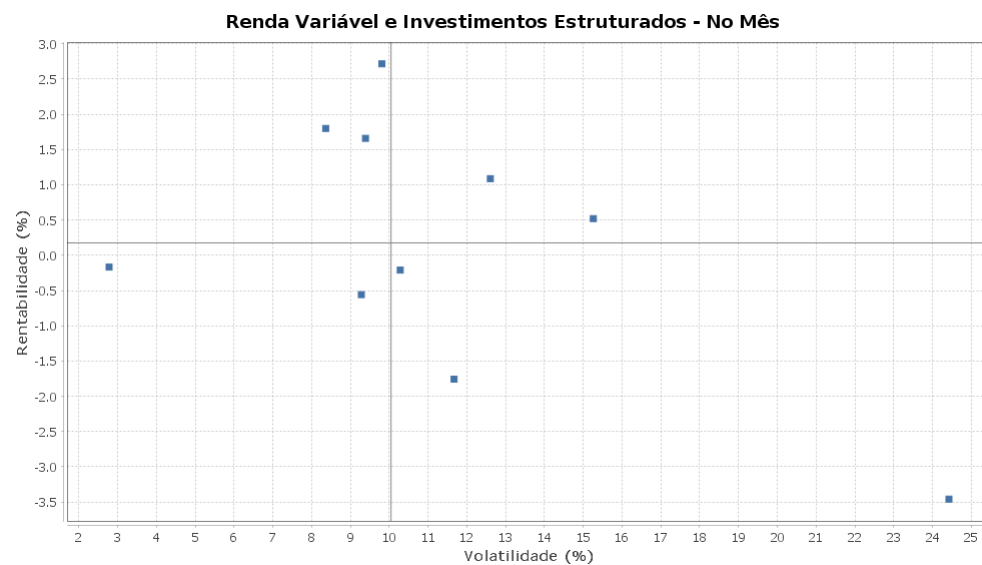
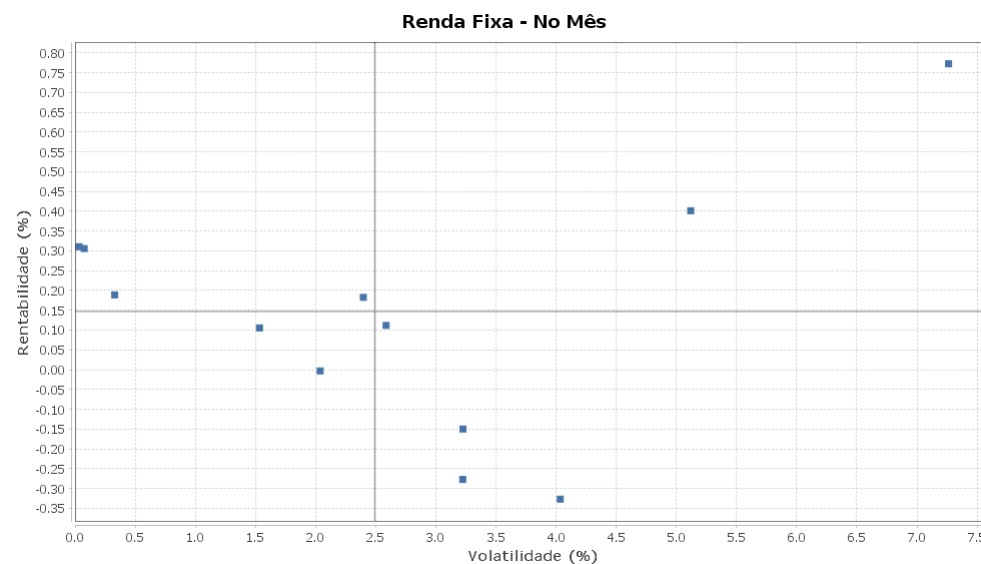
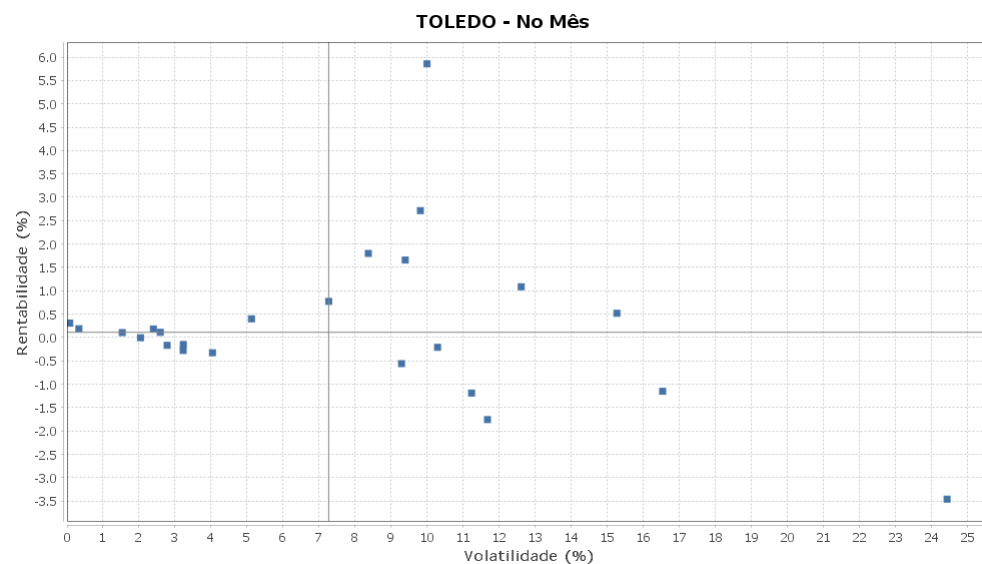
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
35	04/06/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.103.417,05	0,00	1.678.844,67703200	2,4441910000
36	08/06/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12.848,70	0,00	5.264,57903200	2,4405940000
37	11/06/2021	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	359.264,11	0,00	266.678,03112100	1,3471830000
38	23/06/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.964.920,04	811.789,07831600	2,4204810000
39	28/06/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	4.932.200,61	2.028.234,82624400	2,4317700000
40	28/06/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.470.929,80	0,00	1.600.033,28370900	1,5442990000
41	29/06/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	20.737,65	0,00	8.519,01817200	2,4342770000
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 7.766.525,53

Value-At-Risk: 1,91%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,04	0,00	0,08	0,31	15.532.846,92	3,81
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,08	0,05	0,00	-0,03	0,31	3.177.392,83	0,78
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,15	0,01	-0,36	0,19	38.961.888,68	9,56
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	Artigo 7º IV, Alínea a	1,53	1,08	0,02	-0,13	0,11	11.829.332,84	2,90
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,04	1,15	0,15	-0,15	-0,00	67.473.414,51	16,56
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,40	1,44	0,05	-0,05	0,18	18.191.689,67	4,47
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,59	1,24	0,05	-0,08	0,11	20.720.525,39	5,09
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	2,78	2,41	0,03	-0,17	-0,17	4.941.195,63	1,21
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,22	1,51	0,09	-0,18	-0,28	32.563.057,61	7,99
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,23	1,48	0,10	-0,14	-0,15	34.116.654,02	8,37
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,03	2,03	0,03	-0,16	-0,33	9.234.780,00	2,27
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,12	2,67	0,30	0,02	0,40	62.269.556,79	15,29
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,26	3,62	0,04	0,06	0,77	6.738.715,85	1,65
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	8,36	10,40	0,07	0,18	1,80	3.448.938,17	0,85
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	9,28	8,43	0,10	-0,09	-0,56	6.052.949,31	1,49
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	9,39	9,52	0,16	0,14	1,66	8.363.627,62	2,05
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	9,81	6,43	0,26	0,25	2,71	23.566.589,34	5,79
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	9,99	11,10	0,18	0,56	5,86	10.711.451,14	2,63
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	10,28	8,18	0,08	-0,05	-0,21	5.308.133,58	1,30
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	11,23	9,34	0,04	-0,13	-1,19	9.584.616,92	2,35
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	11,67	8,03	0,06	-0,18	-1,76	4.486.631,58	1,10
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	12,61	9,72	0,04	0,06	1,09	2.111.422,99	0,52
FIA CAIXA CONSUMO	Artigo 8º II, Alínea a	15,26	10,13	0,03	0,01	0,52	1.627.572,38	0,40
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	16,53	10,45	-0,00	-0,09	-1,15	5.022.726,51	1,23
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	Artigo 8º II, Alínea a	24,42	14,20	0,03	-0,15	-3,46	1.331.616,61	0,33