



TOLEDO
FEVEREIRO 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 26.02.2021.

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

87,16%

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 | 12,90 | -1,54 | -2,40 | 61.287.218,85 | 15,66 | 6.061.546.612,54 | 1,01 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,56 | 0,02 | 0,04 | 40.182.966,39 | 10,27 | 9.935.744.303,82 | 0,40 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 5,09 | -0,62 | -0,54 | 28.565.662,75 | 7,30 | 13.590.487.322,92 | 0,21 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 19,97 | -2,35 | -4,01 | 6.645.189,09 | 1,70 | 1.625.335.228,61 | 0,41 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 4,23 | -0,53 | -0,39 | 31.439.980,90 | 8,03 | 10.914.192.598,49 | 0,29 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 6,16 | -1,15 | -1,92 | 46.504.721,67 | 11,88 | 2.086.612.425,47 | 2,23 |
| BB | BB | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | 6,34 | -0,91 | -1,46 | 20.557.765,62 | 5,25 | 9.434.126.715,63 | 0,22 |
| CEF | CEF | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 5,98 | -0,51 | -0,48 | 66.669.695,06 | 17,03 | 15.107.095.289,30 | 0,44 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF | 8,82 | -1,43 | -1,59 | 9.075.294,00 | 2,32 | 174.764.503,39 | 5,19 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 6,52 | -0,84 | -1,17 | 310.928.494,33 | 79,44 | | |

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 | 0,50 | 0,07 | 0,28 | 15.397.403,79 | 3,93 | 4.997.370.593,40 | 0,31 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,37 | 0,08 | 0,24 | 3.148.583,02 | 0,80 | 5.566.337.148,97 | 0,06 |
| CEF | CEF | FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP | 3,79 | -0,52 | -0,44 | 11.693.808,00 | 2,99 | 819.953.181,60 | 1,43 |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a | | | 0,66 | -0,16 | 0,00 | 30.239.794,81 | 7,73 | | |

| | | | | | | | | | |
|------------|--|--|------|-------|-------|----------------|-------|--|--|
| Renda Fixa | | | 6,00 | -0,78 | -1,07 | 341.168.289,14 | 87,16 | | |
|------------|--|--|------|-------|-------|----------------|-------|--|--|

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

10,36%

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 | 62,29 | -10,15 | -16,50 | 1.203.675,78 | 0,31 | 416.613.113,87 | 0,29 |
| BAHIA | BEM | BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | 44,72 | -0,97 | -2,83 | 5.452.835,03 | 1,39 | 967.923.119,26 | 0,56 |
| CEF | CEF | FIA CAIXA CONSUMO | 46,18 | -5,36 | -6,66 | 1.479.222,67 | 0,38 | 631.793.991,04 | 0,23 |
| VINCI | CEF | FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | 39,87 | -4,31 | -7,91 | 3.980.940,41 | 1,02 | 927.907.033,94 | 0,43 |
| CEF | CEF | FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 48,25 | -1,99 | -5,40 | 1.792.099,84 | 0,46 | 1.156.878.405,76 | 0,15 |
| ITAU | ITAU | ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI | 42,65 | -3,68 | -5,65 | 3.167.759,68 | 0,81 | 2.112.204.537,83 | 0,15 |
| ITAU | ITAU | ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 43,99 | 0,47 | -1,00 | 4.682.832,56 | 1,20 | 3.416.632.575,89 | 0,14 |
| CEF | CEF | FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | 45,10 | -2,79 | -5,29 | 5.983.549,61 | 1,53 | 988.656.272,19 | 0,61 |
| Sub-total Artigo 8º II, Alínea a | | | 43,98 | -2,67 | -5,19 | 27.742.915,58 | 7,09 | | |

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 | 7,72 | -0,57 | -0,66 | 4.760.135,62 | 1,22 | 4.720.260.747,70 | 0,10 |
| CEF | CEF | CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 32,69 | 2,70 | 2,64 | 8.050.455,57 | 2,06 | 842.253.842,01 | 0,96 |
| Sub-total Artigo 8º III | | | 6,78 | 1,28 | 1,16 | 12.810.591,19 | 3,27 | | |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | 32,20 | -1,52 | -3,48 | 40.553.506,77 | 10,36 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,48%

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 | 29,47 | 3,55 | 9,54 | 9.688.976,01 | 2,48 | 2.403.594.907,13 | 0,40 |
| Sub-total Artigo 9º A, III | | | 29,47 | 3,55 | 9,54 | 9.688.976,01 | 2,48 | | |
| Investimentos no Exterior | | | 29,47 | 3,55 | 9,54 | 9.688.976,01 | 2,48 | | |
| Total | | | 7,53 | -0,77 | -1,12 | 391.410.771,92 | 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 | Limite Legal |
| Renda Fixa | | | | | | | |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 310.928.494,33 | 79,44 | 60,00 | 67,00 | 100,00 | 100,00 |
| Artigo 7º IV, Alínea a | Fundos de Renda Fixa | 30.239.794,81 | 7,73 | 0,00 | 7,00 | 40,00 | 50,00 |
| | Total Renda Fixa | 341.168.289,14 | 87,16 | | | | 100,00 |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | | | | | |
| Artigo 8º II, Alínea a | Fundos de Ações | 27.742.915,58 | 7,09 | 0,00 | 15,00 | 20,00 | 30,00 |
| Artigo 8º III | Fundos Multimercados | 12.810.591,19 | 3,27 | 0,00 | 5,00 | 10,00 | 10,00 |
| | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 40.553.506,77 | 10,36 | | | | 40,00 |
| Investimentos no Exterior | | | | | | | |
| Artigo 9º A, III | Ações - BDR Nível I | 9.688.976,01 | 2,48 | 0,00 | 6,00 | 10,00 | 10,00 |
| | Total Investimentos no Exterior | 9.688.976,01 | 2,48 | | | | 10,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

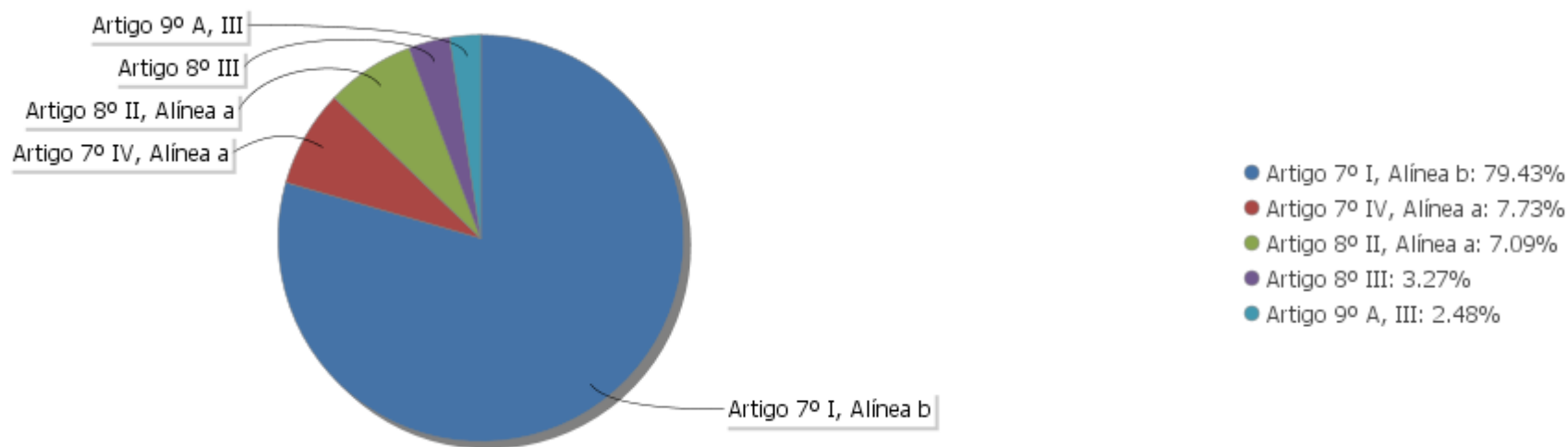
| Estratégia Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R\$) | No Ano(R\$) |
|--|------------------|------------------|-------------------|----------------|-------------------|----------------------|----------------------|
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | -0,84 -624,56 | -1,17 -412,04 | 1,10 244,29 | 1,50 163,90 | 3,84 162,70 | -2.663.057,76 | -3.737.927,53 |
| Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI | -0,16 -115,33 | 0,00 1,10 | 0,53 119,04 | 0,65 71,21 | 2,07 87,72 | -46.991,20 | 1.031,59 |
| Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | -2,67 1,70 | -5,19 2,35 | 2,07 1,02 | 8,92 -1,81 | 1,12 -4,51 | -772.028,04 | -1.521.019,01 |
| Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p. | 1,28 5,66 | 1,16 8,70 | 3,50 2,45 | 6,08 -4,65 | 7,31 1,68 | 133.876,54 | 115.857,84 |
| Artigo 9º A, III % do CDI | 3,55 2.636,28 | 9,54 3.356,14 | 10,30 2.292,95 | 8,76 957,42 | 68,74 2.909,74 | 297.610,05 | 689.760,71 |
| TOLEDO (Total) | | | | | | -3.050.590,41 | -4.452.296,40 |

Análise de Liquidez

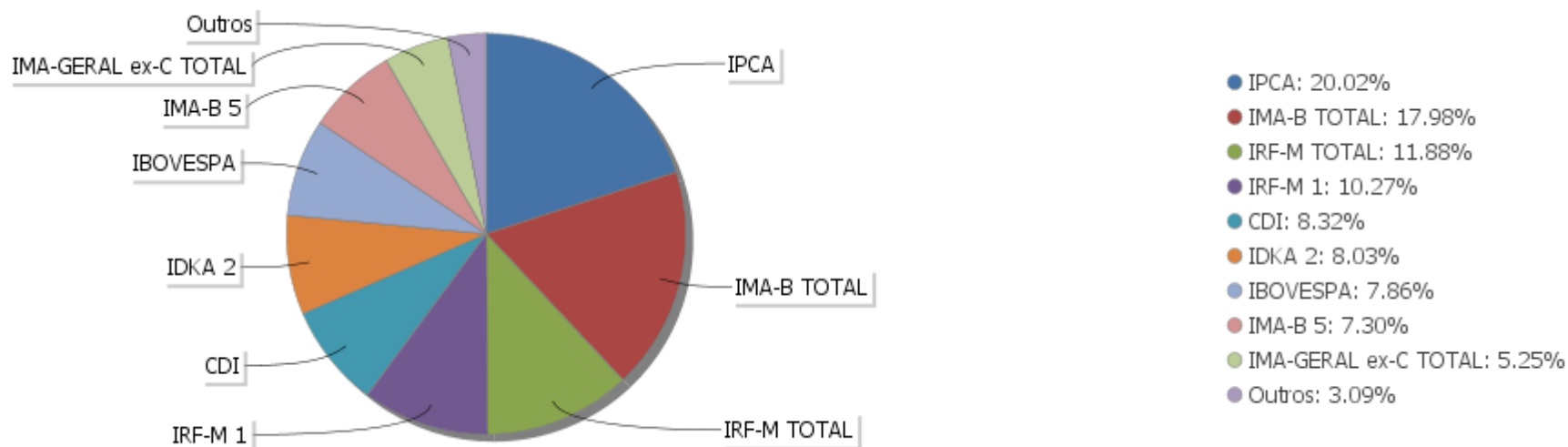
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 359.067.560,63 | 91,74 | 359.067.560,63 | 91,74 |
| de 31 a 365 dias | 23.267.917,29 | 5,94 | 382.335.477,92 | 97,68 |
| acima de 365 dias | 9.075.294,00 | 2,32 | 391.410.771,92 | 100,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

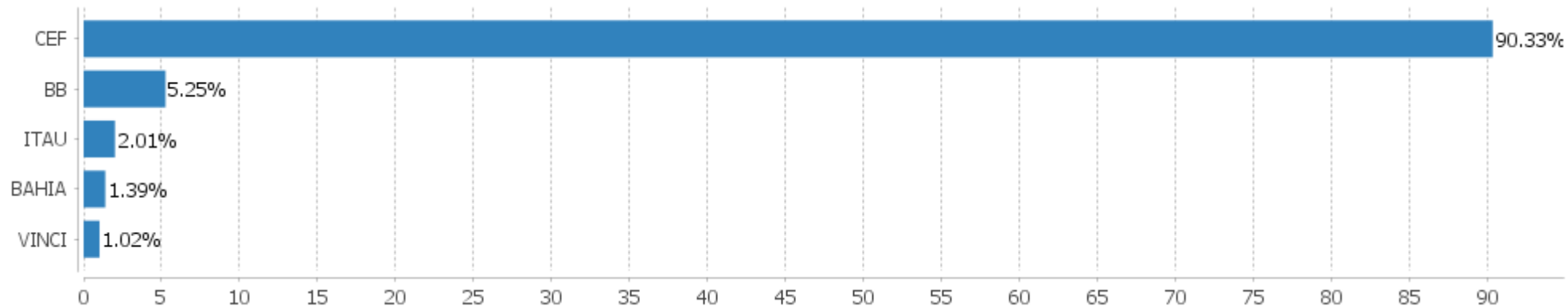


Alocação Por Estratégia



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 | | | | | | | | | | | -1,12 |
| INPC + 5,42% | 0,69 | 1,20 | | | | | | | | | | | 1,90 |
| p.p. indexador | -1,04 | -1,97 | | | | | | | | | | | -3,02 |
| 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 |

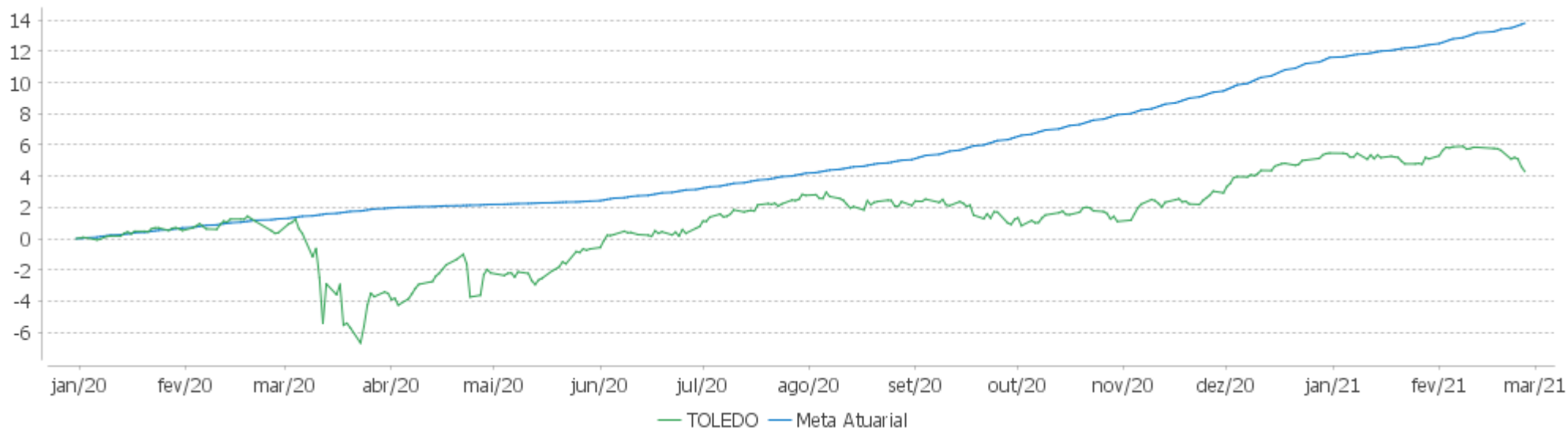
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

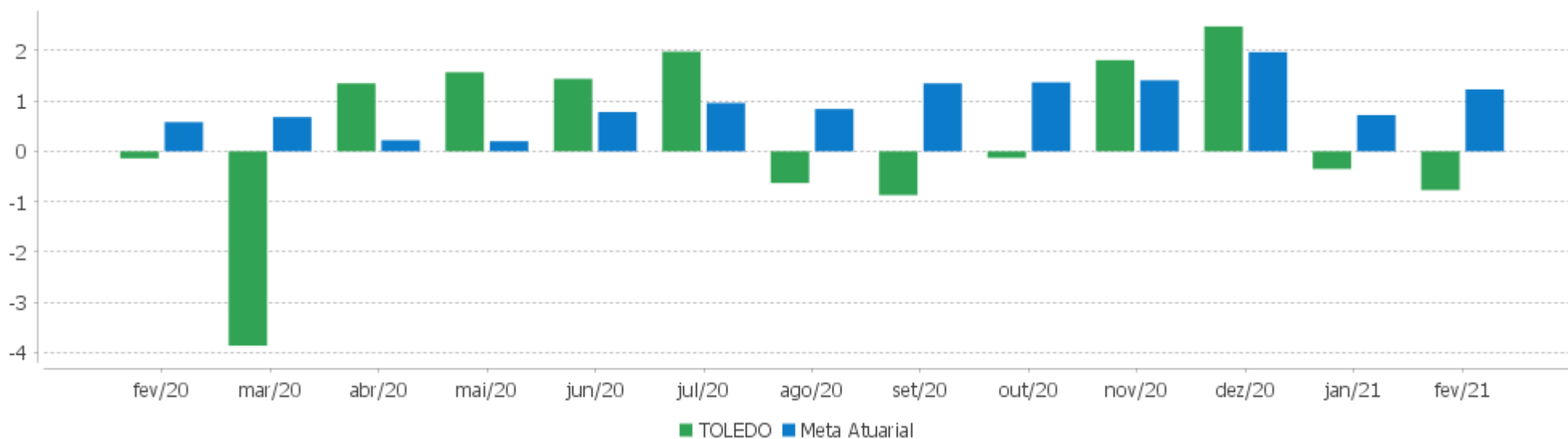
| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial | 6 | 42,86 | 03 meses | 1,33 | 3,90 | -2,57 | 3,01 |
| Meses abaixo da Meta Atuarial | 8 | 57,14 | 06 meses | 2,14 | 8,25 | -6,11 | 3,46 |
| | | | 12 meses | 3,91 | 12,30 | -8,39 | 7,53 |
| | | | 24 meses | | | | |
| | | | 36 meses | | | | |
| Maior rentabilidade da Carteira | 2,48 | 2020-12 | Desde 31/12/2019 | 4,30 | 13,73 | -9,43 | 7,05 |
| 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 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p. | -1,43 0,08 | -1,59 0,76 | 0,90 -1,49 | 1,48 -1,59 | 5,42 2,25 | 19,41 -2,33 | |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p. | -1,54 -0,02 | -2,40 -0,04 | 2,32 -0,06 | 2,96 -0,11 | 2,81 -0,35 | 20,93 -0,80 | 37,77 -1,14 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p. | -0,62 -0,02 | -0,54 -0,05 | 1,27 -0,06 | 2,60 -0,15 | 5,92 -0,31 | 18,50 -0,66 | 30,23 -0,95 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p. | -0,91 -0,09 | -1,46 -0,20 | 0,88 0,05 | 0,90 0,09 | 2,59 0,03 | 14,34 0,43 | 25,55 0,55 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p. | -0,51 -1,37 | -0,48 -1,59 | 0,83 -1,65 | 1,04 -3,91 | 4,64 -0,55 | 19,53 10,12 | 31,08 17,41 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p. | -0,53 -0,05 | -0,39 -0,06 | 1,25 -0,14 | 2,68 -0,04 | 6,48 -0,47 | 17,50 -1,42 | 28,81 -2,22 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p. | 0,02 -0,02 | 0,04 -0,04 | 0,33 -0,06 | 0,82 -0,11 | 2,87 -0,21 | 9,36 -0,44 | 16,69 -0,66 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p. | -1,15 0,03 | -1,92 0,06 | 0,01 0,06 | -0,63 -0,05 | 2,87 -0,14 | 14,72 -0,51 | 25,86 -0,83 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p. | -2,35 -0,02 | -4,01 -0,03 | 3,25 0,02 | 3,33 -0,05 | 0,76 -0,18 | 22,39 -0,81 | 42,85 -1,57 |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI | 0,07 55,48 | 0,28 97,01 | 0,53 118,16 | 0,56 61,03 | 2,05 86,57 | 7,73 95,84 | 14,37 95,84 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI | 0,08 57,89 | 0,24 84,32 | 0,60 134,31 | 0,88 95,86 | 2,00 84,75 | 7,44 92,19 | 14,14 94,27 |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p. | -0,52 -1,38 | -0,44 -1,55 | 0,56 -1,91 | 0,53 -4,41 | | | |
| FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p. | -5,36 -0,07 | -6,66 | -2,10 -0,27 | -1,00 -0,77 | -0,20 -1,23 | 34,71 -1,44 | 28,80 -6,59 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p. | -1,99 2,38 | -5,40 2,14 | 1,78 0,74 | 8,15 -2,58 | -0,35 -5,98 | 31,96 16,84 | 42,70 13,78 |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI Var. IBOVESPA p.p. | -3,68 0,69 | -5,65 1,90 | 2,28 1,23 | 7,86 -2,87 | 5,25 -0,38 | 25,90 10,79 | 51,75 22,83 |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p. | -0,97 3,40 | -2,83 4,71 | 5,71 4,67 | 16,40 5,67 | 11,43 5,80 | 26,79 11,67 | 45,58 16,66 |
| FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL | -10,15 | -16,50 | -12,80 | -9,29 | -32,82 | 0,03 | 9,79 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|--|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|----------|----------|
| % do CDI | -7.544,19 | -5.806,26 | -2.848,96 | -1.015,37 | -1.389,21 | 0,43 | 65,27 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 0,47 | -1,00 | 5,23 | 12,85 | 4,60 | 25,63 | 48,93 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 4,85 | 6,55 | 4,19 | 2,12 | -1,03 | 10,51 | 20,01 |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | -4,31 | -7,91 | 0,72 | 9,47 | -0,18 | 19,66 | 40,76 |
| Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | 0,89 | 2,11 | 2,69 | 1,82 | 3,35 | 2,32 | 3,47 |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | -2,79 | -5,29 | 1,95 | 6,49 | 1,82 | | |
| Var. IBOVESPA p.p. | 1,59 | 2,26 | 0,90 | -4,24 | -3,81 | | |
| FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP | -0,57 | -0,66 | 1,03 | 2,60 | 3,70 | 17,13 | 29,94 |
| % do CDI | -425,09 | -232,10 | 229,25 | 284,54 | 156,61 | 212,27 | 199,70 |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 2,70 | 2,64 | 5,87 | 8,42 | 23,14 | 35,21 | |
| % do CDI | 2.004,05 | 929,40 | 1.306,12 | 919,43 | 979,57 | 436,34 | |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 3,55 | 9,54 | 10,30 | 8,76 | 68,74 | 114,04 | 150,85 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 7,92 | 17,09 | 9,25 | -1,97 | 63,12 | 98,92 | 121,93 |
| TOLEDO | -0,77 | -1,12 | 1,33 | 2,14 | 3,91 | | |
| Var. INPC + 5,87% p.p. | -2,00 | -3,08 | -2,64 | -6,18 | -8,46 | | |
| CDI | 0,13 | 0,28 | 0,45 | 0,92 | 2,36 | 8,07 | 14,99 |
| IBOVESPA | -4,37 | -7,55 | 1,05 | 10,73 | 5,63 | 15,12 | 28,92 |
| INPC + 6,00% | 1,24 | 1,98 | 4,00 | 8,39 | 12,51 | 23,91 | 36,52 |
| IPCA + 6,00% | 1,28 | 2,00 | 3,91 | 7,95 | 11,43 | 22,82 | 35,25 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|-------------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| Renda Fixa | | | | | | | |
| IRF-M 1 | 0,04 | 0,08 | 0,39 | 0,94 | 3,08 | 9,80 | 17,36 |
| IRF-M 1+ | -2,01 | -3,37 | -0,43 | -1,48 | 2,82 | 17,44 | 30,64 |
| IRF-M TOTAL | -1,18 | -1,97 | -0,06 | -0,58 | 3,01 | 15,23 | 26,69 |
| IMA-B 5 | -0,60 | -0,49 | 1,33 | 2,75 | 6,23 | 19,15 | 31,19 |
| IMA-B 5+ | -2,33 | -3,98 | 3,24 | 3,38 | 0,95 | 23,20 | 44,42 |
| IMA-B TOTAL | -1,52 | -2,36 | 2,38 | 3,07 | 3,16 | 21,74 | 38,91 |
| IMA-C TOTAL | 3,72 | 10,42 | 9,19 | 17,82 | 30,63 | 54,91 | 81,60 |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL | -0,83 | -1,26 | 0,83 | 0,82 | 2,55 | 13,91 | 25,00 |
| IMA-GERAL TOTAL | -0,69 | -0,93 | 1,07 | 1,29 | 3,31 | 14,97 | 26,40 |
| IDKA 2 | -0,48 | -0,33 | 1,40 | 2,72 | 6,95 | 18,92 | 31,03 |
| IDKA 20 | -2,69 | -5,42 | 5,32 | 4,90 | -1,91 | 24,76 | 54,08 |
| CDI | 0,13 | 0,28 | 0,45 | 0,92 | 2,36 | 8,07 | 14,99 |
| Renda Variável | | | | | | | |
| IBOVESPA | -4,37 | -7,55 | 1,05 | 10,73 | 5,63 | 15,12 | 28,92 |
| IBRX 100 | -3,45 | -6,38 | 2,19 | 11,97 | 6,92 | 18,84 | 34,16 |
| IBRX 50 | -3,80 | -6,48 | 2,33 | 12,81 | 8,13 | 15,27 | 27,76 |
| SMALL CAP | -1,84 | -5,21 | 1,92 | 9,84 | 2,20 | 38,68 | 54,97 |
| IFIX | 0,25 | 0,57 | 2,78 | 3,75 | -2,61 | 18,56 | 24,88 |
| Índice Consumo - ICON | -5,29 | | -1,83 | -0,23 | 1,03 | 36,15 | 35,39 |
| Índice Dividendos - IDIV | -5,21 | -10,02 | -1,98 | 7,65 | -3,53 | 17,34 | 37,29 |
| Indicadores Econômicos | | | | | | | |
| IPCA | 0,86 | 1,11 | 2,48 | 4,95 | 5,20 | 9,41 | 13,66 |
| INPC | 0,82 | 1,09 | 2,57 | 5,37 | 6,22 | 10,38 | 14,73 |
| IGPM | 2,53 | 5,17 | 6,18 | 18,11 | 28,94 | 37,73 | 48,21 |
| SELIC | 0,13 | 0,28 | 0,45 | 0,92 | 2,36 | 8,07 | 15,00 |
| Meta Atuarial | | | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|--------------|------------|---|--------------|--------------|--------------------|--------------|
| 6 | 03/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 31.104,68 | 0,00 | 12.919,91398500 | 2,4074990000 |
| 7 | 05/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 3.963.693,31 | 0,00 | 1.645.501,26079000 | 2,4088060000 |
| 8 | 10/02/2021 | FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | 355.022,70 | 0,00 | 281.465,38157500 | 1,2613370000 |
| 9 | 23/02/2021 | CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 227.967,08 | 0,00 | 164.086,42845200 | 1,3893110000 |
| 10 | 24/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00 | 4.719.399,24 | 1.961.992,05600400 | 2,4054120000 |
| 11 | 25/02/2021 | CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 1.439.825,12 | 0,00 | 1.050.833,01038100 | 1,3701750000 |
| 12 | 26/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 49.638,19 | 0,00 | 20.788,70550800 | 2,3877480000 |
| 13 | 26/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 31.104,68 | 0,00 | 13.026,78507100 | 2,3877480000 |
| 14 | 26/02/2021 | FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 1.000.000,00 | 0,00 | 173.923,50913637 | 5,7496540000 |
| Total | | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 6.497.625,71

Value-At-Risk: 1,66%

| Ativo | Estratégia | Volatilidade | VaR | CVaR | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|------------------------|--------------|-------|------|--------|--------|---------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,05 | 0,05 | 0,00 | -1,25 | 0,08 | 3.148.583,02 | 0,80 |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,06 | 0,10 | 0,00 | -0,95 | 0,07 | 15.397.403,79 | 3,93 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | Artigo 7º I, Alínea b | 0,22 | 0,15 | 0,01 | -0,53 | 0,02 | 40.182.966,39 | 10,27 |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP | Artigo 7º IV, Alínea a | 1,97 | 0,94 | 0,02 | -0,33 | -0,52 | 11.693.808,00 | 2,99 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | Artigo 7º I, Alínea b | 2,01 | 1,06 | 0,15 | -0,32 | -0,51 | 66.669.695,06 | 17,03 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 2,17 | 1,35 | 0,12 | -0,59 | -1,15 | 46.504.721,67 | 11,88 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 2,35 | 1,31 | 0,06 | -0,45 | -0,91 | 20.557.765,62 | 5,25 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 2,46 | 1,23 | 0,07 | -0,31 | -0,62 | 28.565.662,75 | 7,30 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 2,74 | 1,16 | 0,07 | -0,24 | -0,53 | 31.439.980,90 | 8,03 |
| FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF | Artigo 7º I, Alínea b | 3,94 | 1,62 | 0,03 | -0,40 | -1,43 | 9.075.294,00 | 2,32 |
| FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP | Artigo 8º III | 4,65 | 2,31 | 0,02 | -0,15 | -0,57 | 4.760.135,62 | 1,22 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 4,89 | 2,29 | 0,28 | -0,34 | -1,54 | 61.287.218,85 | 15,66 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 7,69 | 3,93 | 0,05 | -0,32 | -2,35 | 6.645.189,09 | 1,70 |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | Artigo 9º A, III | 13,16 | 11,52 | 0,04 | 0,26 | 3,55 | 9.688.976,01 | 2,48 |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | Artigo 8º III | 14,21 | 8,18 | 0,11 | 0,18 | 2,70 | 8.050.455,57 | 2,06 |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 18,97 | 10,91 | 0,13 | -0,06 | -0,97 | 5.452.835,03 | 1,39 |
| FIA CAIXA CONSUMO | Artigo 8º II, Alínea a | 20,31 | 10,19 | 0,03 | -0,27 | -5,36 | 1.479.222,67 | 0,38 |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI | Artigo 8º II, Alínea a | 21,12 | 10,63 | 0,07 | -0,18 | -3,68 | 3.167.759,68 | 0,81 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | Artigo 8º II, Alínea a | 21,35 | 10,05 | 0,10 | 0,02 | 0,47 | 4.682.832,56 | 1,20 |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | Artigo 8º II, Alínea a | 21,77 | 10,03 | 0,13 | -0,13 | -2,79 | 5.983.549,61 | 1,53 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | Artigo 8º II, Alínea a | 22,95 | 10,46 | 0,04 | -0,09 | -1,99 | 1.792.099,84 | 0,46 |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | Artigo 8º II, Alínea a | 25,33 | 11,12 | 0,09 | -0,18 | -4,31 | 3.980.940,41 | 1,02 |
| FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL | Artigo 8º II, Alínea a | 26,37 | 17,89 | 0,04 | -0,39 | -10,15 | 1.203.675,78 | 0,31 |