



PATO BRANCO CONSOLIDADO
2º TRIMESTRE 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

RENDA FIXA **73,72%**

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	2,97	0,17	1,15	436.450,51	0,75	7.001.217.927,34	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,55	-0,15	1,38	5.769.533,13	9,97	14.363.834.668,17	0,04
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,32	-0,09	1,42	8.303.051,82	14,35	10.494.201.076,30	0,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,56	0,17	1,42	435.854,10	0,75	1.796.288.008,02	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,97	0,18	1,13	411.899,16	0,71	1.645.783.274,49	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,55	-0,19	1,37	7.368.617,12	12,73	5.768.393.191,74	0,13
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,94	0,11	1,22	6.827.759,27	11,80	9.201.718.777,36	0,07
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,33	-0,00	0,90	4.746.755,23	8,20	16.058.908.177,46	0,03
BB	BB	BB PREV IRF-M 1+	4,58	0,15	1,34	575.130,38	0,99	262.066.832,28	0,22
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,68	-0,05	1,29	34.875.050,72	60,25		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,15	0,22	0,53	196.103,30	0,34	2.307.212.680,54	0,01
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,47	0,29	0,67	3.182.881,19	5,50	3.457.648.238,53	0,09
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,29	0,31	0,67	1.006.697,28	1,74	1.302.863.614,80	0,08
CEF	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,13	0,11	0,83	3.408.848,29	5,89	1.001.985.294,49	0,34
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,83	0,20	0,71	7.794.530,06	13,47		
Renda Fixa			2,42	-0,01	1,18	42.669.580,78	73,72		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

26,28%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,43	0,88	9,90	2.852.409,30	4,93	1.350.902.525,33	0,21
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	20,89	0,43	8,57	1.021.613,12	1,77	855.482.109,78	0,12
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			20,52	0,76	9,55	3.874.022,42	6,69		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES ENERGIA FI	19,14	-4,32	-1,44	1.732.364,83	2,99	374.005.923,40	0,46
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	21,92	0,51	7,94	971.486,50	1,68	328.859.645,80	0,30
CEF	CEF	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	22,03	-0,52	6,23	2.130.940,18	3,68	487.044.617,41	0,44
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,97	-0,21	11,00	642.538,68	1,11	3.594.423.115,17	0,02
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	15,74	2,70	3,60	1.492.645,15	2,58	1.351.697.208,13	0,11
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	20,28	-0,26	10,48	795.491,80	1,37	1.824.781.743,33	0,04
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			19,04	-0,56	5,49	7.765.467,14	13,42		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,67	-0,17	2,40	897.433,13	1,55	4.432.831.656,33	0,02
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	2,96	0,16	1,70	1.494.043,32	2,58	117.051.042,43	1,28
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	15,05	2,71	3,44	1.179.049,39	2,04	2.298.502.554,43	0,05
Sub-total Artigo 8º III			3,56	0,91	2,74	3.570.525,84	6,17		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			16,35	0,11	6,01	15.210.015,40	26,28		
--	--	--	--------------	-------------	-------------	----------------------	--------------	--	--

Total			4,95	0,02	2,35	57.879.596,18	100,00		
--------------	--	--	-------------	-------------	-------------	----------------------	---------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	34.875.050,72	60,25	0,00	53,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	7.794.530,06	13,47	0,00	7,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	42.669.580,78	73,72					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alinea a	Fundos de Ações Referenciados	3.874.022,42	6,69	0,00	8,00	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	7.765.467,14	13,42	0,00	16,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	3.570.525,84	6,17	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	15.210.015,40	26,28					30,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,05 -16,78	1,29 163,42	1,29 163,42	0,56 44,03	3,75 164,93	-14.243,63	448.597,28
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,20 63,80	0,71 90,69	0,71 90,69	0,85 66,23	1,74 76,36	17.002,98	56.877,42
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,76 0,30	9,55 0,83	9,55 0,83	8,49 1,95	34,69 1,29	29.251,28	337.666,16
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,56 -1,03	5,49 -3,23	5,49 -3,23	2,65 -3,89	20,74 -12,66	-46.551,85	375.528,58
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,91 0,44	2,74 -5,98	2,74 -5,98	2,34 -4,20	6,15 -27,25	32.089,50	85.016,73
PATO BRANCO CONSOLIDADO (Total)						17.548,28	1.303.686,17

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV IRF-M 1+	574.243,97	0,00	0,00	0,00	575.130,38	886,41	7.599,60
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6.820.155,06	0,00	0,00	0,00	6.827.759,27	7.604,21	82.160,95
BB PREV RF IDKA2	8.310.823,14	0,00	0,00	0,00	8.303.051,82	-7.771,32	116.374,16
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	7.100.352,71	280.023,66	0,00	0,00	7.368.617,12	-11.759,25	106.020,20
BB PREV RF IRF-M	435.697,38	0,00	0,00	0,00	436.450,51	753,13	4.956,64
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.324.827,15	450.000,00	0,00	0,00	5.769.533,13	-5.294,02	78.338,40
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	435.123,18	0,00	0,00	0,00	435.854,10	730,92	6.117,44
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	411.149,70	0,00	0,00	0,00	411.899,16	749,46	4.608,10
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	4.746.898,40	0,00	0,00	0,00	4.746.755,23	-143,17	42.421,79
					34.875.050,72	-14.243,63	-0,02

Artigo 7º IV, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	132.963,38	1.050.078,38	-988.130,83	0,00	196.103,30	1.192,37	2.307,47
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	3.405.259,08	0,00	0,00	0,00	3.408.848,29	3.589,21	26.813,75
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	1.003.565,17	0,00	0,00	0,00	1.006.697,28	3.132,11	6.697,28
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3.173.791,90	0,00	0,00	0,00	3.182.881,19	9.089,29	21.058,92
					7.794.530,06	17.002,98	0,02

Artigo 8º I, Alinea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	2.827.514,44	0,00	0,00	0,00	2.852.409,30	24.894,86	257.056,12
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	1.017.256,70	0,00	0,00	0,00	1.021.613,12	4.356,42	80.610,04
					3.874.022,42	29.251,28	0,04

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	1.143.395,07	308.016,79	0,00	0,00	1.492.645,15	41.233,29	50.106,00
BB AÇÕES CONSUMO FIC	966.536,97	0,00	0,00	0,00	971.486,50	4.949,53	71.475,22
BB AÇÕES ENERGIA FI	1.810.539,71	0,00	0,00	0,00	1.732.364,83	-78.174,88	-10.200,08
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	797.542,59	0,00	0,00	0,00	795.491,80	-2.050,79	75.430,94
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	2.142.090,37	0,00	0,00	0,00	2.130.940,18	-11.150,19	125.029,83
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	643.897,49	0,00	0,00	0,00	642.538,68	-1.358,81	63.686,67
					7.765.467,14	-46.551,85	-0,06

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	1.491.598,01	0,00	0,00	0,00	1.494.043,32	2.445,31	24.963,86
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.147.888,51	0,00	0,00	0,00	1.179.049,39	31.160,88	39.049,39

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	898.949,82	0,00	0,00	0,00	897.433,13	-1.516,69	21.003,48
					3.570.525,84	32.089,50	0,04

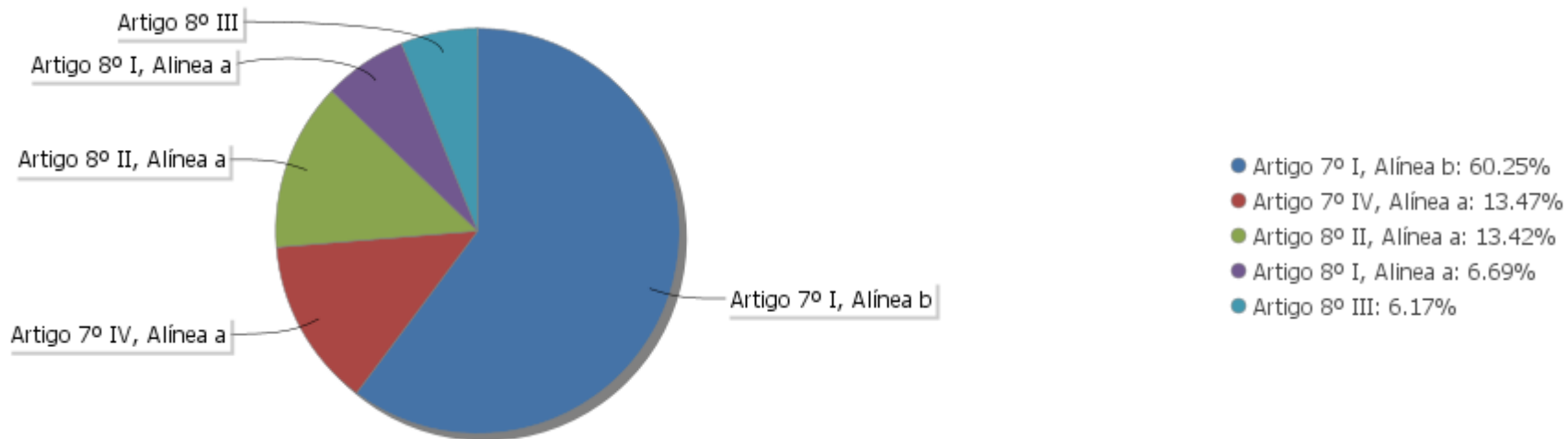
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

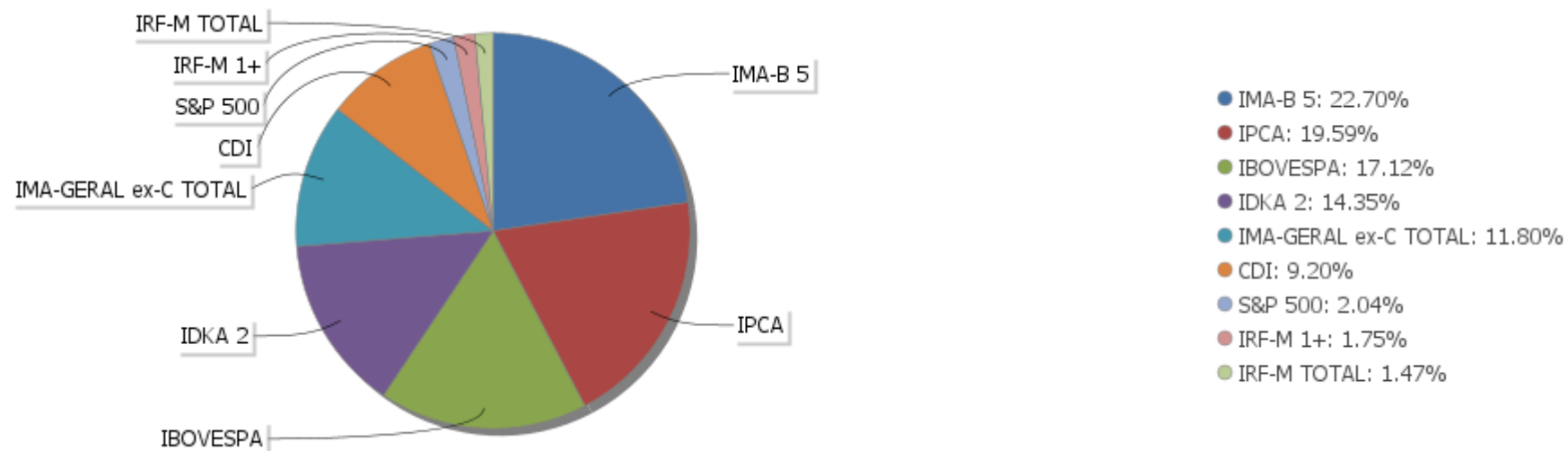
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	57.237.057,50	98,89	57.237.057,50	98,89
de 31 a 365 dias	642.538,68	1,11	57.879.596,18	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	57.879.596,18	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

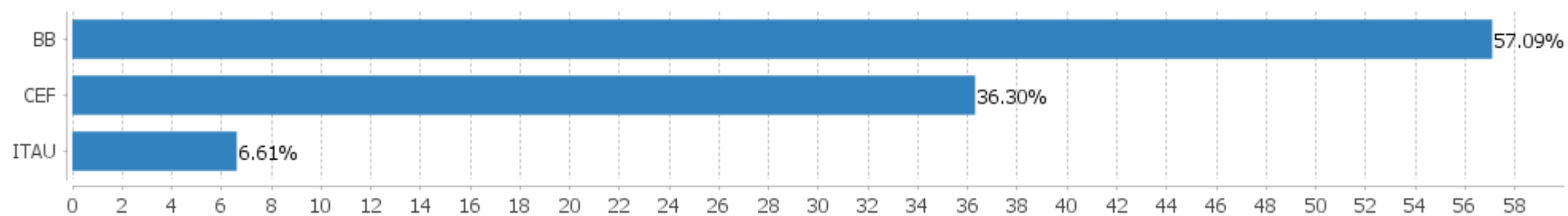


Alocação Por Estratégia



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	-0,68	-1,34	1,19	0,93	1,38	0,02							1,48
IPCA + 5,43%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,97							6,48
p.p. indexador	-1,35	-2,58	-0,23	0,20	0,11	-0,95							-5,00
2020	0,47	-0,63	-5,97	2,01	2,51	1,89	2,32	-0,99	-1,37	-0,16	3,13	2,95	5,94
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	-0,25	-1,29	-6,54	1,87	2,44	1,15	1,43	-1,71	-2,49	-1,50	1,78	1,09	-4,70
2019	1,43	0,31	0,54	0,84	1,61	1,98	1,00	0,11	1,77	1,74	-0,36	1,55	13,24
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	0,60	-0,58	-0,66	-0,22	0,97	1,53	0,28	-0,51	1,32	1,11	-1,33	-0,09	2,65

Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

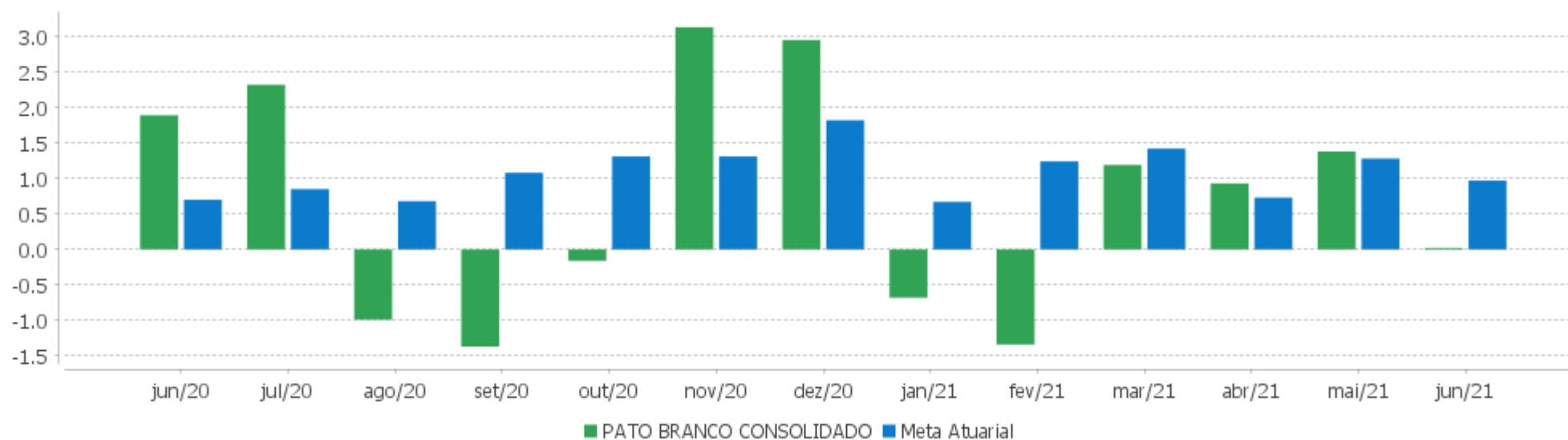
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	14	46,67	03 meses	2,35	3,01	-0,66	3,61
Meses abaixo - Meta Atuarial	16	53,33	06 meses	1,48	6,48	-5,00	4,70
			12 meses	7,49	14,46	-6,97	4,95
			24 meses	13,90	23,88	-9,98	7,67
			Desde 31/12/2018	21,75	30,29	-8,54	6,96
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	3,13	2020-11					
Menor rentabilidade da Carteira	-5,97	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 Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,22 72,90	0,53 66,67	0,53 66,67	0,76 59,28	1,16 50,75	4,70 67,24	10,13 73,73
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,31 101,40	0,77 97,57	0,77 97,57	1,13 88,69	2,27 99,94	6,64 95,04	13,31 96,84
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,29 -0,24	0,67 -1,01	0,67 -1,01	1,01 -2,76	1,59 -6,75	7,30 -3,35	21,15 6,76
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,11 -0,42	0,83 -0,85	0,83 -0,85	0,72 -3,05	2,29 -6,06		
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	0,17 -0,05	1,42 -0,12	1,42 -0,12	-3,43 -0,13	-1,30 -0,21	10,08 -0,49	31,04 -0,74
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,15 -0,02	1,38 -0,05	1,38 -0,05	1,15 -0,13	5,77 -0,29	14,77 -0,64	31,38 -0,95
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	-0,09 0,22	1,42 -0,49	1,42 -0,49	1,42 -0,45	6,38 -0,69	15,08 -1,37	28,85 -3,02
BB PREV IRF-M 1+ Var. IRF-M 1+ p.p.	0,15 -0,06	1,34 -0,20	1,34 -0,20	-3,39 -0,08	-1,37 -0,27	9,64 -0,93	
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,11 -0,21	1,22 -0,10	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	0,90 -0,78	0,90 -0,78	0,72 -3,05	2,68 -5,67	12,77 2,11	31,64 17,26
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-0,19 -0,06	1,37 -0,07	1,37 -0,07	1,17 -0,12	5,78 -0,29	14,87 -0,55	31,43 -0,90
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,17 -0,04	1,15 -0,11	1,15 -0,11	-1,70 -0,12	-0,09 -0,23	9,41 -0,56	26,38 -0,88
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,18 -0,03	1,13 -0,13	1,13 -0,13	-1,69 -0,11	-0,09 -0,23	9,44 -0,53	26,47 -0,79
BB AÇÕES ENERGIA FI % do CDI	-4,32 -1.402,90	-1,44 -182,95	-1,44 -182,95	-4,66 -364,37	10,54 462,89	14,09 201,70	96,85 704,66
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA Var. IBOVESPA p.p.	-0,52 -0,98	6,23 -2,48	6,23 -2,48	2,52 -4,02	22,93 -10,47	28,62 3,04	97,14 22,87
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,70 2,23	8,53 -0,19	8,53 -0,19	15,32 8,78			
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-0,21	11,00	11,00	12,22	37,29	31,25	87,46

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-0,68	2,28	2,28	5,68	3,90	5,66	13,19
BB AÇÕES CONSUMO FIC	0,51	7,94	7,94	2,78	15,08	31,75	74,23
Var. IBOVESPA p.p.	0,05	-0,78	-0,78	-3,76	-18,32	6,16	-0,04
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	-0,26	10,48	10,48	12,99	34,12	41,19	
Var. IBOVESPA p.p.	-0,72	1,76	1,76	6,45	0,72	15,60	
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	0,16	1,70	1,70	0,67	3,08		
% do CDI	53,27	215,67	215,67	52,06	135,48		
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP	-0,17	2,40	2,40	3,12	7,86	14,62	35,05
% do CDI	-54,82	304,15	304,15	244,11	345,16	209,29	255,01
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2,71	8,76	8,76	16,15	38,60	43,45	
Var. S&P 500 p.p.	4,99	13,79	13,79	6,02	11,98	-47,24	
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	0,43	8,57	8,57	6,32	32,81	24,90	72,42
Var. IBOVESPA p.p.	-0,04	-0,15	-0,15	-0,22	-0,58	-0,69	-1,85
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	0,88	9,90	9,90	9,21	35,33	30,01	83,50
Var. IBOVESPA p.p.	0,42	1,19	1,19	2,67	1,93	4,42	9,23
PATO BRANCO CONSOLIDADO	0,02	2,35	2,35	1,48	7,49	13,90	
Var. IPCA + 5,43% p.p.	-0,95	-0,66	-0,66	-5,00	-6,72	-9,10	
CDI	0,31	0,79	0,79	1,28	2,28	6,98	13,74
IBOVESPA	0,46	8,72	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27
INPC + 6,00%	1,09	3,42	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46
IPCA + 6,00%	1,02	3,15	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,21	0,68	0,68	0,81	2,04	8,17	15,99	25,04	41,88
IRF-M 1+	0,22	1,54	1,54	-3,30	-1,09	10,57	31,78	44,01	70,12
IRF-M TOTAL	0,21	1,26	1,26	-1,58	0,14	9,97	27,26	38,64	61,89
IMA-B 5	-0,13	1,44	1,44	1,29	6,07	15,42	32,32	45,20	62,50
IMA-B 5+	0,83	2,69	2,69	-2,55	8,52	10,66	55,78	65,31	89,15
IMA-B TOTAL	0,42	2,14	2,14	-0,72	7,42	12,74	45,16	57,06	77,99
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,32	1,32	1,32	-0,34	2,74	9,23	26,31	36,75	56,76
IMA-GERAL TOTAL	0,35	1,48	1,48	0,14	3,55	10,30	27,83	38,65	58,38
IDKA 2	-0,32	1,91	1,91	1,87	7,06	16,45	31,87	45,03	63,71
IDKA 20	1,07	3,85	3,85	-3,63	12,34	7,07	77,65	82,49	113,49
CDI	0,31	0,79	0,79	1,28	2,28	6,98	13,74	22,11	37,80

Renda Variável

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,53	1,68	1,68	3,77	8,35	10,66	14,38	19,40	22,99
INPC	0,60	1,95	1,95	3,95	9,22	11,78	15,49	19,56	22,62
IGPM	0,60	6,30	6,30	15,08	35,75	45,68	55,16	65,90	64,61
SELIC	0,31	0,79	0,79	1,28	2,28	6,98	13,75	22,12	37,84

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-2,27	-5,03	-5,03	10,13	26,62	90,69	105,09	168,14	219,09
MSCI ACWI	-3,25	-6,11	-6,11	7,23	25,29	79,54	84,88	134,07	181,00
MSCI World	-3,06	-5,78	-5,78	7,96	25,18	80,80	87,35	138,06	184,42

Meta Atuarial

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

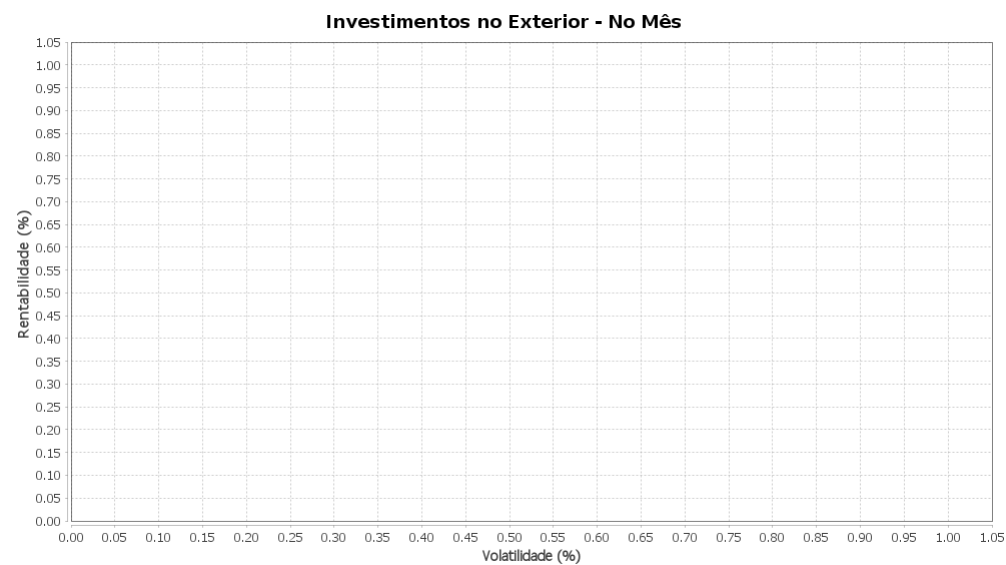
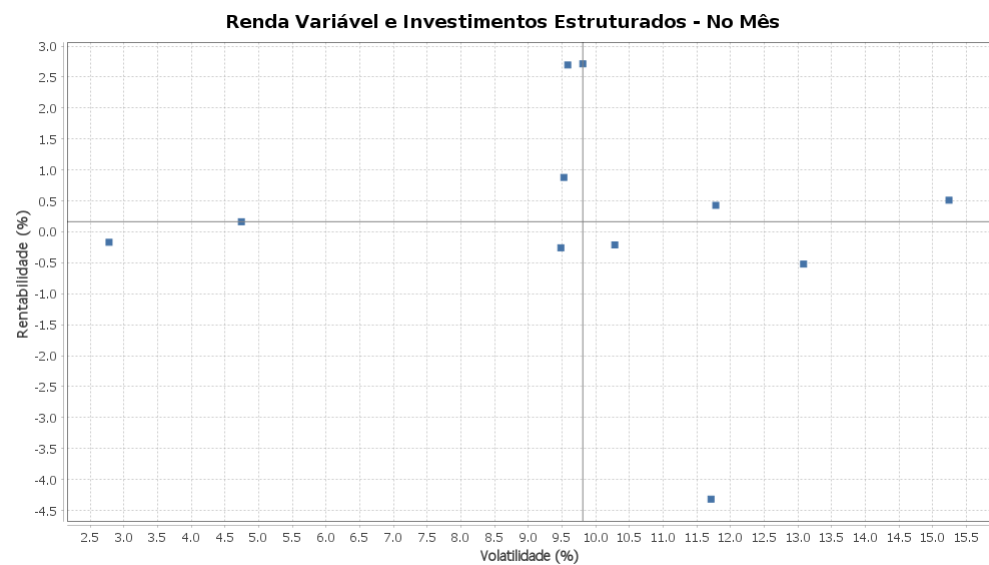
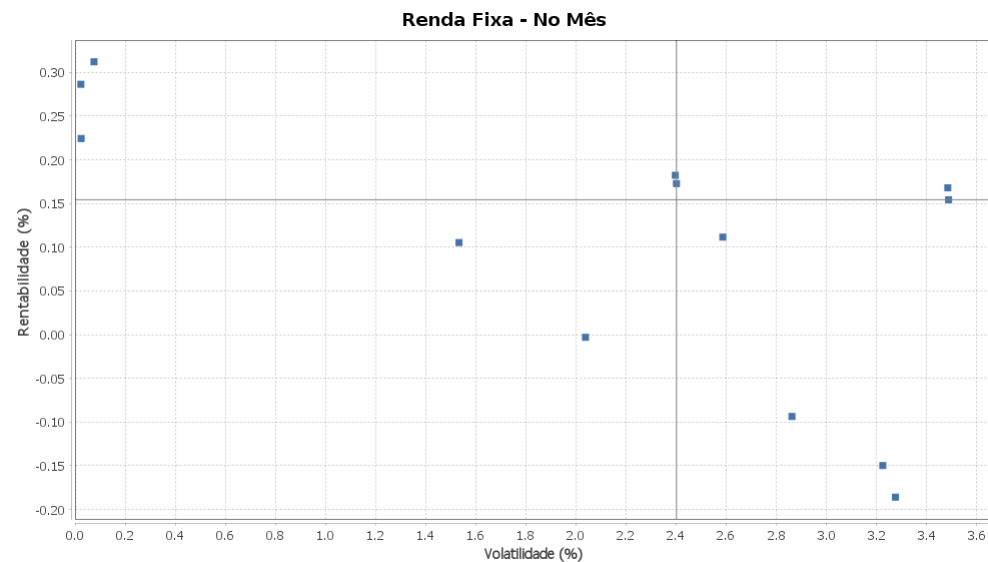
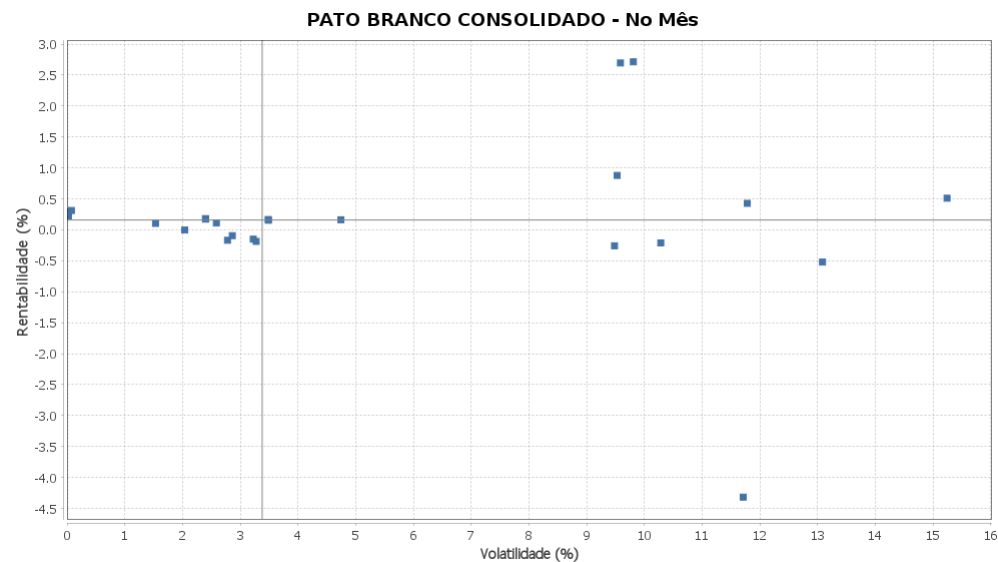
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
184	06/04/2021	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	29.150,25	0,00	1.414,99832500	20,6009077670
189	09/04/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	16.265,00	7.672,76132300	2,1198365640
193	16/04/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	16.985,37	0,00	8.010,58429000	2,1203659290
190	16/04/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3,13	1,47616000	2,1203659290
197	16/04/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	600.000,00	0,00	401.098,20689000	1,4958930000
194	16/04/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.000.000,00	309.471,24417900	3,2313180000
196	16/04/2021	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	600.000,00	0,00	578,55220900	1.037,0714860000
195	16/04/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	1.000.000,00	0,00	685.214,04030900	1,4593980000
187	19/04/2021	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	603.424,01	0,00	421.554,25279600	1,4314266930
191	20/04/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	20.889,33	9.850,65307100	2,1206035630
188	28/04/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	50.000,00	0,00	23.571,83085500	2,1211759200
185	28/04/2021	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	952.751,87	45.813,09579300	20,7964961440
192	30/04/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.917,39	4.203,48986500	2,1214253600
186	30/04/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	32.677,17	0,00	15.403,40311500	2,1214253600
205	06/05/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	3,67	0,00	1,72955900	2,1219276930
200	07/05/2021	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	28.492,59	0,00	19.569,25282300	1,4559876280
206	07/05/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.332,93	1.570,56566300	2,1221207610
207	10/05/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	11.385,92	5.364,81658100	2,1223316450
212	14/05/2021	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,00	16.107,64	15,53043400	1.037,1660580000
204	14/05/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	950.000,00	0,00	447.437,73549100	2,1232004470
208	14/05/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3,13	1,47419000	2,1232004470
211	14/05/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	540.000,00	0,00	360.855,95031415	1,4964420000
199	17/05/2021	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	502.605,76	0,00	350.714,71693100	1,4330900180
203	17/05/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	16.107,64	0,00	7.585,72962700	2,1234134080
198	25/05/2021	BB AÇÕES ENERGIA FI	0,00	457.284,12	27.020,29801200	16,9237260000
202	25/05/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	630,19	296,59673900	2,1247367810
201	27/05/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	921.978,87	433.852,92808800	2,1250954190
209	31/05/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.765,50	3.653,51354300	2,1254882210

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
219	01/06/2021	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	29.619,82	0,00	20.491,03036000	1,4455017380
220	02/06/2021	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	27.805,79	0,00	19.160,39015800	1,4512120980
223	10/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	16.876,28	7.934,56608600	2,1269316830
222	15/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	50.000,00	0,00	23.501,52534100	2,1275214810
224	17/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3,13	1,47093000	2,1279049630
226	17/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	33.970,74	0,00	15.964,40658300	2,1279049630
215	17/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	950.000,00	0,00	446.448,50992800	2,1279049630
213	17/06/2021	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	250.000,00	0,00	12.038,17204900	20,7672725530
228	17/06/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	450.000,00	0,00	138.598,47375300	3,2467890000
221	18/06/2021	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	250.591,18	0,00	175.074,66280200	1,4313389270
216	18/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	16.107,64	7.568,78003300	2,1281685990
227	18/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	16.107,64	0,00	7.568,78003300	2,1281685990
217	25/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.806,36	3.665,82243800	2,1294975770
218	28/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	942.824,09	442.694,37459500	2,1297403900
225	30/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.513,33	2.118,67834600	2,1302572940
214	30/06/2021	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	30.023,66	0,00	1.437,46253400	20,8865687180
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 1.281.700,52

Value-At-Risk: 2,21%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,03	0,00	-0,91	0,29	3.182.881,19	5,50
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,03	0,00	-3,44	0,22	196.103,30	0,34
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,08	0,05	0,00	0,06	0,31	1.006.697,28	1,74
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	Artigo 7º IV, Alínea a	1,53	1,08	0,05	-0,13	0,11	3.408.848,29	5,89
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,04	1,15	0,07	-0,15	-0,00	4.746.755,23	8,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,40	1,44	0,01	-0,05	0,18	411.899,16	0,71
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,40	1,46	0,01	-0,06	0,17	436.450,51	0,75
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,59	1,24	0,11	-0,08	0,11	6.827.759,27	11,80
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	2,78	2,41	0,03	-0,17	-0,17	897.433,13	1,55
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,86	1,37	0,15	-0,14	-0,09	8.303.051,82	14,35
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,23	1,48	0,11	-0,14	-0,15	5.769.533,13	9,97
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,28	1,48	0,14	-0,15	-0,19	7.368.617,12	12,73
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,48	2,35	0,01	-0,04	0,17	435.854,10	0,75
BB PREV IRF-M 1+	Artigo 7º I, Alínea b	3,49	2,33	0,02	-0,04	0,15	575.130,38	0,99
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	Artigo 8º III	4,74	1,95	0,04	-0,03	0,16	1.494.043,32	2,58
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	9,48	7,14	0,08	-0,06	-0,26	795.491,80	1,37
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	9,53	7,92	0,35	0,06	0,88	2.852.409,30	4,93
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	Artigo 8º II, Alínea a	9,59	6,33	0,09	0,25	2,70	1.492.645,15	2,58
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	9,81	6,43	0,07	0,25	2,71	1.179.049,39	2,04
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	10,28	8,18	0,08	-0,05	-0,21	642.538,68	1,11
BB AÇÕES ENERGIA FI	Artigo 8º II, Alínea a	11,71	9,29	0,22	-0,39	-4,32	1.732.364,83	2,99
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	11,78	8,27	0,13	0,01	0,43	1.021.613,12	1,77
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	Artigo 8º II, Alínea a	13,09	9,08	0,30	-0,06	-0,52	2.130.940,18	3,68
BB AÇÕES CONSUMO FIC	Artigo 8º II, Alínea a	15,24	10,16	0,14	0,01	0,51	971.486,50	1,68