



PATO BRANCO CONSOLIDADO
3º 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 30.09.2021.

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 **73,49%**

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	2,91	-0,38	-1,51	429.848,99	0,69	6.207.836.765,86	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,48	0,98	1,13	6.036.004,88	9,71	11.150.255.278,19	0,05
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,29	1,03	1,30	8.410.844,62	13,53	9.425.482.510,34	0,09
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,51	-0,78	-2,78	423.737,21	0,68	1.479.274.934,11	0,03
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,91	-0,37	-1,46	405.867,75	0,65	1.386.775.998,41	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,49	0,98	1,11	7.478.163,14	12,03	6.090.651.961,96	0,12
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,68	-0,01	-0,70	6.779.781,46	10,90	8.672.013.980,14	0,08
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,43	0,35	-1,87	4.658.139,70	7,49	14.407.320.968,51	0,03
BB	BB	BB PREV IRF-M 1+	4,53	-0,82	-2,82	558.900,39	0,90	208.930.479,98	0,27
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,49	0,64	0,23	35.181.288,14	56,59		

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	0,16	0,35	0,90	220.123,80	0,35	2.310.961.339,30	0,01
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,68	0,84	1,30	3.473.013,61	5,59	3.094.123.781,71	0,11
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,30	0,51	1,45	3.457.909,54	5,56	1.378.337.921,80	0,25
CEF	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,21	0,49	-1,52	3.357.110,08	5,40	1.036.012.764,97	0,32
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,03	0,61	0,17	10.508.157,03	16,90		

Renda Fixa			2,25	0,63	0,21	45.689.445,17	73,49		
-------------------	--	--	-------------	-------------	-------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

24,26%

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	20,39	-6,75	-13,47	2.468.219,60	3,97	1.120.979.496,53	0,22
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	20,80	-6,56	-12,44	894.509,99	1,44	611.621.285,66	0,15
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			20,47	-6,70	-13,20	3.362.729,59	5,41		

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	18,75	-2,30	-3,54	993.356,31	1,60	337.073.560,97	0,29
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	21,62	-6,18	-15,08	1.349.686,41	2,17	251.032.322,68	0,54
CEF	CEF	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	21,58	-1,88	-6,58	1.525.609,98	2,45	378.964.582,69	0,40
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,12	-6,52	-11,40	569.318,19	0,92	3.106.281.742,93	0,02
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	13,94	-4,78	0,67	2.502.248,62	4,02	2.078.841.851,24	0,12
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	20,28	-7,71	-14,35	986.133,55	1,59	1.709.110.671,86	0,06
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			17,88	-4,68	-7,29	7.926.353,06	12,75		

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	3,71	-0,74	-2,45	875.440,09	1,41	4.076.882.979,35	0,02
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	3,54	-0,71	-1,16	1.476.782,35	2,38	129.252.566,49	1,14
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,92	-4,64	1,14	1.443.185,35	2,32	3.166.279.756,52	0,05
Sub-total Artigo 8º III			4,34	-2,25	-0,83	3.795.407,79	6,10		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			15,24	-4,54	-7,21	15.084.490,44	24,26		
--	--	--	--------------	--------------	--------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,25%

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,24	-0,25	-2,89	788.733,34	1,27	3.337.438.389,61	0,02
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	18,27	0,71	0,71	302.138,83	0,49	1.182.247.363,81	0,03
BB	BB	BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS FIC DE FIA - BDR ETF NÍVEL I	15,19	-2,91	-2,91	308.867,84	0,50	202.130.127,97	0,15
Sub-total Artigo 9º A, III			14,74	-1,41	-4,03	1.399.740,01	2,25		
Investimentos no Exterior			14,74	-1,41	-4,03	1.399.740,01	2,25		
Total			4,67	-0,72	-1,79	62.173.675,62	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	35.181.288,14	56,59	0,00	53,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	10.508.157,03	16,90	0,00	7,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	45.689.445,17	73,49					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	3.362.729,59	5,41	0,00	8,00	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	7.926.353,06	12,75	0,00	16,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	3.795.407,79	6,10	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	15.084.490,44	24,26					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	1.399.740,01	2,25	0,00	7,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	1.399.740,01	2,25					10,00

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	0,64 144,99	0,23 18,44	0,23 18,44	1,52 75,25	3,69 123,45	222.123,15	78.432,64
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,61 139,53	0,17 14,01	0,17 14,01	0,89 44,03	1,75 58,63	62.725,90	26.256,56
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-6,70 -0,13	-13,20 -0,72	-13,20 -0,72	-4,91 -0,06	17,40 0,09	-241.463,03	-511.292,83
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,68 1,89	-7,29 5,19	-7,29 5,19	-2,20 2,65	13,59 -3,72	-389.225,85	-609.693,35
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-2,25 4,32	-0,83 11,65	-0,83 11,65	1,88 6,73	4,78 -12,53	-87.222,23	-33.954,58
Artigo 9º A, III % do CDI	-1,41 -322,57	-4,03 -720,88				-5.151,62	-18.397,15
PATO BRANCO CONSOLIDADO (Total)						-438.213,68	-1.068.648,71

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+	563.510,47	0,00	0,00	0,00	558.900,39	-4.610,08	-16.229,99
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6.780.141,63	0,00	0,00	0,00	6.779.781,46	-360,17	-47.977,81
BB PREV RF IDKA2	8.324.812,15	0,00	0,00	0,00	8.410.844,62	86.032,47	107.792,80
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	7.405.765,47	0,00	0,00	0,00	7.478.163,14	72.397,67	81.741,24
BB PREV RF IRF-M	431.470,58	0,00	0,00	0,00	429.848,99	-1.621,59	-6.601,52
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.977.363,07	0,00	0,00	0,00	6.036.004,88	58.641,81	66.471,75
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	427.066,23	0,00	0,00	0,00	423.737,21	-3.329,02	-12.116,89
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	407.371,47	0,00	0,00	0,00	405.867,75	-1.503,72	-6.031,41
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	4.641.663,92	0,00	0,00	0,00	4.658.139,70	16.475,78	-88.615,53
					35.181.288,14	0,00	0,00

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	243.084,51	1.016.985,37	-1.042.189,34	0,00	220.123,80	2.243,26	4.705,41
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	3.340.644,10	0,00	0,00	0,00	3.357.110,08	16.465,98	-51.738,21
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	2.353.320,36	1.089.397,72	0,00	0,00	3.457.909,54	15.191,46	29.622,90
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3.444.188,41	0,00	0,00	0,00	3.473.013,61	28.825,20	43.666,46
					10.508.157,03	0,00	0,00

Artigo 8º I, Alinea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	2.646.925,58	0,00	0,00	0,00	2.468.219,60	-178.705,98	-384.189,70
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	957.267,04	0,00	0,00	0,00	894.509,99	-62.757,05	-127.103,13
					3.362.729,59	0,00	0,00

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	2.568.118,81	59.746,19	0,00	0,00	2.502.248,62	-125.616,38	-10.975,80
BB AÇÕES CONSUMO FIC	1.438.516,89	0,00	0,00	0,00	1.349.686,41	-88.830,48	-221.800,09
BB AÇÕES ENERGIA FI	1.016.690,83	0,00	0,00	0,00	993.356,31	-23.334,52	-39.008,52
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	1.068.556,37	0,00	0,00	0,00	986.133,55	-82.422,82	-159.358,25
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	1.554.911,50	0,00	0,00	0,00	1.525.609,98	-29.301,52	-105.330,20
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	609.038,32	0,00	0,00	0,00	569.318,19	-39.720,13	-73.220,49
					7.926.353,06	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	1.487.284,63	0,00	0,00	0,00	1.476.782,35	-10.502,28	-17.260,97
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.513.380,57	0,00	0,00	0,00	1.443.185,35	-70.195,22	5.299,43

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	881.964,82	0,00	0,00	0,00	875.440,09	-6.524,73	-21.993,04
					3.795.407,79	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS FIC DE FIA - BDR ETF NÍVEL I	0,00	318.137,16	0,00	0,00	308.867,84	-9.269,32	-9.269,32
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	0,00	300.000,00	0,00	0,00	302.138,83	2.138,83	2.138,83
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	486.754,47	300.000,00	0,00	0,00	788.733,34	1.978,87	-11.266,66
					1.399.740,01	0,00	0,00

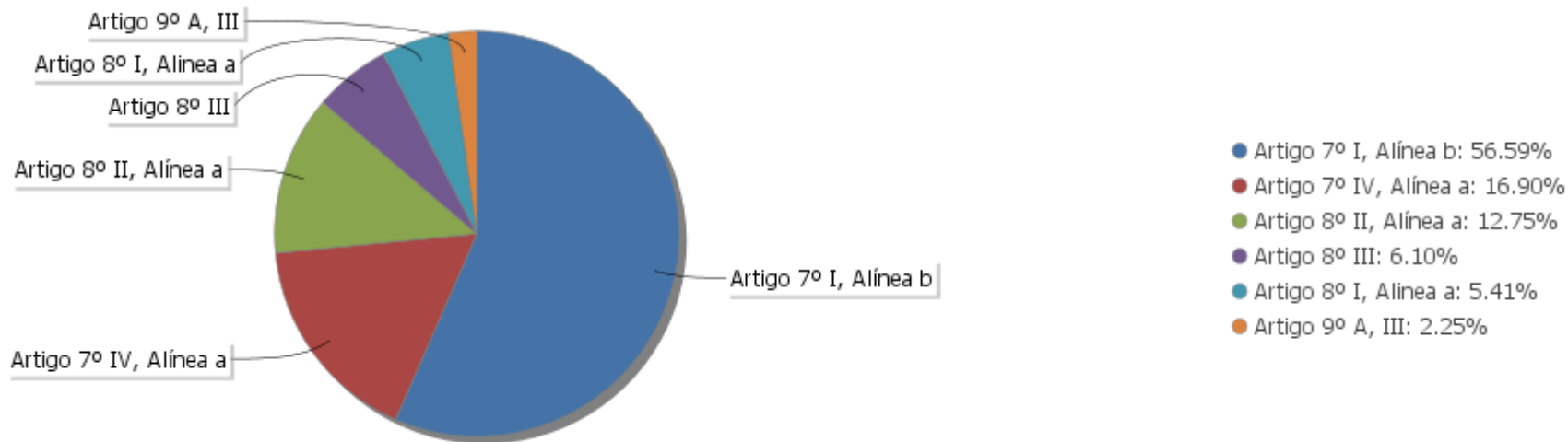
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

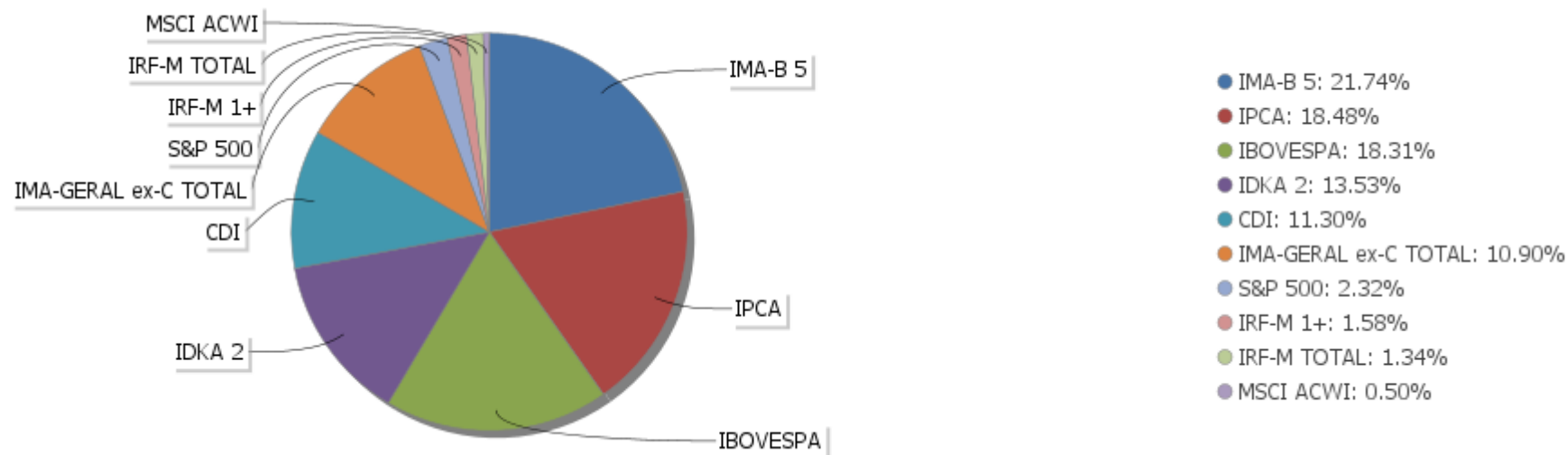
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	61.604.357,43	99,08	61.604.357,43	99,08
de 31 a 365 dias	569.318,19	0,92	62.173.675,62	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	62.173.675,62	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

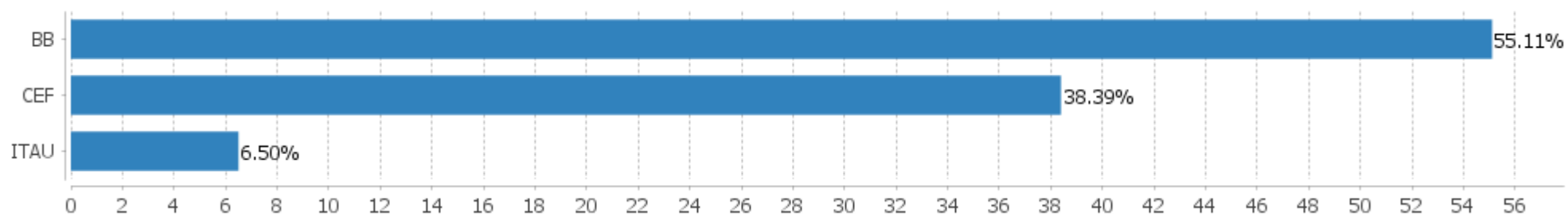


Alocação Por Estratégia



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	-0,65	-0,43	-0,72				-0,34
IPCA + 5,43%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,97	1,43	1,34	1,61				11,20
p.p. indexador	-1,35	-2,58	-0,23	0,20	0,11	-0,95	-2,08	-1,77	-2,33				-11,54
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

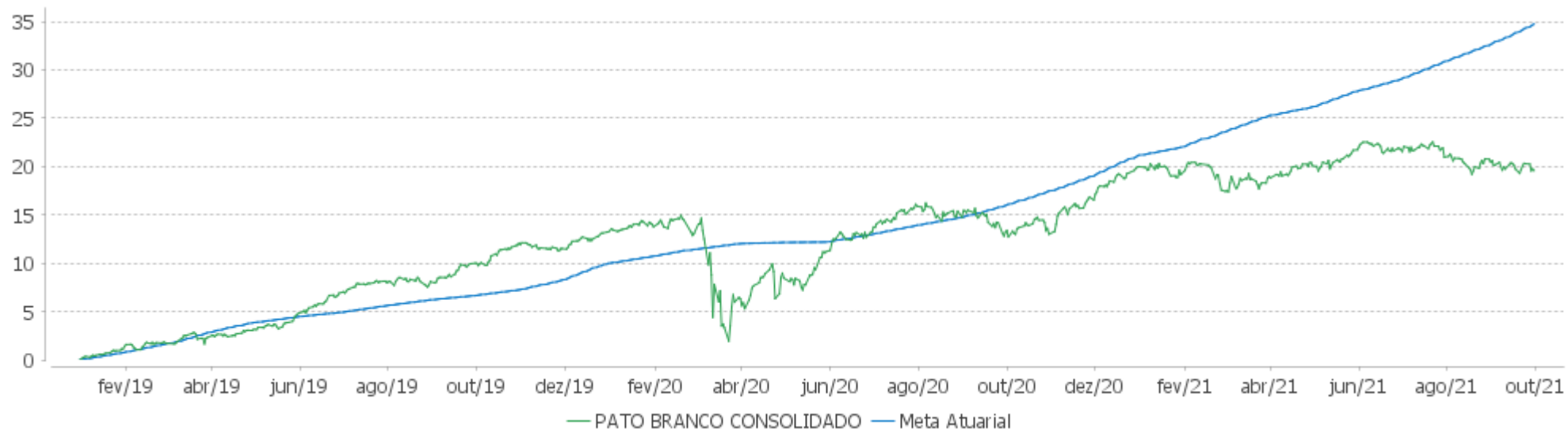
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

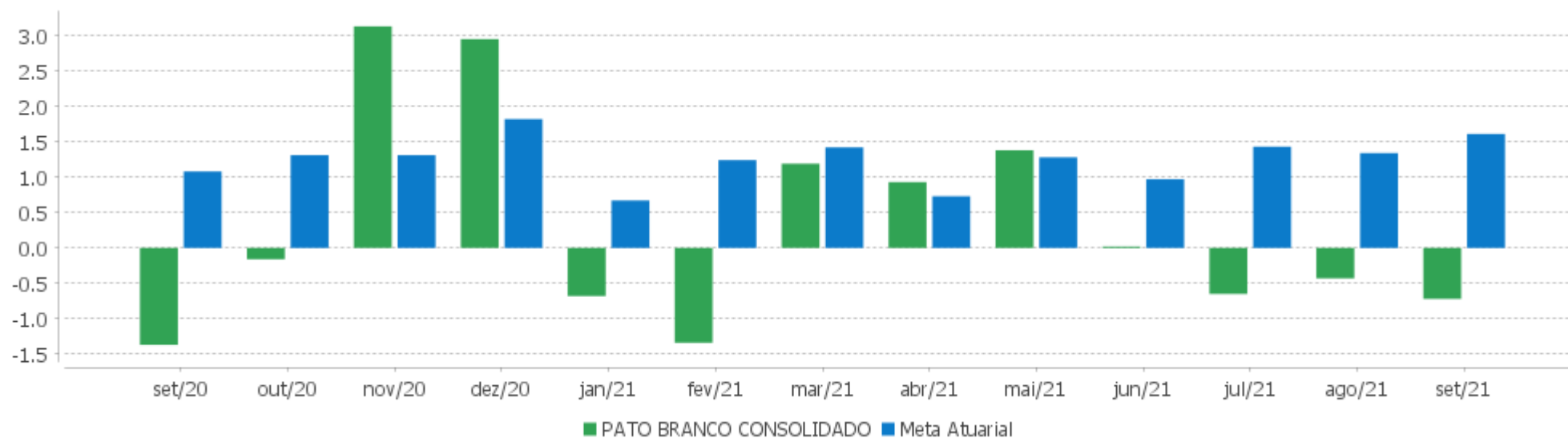
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	14	42,42	03 meses	-1,79	4,43	-6,23	4,43
Meses abaixo - Meta Atuarial	19	57,58	06 meses	0,51	7,58	-7,06	4,07
			12 meses	5,64	16,33	-10,69	4,67
			24 meses	8,70	27,08	-18,38	7,78
			Desde 31/12/2018	19,57	36,07	-16,50	6,77
	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	0,35 79,41	0,90 73,21	0,90 73,21	1,43 70,75	1,88 62,88	4,33 65,05	9,68 72,54
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,51 117,13	1,45 118,34	1,45 118,34	2,23 110,55	3,31 110,67	6,54 98,23	13,19 98,78
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,84 -0,32	1,30 -1,72	1,30 -1,72	1,98 -2,77	2,72 -7,53	6,51 -7,19	21,07 4,08
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,49 -0,67	-1,52 -4,54	-1,52 -4,54	-0,70 -5,45	0,74 -9,50		
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,78 -0,05	-2,78 -0,13	-2,78 -0,13	-1,40 -0,25	-3,39 -0,25	3,69 -0,54	25,29 -0,64
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,98 -0,02	1,13 -0,05	1,13 -0,05	2,53 -0,11	5,69 -0,26	13,00 -0,62	30,19 -0,93
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,03 -0,06	1,30 0,11	1,30 0,11	2,74 -0,38	6,05 -0,17	13,77 -0,94	27,54 -1,91
BB PREV IRF-M 1+ Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,82 -0,09	-2,82 -0,17	-2,82 -0,17	-1,52 -0,37	-3,32 -0,18	3,29 -0,95	
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,01 -0,03	-0,70 -0,28	-0,70 -0,28	0,51 -0,38	1,75 -0,30	5,52 -0,51	23,63 0,04
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,35 -0,81	-1,87 -4,89	-1,87 -4,89	-0,98 -5,73	0,85 -9,39	7,32 -6,38	26,96 9,96
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,98 -0,02	1,11 -0,08	1,11 -0,08	2,49 -0,15	5,70 -0,25	13,04 -0,58	30,18 -0,94
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,38 -0,05	-1,51 -0,12	-1,51 -0,12	-0,38 -0,23	-1,26 -0,24	4,87 -0,60	22,26 -0,96
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,37 -0,04	-1,46 -0,07	-1,46 -0,07	-0,35 -0,20	-1,25 -0,24	4,97 -0,50	22,56 -0,66
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI % do CDI	-0,71 -161,14	-1,16 -94,47	-1,16 -94,47	0,52 26,03	1,45 48,54		
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	-0,74 -168,82	-2,45 -200,40	-2,45 -200,40	-0,11 -5,60	4,85 162,19	8,05 120,97	28,60 214,26
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-4,64 -5,36	1,14 -7,86	1,14 -7,86	9,99 6,48	30,71 7,20	42,05 -46,96	
BB AÇÕES ENERGIA FI	-2,30	-3,54	-3,54	-4,93	11,02	4,96	84,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-523,74	-289,73	-289,73	-244,89	368,50	74,56	632,58
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA Var. IBOVESPA p.p.	-1,88 4,68	-6,58 5,90	-6,58 5,90	-0,76 4,09	15,82 -1,49	9,79 3,84	86,15 46,28
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,78 1,79	0,67 13,15	0,67 13,15	9,25 14,10	28,99 11,68		
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	-6,52 0,05	-11,40 1,08	-11,40 1,08	-1,65 3,20	19,26 1,95	6,71 0,75	56,58 16,71
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	-6,18 0,39	-15,08 -2,60	-15,08 -2,60	-8,33 -3,48	-3,45 -20,76	-4,33 -10,28	45,72 5,84
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-7,71 -1,15	-14,35 -1,87	-14,35 -1,87	-5,38 -0,53	16,49 -0,82	8,55 2,60	
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-6,56 0,01	-12,44 0,04	-12,44 0,04	-4,94 -0,09	16,86 -0,45	5,56 -0,40	38,58 -1,29
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	-6,75 -0,18	-13,47 -0,99	-13,47 -0,99	-4,90 -0,05	17,56 0,25	7,93 1,97	46,90 7,02
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-0,25 6,32	7,72 20,20	7,72 20,20	3,03 7,87	18,25 0,94	90,64 84,69	101,42 61,54
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	0,62 7,19	9,07 21,55	9,07 21,55	3,96 8,81	18,60 1,29	85,75 79,79	81,06 41,19
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS FIC DE FIA - BDR ETF NÍVEL I Var. MSCI ACWI p.p.	-4,50 -5,72	-1,72 -8,88	-1,72 -8,88	4,96 4,35			
PATO BRANCO CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,43% p.p.	-0,72 -2,33	-1,79 -6,23	-1,79 -6,23	0,51 -7,06	5,64 -10,57	8,70 -17,66	
CDI	0,44	1,22	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35
IBOVESPA	-6,57	-12,48	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87
INPC + 6,00%	1,69	4,69	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02
IPCA + 6,00%	1,65	4,58	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28

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	0,40	0,96	0,96	1,65	2,49	7,15	15,12	22,90	38,45
IRF-M 1+	-0,73	-2,65	-2,65	-1,15	-3,14	4,23	25,92	32,64	58,13
IRF-M TOTAL	-0,33	-1,39	-1,39	-0,15	-1,02	5,48	23,23	30,30	53,03
IMA-B 5	1,00	1,18	1,18	2,64	5,95	13,62	31,12	39,68	58,47
IMA-B 5+	-1,26	-4,19	-4,19	-1,61	3,20	1,48	46,98	45,78	70,99
IMA-B TOTAL	-0,13	-1,59	-1,59	0,52	4,71	6,92	40,46	44,04	66,75
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,02	-0,42	-0,42	0,89	2,05	6,02	23,59	29,99	49,60
IMA-GERAL TOTAL	-0,01	-0,52	-0,52	0,96	2,48	6,93	24,87	31,60	51,09
IDKA 2	1,10	1,18	1,18	3,12	6,21	14,71	29,45	40,48	59,67
IDKA 20	-3,03	-8,65	-8,65	-5,13	2,03	-7,04	59,98	49,40	80,44
CDI	0,44	1,22	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,90	34,86

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-6,57	-12,48	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87	49,38	90,14
IBRX 100	-6,99	-13,61	-13,61	-5,31	17,82	7,71	45,23	53,72	95,90
IBRX 50	-7,47	-14,15	-14,15	-5,58	18,46	6,59	37,53	47,56	87,32
SMALL CAP	-6,43	-15,22	-15,22	-4,70	15,75	13,69	78,82	65,15	133,65
IFIX	-1,24	-1,42	-1,42	-4,61	-2,83	1,17	27,21	22,27	49,54
Índice Consumo - ICON	-5,95	-14,34	-14,34	-7,48	-1,67	-2,69	50,48	25,77	51,19
Índice Dividendos - IDIV	-4,48	-6,59	-6,59	-1,51	19,58	7,85	64,83	56,04	121,60

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	1,16	3,02	3,02	4,75	10,25	13,70	16,99	22,29	25,39
INPC	1,20	3,13	3,13	5,14	10,78	15,09	18,46	23,16	25,17
IGPM	-0,64	0,80	0,80	7,15	24,86	47,25	52,21	67,49	65,07
SELIC	0,44	1,21	1,21	2,01	2,99	6,64	13,32	20,87	34,83

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	0,73	8,99	8,99	3,52	23,52	89,01	100,82	193,57	232,88
MSCI ACWI	1,23	7,16	7,16	0,61	21,06	78,00	83,86	150,21	184,12
MSCI World	1,22	8,36	8,36	2,09	22,47	80,14	87,02	158,04	191,94

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,49	4,07	4,07	6,84	14,64	22,96	31,56	42,95	52,39
IPCA + 5,00%	1,57	4,32	4,32	7,36	15,74	25,33	35,38	48,50	59,82
IPCA + 5,50%	1,61	4,45	4,45	7,61	16,29	26,53	37,32	51,33	63,64
IPCA + 5,89%	1,64	4,55	4,55	7,81	16,71	27,46	38,84	53,57	66,67
IPCA + 6,00%	1,65	4,58	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28	54,21	67,53
INPC + 4,00%	1,53	4,18	4,18	7,24	15,20	24,46	33,20	43,97	52,12
INPC + 6,00%	1,69	4,69	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02	55,31	67,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

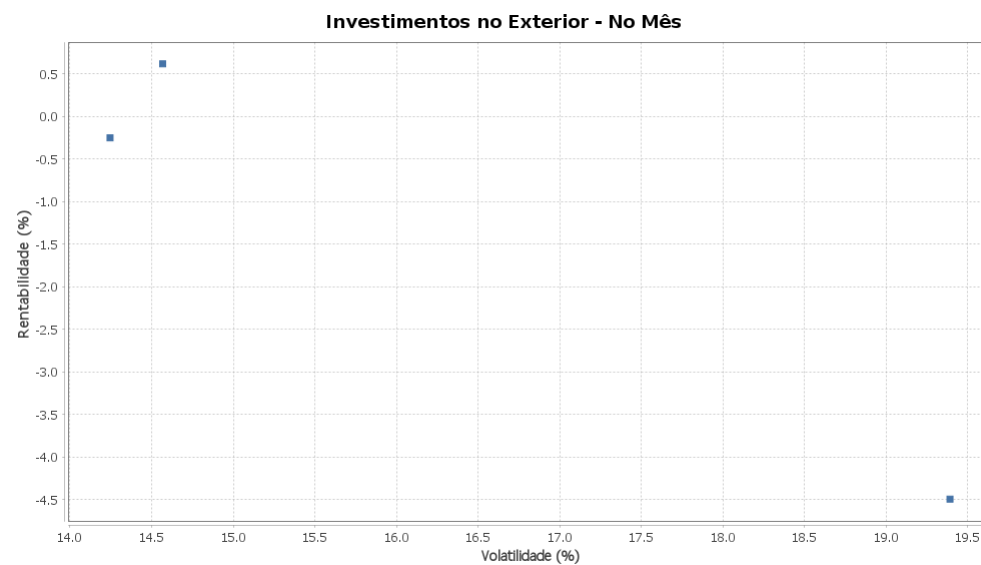
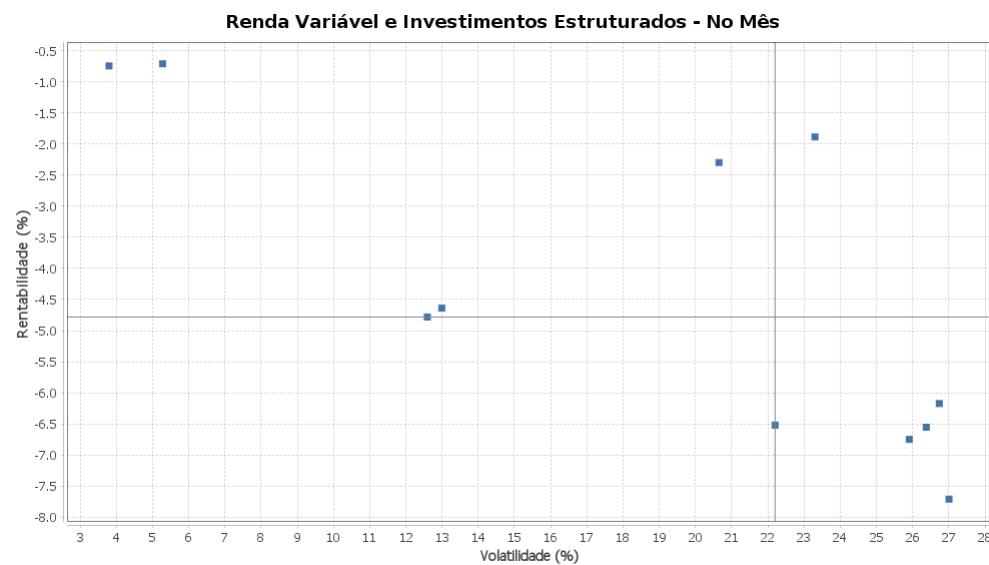
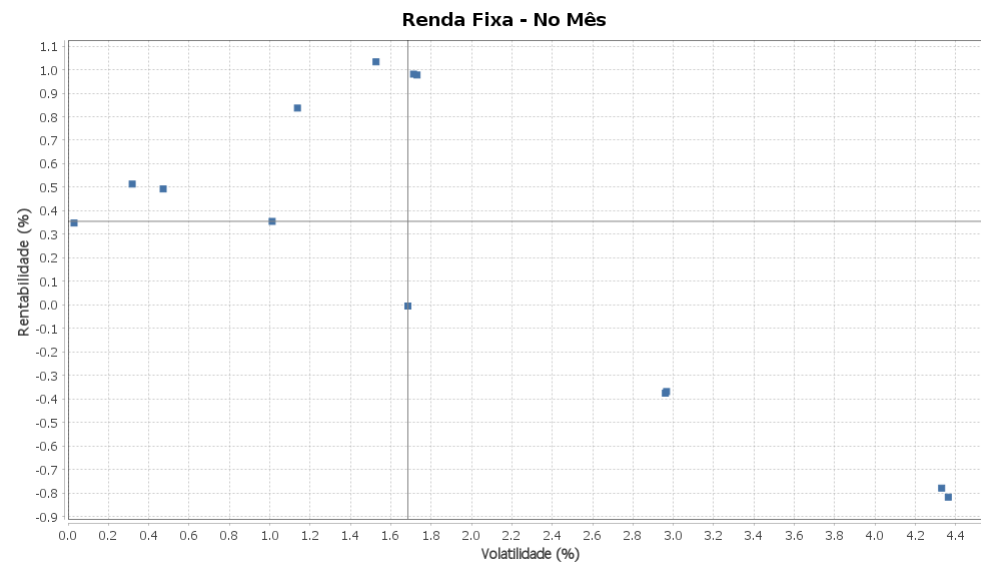
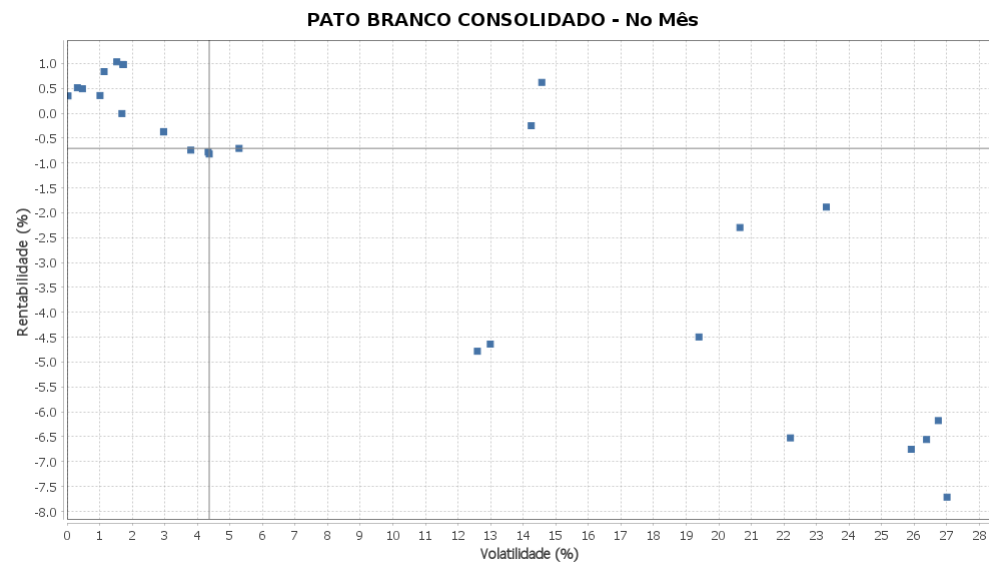
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
231	01/07/2021	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	27.804,78	0,00	1.331,66665000	20,8796848570
245	09/07/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	17.705,03	8.304,76762700	2,1319115470
246	22/07/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	301,91	141,47144100	2,1340702910
240	22/07/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	16.985,37	0,00	7.959,14271000	2,1340702910
235	22/07/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.000.000,00	0,00	468.588,12674400	2,1340702910
244	22/07/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	246.465,96	0,00	13.479,98667457	18,2838430000
248	23/07/2021	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	0,00	500.000,00	246.113,25399800	2,0315850000
238	23/07/2021	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	500.000,00	0,00	329.240,36462000	1,5186473280
230	23/07/2021	BB AÇÕES ENERGIA FI	0,00	700.000,00	43.560,09974500	16,0697520000
236	23/07/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	174,62	81,81496400	2,1343283910
242	23/07/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	200.000,00	0,00	60.932,08418499	3,2823430000
239	28/07/2021	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	250.000,00	0,00	164.878,34665500	1,5162694500
233	28/07/2021	BB AÇÕES CONSUMO FIC	350.000,00	0,00	103.032,75386100	3,3969780180
234	28/07/2021	BB AÇÕES CONSUMO FIC	250.000,00	0,00	73.594,82418600	3,3969780180
232	28/07/2021	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	350.000,00	0,00	225.410,50976300	1,5527226320
237	28/07/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	980.793,24	459.375,40434300	2,1350582350
247	30/07/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.092,72	2.384,78335000	2,1355063550
243	30/07/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	30.903,26	0,00	19.459,60888423	1,5880720000
248	02/08/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3,13	1,46553200	2,1357437470
249	03/08/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	27.933,27	0,00	17.527,58247400	1,5936750000
250	09/08/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	1.332.191,64	0,00	901.841,15662700	1,4771910000
251	10/08/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	19.655,77	9.196,38840400	2,1373357820
252	17/08/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	50.000,00	0,00	23.377,18045600	2,1388379190
253	19/08/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.000.000,00	0,00	467.413,01247600	2,1394355170
255	19/08/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	16.985,37	0,00	7.939,18295900	2,1394355170
254	19/08/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3,13	1,46300300	2,1394355170
256	20/08/2021	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	210.833,08	0,00	137.311,99889300	1,5354308560
257	20/08/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.971,75	1.388,84900300	2,1397214480

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
259	23/08/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	200.000,00	0,00	123.235,95433600	1,6229030000
258	23/08/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	500.000,00	0,00	79.249,53856956	6,3091850000
260	27/08/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.006.261,94	469.935,59330000	2,1412762820
261	31/08/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.488,44	3.029,32752000	2,1418747090
274	01/09/2021	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	31.970,34	0,00	20.432,87728400	1,5646518870
269	02/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	303,13	141,47847800	2,1425873640
273	03/09/2021	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	27.775,85	0,00	17.713,22761700	1,5680851960
268	03/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.400,00	653,32880500	2,1428719940
267	10/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	16.205,19	7.557,83756400	2,1441569580
266	13/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	233,61	108,93439800	2,1445016860
275	17/09/2021	BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS FIC DE FIA - BDR ETF NÍVEL I	318.137,16	0,00	271.027,39501900	1,1738192000
271	17/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.000.000,00	0,00	466.013,63318700	2,1458599680
264	17/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	16.985,37	0,00	7.915,41398400	2,1458599680
262	17/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	1.089.397,72	0,00	733.015,23967000	1,4861870000
272	20/09/2021	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	300.000,00	0,00	121.247,85361500	2,4742706040
263	20/09/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	300.000,00	0,00	49.487,79309351	6,0621010000
270	29/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.018.767,46	474.087,22232200	2,1489030120
265	30/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.279,95	2.456,55815200	2,1493283180
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 1.219.468,03

Value-At-Risk: 1,96%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	-0,00	-3,03	0,35	220.123,80	0,35
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,32	0,06	0,00	0,24	0,51	3.457.909,54	5,56
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,47	1,20	0,04	0,12	0,49	3.357.110,08	5,40
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,01	1,46	0,07	-0,08	0,35	4.658.139,70	7,49
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	1,14	0,52	0,02	0,35	0,84	3.473.013,61	5,59
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,53	1,07	0,09	0,39	1,03	8.410.844,62	13,53
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,68	1,11	0,09	-0,26	-0,01	6.779.781,46	10,90
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,71	1,23	0,08	0,32	0,98	6.036.004,88	9,71
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,73	1,25	0,10	0,31	0,98	7.478.163,14	12,03
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,96	1,48	0,01	-0,27	-0,38	429.848,99	0,69
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,97	1,49	0,01	-0,27	-0,37	405.867,75	0,65
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	3,80	2,01	0,03	-0,31	-0,74	875.440,09	1,41
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,33	2,18	0,01	-0,28	-0,78	423.737,21	0,68
BB PREV IRF-M 1+	Artigo 7º I, Alínea b	4,36	2,18	0,01	-0,29	-0,82	558.900,39	0,90
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	Artigo 8º III	5,28	2,19	0,05	-0,22	-0,71	1.476.782,35	2,38
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,59	5,95	0,15	-0,41	-4,78	2.502.248,62	4,02
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	12,99	6,26	0,09	-0,39	-4,64	1.443.185,35	2,32
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	14,25	6,65	-0,01	-0,05	-0,25	788.733,34	1,27
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	14,57	6,16	-0,00	0,01	0,62	302.138,83	0,49
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS FIC DE FIA - BDR ETF NÍVEL I	Artigo 9º A, III	19,39	7,62	0,02	-0,25	-4,50	308.867,84	0,50
BB AÇÕES ENERGIA FI	Artigo 8º II, Alínea a	20,65	9,52	0,12	-0,13	-2,30	993.356,31	1,60
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	22,20	8,31	0,07	-0,31	-6,52	569.318,19	0,92
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	Artigo 8º II, Alínea a	23,30	9,09	0,20	-0,10	-1,88	1.525.609,98	2,45
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	25,91	8,65	0,31	-0,28	-6,75	2.468.219,60	3,97
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	26,38	10,03	0,13	-0,27	-6,56	894.509,99	1,44
BB AÇÕES CONSUMO FIC	Artigo 8º II, Alínea a	26,74	10,08	0,18	-0,25	-6,18	1.349.686,41	2,17
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	27,00	8,64	0,12	-0,30	-7,71	986.133,55	1,59