



LDB
EMPRESAS

PATO BRANCO CONSOLIDADO
MAIO 2021



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.05.2021.

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 73,77%

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
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	2,98	0,16	-1,87	435.697,38	0,77	7.136.312.109,36	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,44	0,67	1,31	5.324.827,15	9,38	14.343.181.790,80	0,04
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,23	0,67	1,51	8.310.823,14	14,64	10.138.018.656,57	0,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	4,58	0,15	-3,59	435.123,18	0,77	1.857.583.224,25	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,98	0,17	-1,86	411.149,70	0,72	1.660.439.042,86	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,44	0,69	1,36	7.100.352,71	12,51	5.747.060.006,20	0,12
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,94	0,48	-0,79	6.820.155,06	12,02	9.352.083.339,26	0,07
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,36	0,24	0,72	4.746.898,40	8,36	15.989.068.973,83	0,03
BB	BB	BB PREV IRF-M 1+	4,60	0,13	-3,54	574.243,97	1,01	265.768.784,28	0,22
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,65	0,55	0,61	34.159.270,69	60,18		

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
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,15	0,19	0,41	132.963,38	0,23	2.438.437.445,72	0,01
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,53	0,27	0,72	3.173.791,90	5,59	3.524.278.161,54	0,09
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,29	0,27	0,36	1.003.565,17	1,77	1.215.667.213,81	0,08
CEF	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,18	0,20	0,61	3.405.259,08	6,00	985.987.140,01	0,35
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,84	0,22	0,65	7.715.579,53	13,59		
Renda Fixa			2,40	0,48	0,58	41.874.850,22	73,77		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

26,23%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21,58	5,51	8,26	2.827.514,44	4,98	1.330.479.590,28	0,21
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	21,94	6,08	5,87	1.017.256,70	1,79	868.002.053,73	0,12
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			21,65	5,66	7,67	3.844.771,14	6,77		

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
BB	BB	BB AÇÕES ENERGIA FI	19,97	4,84	-0,35	1.810.539,71	3,19	405.690.446,43	0,45
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	22,58	6,38	2,26	966.536,97	1,70	316.652.020,08	0,31
CEF	CEF	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	22,97	4,89	3,05	2.142.090,37	3,77	520.832.804,43	0,41
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	20,30	7,67	12,46	643.897,49	1,13	3.647.662.719,96	0,02
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	16,31	0,31	0,88	1.143.395,07	2,01	1.199.295.725,68	0,10
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	27,42	2,60	13,28	797.542,59	1,41	1.724.215.103,27	0,05
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			20,00	4,58	3,23	7.504.002,20	13,22		

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	3,66	1,44	3,29	898.949,82	1,58	4.460.356.611,72	0,02
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	2,66	1,01	0,50	1.491.598,01	2,63	120.319.284,91	1,24
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	16,69	0,48	0,71	1.147.888,51	2,02	1.997.517.389,78	0,06
Sub-total Artigo 8º III			3,35	1,00	1,42	3.538.436,34	6,23		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

17,35 4,05 4,04 14.887.209,68 26,23

Total

5,08 1,38 1,46 56.762.059,90 100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	34.159.270,69	60,18	0,00	53,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	7.715.579,53	13,59	0,00	7,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	41.874.850,22	73,77					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	3.844.771,14	6,77	0,00	8,00	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	7.504.002,20	13,22	0,00	16,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	3.538.436,34	6,23	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	14.887.209,68	26,23					30,00

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	0,55 202,31	0,61 63,56	1,45 213,61	2,57 227,13	4,79 219,93	185.795,92	208.427,40
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,22 79,80	0,65 67,08	0,74 109,30	1,07 94,66	1,98 90,79	19.030,61	44.859,04
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	5,66 -0,49	7,67 1,63	15,01 0,30	17,22 1,31	45,47 1,06	206.087,71	290.605,18
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	4,58 -1,58	3,23 -2,82	12,66 -2,05	10,79 -5,12	28,94 -15,47	335.602,56	255.922,57
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	1,00 -5,16	1,42 -4,62	2,07 -12,63	3,01 -12,90	6,51 -37,90	34.181,19	43.974,96
PATO BRANCO CONSOLIDADO (Total)						780.697,99	843.789,15

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 IRF-M 1+	573.524,72	0,00	0,00	0,00	574.243,97	719,25	-21.057,97
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6.787.519,73	0,00	0,00	0,00	6.820.155,06	32.635,33	-45.938,79
BB PREV RF IDKA2	8.255.435,97	0,00	0,00	0,00	8.310.823,14	55.387,17	123.853,15
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	7.052.033,36	0,00	0,00	0,00	7.100.352,71	48.319,35	102.084,12
BB PREV RF IRF-M	435.006,05	0,00	0,00	0,00	435.697,38	691,33	-8.301,83
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.289.420,62	0,00	0,00	0,00	5.324.827,15	35.406,53	69.419,93
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	434.485,51	0,00	0,00	0,00	435.123,18	637,67	-39.688,69
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	410.453,78	0,00	0,00	0,00	411.149,70	695,92	-7.812,44
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	4.735.595,03	0,00	0,00	0,00	4.746.898,40	11.303,37	35.869,92
					34.159.270,69	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 Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	110.889,71	966.111,31	-945.096,54	0,00	132.963,38	1.058,90	1.166,98
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	3.414.718,16	0,00	-16.107,64	0,00	3.405.259,08	6.648,56	17.355,02
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	1.000.814,72	0,00	0,00	0,00	1.003.565,17	2.750,45	3.565,17
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3.165.219,20	0,00	0,00	0,00	3.173.791,90	8.572,70	22.771,87
					7.715.579,53	0,00	0,00

Artigo 8º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	2.679.756,83	0,00	0,00	0,00	2.827.514,44	147.757,61	225.884,96
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	958.926,60	0,00	0,00	0,00	1.017.256,70	58.330,10	64.720,22
					3.844.771,14	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	606.859,02	531.098,35	0,00	0,00	1.143.395,07	5.437,70	8.872,71
BB AÇÕES CONSUMO FIC	908.587,94	0,00	0,00	0,00	966.536,97	57.949,03	24.913,22
BB AÇÕES ENERGIA FI	2.161.461,11	0,00	-457.284,12	0,00	1.810.539,71	106.362,72	-6.174,83
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	777.367,87	0,00	0,00	0,00	797.542,59	20.174,72	93.513,82
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	2.042.282,27	0,00	0,00	0,00	2.142.090,37	99.808,10	63.459,37
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	598.027,20	0,00	0,00	0,00	643.897,49	45.870,29	71.338,28
					7.504.002,20	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	1.476.668,78	0,00	0,00	0,00	1.491.598,01	14.929,23	7.426,40
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	601.366,14	540.000,00	0,00	0,00	1.147.888,51	6.522,37	7.888,51
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	886.220,23	0,00	0,00	0,00	898.949,82	12.729,59	28.660,05
					3.538.436,34	0,00	0,00

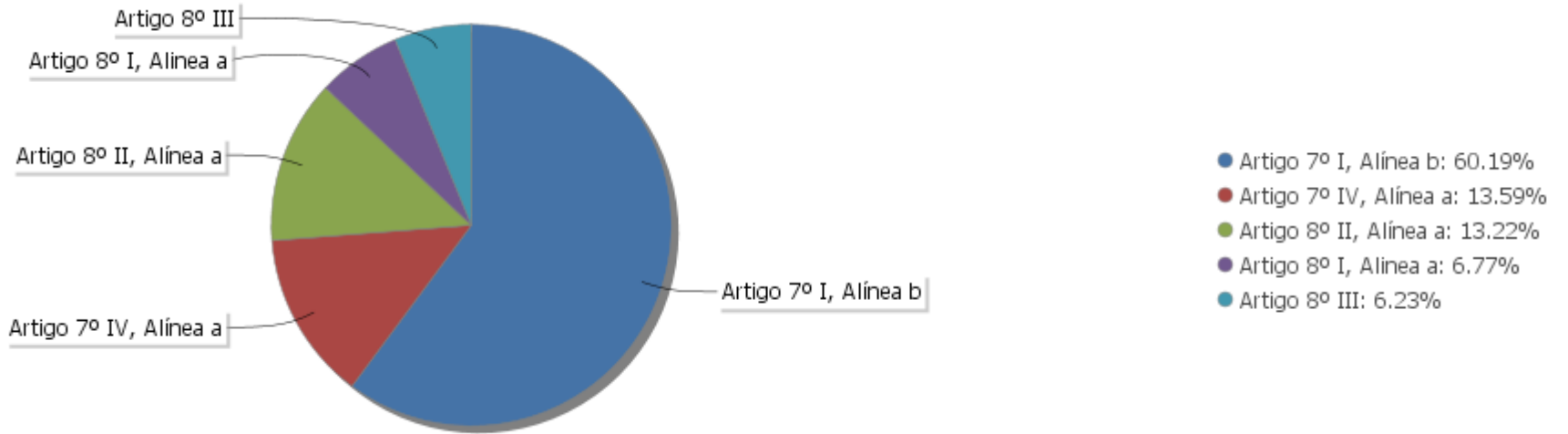
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

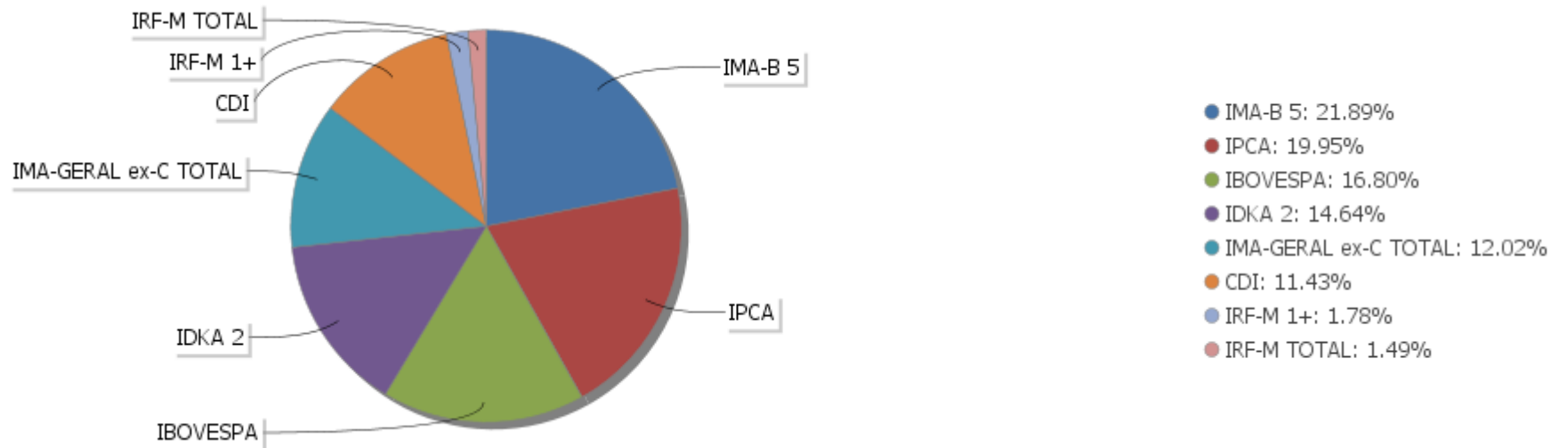
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	56.118.162,41	98,87	56.118.162,41	98,87
de 31 a 365 dias	643.897,49	1,13	56.762.059,90	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	56.762.059,90	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

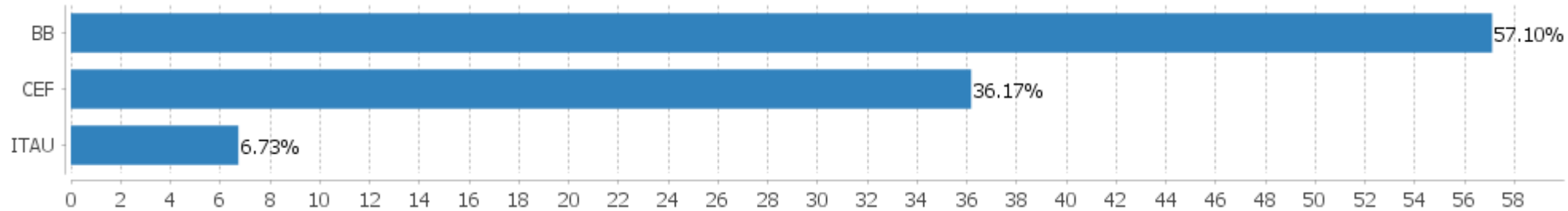


Alocação Por Estratégia



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								1,46
IPCA + 5,43%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28								5,45
p.p. indexador	-1,35	-2,58	-0,23	0,20	0,11								-3,99
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

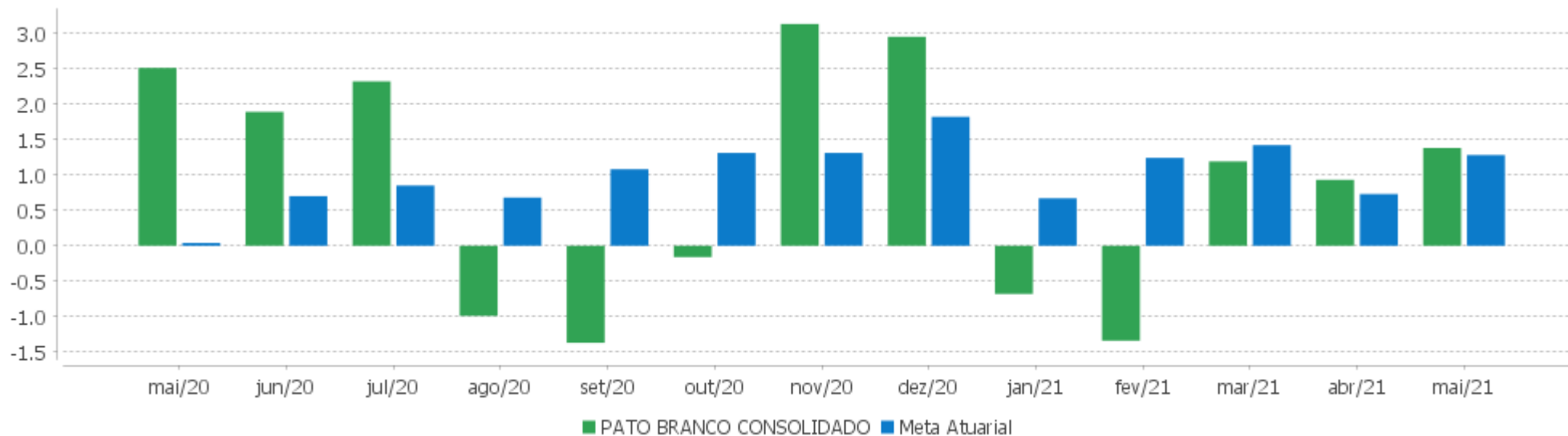
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	14	48,28	03 meses	3,54	3,46	0,07	4,77
Meses abaixo - Meta Atuarial	15	51,72	06 meses	4,45	7,41	-2,96	4,73
			12 meses	9,49	14,19	-4,70	5,08
			24 meses	16,13	23,24	-7,11	7,67
Maior rentabilidade da Carteira	3,13	2020-11	Desde 31/12/2018	21,73	29,04	-7,31	7,06
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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	0,15 -0,05	-3,59 -0,08	-0,25 -0,11	-0,67 -0,10	-0,47 -0,18	12,87 -0,46	30,62 -0,68
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,67 -0,02	1,31 -0,11	1,85 -0,07	3,15 -0,12	7,10 -0,30	16,90 -0,65	32,13 -0,96
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,67 -0,20	1,51 -0,68	1,89 -0,64	3,06 -0,90	7,77 -0,70	16,46 -1,80	29,34 -3,17
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,48 -0,02	-0,79 -0,13	0,68 0,07	1,57 0,12	3,44 0,10	11,29 0,29	26,57 0,54
BB PREV IRF-M 1+ Var. IRF-M 1+ p.p.	0,13 -0,07	-3,54 -0,03	-0,34 -0,20	-0,55 0,01	-0,50 -0,22	12,30 -1,03	
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,24 -0,59	0,72 -2,50	1,21 -0,87	2,05 -2,56	3,45 -4,60	15,85 5,77	32,24 17,02
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,69 -0,00	1,36 -0,06	1,89 -0,03	3,19 -0,09	7,12 -0,28	17,04 -0,51	32,23 -0,86
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,16 -0,04	-1,87 -0,08	0,11 -0,08	0,06 -0,08	0,51 -0,21	11,56 -0,54	26,18 -0,87
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,17 -0,03	-1,86 -0,08	0,05 -0,14	0,06 -0,07	0,49 -0,22	11,59 -0,52	26,28 -0,76
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,19 70,85	0,53 55,01	0,40 59,49	0,64 56,08	1,06 48,61	4,87 67,99	10,36 74,07
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,27 101,66	0,82 84,66	0,58 85,56	1,23 108,21	2,25 103,07	6,80 95,01	13,52 96,72
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,27 -0,56	0,72 -2,50	0,52 -1,56	0,92 -3,69	1,75 -6,31	9,72 -0,36	21,51 6,29
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,20 -0,63	0,61 -2,61	1,05 -1,03	1,62 -2,99	2,86 -5,20		
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	6,08 -0,08	5,87 -0,18	14,52 -0,18	15,65 -0,26	43,63 -0,77	29,32 -0,76	62,71 -1,74
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	5,51 -0,64	8,26 2,21	15,18 0,48	17,73 1,82	46,08 1,67	34,33 4,25	73,90 9,46
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI % do CDI	1,01 374,00	0,50 51,75	1,13 165,70	1,93 170,11	3,43 157,53		
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	1,44	3,29	3,98	5,05	9,39	17,48	35,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	531,36	340,59	584,54	445,73	431,07	244,25	252,41
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,48	13,08	10,17	16,63	36,09	49,57	
% do CDI	177,82	1.352,91	1.494,11	1.468,22	1.655,99	692,64	
BB AÇÕES ENERGIA FI	4,84	-0,35	12,11	6,90	20,24	21,52	101,69
% do CDI	1.788,77	-36,48	1.779,19	608,99	928,68	300,78	727,31
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	4,89	3,05	13,41	11,64	32,84	36,02	89,39
Var. IBOVESPA p.p.	-1,27	-3,00	-1,30	-4,27	-11,57	5,95	24,94
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	0,31	12,29	9,81	15,54			
Var. IBOVESPA p.p.	-5,85	6,24	-4,90	-0,37			
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	7,67	12,46	13,59	19,54	50,35	41,02	81,50
Var. IBOVESPA p.p.	1,51	6,41	-1,11	3,63	5,95	10,94	17,06
BB AÇÕES CONSUMO FIC	6,38	2,26	9,59	7,27	25,84	35,92	65,59
Var. IBOVESPA p.p.	0,22	-3,79	-5,12	-8,64	-18,56	5,84	1,15
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	2,60	13,28	18,60	22,33	43,24	47,54	
Var. IBOVESPA p.p.	-3,56	7,23	3,90	6,42	-1,17	17,46	
PATO BRANCO CONSOLIDADO	1,38	1,46	3,54	4,45	9,49	16,13	
Var. IPCA + 5,43% p.p.	0,11	-3,99	0,07	-2,92	-4,41	-6,18	
CDI	0,27	0,97	0,68	1,13	2,18	7,16	13,98
IBOVESPA	6,16	6,05	14,70	15,91	44,41	30,08	64,44
INPC + 6,00%	1,45	5,80	3,74	7,89	15,40	24,81	38,59
IPCA + 6,00%	1,32	5,68	3,61	7,65	14,51	23,63	37,13

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	0,20	0,60	0,52	0,91	2,11	8,57	16,37	25,88	43,11
IRF-M 1+	0,20	-3,51	-0,14	-0,57	-0,28	13,33	31,30	45,86	74,27
IRF-M TOTAL	0,20	-1,79	0,19	0,13	0,71	12,10	27,04	40,22	64,99
IMA-B 5	0,69	1,42	1,92	3,27	7,39	17,55	33,09	46,16	64,24
IMA-B 5+	1,38	-3,35	0,65	3,91	10,69	15,30	52,84	63,86	92,42
IMA-B TOTAL	1,06	-1,14	1,25	3,66	9,17	16,46	44,09	56,66	80,66
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,50	-0,66	0,61	1,45	3,33	11,00	26,04	37,48	59,06
IMA-GERAL TOTAL	0,61	-0,21	0,73	1,81	4,20	12,11	27,53	39,29	60,68
IDKA 2	0,88	2,19	2,53	3,96	8,47	18,26	32,51	46,64	65,76
IDKA 20	2,37	-4,65	0,81	6,18	15,79	13,16	71,22	79,58	122,22
CDI	0,27	0,97	0,68	1,13	2,18	7,16	13,98	22,72	38,97

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,16	6,05	14,70	15,91	44,41	30,08	64,44	101,27	160,39
IBRX 100	5,92	8,14	15,50	18,03	47,63	34,45	72,38	109,11	171,70
IBRX 50	6,18	8,39	15,91	18,61	49,33	32,34	65,03	102,41	160,17
SMALL CAP	6,32	10,00	16,04	18,26	57,75	55,08	97,90	135,01	241,15
IFIX	-1,56	-1,87	-2,43	0,28	5,97	10,33	27,21	36,94	74,68
Índice Consumo - ICON	6,51	2,66	9,81	7,79	27,87	37,71	69,55	74,93	108,51
Índice Dividendos - IDIV	5,64	4,32	15,93	13,64	37,85	30,26	78,57	100,70	199,05

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	0,83	3,22	2,08	4,61	8,06	10,08	15,21	18,50	22,77
INPC	0,96	3,33	2,22	4,84	8,90	11,13	16,44	18,49	22,46
IGPM	4,10	14,39	8,77	15,49	37,04	45,96	57,11	63,81	66,39
SELIC	0,27	0,97	0,68	1,13	2,18	7,16	13,99	22,73	39,01

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	-2,64	12,69	4,37	13,92	33,16	102,83	116,09	181,17	191,78
MSCI ACWI	-1,84	10,84	2,43	12,92	34,65	91,95	95,33	147,44	157,20
MSCI World	-1,95	11,37	3,24	13,05	33,59	93,08	98,36	151,08	158,61

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,16	4,87	3,11	6,65	12,36	19,03	29,54	38,50	49,22
IPCA + 5,00%	1,24	5,28	3,36	7,15	13,44	21,32	33,30	43,87	56,50
IPCA + 5,50%	1,28	5,48	3,48	7,40	13,97	22,47	35,20	46,62	60,24
IPCA + 5,89%	1,31	5,64	3,58	7,60	14,39	23,38	36,70	48,78	63,21
IPCA + 6,00%	1,32	5,68	3,61	7,65	14,51	23,63	37,13	49,40	64,06
INPC + 4,00%	1,29	4,99	3,24	6,88	13,23	20,16	30,92	38,49	48,86
INPC + 6,00%	1,45	5,80	3,74	7,89	15,40	24,81	38,59	49,39	63,66

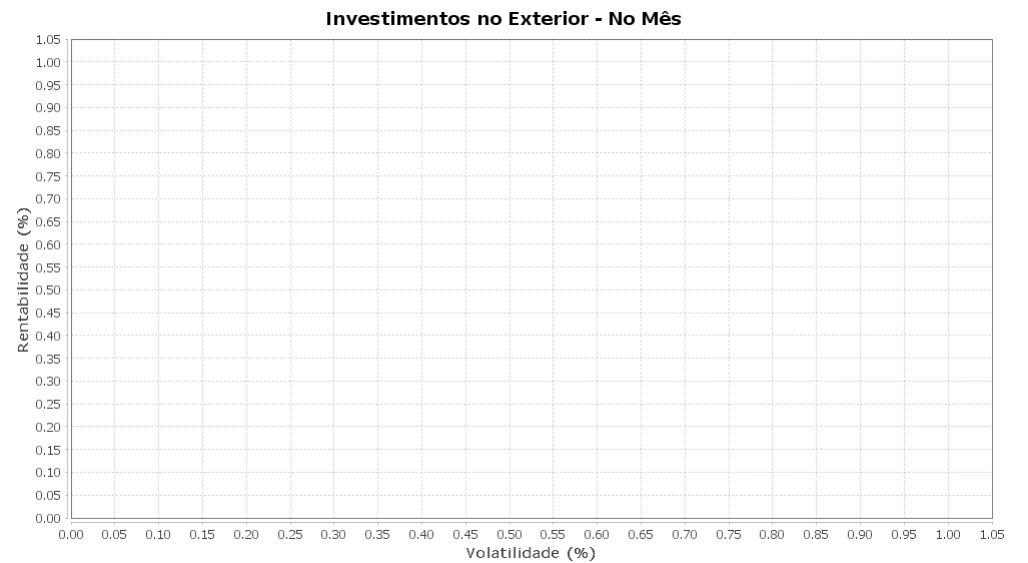
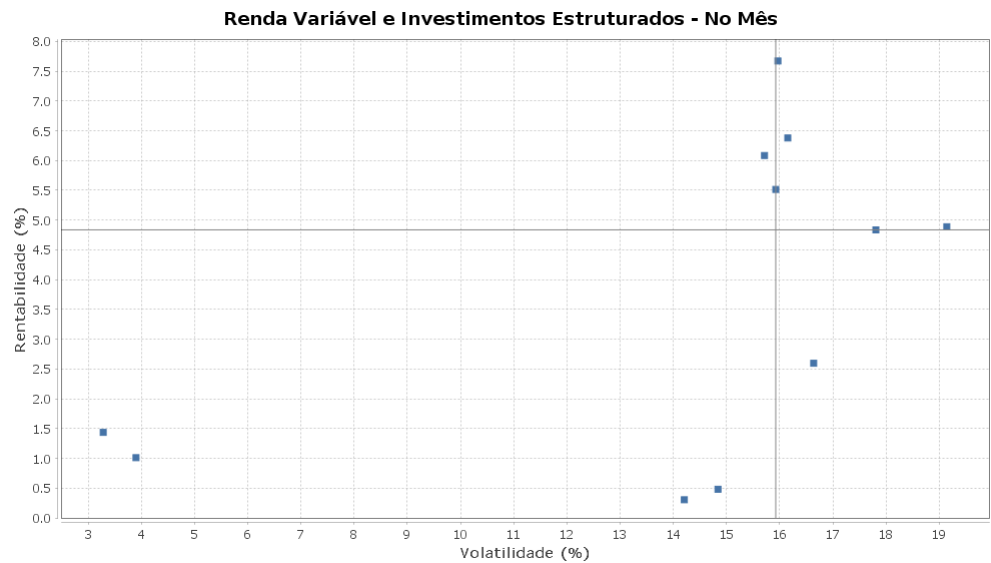
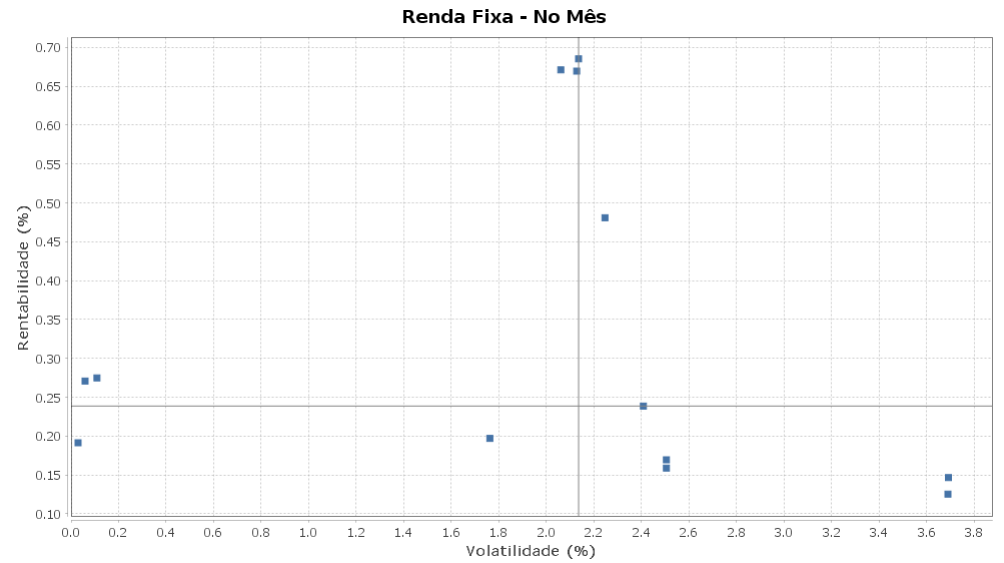
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 1.500.712,30

Value-At-Risk: 2,64%

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	-2,67	0,19	132.963,38	0,23
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,04	0,00	0,01	0,27	3.173.791,90	5,59
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,11	0,06	0,00	0,04	0,27	1.003.565,17	1,77
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	Artigo 7º IV, Alínea a	1,76	1,08	0,05	-0,04	0,20	3.405.259,08	6,00
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,06	1,37	0,14	0,19	0,67	8.310.823,14	14,64
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,13	1,39	0,09	0,19	0,67	5.324.827,15	9,38
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,13	1,41	0,13	0,19	0,69	7.100.352,71	12,51
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,25	1,42	0,12	0,09	0,48	6.820.155,06	12,02
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,41	1,16	0,07	-0,01	0,24	4.746.898,40	8,36
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,50	1,47	0,01	-0,04	0,17	411.149,70	0,72
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,50	1,49	0,01	-0,04	0,16	435.697,38	0,77
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	3,28	2,40	0,04	0,36	1,44	898.949,82	1,58
BB PREV IRF-M 1+	Artigo 7º I, Alínea b	3,69	2,37	0,01	-0,04	0,13	574.243,97	1,01
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,69	2,40	0,01	-0,03	0,15	435.123,18	0,77
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	Artigo 8º III	3,90	1,58	0,03	0,19	1,01	1.491.598,01	2,63
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	Artigo 8º II, Alínea a	14,21	6,67	0,07	0,00	0,31	1.143.395,07	2,01
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	14,84	6,69	0,07	0,01	0,48	1.147.888,51	2,02
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	15,72	11,96	0,20	0,37	6,08	1.017.256,70	1,79
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	15,93	12,16	0,55	0,33	5,51	2.827.514,44	4,98
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	15,97	8,98	0,09	0,46	7,67	643.897,49	1,13
BB AÇÕES CONSUMO FIC	Artigo 8º II, Alínea a	16,15	12,24	0,17	0,38	6,38	966.536,97	1,70
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	16,64	13,39	0,16	0,14	2,60	797.542,59	1,41
BB AÇÕES ENERGIA FI	Artigo 8º II, Alínea a	17,81	10,31	0,26	0,26	4,84	1.810.539,71	3,19
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	Artigo 8º II, Alínea a	19,14	10,78	0,37	0,24	4,89	2.142.090,37	3,77