



LDB
EMPRESAS

TAMBAÚ
JUNHO 2021



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 30.06.2021.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA **98,48%**

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-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,35	0,18	0,65	7.010.549,68	9,20	7.575.446.149,90	0,09
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,33	0,19	0,70	203.759,84	0,27	8.267.613.291,28	0,00
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,36	0,20	0,62	10.549.042,02	13,84	699.134.038,39	1,51
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,32	-0,09	1,42	13.696.784,75	17,97	10.494.201.076,30	0,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,47	-0,28	1,56	6.639.752,80	8,71	11.796.463.834,87	0,06
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,94	0,11	-0,68	12.301.597,56	16,14	9.201.718.777,36	0,13
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,33	-0,15	-0,15	459.336,87	0,60	16.058.908.177,46	0,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,58	0,04	0,62	50.860.823,52	66,73		

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
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,26	0,31	1,15	2.062.738,38	2,71	14.040.360.809,73	0,01
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,17	0,35	1,45	11.840.701,74	15,54	3.237.283.272,24	0,37
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	0,33	1,32	81.922,18	0,11	3.920.215.063,90	0,00
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,71	-0,14	0,68	5.082.644,72	6,67	1.148.865.288,98	0,44
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	3,32	0,05	-0,39	5.125.460,84	6,73	4.294.022.962,49	0,12
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,09	0,18	0,89	24.193.467,86	31,74		

Renda Fixa			1,41	0,08	0,71	75.054.291,38	98,48		
-------------------	--	--	-------------	-------------	-------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,52%

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
BRAM	BRADESCO	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	20,05	-0,54	-0,54	99.460,11	0,13	322.546.994,90	0,03
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	20,15	-0,87	20,54	744.095,62	0,98	517.658.364,97	0,14
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	15,74	2,70	4,40	104.402,44	0,14	1.351.697.208,13	0,01
BB	BB	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	20,63	-3,16	-3,16	211.876,94	0,28	1.117.769.353,36	0,02
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			15,17	-0,63	18,16	1.159.835,11	1,52		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			15,17	-0,63	18,16	1.159.835,11	1,52		
Total			1,43	0,06	0,75	76.214.126,49	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	50.860.823,52	66,73	0,00	52,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	24.193.467,86	31,74	0,00	33,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	75.054.291,38	98,48					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	1.159.835,11	1,52	0,00	15,00	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	1.159.835,11	1,52					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	0,04 11,64	0,62 48,32	1,06 134,71	0,62 48,32	3,46 152,07	18.216,30	315.403,71
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,18 58,56	0,89 69,51	1,07 135,63	0,89 69,51	2,77 121,80	43.693,03	213.616,29
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,63 -1,09	18,16 6,95	13,49 4,77			-15.705,25	36.272,95
TAMBAÚ (Total)						46.204,08	565.292,95

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	12.287.897,03	0,00	0,00	0,00	12.301.597,56	13.700,53	-84.359,90
BB PREV RF IDKA2	13.709.604,39	0,00	0,00	0,00	13.696.784,75	-12.819,64	191.489,57
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	7.634.832,20	0,00	-638.113,61	0,00	7.010.549,68	13.831,09	52.635,60
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	10.527.764,52	0,00	0,00	0,00	10.549.042,02	21.277,50	64.920,52
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.728.690,24	929.244,30	0,00	0,00	6.639.752,80	-18.181,74	83.430,68
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.381.453,68	27.093,12	-1.205.858,65	0,00	203.759,84	1.071,69	7.950,37
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	460.000,00	0,00	0,00	459.336,87	-663,13	-663,13
					50.860.823,52	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	5.123.061,84	0,00	0,00	0,00	5.125.460,84	2.399,00	-20.229,59
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	300.195,81	0,00	-218.786,39	0,00	81.922,18	512,76	5.111,31
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	2.056.403,69	0,00	0,00	0,00	2.062.738,38	6.334,69	26.987,44
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	11.799.095,14	0,00	0,00	0,00	11.840.701,74	41.606,60	169.696,93
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5.089.804,74	0,00	0,00	0,00	5.082.644,72	-7.160,02	32.050,20
					24.193.467,86	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	101.661,25	0,00	0,00	0,00	104.402,44	2.741,19	4.402,44
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	0,00	218.786,39	0,00	0,00	211.876,94	-6.909,45	-6.909,45
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	0,00	100.000,00	0,00	0,00	99.460,11	-539,89	-539,89
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	505.492,58	249.600,14	0,00	0,00	744.095,62	-10.997,10	39.319,85
					1.159.835,11	0,00	0,00

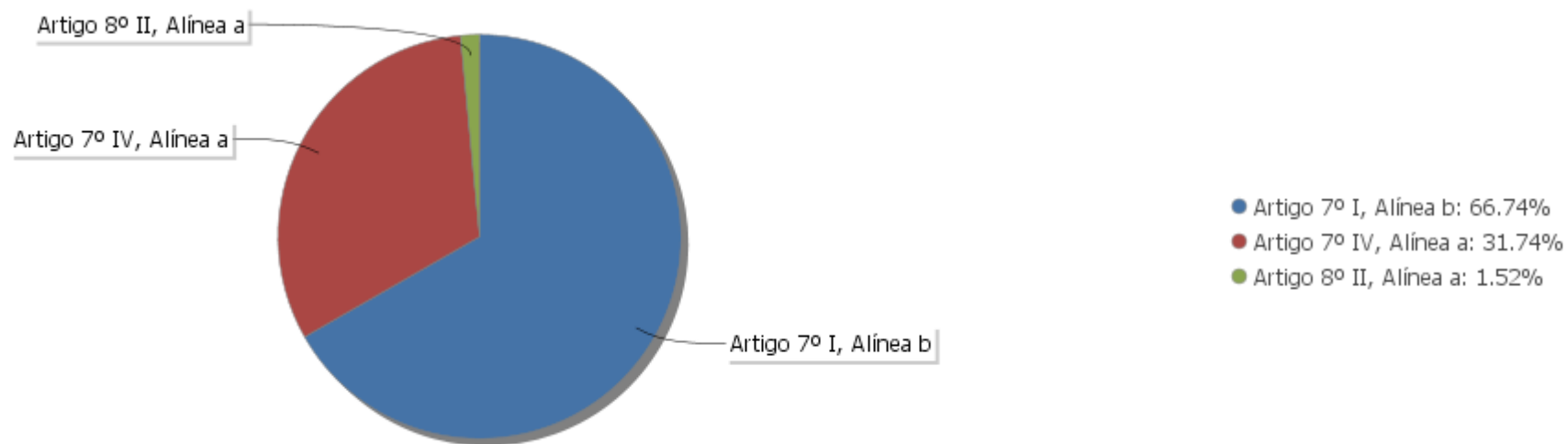
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

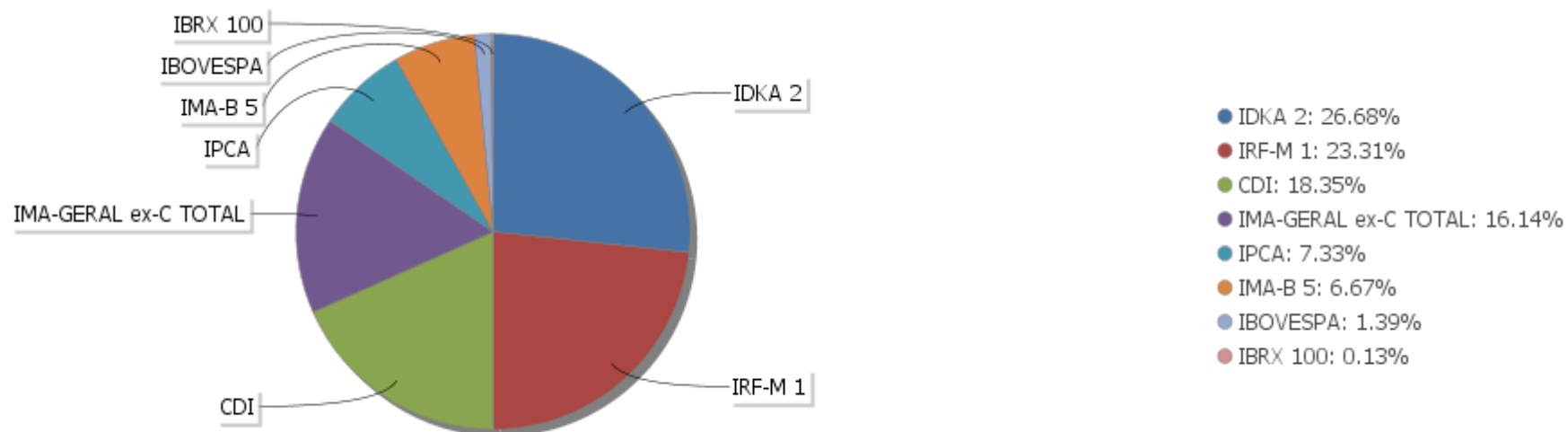
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	76.214.126,49	100,00	76.214.126,49	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	76.214.126,49	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	76.214.126,49	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

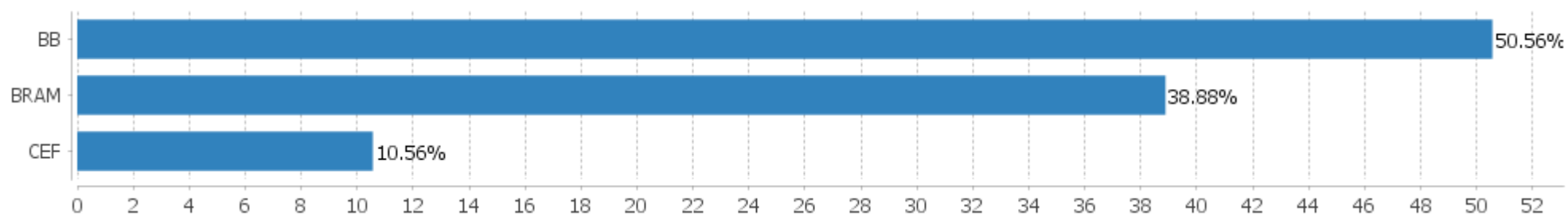


Alocação Por Estratégia



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	-0,04	-0,36	0,05	0,56	0,48	0,06							0,75
IPCA + 5,89%	0,71	1,27	1,46	0,77	1,31	1,01							6,71
p.p. indexador	-0,75	-1,63	-1,41	-0,21	-0,83	-0,95							-5,96
2020	0,41	0,40	-0,54	0,38	0,84	0,58	0,70	0,02	-0,14	0,12	0,63	1,15	4,64
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	-0,30	-0,26	-1,11	0,24	0,76	-0,15	-0,19	-0,70	-1,26	-1,22	-0,72	-0,71	-6,01

Performance Sobre a Meta Atuarial

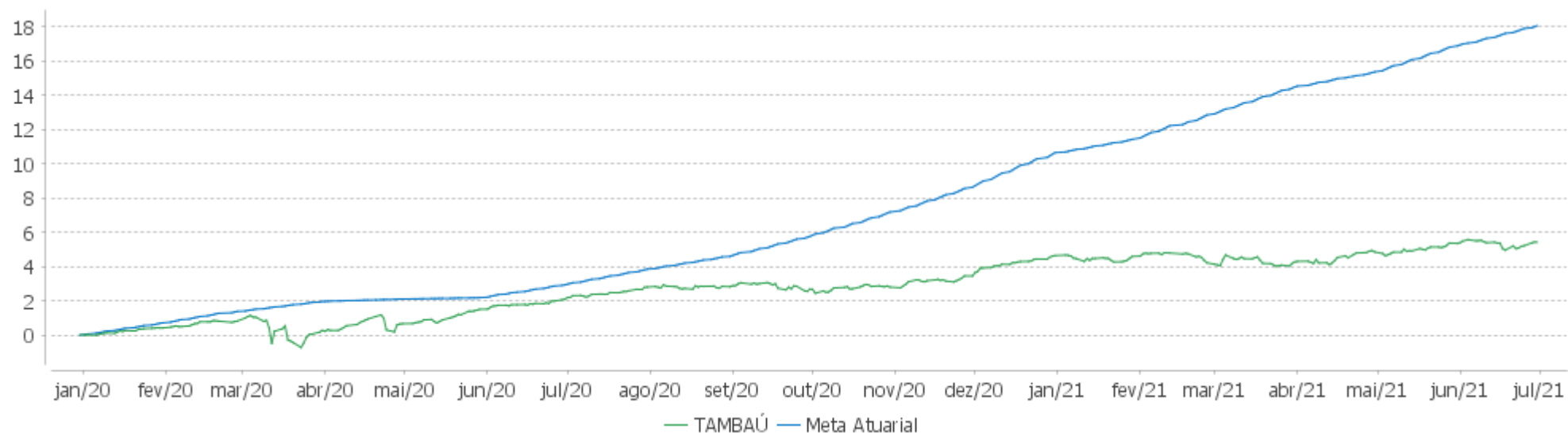
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	2	11,11
Meses abaixo - Meta Atuarial	16	88,89
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,15	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2020-03

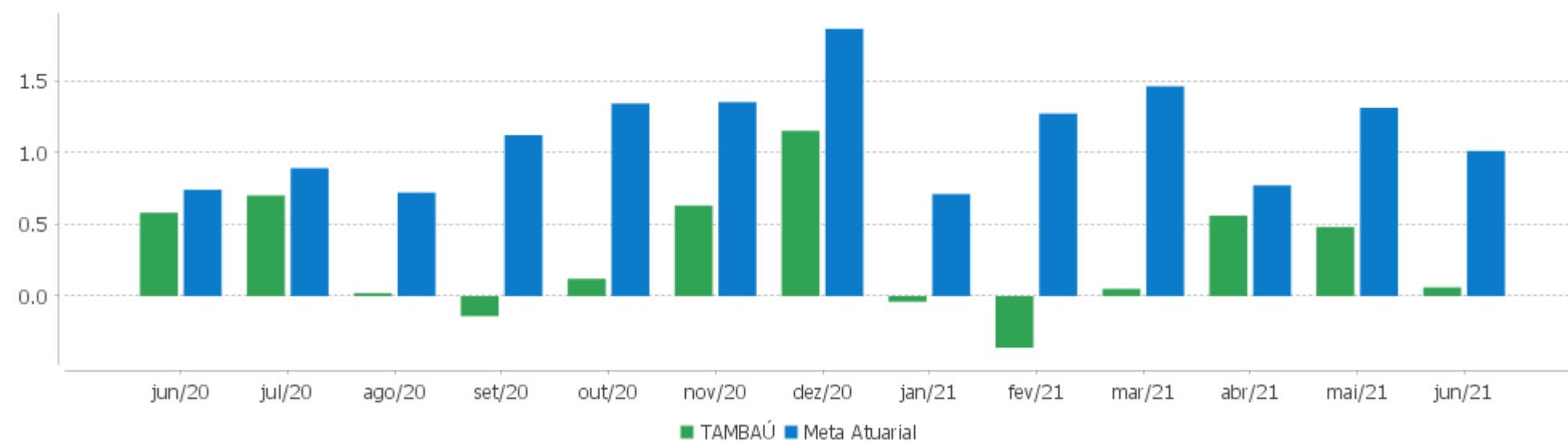
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,10	3,12	-2,02	1,57
06 meses	0,75	6,71	-5,96	1,60
12 meses	3,26	14,70	-11,44	1,43
24 meses				
Desde 31/12/2019	5,42	18,07	-12,65	1,96

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
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-0,14 -0,01	0,68 -0,61	1,41 -0,03	0,68 -0,61	5,19 -0,88	14,40 -1,02	31,03 -1,29
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,35 114,57	1,45 113,19	0,89 113,47	1,45 113,19	2,42 106,43	6,41 91,73	13,04 94,89
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,33 106,86	1,32 103,34	0,81 103,39	1,32 103,34	2,35 103,14	6,51 93,15	13,10 95,32
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA % do CDI	0,31 100,09	1,15 90,07	0,72 91,84	1,15 90,07	1,89 82,93	6,38 91,29	12,91 93,92
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,05 -0,48	-0,39 -4,16	1,36 -0,32	-0,39 -4,16	3,22 -5,13		
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	-0,09 0,22	1,42 -0,45	1,42 -0,49	1,42 -0,45	6,38 -0,69	15,08 -1,37	28,85 -3,02
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,11 -0,21	-0,68 -0,34	1,22 -0,10	-0,68 -0,34	2,58 -0,16	9,05 -0,18	26,47 0,17
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,20 -0,01	0,62 -0,19	0,60 -0,08	0,62 -0,19	1,64 -0,40	7,44 -0,73	14,93 -1,05
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,00 -0,53	0,72 -3,05	0,90 -0,78	0,72 -3,05	2,68 -5,67	12,77 2,11	31,64 17,26
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,18 -0,03	0,65 -0,16	0,60 -0,08	0,65 -0,16	1,65 -0,38	7,46 -0,71	15,02 -0,97
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,28 0,04	1,56 -0,30	1,59 -0,32	1,56 -0,30	6,40 -0,66	15,12 -1,34	29,13 -2,74
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,19 -0,02	0,70 -0,12	0,64 -0,04	0,70 -0,12	1,82 -0,21	7,71 -0,46	15,35 -0,64
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p.	-0,87 -1,33	19,92 13,38	15,78 7,06	19,92 13,38	42,87 9,48		
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA Var. IBRX 100 p.p.	0,67 0,03	6,99 -1,83	9,71 0,10	6,99 -1,83	33,76 -2,57	30,33 0,36	83,09 0,12
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-0,80 -1,26	5,81 -0,73	7,62 -1,09	5,81 -0,73	39,67 6,27	43,84 18,25	
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,70 2,23	15,32 8,78	8,53 -0,19	15,32 8,78			
TAMBAÚ	0,06	0,75	1,10	0,75	3,26		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 5,89% p.p.	-0,95	-5,96	-2,02	-5,96	-11,44		
CDI	0,31	1,28	0,79	1,28	2,28	6,98	13,74
IBOVESPA	0,46	6,54	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27
INPC + 6,00%	1,09	6,95	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46
IPCA + 6,00%	1,02	6,76	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

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

Renda Variável

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

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

Investimentos no Exterior

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

Meta Atuarial

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

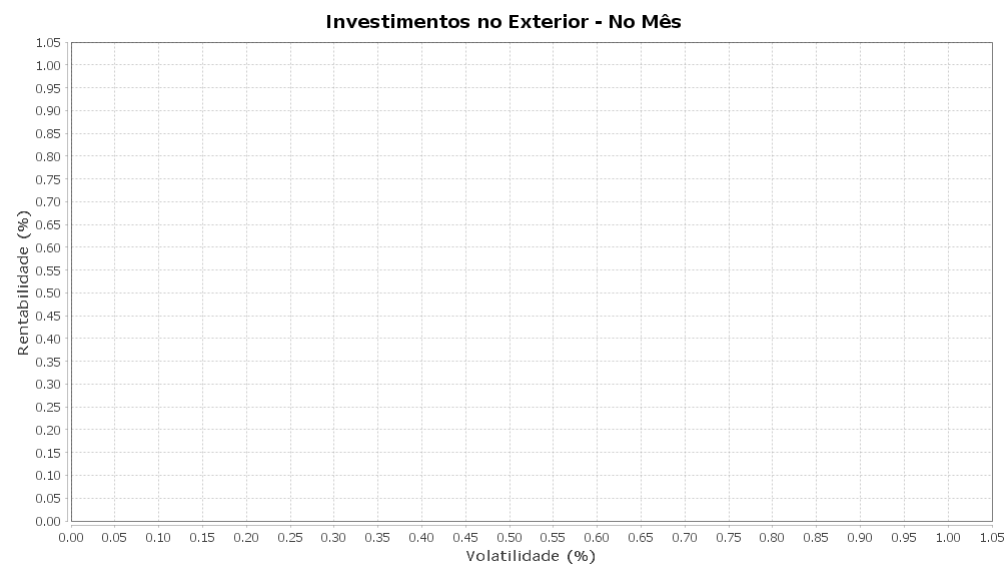
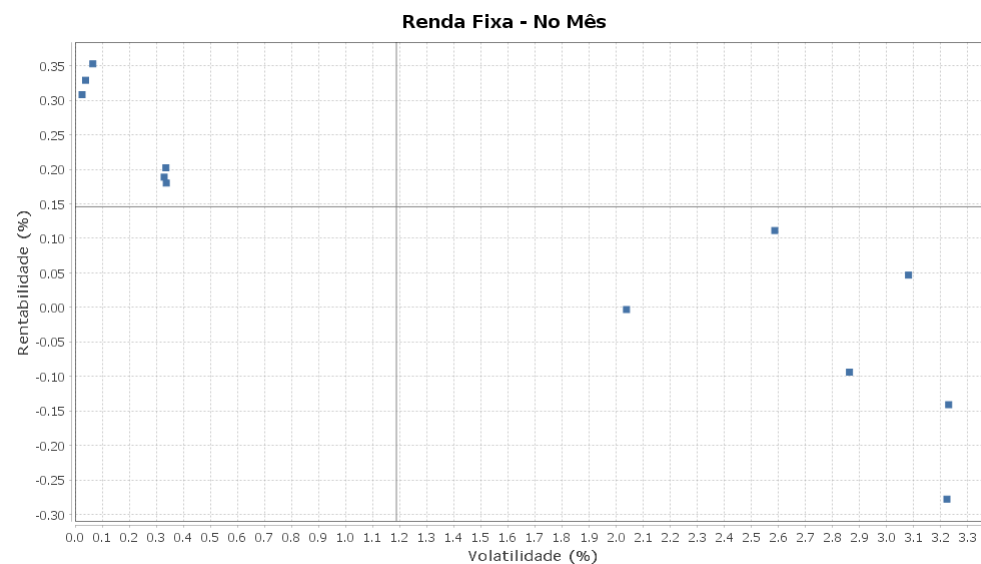
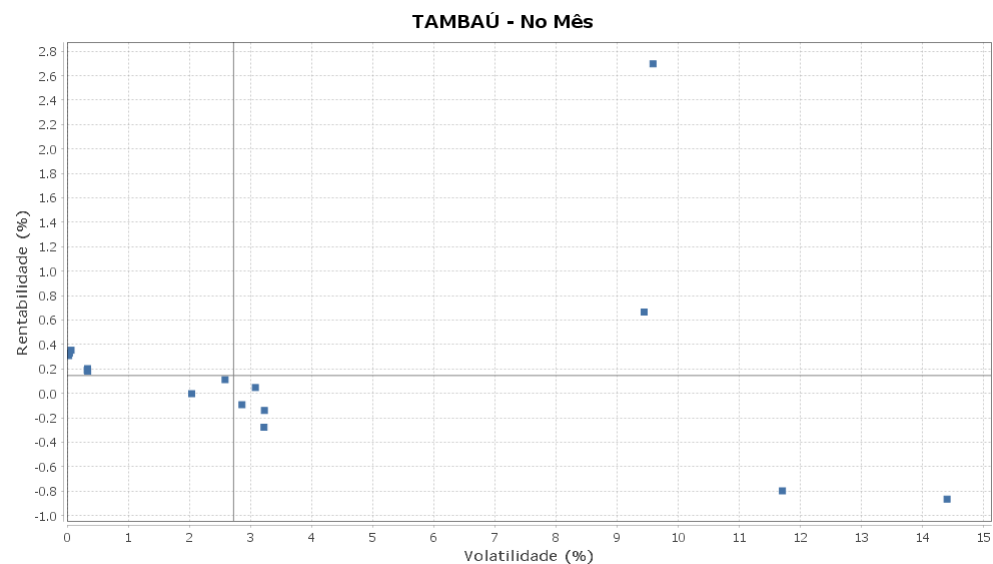
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
53	02/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.060,00	1.164,98955126	2,6266330000
60	08/06/2021	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	100.000,00	0,00	40.189,18657689	2,4882315000
61	08/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.188.619,55	452.338,39424414	2,6277220000
58	08/06/2021	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	452.000,00	0,00	295.917,06465984	1,5274550000
66	08/06/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	200.000,00	0,00	81.947,26365795	2,4405940000
56	08/06/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	629.711,19	0,00	258.015,54457644	2,4405940000
59	09/06/2021	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	8.000,00	0,00	5.242,02082524	1,5261290000
50	09/06/2021	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	247.877,95	0,00	167.984,97014088	1,4755960000
54	09/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.093,12	0,00	10.311,85879442	2,6273750000
57	09/06/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	99.533,11	0,00	40.770,33578666	2,4413120000
51	10/06/2021	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	1.233,59	0,00	834,77866614	1,4777450000
69	11/06/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	218.786,39	94.016,40618900	2,3271086370
65	14/06/2021	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	212.195,98	0,00	72.634,09909300	2,9214374880
64	15/06/2021	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	6.590,41	0,00	2.260,67223100	2,9152434870
52	23/06/2021	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	488,60	0,00	337,42138517	1,4480410000
63	29/06/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	638.113,61	232.605,40239700	2,7433309950
55	30/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.179,10	5.388,85652076	2,6311890000

Total

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 670.631,27

Value-At-Risk: 0,88%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,03	0,00	0,01	0,31	2.062.738,38	2,71
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,04	0,00	0,55	0,33	81.922,18	0,11
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,03	0,00	0,68	0,35	11.840.701,74	15,54
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,15	0,00	-0,36	0,19	203.759,84	0,27
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,34	0,15	0,02	-0,31	0,20	10.549.042,02	13,84
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,34	0,15	0,01	-0,38	0,18	7.010.549,68	9,20
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,04	1,15	0,01	-0,15	-0,00	459.336,87	0,60
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,59	1,24	0,19	-0,08	0,11	12.301.597,56	16,14
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,86	1,37	0,24	-0,14	-0,09	13.696.784,75	17,97
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	3,08	1,39	0,09	-0,08	0,05	5.125.460,84	6,73
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,22	1,51	0,13	-0,18	-0,28	6.639.752,80	8,71
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	3,23	1,73	0,11	-0,14	-0,14	5.082.644,72	6,67
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	Artigo 8º II, Alínea a	9,44	8,00	0,01	0,04	0,67	99.460,11	0,13
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	Artigo 8º II, Alínea a	9,59	6,33	0,00	0,25	2,70	104.402,44	0,14
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	11,70	7,78	0,01	-0,09	-0,80	211.876,94	0,28
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	Artigo 8º II, Alínea a	14,40	9,57	0,06	-0,08	-0,87	744.095,62	0,98