



LDB
EMPRESAS

TAMBAÚ
JULHO 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 30.07.2021.

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 **95,36%**

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	0,37	0,16	0,82	6.376.421,32	8,38	6.744.375.720,34	0,09
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	0,17	0,86	204.275,09	0,27	7.606.396.263,31	0,00
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,38	0,19	0,81	8.565.998,75	11,26	692.783.606,96	1,24
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,34	0,08	1,50	6.816.250,93	8,96	10.405.647.705,90	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,50	-0,06	1,50	6.635.441,08	8,72	12.042.628.715,86	0,06
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,58	-0,23	-0,23	4.988.333,64	6,56	5.928.712.027,28	0,08
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,93	-0,25	-0,93	12.270.886,00	16,13	8.970.903.955,40	0,14
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,49	-0,78	-0,92	455.774,16	0,60	15.935.689.880,46	0,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,62	-0,01	0,60	46.313.380,97	60,89		

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	0,27	0,38	1,53	2.070.498,92	2,72	8.856.672.436,73	0,02
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,17	0,39	1,84	11.886.591,80	15,63	3.447.645.804,86	0,34
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	0,39	1,72	82.244,27	0,11	4.167.355.289,66	0,00
BRAM	BRABESCO	BRABESCO H FI RF NILO	6,39	-0,70	-0,70	1.985.979,35	2,61	760.169.057,97	0,26
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,74	-0,02	0,66	5.081.703,70	6,68	1.155.055.229,01	0,44
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	3,30	-0,11	-0,50	5.119.762,74	6,73	4.460.514.993,96	0,11
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,14	0,13	1,02	26.226.780,78	34,48		

Renda Fixa			1,46	0,04	0,74	72.540.161,75	95,36		
-------------------	--	--	-------------	-------------	-------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,64%

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	BRABESCO	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	19,98	-3,78	-4,30	95.701,26	0,13	297.860.192,46	0,03
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	20,07	-4,66	14,93	1.243.454,81	1,63	557.695.457,37	0,22
BB	BB	BB AÇÕES AGRO FIC FI	15,26	-3,83	-3,83	961.742,07	1,26	392.201.124,42	0,25
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	14,91	2,39	6,90	1.019.284,25	1,34	1.691.694.911,58	0,06
BB	BB	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	20,42	-2,78	-5,86	205.983,52	0,27	1.269.495.027,18	0,02
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			14,97	-1,98	15,82	3.526.165,91	4,64		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			14,97	-1,98	15,82	3.526.165,91	4,64		
Total			1,50	-0,08	0,67	76.066.327,66	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	46.313.380,97	60,89	0,00	52,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	26.226.780,78	34,48	0,00	33,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	72.540.161,75	95,36					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	3.526.165,91	4,64	0,00	15,00	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	3.526.165,91	4,64					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	-0,01 -4,00	0,60 36,82	0,48 51,14	0,67 44,83	2,64 108,14	-1.717,25	313.686,46
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,13 36,44	1,02 62,21	0,73 78,40	1,02 68,46	2,36 96,78	33.312,92	246.929,21
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,98 1,97	15,82 9,00	2,52 0,07			-87.084,66	-50.811,71
TAMBAÚ (Total)						-55.488,99	509.803,96

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	12.301.597,56	0,00	0,00	0,00	12.270.886,00	-30.711,56	-115.071,46
BB PREV RF IDKA2	13.696.784,75	0,00	-6.900.000,00	0,00	6.816.250,93	19.466,18	210.955,75
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	5.000.000,00	0,00	0,00	4.988.333,64	-11.666,36	-11.666,36
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	7.010.549,68	0,13	-645.883,72	0,00	6.376.421,32	11.755,23	64.390,83
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	10.549.042,02	0,00	-2.000.000,00	0,00	8.565.998,75	16.956,73	81.877,25
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.639.752,80	0,00	0,00	0,00	6.635.441,08	-4.311,72	79.118,96
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	203.759,84	11.009,27	-10.850,98	0,00	204.275,09	356,96	8.307,33
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	459.336,87	0,00	0,00	0,00	455.774,16	-3.562,71	-4.225,84
					46.313.380,97	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	5.125.460,84	0,00	0,00	0,00	5.119.762,74	-5.698,10	-25.927,69
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	81.922,18	0,00	0,00	0,00	82.244,27	322,09	5.433,40
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	2.062.738,38	0,00	0,00	0,00	2.070.498,92	7.760,54	34.747,98
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	11.840.701,74	0,00	0,00	0,00	11.886.591,80	45.890,06	215.586,99
BRADESCO H FI RF NILO	0,00	2.000.000,00	0,00	0,00	1.985.979,35	-14.020,65	-14.020,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5.082.644,72	0,00	0,00	0,00	5.081.703,70	-941,02	31.109,18
					26.226.780,78	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 AGRO FIC FI	0,00	1.000.000,00	0,00	0,00	961.742,07	-38.257,93	-38.257,93
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	104.402,44	900.000,00	0,00	0,00	1.019.284,25	14.881,81	19.284,25
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	211.876,94	0,00	0,00	0,00	205.983,52	-5.893,42	-12.802,87
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	99.460,11	0,00	0,00	0,00	95.701,26	-3.758,85	-4.298,74
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	744.095,62	553.415,46	0,00	0,00	1.243.454,81	-54.056,27	-14.736,42
					3.526.165,91	0,00	0,00

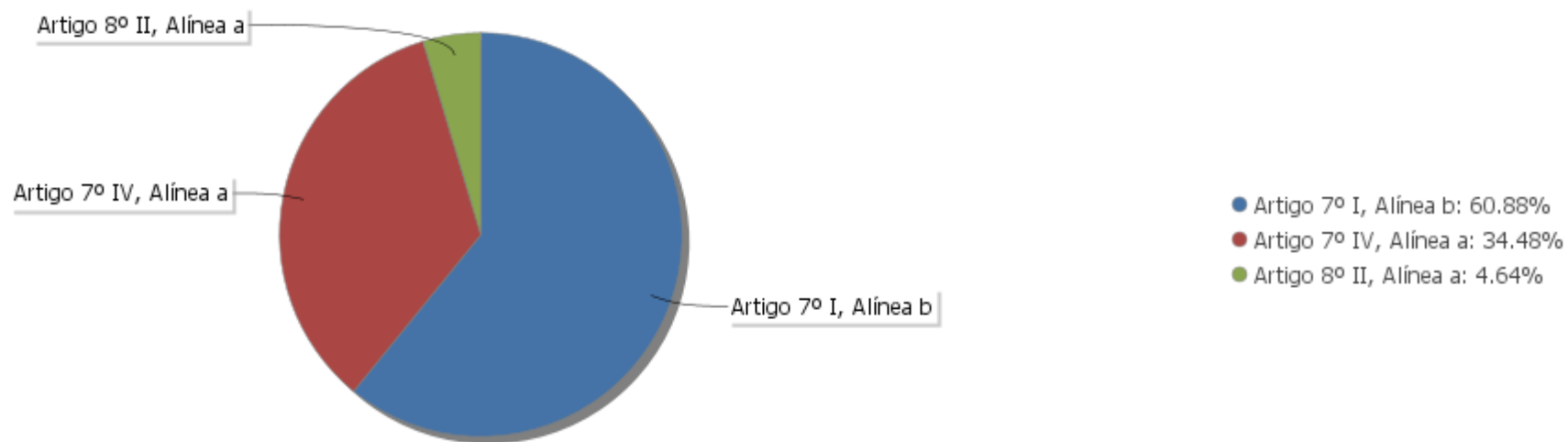
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

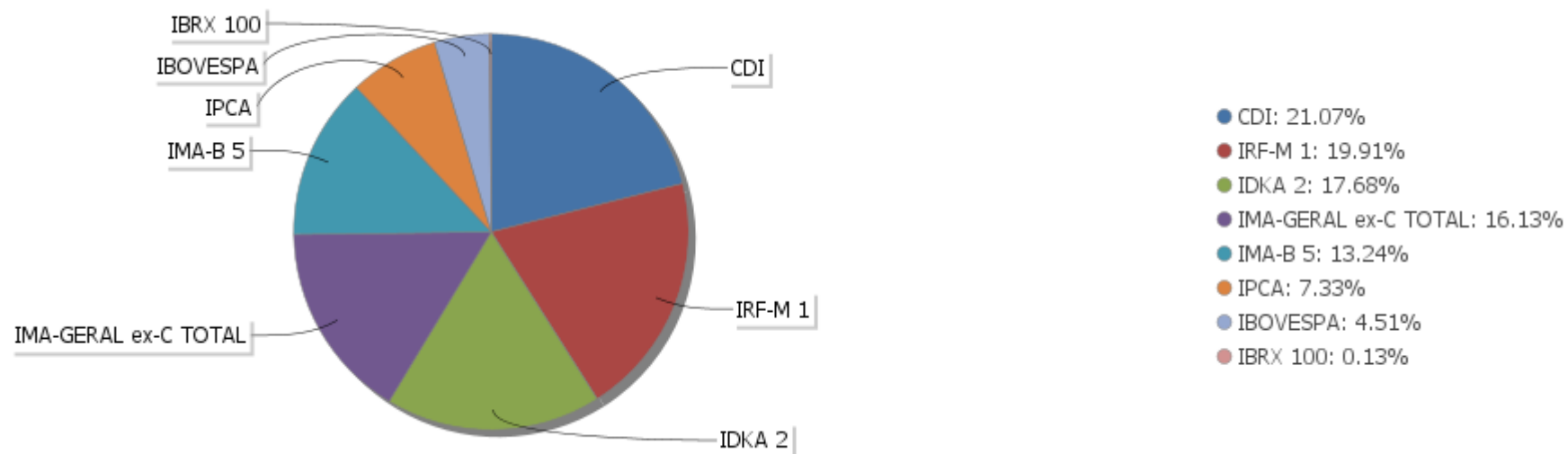
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	76.066.327,66	100,00	76.066.327,66	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	76.066.327,66	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	76.066.327,66	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

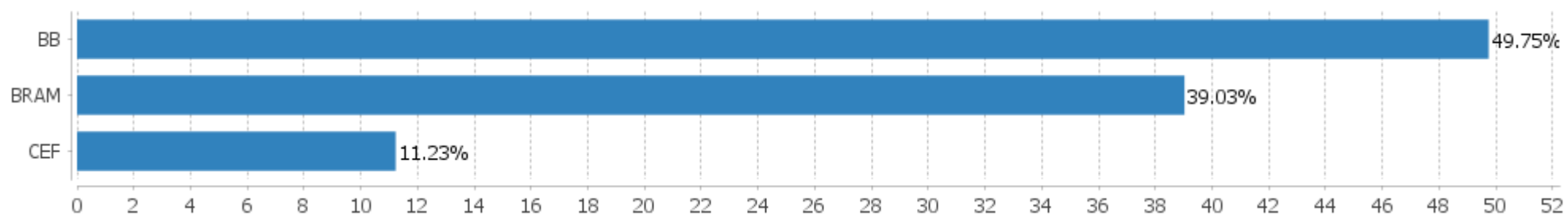


Alocação Por Estratégia



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	-0,08						0,67
IPCA + 5,89%	0,71	1,27	1,46	0,77	1,31	1,01	1,47						8,27
p.p. indexador	-0,75	-1,63	-1,41	-0,21	-0,83	-0,95	-1,54						-7,60
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

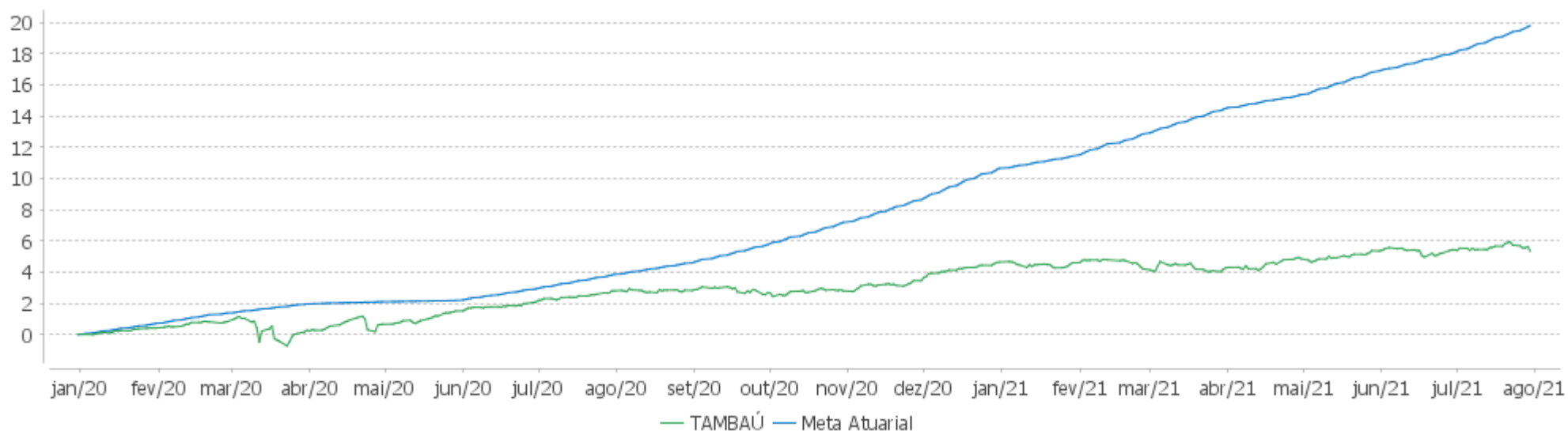
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

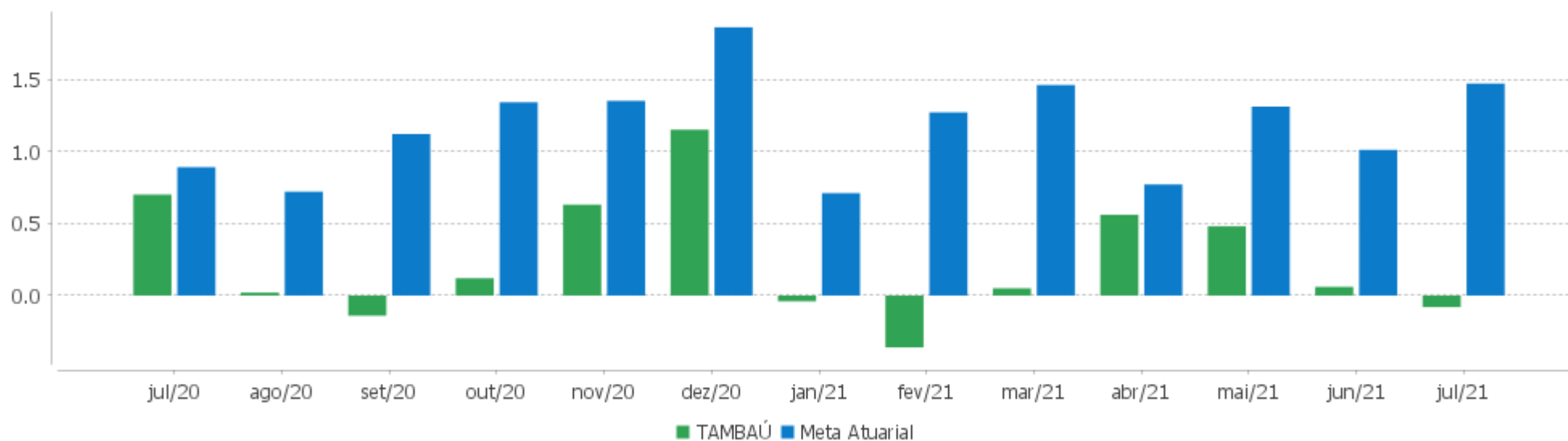
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	2	10,53	03 meses	0,46	3,84	-3,37	1,59
Meses abaixo - Meta Atuarial	17	89,47	06 meses	0,71	7,51	-6,80	1,65
			12 meses	2,47	15,36	-12,90	1,50
			24 meses				
Desde 31/12/2019				5,34	19,80	-14,46	1,94
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	1,15	2020-12					
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	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
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,08 0,26	1,50 -0,18	0,66 0,28	1,32 -0,21	5,61 -0,27	14,05 -1,02	27,39 -2,18
BRABESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,19 0,00	0,81 -0,19	0,59 -0,01	0,78 -0,18	1,61 -0,37	6,90 -0,70	14,40 -1,04
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,25 -0,15	-0,93 -0,49	0,34 -0,38	-0,38 -0,38	0,55 -0,41	7,68 -0,42	24,46 0,00
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,78 -1,74	-0,06 -4,83	-0,54 -2,88	-0,09 -4,59	0,90 -8,10	10,67 -0,84	29,39 14,29
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,16 -0,02	0,82 -0,18	0,52 -0,08	0,79 -0,17	1,58 -0,40	6,89 -0,72	14,43 -1,01
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,02 -0,01	1,19 -0,12	0,52 -0,07	1,09 -0,11	4,79 -0,27	13,79 -0,54	29,57 -0,87
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,06 0,11	1,50 -0,19	0,50 0,12	1,36 -0,17	5,46 -0,43	14,00 -1,08	27,53 -2,04
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,17 -0,02	0,86 -0,14	0,53 -0,07	0,84 -0,12	1,75 -0,24	7,14 -0,46	14,76 -0,69
BRABESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02 -0,05	0,66 -0,65	0,44 -0,14	0,68 -0,53	4,15 -0,90	13,29 -1,04	29,07 -1,37
BRABESCO H FI RF NILO % do CDI	-0,70 -197,89	-2,14 -130,39	0,75 79,73	-1,04 -69,92	1,40 57,51	10,42 154,13	42,62 314,90
BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,39 108,98	1,84 112,31	1,04 110,99	1,68 113,15	2,55 104,37	6,22 92,08	12,88 95,19
BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA % do CDI	0,38 105,80	1,53 93,50	0,97 103,04	1,38 92,70	2,09 85,58	6,19 91,60	12,74 94,13
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,39 110,56	1,72 104,94	1,01 107,79	1,55 104,37	2,51 102,76	6,34 93,81	12,96 95,74
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	-0,11 -1,07	-0,50 -5,27	0,54 -1,80	-0,04 -4,54	1,16 -7,84		
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p.	-4,66 -0,71	14,33 11,99	0,55 -1,90	18,56 12,71	28,29 9,93	36,95 17,32	
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA Var. IBRX 100 p.p.	-3,78 0,21	2,95 -1,53	2,30 -0,03	6,48 -1,26	18,69 -2,03	23,31 -0,03	62,52 1,12
BB AÇÕES AGRO FIC FI	-2,74	8,33	1,27				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	1,21	6,23	-1,17				
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-2,78 1,16	2,87 0,53	2,04 -0,40	8,25 2,40	23,66 5,30	34,95 15,32	
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,39 6,33	18,08 15,74	5,47 3,03	18,54 12,69	34,02 15,67		
TAMBAÚ Var. IPCA + 5,89% p.p.	-0,08 -1,54	0,67 -7,60	0,46 -3,37	0,71 -6,80	2,47 -12,90		
CDI	0,36	1,64	0,94	1,49	2,44	6,76	13,53
IBOVESPA	-3,94	2,34	2,44	5,85	18,35	19,63	53,75
INPC + 6,00%	1,54	8,59	4,13	7,80	16,39	26,73	38,51
IPCA + 6,00%	1,47	8,33	3,86	7,56	15,48	25,26	36,99

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	0,19	1,00	0,60	0,96	1,99	7,60	15,44	23,97	40,68
IRF-M 1+	-0,83	-4,11	-0,42	-2,76	-3,34	8,28	28,38	38,97	66,27
IRF-M TOTAL	-0,47	-2,04	-0,06	-1,25	-1,40	8,27	24,82	34,87	59,02
IMA-B 5	0,03	1,31	0,59	1,21	5,06	14,34	30,43	41,23	60,61
IMA-B 5+	-0,76	-3,29	1,44	-1,63	0,34	8,18	49,88	56,72	81,63
IMA-B TOTAL	-0,37	-1,09	1,10	-0,24	2,53	10,89	41,35	50,46	72,98
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,10	-0,44	0,72	-0,00	0,96	8,10	24,45	33,52	54,06
IMA-GERAL TOTAL	-0,10	0,04	0,87	0,28	1,67	9,12	25,92	35,34	55,62
IDKA 2	-0,18	1,68	0,38	1,54	5,88	15,07	29,57	41,20	61,95
IDKA 20	-1,44	-5,02	1,98	-2,27	-1,21	3,68	67,33	69,21	99,56
CDI	0,36	1,64	0,94	1,49	2,44	6,76	13,53	21,57	36,78

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,94	2,34	2,44	5,85	18,35	19,63	53,75	84,77	112,54
IBRX 100	-3,99	4,47	2,33	7,73	20,73	23,34	61,40	92,00	121,47
IBRX 50	-3,85	4,91	2,77	7,91	22,23	22,51	54,85	86,08	113,55
SMALL CAP	-5,80	4,96	1,45	8,69	20,13	29,57	86,53	106,58	160,32
IFIX	2,51	-1,60	-1,29	-1,92	3,33	6,19	31,08	36,68	62,68
Índice Consumo - ICON	-5,22	-2,08	1,59	-0,81	2,95	15,45	58,99	62,68	71,63
Índice Dividendos - IDIV	-1,72	0,31	1,58	5,67	14,21	18,21	67,31	86,37	136,91

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	0,96	4,76	2,34	4,50	8,99	11,51	15,10	20,26	23,52
INPC	1,02	5,01	2,60	4,73	9,85	12,81	16,38	20,58	23,08
IGPM	0,78	15,98	5,54	13,06	33,83	46,23	55,58	68,40	65,60
SELIC	0,36	1,64	0,94	1,49	2,44	6,76	13,54	21,59	36,81

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	4,72	15,33	-0,37	10,68	32,26	100,62	112,87	191,07	219,74
MSCI ACWI	2,99	10,44	-2,20	5,36	29,16	87,89	90,03	148,07	175,22
MSCI World	4,15	12,45	-1,01	7,85	31,07	90,86	94,44	156,03	181,87

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,31	7,15	3,36	6,55	13,32	20,59	29,41	40,58	50,15
IPCA + 5,00%	1,39	7,74	3,61	7,06	14,40	22,91	33,17	46,04	57,47
IPCA + 5,50%	1,43	8,04	3,74	7,31	14,94	24,08	35,07	48,83	61,23
IPCA + 5,89%	1,47	8,27	3,84	7,51	15,36	25,00	36,57	51,03	64,22
IPCA + 6,00%	1,47	8,33	3,86	7,56	15,48	25,26	36,99	51,65	65,07
INPC + 4,00%	1,37	7,41	3,63	6,79	14,21	22,00	30,85	40,95	49,61
INPC + 6,00%	1,54	8,59	4,13	7,80	16,39	26,73	38,51	52,05	64,49

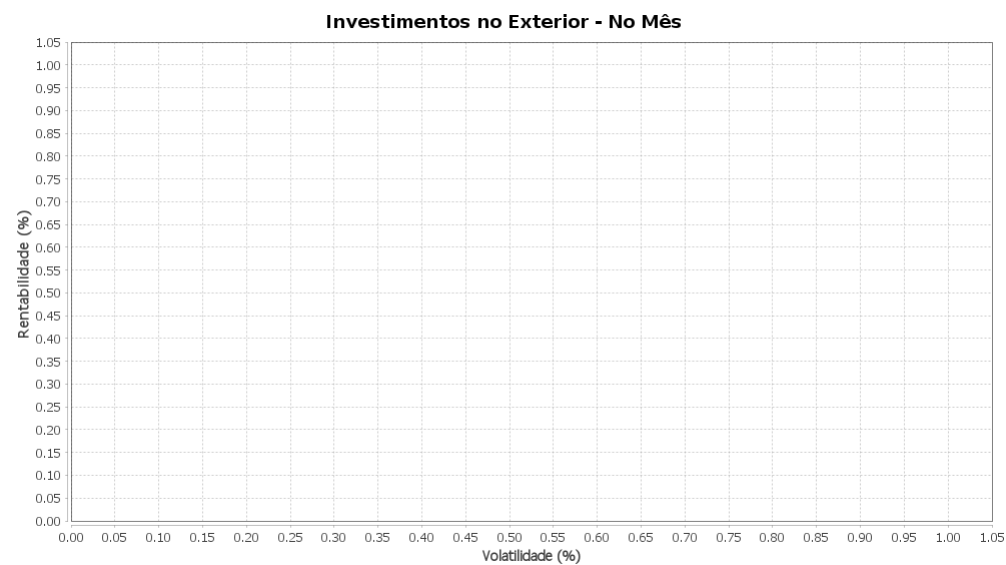
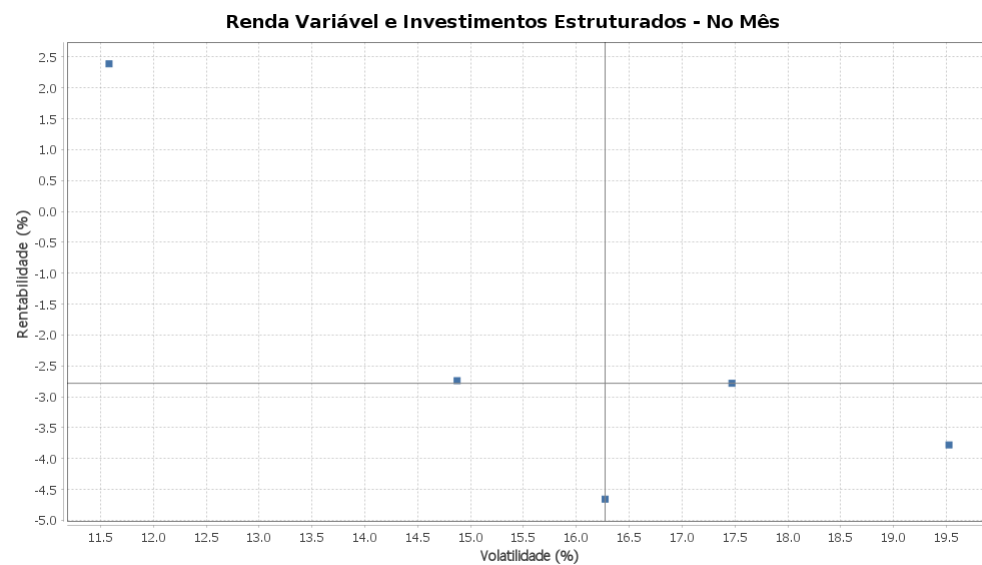
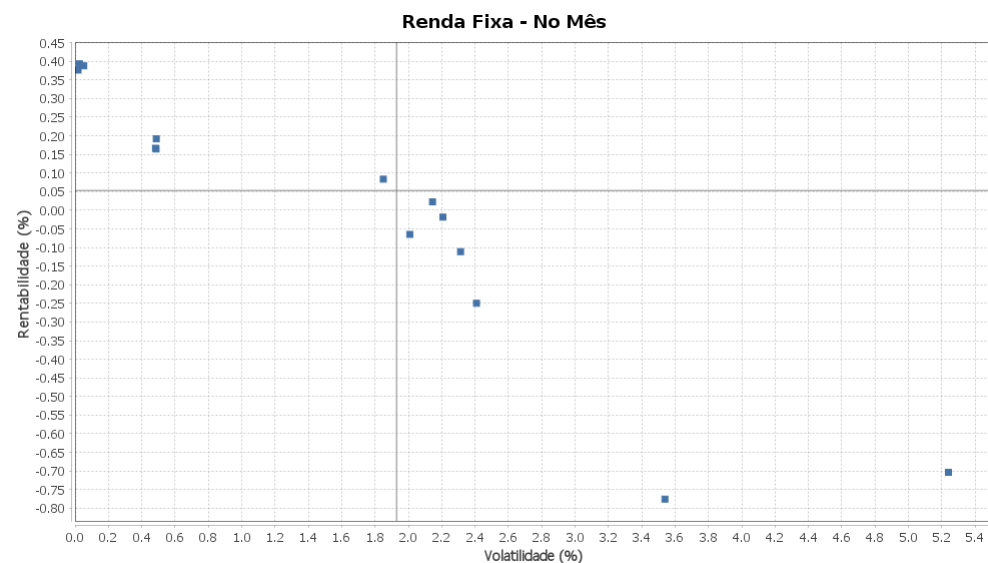
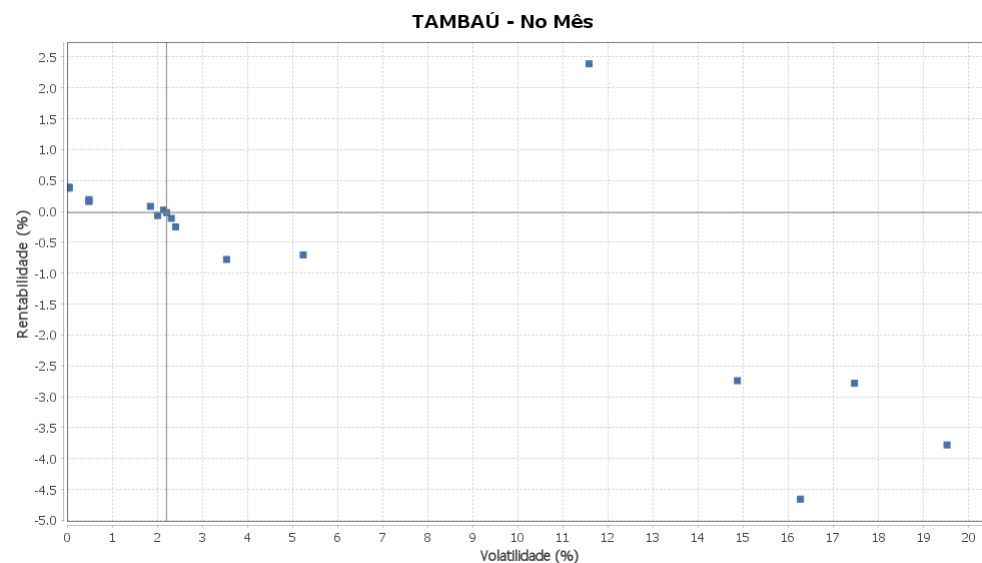
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
77	02/07/2021	BB PREV RF IDKA2	0,00	1.900.000,00	647.026,55319000	2,9365100870
87	02/07/2021	BB AÇÕES AGRO FIC FI	1.000.000,00	0,00	887.793,42125200	1,1263881620
79	05/07/2021	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	900.000,00	0,00	600.902,35022200	1,4977475120
80	05/07/2021	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	2.000.000,00	771.526,86284870	2,5922623000
81	05/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.009,27	0,00	4.182,99320000	2,6319120000
70	06/07/2021	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	551.000,00	0,00	388.234,86306700	1,4192440000
86	06/07/2021	BRADESCO H FI RF NILO	2.000.000,00	0,00	855.475,38896000	2,3378814000
73	12/07/2021	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	624,75	0,00	437,82929100	1,4269260000
71	12/07/2021	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	753,91	0,00	528,34554800	1,4269260000
82	12/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	300,00	113,92395100	2,6333360000
72	13/07/2021	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	1.036,80	0,00	727,09829700	1,4259420000
83	14/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	250,00	94,88275200	2,6348310000
78	15/07/2021	BB PREV RF IDKA2	0,00	5.000.000,00	1.701.394,56731800	2,9387657020
74	15/07/2021	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	5.000.000,00	0,00	238.775,81048600	20,9401446060
84	26/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.380,00	903,04909200	2,6355160000
76	29/07/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	645.883,72	234.997,54401200	2,7484700860
85	29/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.920,98	3.004,33340100	2,6365180000
75	30/07/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,13	0,00	0,04731600	2,7474746120
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 696.310,92

Value-At-Risk: 0,92%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,03	-0,00	1,14	0,38	2.070.498,92	2,72
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,03	0,00	1,42	0,39	82.244,27	0,11
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,03	-0,00	0,61	0,39	11.886.591,80	15,63
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,48	0,17	0,00	-0,39	0,17	204.275,09	0,27
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,49	0,17	0,01	-0,39	0,16	6.376.421,32	8,38
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,49	0,16	0,01	-0,34	0,19	8.565.998,75	11,26
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,85	1,21	0,10	-0,15	0,08	6.816.250,93	8,96
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,28	0,10	-0,21	-0,06	6.635.441,08	8,72
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,14	1,36	0,08	-0,16	0,02	4.988.333,64	6,56
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	2,21	1,34	0,08	-0,17	-0,02	5.081.703,70	6,68
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	2,31	1,21	0,08	-0,20	-0,11	5.119.762,74	6,73
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,41	1,20	0,18	-0,25	-0,25	12.270.886,00	16,13
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,54	1,03	0,01	-0,32	-0,78	455.774,16	0,60
BRADESCO H FI RF NILO	Artigo 7º IV, Alínea a	5,24	2,48	0,06	-0,20	-0,70	1.985.979,35	2,61
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	Artigo 8º II, Alínea a	11,58	6,01	0,03	0,18	2,39	1.019.284,25	1,34
BB AÇÕES AGRO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	14,87	7,13	0,05	-0,21	-2,74	961.742,07	1,26
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	Artigo 8º II, Alínea a	16,27	8,54	0,10	-0,31	-4,66	1.243.454,81	1,63
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	17,47	7,58	0,01	-0,18	-2,78	205.983,52	0,27
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	Artigo 8º II, Alínea a	19,52	6,38	0,00	-0,21	-3,78	95.701,26	0,13