



TAMBAÚ
SETEMBRO 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 **90,90%**

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	0,40	0,37	1,53	5.773.460,18	7,57	6.892.529.188,23	0,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,38	0,38	1,59	237.055,00	0,31	6.805.654.314,46	0,00
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,41	0,39	1,56	7.623.096,51	9,99	665.519.143,94	1,15
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,29	1,03	2,73	6.898.983,76	9,04	9.425.482.510,34	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,27	-1,27	-3,21	146.085,72	0,19	1.307.235.728,08	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,45	1,08	2,79	6.727.300,14	8,82	11.068.272.487,58	0,06
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,49	0,98	0,85	8.663.851,62	11,36	6.090.651.961,96	0,14
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,68	-0,01	-1,38	12.215.155,78	16,01	8.672.013.980,14	0,14
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,43	0,35	-2,01	450.761,67	0,59	14.407.320.968,51	0,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,59	0,56	1,20	48.735.750,38	63,89		

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	0,45	2,41	2.088.480,93	2,74	9.148.556.896,00	0,02
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,18	0,49	2,84	11.355.081,26	14,89	3.692.592.328,71	0,31
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	0,46	2,64	82.991,31	0,11	5.468.058.659,45	0,00
BRAM	BRABESCO	BRABESCO H FI RF NILO	6,10	-0,30	-2,57	1.948.513,29	2,55	740.558.592,76	0,26
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,64	0,95	1,69	5.133.889,07	6,73	1.161.932.475,65	0,44
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,92	-0,14	-1,10	0,00	0,00	4.429.459.913,60	0,00
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,17	0,48	1,57	20.608.955,86	27,02		
Renda Fixa			1,45	0,54	1,33	69.344.706,24	90,90		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

8,17%

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	20,15	-6,63	-13,91	86.091,71	0,11	249.531.675,03	0,03
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	20,35	-3,75	7,35	1.161.522,42	1,52	468.658.477,76	0,25
BB	BB	BB AÇÕES AGRO FIC FI	16,46	3,21	-4,15	958.474,26	1,26	406.398.364,39	0,24
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	13,94	-4,78	5,10	2.452.186,30	3,21	2.078.841.851,24	0,12
BB	BB	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	20,26	-3,98	-11,47	193.708,74	0,25	1.327.140.890,40	0,01
BRAM	BEM	BRADESCO FIC EM AÇÕES CRESCIMENTO	20,21	-3,71	-5,51	188.986,68	0,25	49.405.069,78	0,38
CEF	CEF	FIA CAIXA SEGURIDADE	38,08	-16,22	-21,84	7.652,41	0,01	871.435.361,71	0,00
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			15,56	-3,18	10,62	5.048.622,52	6,62		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	0,27	0,46	0,77	213.770,49	0,28	9.695.140.671,92	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	13,89	-4,70	-2,35	971.833,33	1,27	258.269.045,58	0,38
Sub-total Artigo 8º III			9,60	-3,82	-1,97	1.185.603,82	1,55		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			14,83	-3,26	11,29	6.234.226,34	8,17		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,92%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,24	-0,25	0,39	705.123,62	0,92	3.337.438.389,61	0,02
Sub-total Artigo 9º A, III			18,24	-0,25	0,39	705.123,62	0,92		
Investimentos no Exterior			14,06	-0,25	0,39	705.123,62	0,92		
Total			1,58	0,24	0,92	76.284.056,20	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	48.735.750,38	63,89	0,00	52,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	20.608.955,86	27,02	0,00	33,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	69.344.706,24	90,90					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	5.048.622,52	6,62	0,00	15,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	1.185.603,82	1,55	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	6.234.226,34	8,17					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	705.123,62	0,92					10,00
	Total Investimentos no Exterior	705.123,62	0,92					10,00

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	0,56 127,23	1,20 47,93	0,58 47,49	1,65 81,82	3,35 112,11	276.161,26	604.894,81
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,48 110,33	1,57 62,53	0,67 55,09	1,75 86,84	3,08 103,15	100.551,83	363.589,93
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,18 3,39	10,62 13,28	-6,38 6,10	6,25 11,10		-138.615,37	-238.132,37
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-3,82 2,75	-1,97 7,81				-46.974,11	-26.575,35
Artigo 9º A, III % do CDI	-0,25 -57,07	0,39 50,80				-3.522,70	-2.561,38
TAMBAÚ (Total)						187.600,91	701.215,64

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	12.215.804,70	0,00	0,00	0,00	12.215.155,78	-648,92	-170.801,68
BB PREV RF IDKA2	6.828.415,74	0,00	0,00	0,00	6.898.983,76	70.568,02	293.688,58
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4.993.501,30	3.589.306,10	0,00	0,00	8.663.851,62	81.044,22	74.545,52
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	6.397.747,91	0,00	-647.402,79	0,00	5.773.460,18	23.115,06	108.832,48
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	7.593.380,56	0,00	0,00	0,00	7.623.096,51	29.715,95	138.975,01
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.648.335,28	9.060,83	-1.791,78	0,00	6.727.300,14	71.695,81	163.708,97
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	147.957,64	0,00	0,00	0,00	146.085,72	-1.871,92	-4.851,54
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	221.858,12	25.710,74	-11.462,56	0,00	237.055,00	948,70	10.035,80
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	449.167,33	0,00	0,00	0,00	450.761,67	1.594,34	-9.238,33
					48.735.750,38	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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	5.096.474,24	0,00	-5.089.306,10	0,00	0,00	-7.168,14	-56.384,33
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	82.612,01	0,00	0,00	0,00	82.991,31	379,30	6.180,44
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	2.079.192,50	0,00	0,00	0,00	2.088.480,93	9.288,43	52.729,99
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	11.299.433,00	0,00	0,00	0,00	11.355.081,26	55.648,26	329.255,99
BRADESCO H FI RF NILO	1.954.440,28	0,00	0,00	0,00	1.948.513,29	-5.926,99	-51.486,71
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5.085.558,10	0,00	0,00	0,00	5.133.889,07	48.330,97	83.294,55
					20.608.955,86	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	928.677,14	0,00	0,00	0,00	958.474,26	29.797,12	-41.525,74
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	1.052.502,43	1.500.000,00	0,00	0,00	2.452.186,30	-100.316,13	-47.813,70
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	201.742,15	0,00	0,00	0,00	193.708,74	-8.033,41	-25.077,65
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	92.200,26	0,00	0,00	0,00	86.091,71	-6.108,55	-13.908,29
BRADESCO FIC EM AÇÕES CRESCIMENTO	196.259,54	0,00	0,00	0,00	188.986,68	-7.272,86	-11.013,32
FIA CAIXA SEGURIDADE	9.133,53	0,00	0,00	0,00	7.652,41	-1.481,12	-2.124,86
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	1.206.722,84	0,00	0,00	0,00	1.161.522,42	-45.200,42	-96.668,81
					5.048.622,52	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	208.121,00	4.683,30	0,00	0,00	213.770,49	966,19	1.591,32
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	1.019.773,63	0,00	0,00	0,00	971.833,33	-47.940,30	-28.166,67
					1.185.603,82	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	151.816,80	556.829,52	0,00	0,00	705.123,62	-3.522,70	-2.561,38
					705.123,62	0,00	0,00

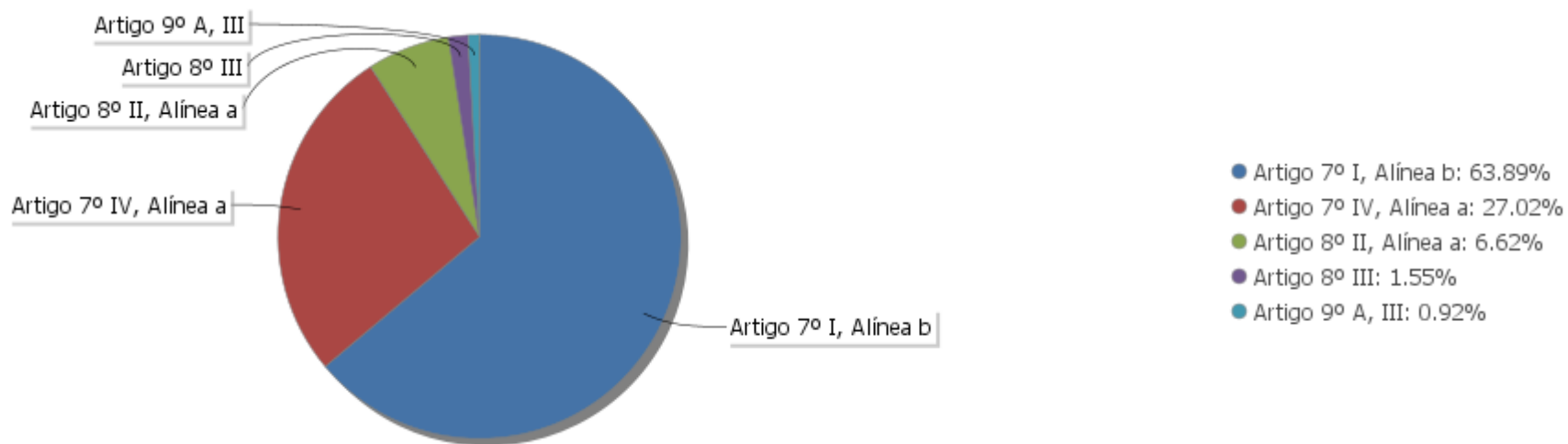
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

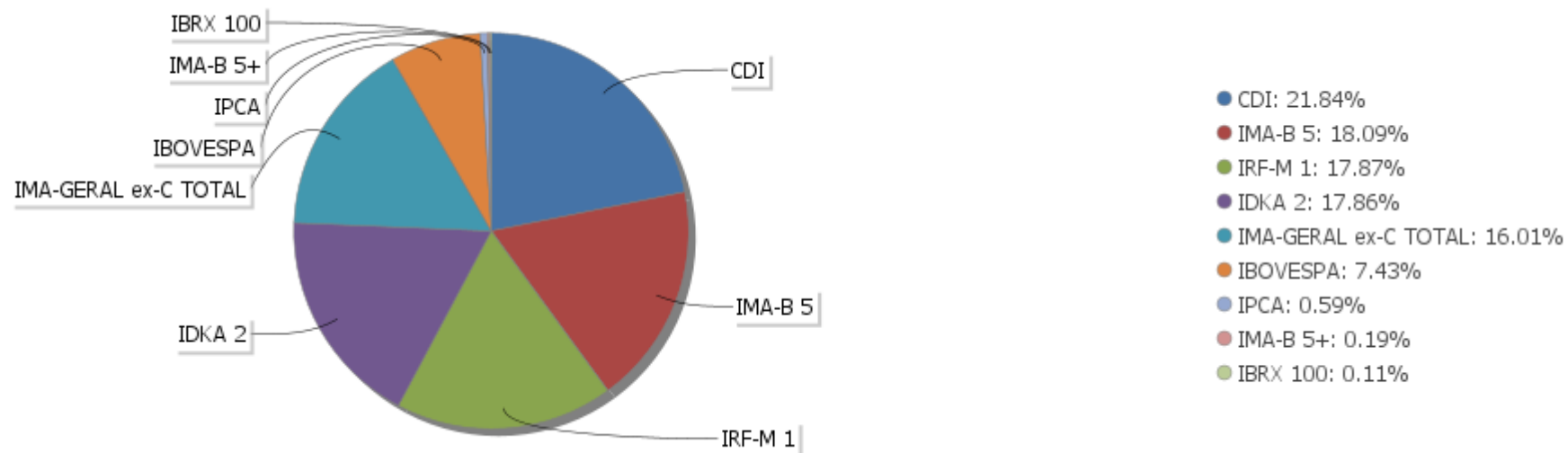
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	76.284.056,20	100,00	76.284.056,20	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	76.284.056,20	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	76.284.056,20	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

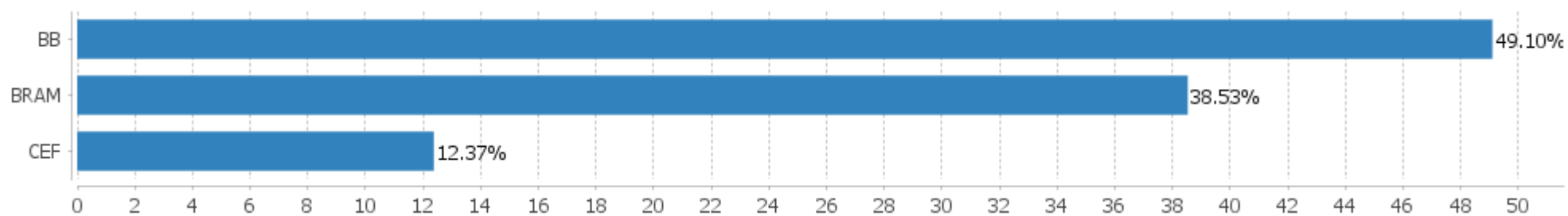


Alocação Por Estratégia



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	0,00	0,24				0,92
IPCA + 5,89%	0,71	1,27	1,46	0,77	1,31	1,01	1,47	1,38	1,64				11,56
p.p. indexador	-0,75	-1,63	-1,41	-0,21	-0,83	-0,95	-1,54	-1,37	-1,40				-10,65
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

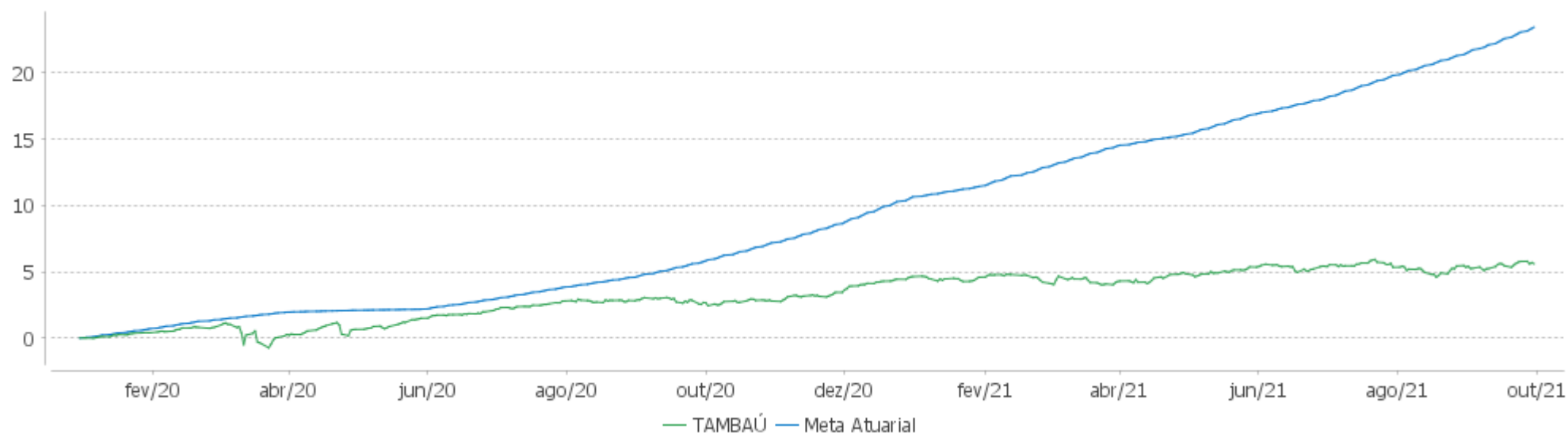
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

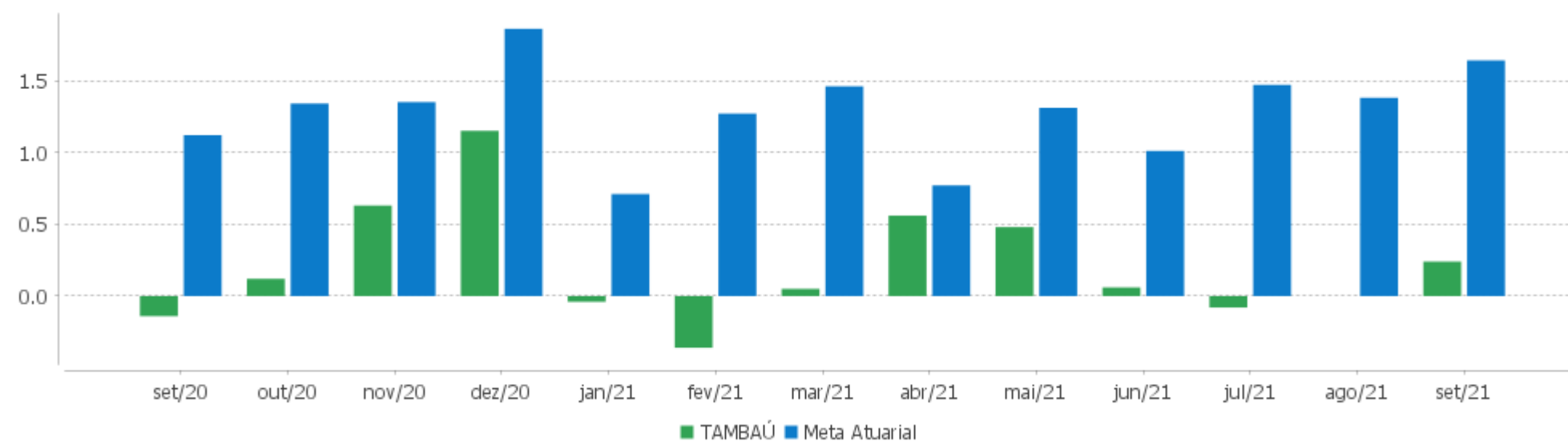
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	2	9,52	03 meses	0,17	4,55	-4,38	1,88
Meses abaixo - Meta Atuarial	19	90,48	06 meses	1,27	7,81	-6,54	1,73
			12 meses	2,84	16,71	-13,87	1,58
			24 meses				
Desde 31/12/2019				5,60	23,44	-17,85	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.	1,03 -0,06	2,73 -0,34	1,30 0,11	2,74 -0,38	6,05 -0,17	13,77 -0,94	27,54 -1,91
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,01 -0,03	-1,38 -0,62	-0,70 -0,28	0,51 -0,38	1,75 -0,30	5,52 -0,51	23,63 0,04
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,39 -0,01	1,56 -0,22	0,94 -0,02	1,54 -0,11	2,24 -0,25	6,47 -0,68	14,11 -1,01
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,35 -0,81	-1,16 -8,06	-1,87 -4,89	-0,98 -5,73	0,85 -9,39	7,32 -6,38	26,96 9,96
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,37 -0,04	1,53 -0,25	0,87 -0,09	1,47 -0,18	2,16 -0,33	6,42 -0,73	14,11 -1,01
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,08 -0,02	2,79 -0,28	1,21 0,03	2,82 -0,30	5,92 -0,29	13,71 -1,00	27,67 -1,78
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,98 -0,02	2,29 -0,20	1,11 -0,08	2,49 -0,15	5,70 -0,25	13,04 -0,58	30,18 -0,94
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,38 -0,02	1,59 -0,19	0,89 -0,07	1,54 -0,11	2,25 -0,25	6,68 -0,47	14,44 -0,68
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,27 -0,01	-6,87 -0,24	-4,33 -0,14	-1,81 -0,20	2,97 -0,24	0,80 -0,67	45,16 -1,83
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,95 -0,05	1,69 -0,79	1,01 -0,18	2,43 -0,21	4,98 -0,97	12,47 -1,16	29,72 -1,40
BRADERCO H FI RF NILO % do CDI	-0,30 -69,20	-3,98 -158,81	-2,58 -210,73	-0,30 -14,87	3,24 108,29	5,66 85,07	41,13 308,17
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,49 112,38	2,84 113,34	1,38 112,49	2,28 113,27	3,26 109,08	6,25 93,96	12,84 96,20
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA % do CDI	0,45 101,94	2,41 96,24	1,25 102,05	1,98 98,32	2,85 95,45	6,11 91,88	12,58 94,23
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,46 104,77	2,64 105,40	1,31 106,72	2,13 105,74	3,23 107,92	6,30 94,70	12,80 95,91
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,11 -1,05	-0,85 -7,75	-0,46 -3,48	0,90 -3,85	2,78 -7,47		
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p.	-3,75 2,82	6,80 13,55	-10,94 1,54	3,12 7,96	28,12 10,81	29,33 23,38	
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-6,63	-7,39	-13,44	-5,04	14,94	7,53	45,93

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBRX 100 p.p.	0,37	-1,40	0,17	0,27	-2,89	-0,18	0,70
BB AÇÕES AGRO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	3,21 9,78	7,96 14,94	-3,07 9,41	6,73 11,57			
BRADESCO FIC EM AÇÕES CRESCIMENTO Var. IBOVESPA p.p.	-3,71 2,86	2,83 9,58	-8,96 3,52	3,15 8,00	18,29 0,98		
FIA CAIXA SEGURIDADE Var. IBOVESPA p.p.	-16,22 -9,65	-14,27 -7,61	-36,40 -23,92				
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-3,98 2,59	-3,26 3,49	-8,57 3,90	-1,61 3,24	23,96 6,65	25,09 19,14	
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,78 1,79	16,09 22,85	0,67 13,15	9,25 14,10	28,99 11,68		
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	-4,70 -1.072,77	16,72 666,93	0,92 75,29	9,55 473,80	30,02 1.003,60	42,82 643,58	49,43 370,33
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI % do CDI	0,46 105,23	2,51 99,97	1,22 99,75	1,93 95,78	3,43 114,53	8,16 122,66	17,17 128,65
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-0,25 6,32	16,72 23,48	7,72 20,20	3,03 7,87	18,25 0,94	90,64 84,69	101,42 61,54
TAMBAÚ Var. IPCA + 5,89% p.p.	0,24 -1,40	0,92 -10,65	0,17 -4,38	1,27 -6,54	2,84 -13,87		
CDI	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35
IBOVESPA	-6,57	-6,75	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87
INPC + 6,00%	1,69	11,97	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02
IPCA + 6,00%	1,65	11,65	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28

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	0,40	1,78	0,96	1,65	2,49	7,15	15,12	22,90	38,45
IRF-M 1+	-0,73	-5,87	-2,65	-1,15	-3,14	4,23	25,92	32,64	58,13
IRF-M TOTAL	-0,33	-2,95	-1,39	-0,15	-1,02	5,48	23,23	30,30	53,03
IMA-B 5	1,00	2,48	1,18	2,64	5,95	13,62	31,12	39,68	58,47
IMA-B 5+	-1,26	-6,63	-4,19	-1,61	3,20	1,48	46,98	45,78	70,99
IMA-B TOTAL	-0,13	-2,30	-1,59	0,52	4,71	6,92	40,46	44,04	66,75
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,02	-0,76	-0,42	0,89	2,05	6,02	23,59	29,99	49,60
IMA-GERAL TOTAL	-0,01	-0,38	-0,52	0,96	2,48	6,93	24,87	31,60	51,09
IDKA 2	1,10	3,07	1,18	3,12	6,21	14,71	29,45	40,48	59,67
IDKA 20	-3,03	-11,97	-8,65	-5,13	2,03	-7,04	59,98	49,40	80,44
CDI	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,90	34,86

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-6,57	-6,75	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87	49,38	90,14
IBRX 100	-6,99	-5,99	-13,61	-5,31	17,82	7,71	45,23	53,72	95,90
IBRX 50	-7,47	-6,33	-14,15	-5,58	18,46	6,59	37,53	47,56	87,32
SMALL CAP	-6,43	-5,54	-15,22	-4,70	15,75	13,69	78,82	65,15	133,65
IFIX	-1,24	-5,38	-1,42	-4,61	-2,83	1,17	27,21	22,27	49,54
Índice Consumo - ICON	-5,95	-11,50	-14,34	-7,48	-1,67	-2,69	50,48	25,77	51,19
Índice Dividendos - IDIV	-4,48	-4,67	-6,59	-1,51	19,58	7,85	64,83	56,04	121,60

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	1,16	6,90	3,02	4,75	10,25	13,70	16,99	22,29	25,39
INPC	1,20	7,21	3,13	5,14	10,78	15,09	18,46	23,16	25,17
IGPM	-0,64	16,00	0,80	7,15	24,86	47,25	52,21	67,49	65,07
SELIC	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,91	34,89

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	0,73	20,04	8,99	3,52	23,52	89,01	100,82	193,57	232,88
MSCI ACWI	1,23	14,91	7,16	0,61	21,06	78,00	83,86	150,21	184,12
MSCI World	1,22	16,99	8,36	2,09	22,47	80,14	87,02	158,04	191,94

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,49	10,07	4,07	6,84	14,64	22,96	31,56	42,95	52,39
IPCA + 5,00%	1,57	10,86	4,32	7,36	15,74	25,33	35,38	48,50	59,82
IPCA + 5,50%	1,61	11,26	4,45	7,61	16,29	26,53	37,32	51,33	63,64
IPCA + 5,89%	1,64	11,56	4,55	7,81	16,71	27,46	38,84	53,57	66,67
IPCA + 6,00%	1,65	11,65	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28	54,21	67,53
INPC + 4,00%	1,53	10,39	4,18	7,24	15,20	24,46	33,20	43,97	52,12
INPC + 6,00%	1,69	11,97	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02	55,31	67,23

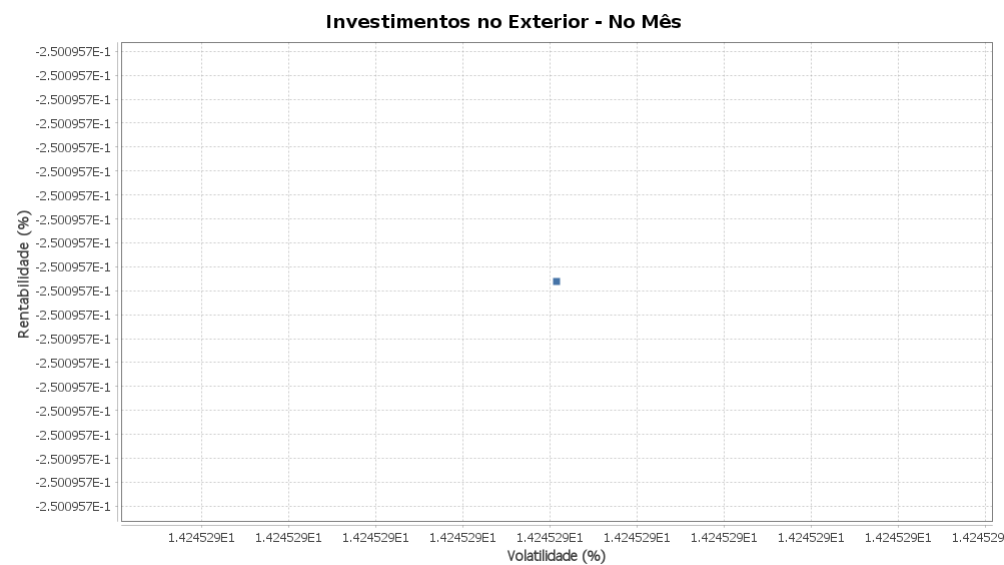
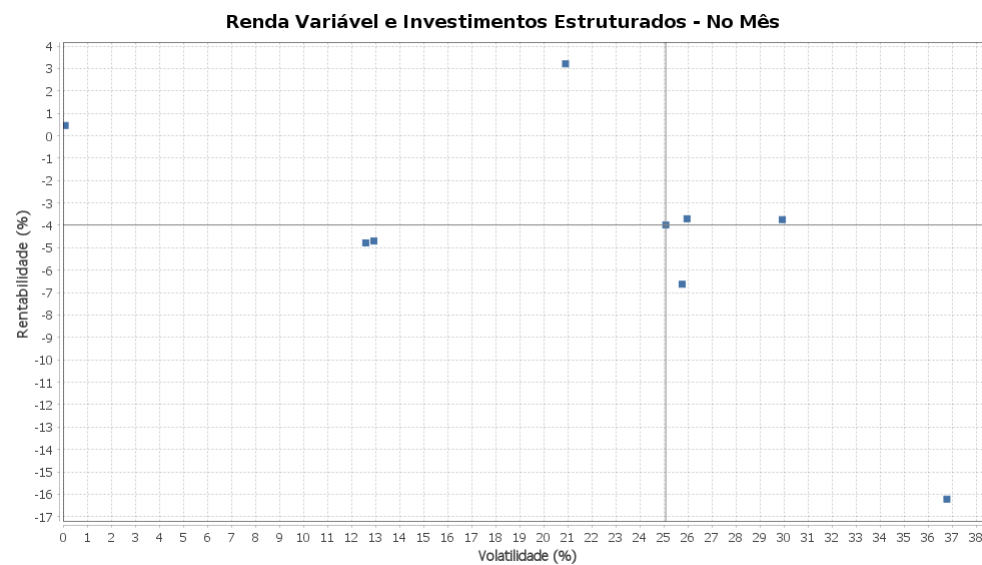
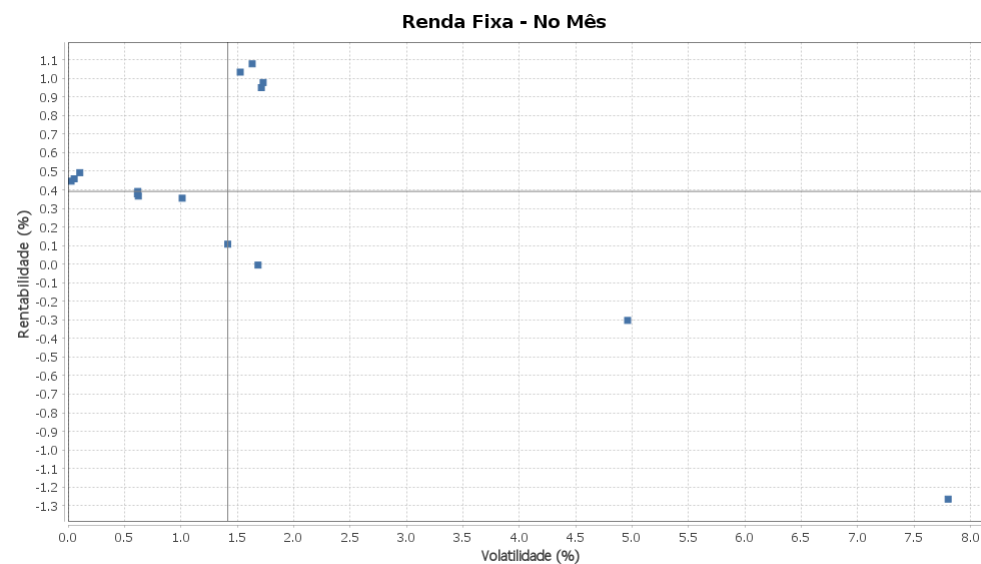
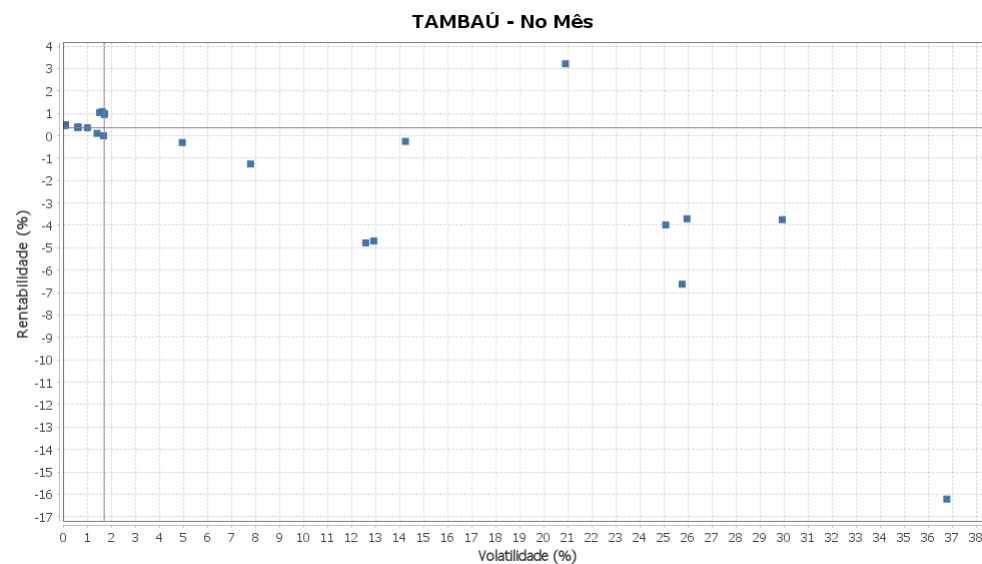
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
114	02/09/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	8.415,08	0,00	1.363,62435755	6,1711130000
115	03/09/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	83.487,30	0,00	13.505,60915842	6,1816760000
104	09/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	25.247,19	0,00	9.552,86120100	2,6428930000
109	09/09/2021	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,00	5.089.306,10	4.824.718,40026800	1,0548400290
113	09/09/2021	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	3.430.095,12	0,00	163.889,16673700	20,9293584700
105	09/09/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPKA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	624,75	0,00	256,07467700	2,4397180000
108	10/09/2021	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	1.500.000,00	0,00	971.300,60418300	1,5443210820
112	10/09/2021	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	159.210,98	0,00	7.606,36863100	20,9312732150
116	10/09/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	461.837,95	0,00	74.998,77394063	6,1579400000
117	14/09/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	3.089,19	0,00	504,89896757	6,1184320000
111	22/09/2021	BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	4.683,30	0,00	1.239,41667900	3,7786323830
110	28/09/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	647.402,79	234.108,94986500	2,7653910300
107	28/09/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPKA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.791,78	727,32216700	2,4635300000
103	29/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.462,56	4.318,88909100	2,6540530000
102	30/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	463,55	0,00	174,61930600	2,6546320000
106	30/09/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPKA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8.436,08	0,00	3.423,63094600	2,4640740000
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 758.165,74

Value-At-Risk: 0,99%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	-0,00	0,32	0,45	2.088.480,93	2,74
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,03	0,00	0,39	0,46	82.991,31	0,11
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	Artigo 8º III	0,09	0,08	0,00	0,26	0,46	213.770,49	0,28
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,10	0,04	-0,00	0,52	0,49	11.355.081,26	14,89
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,61	0,18	0,00	-0,10	0,38	237.055,00	0,31
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,62	0,19	0,01	-0,08	0,39	7.623.096,51	9,99
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,62	0,18	0,01	-0,12	0,37	5.773.460,18	7,57
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,01	1,46	0,01	-0,08	0,35	450.761,67	0,59
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	1,42	NaN	0,00	-0,23	0,11	0,00	0,00
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,53	1,07	0,08	0,39	1,03	6.898.983,76	9,04
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,63	1,04	0,07	0,39	1,08	6.727.300,14	8,82
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,68	1,11	0,15	-0,26	-0,01	12.215.155,78	16,01
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	1,71	1,26	0,07	0,30	0,95	5.133.889,07	6,73
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,73	1,25	0,12	0,31	0,98	8.663.851,62	11,36
BRADESCO H FI RF NILO	Artigo 7º IV, Alínea a	4,96	3,38	0,07	-0,15	-0,30	1.948.513,29	2,55
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,80	4,07	0,01	-0,22	-1,27	146.085,72	0,19
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,59	5,95	0,11	-0,41	-4,78	2.452.186,30	3,21
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	Artigo 8º III	12,93	6,26	0,05	-0,40	-4,70	971.833,33	1,27
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	14,25	6,65	-0,01	-0,05	-0,25	705.123,62	0,92
BB AÇÕES AGRO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	20,90	8,14	0,07	0,13	3,21	958.474,26	1,26
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	25,08	9,60	0,02	-0,18	-3,98	193.708,74	0,25
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	Artigo 8º II, Alínea a	25,76	9,04	0,01	-0,27	-6,63	86.091,71	0,11
BRADESCO FIC EM AÇÕES CRESCIMENTO	Artigo 8º II, Alínea a	25,96	8,40	0,01	-0,16	-3,71	188.986,68	0,25
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	Artigo 8º II, Alínea a	29,92	11,96	0,14	-0,14	-3,75	1.161.522,42	1,52
FIA CAIXA SEGURIDADE	Artigo 8º II, Alínea a	36,77	17,91	0,00	-0,45	-16,22	7.652,41	0,01