



LDB
EMPRESAS

TOLEDO
2º 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 30.06.2021.

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

RENDA FIXA

78,75%

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,72	-0,07	0,40	2,09	62.269.556,79	15,29	5.867.854.510,24	1,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,33	-0,01	0,19	0,64	38.961.888,68	9,56	8.267.613.291,28	0,47
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,55	0,00	-0,15	1,38	34.116.654,02	8,37	14.363.834.668,17	0,24
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,88	-0,13	0,77	2,63	6.738.715,85	1,65	1.599.152.888,14	0,42
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,47	0,01	-0,28	1,59	32.563.057,61	7,99	11.796.463.834,87	0,28
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,97	-0,14	0,18	1,13	18.191.689,67	4,47	1.645.783.274,49	1,11
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,94	-0,06	0,11	1,22	20.720.525,39	5,09	9.201.718.777,36	0,23
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,33	-0,11	-0,00	0,90	67.473.414,51	16,56	16.058.908.177,46	0,42
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,00	-0,01	-0,33	1,69	9.234.780,00	2,27	177.835.742,01	5,19
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,92	-0,06	0,08	1,34	290.270.282,52	71,26		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,47	0,02	0,31	0,72	15.532.846,92	3,81	5.225.006.230,82	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,26	0,01	0,31	0,82	3.177.392,83	0,78	5.582.841.841,27	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,13	-0,09	0,11	0,83	11.829.332,84	2,90	1.001.985.294,49	1,18
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,79	-0,03	0,23	0,77	30.539.572,59	7,50		
Renda Fixa			2,70	-0,05	0,10	1,29	320.809.855,11	78,75		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

15,03%

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	33,64	0,74	-3,46	0,98	1.331.616,61	0,33	406.327.856,78	0,33
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	20,03	-0,05	-0,56	7,86	6.052.949,31	1,49	1.093.616.523,63	0,55
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	21,85	-0,74	0,52	7,73	1.627.572,38	0,40	575.413.760,97	0,28
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,69	-0,16	-1,76	6,71	4.486.631,58	1,10	1.018.349.879,65	0,44
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	21,68	-0,08	1,09	12,50	2.111.422,99	0,52	1.246.438.857,80	0,17
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	20,91	0,23	1,80	10,18	3.448.938,17	0,85	2.253.324.643,65	0,15
ITAU	ITAU	ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	18,97	-0,17	-0,21	11,00	5.308.133,58	1,30	3.594.423.115,17	0,15
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	18,75	-0,15	1,66	10,34	8.363.627,62	2,05	1.144.591.390,81	0,73
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			19,31	-0,09	0,16	9,05	32.730.892,24	8,03		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,67	0,03	-0,17	2,40	4.941.195,63	1,21	4.432.831.656,33	0,11
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	15,05	0,14	2,71	8,76	23.566.589,34	5,79	2.298.502.554,43	1,03
Sub-total Artigo 8º III			7,76	0,12	2,16	6,99	28.507.784,97	7,00		
Renda Variável			15,43	0,01	1,05	8,24	61.238.677,21	15,03		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,22%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	19,83	-1,14	5,86	7,11	10.711.451,14	2,63	560.062.356,02	1,91
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	24,39	0,83	-1,15	0,45	5.022.726,51	1,23	1.609.258.405,72	0,31
Sub-total Artigo 9º II			8,19	-0,52	3,51	4,89	15.734.177,65	3,86		

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	21,15	1,22	-1,19	-4,36	9.584.616,92	2,35	2.860.128.891,15	0,34
Sub-total Artigo 9º III			21,15	1,22	-1,19	-4,36	9.584.616,92	2,35		
Investimentos no Exterior			20,95	0,13	1,68	-0,96	25.318.794,57	6,22		
Total			3,38	-0,03	0,33	2,14	407.367.326,89	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	290.270.282,52	71,26	0,00	67,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	30.539.572,59	7,50	0,00	7,00	40,00	0,00	50,00
	Total Renda Fixa	320.809.855,11	78,75					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	32.730.892,24	8,03	0,00	15,00	20,00	0,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	28.507.784,97	7,00	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável	61.238.677,21	15,03					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	15.734.177,65	3,86	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	9.584.616,92	2,35	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	25.318.794,57	6,22					10,00
Total		407.367.326,89	100,00					

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	0,08 26,88	1,34 171,13	1,34 171,13	0,03 2,03	3,85 169,62	214.922,27	4.030.971,90
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,23 75,57	0,77 98,93	0,77 98,93	0,99 78,38	2,05 90,40	70.201,42	234.496,53
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,16 -0,30	9,05 0,34	9,05 0,34	6,62 0,08	29,70 -3,70	49.726,14	2.653.861,33
Artigo 8º III % do CDI	2,16 707,23	6,99 893,28	6,99 893,28	11,51 907,33	17,82 785,61	554.016,08	1.282.086,87
Artigo 9º II % do CDI	3,51 1.152,73	4,89 1.229,47				534.224,09	734.177,65
Artigo 9º III % do CDI	-1,19 -389,79	-4,36 -556,89	-4,36 -556,89	8,36 658,79	26,23 1.156,26	-115.280,48	-436.475,04
TOLEDO (Total)						1.307.809,52	8.499.119,24

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	20.697.448,53	0,00	0,00	0,00	20.720.525,39	23.076,86	249.337,73
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.265.074,00	0,00	0,00	0,00	9.234.780,00	-30.294,00	153.252,00
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	35.454.868,84	4.137.003,40	-6.897.120,65	0,00	32.563.057,61	-131.693,98	592.655,64
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	34.167.806,40	0,00	0,00	0,00	34.116.654,02	-51.152,38	465.991,19
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.687.081,52	0,00	0,00	0,00	6.738.715,85	51.634,33	172.941,67
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	62.020.627,81	0,00	0,00	0,00	62.269.556,79	248.928,98	1.273.321,72
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	38.888.531,27	0,00	0,00	0,00	38.961.888,68	73.357,41	248.784,35
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	18.158.589,68	0,00	0,00	0,00	18.191.689,67	33.099,99	271.676,83
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	67.475.449,45	0,00	0,00	0,00	67.473.414,51	-2.034,94	603.010,77
					290.270.282,52	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.167.706,13	0,00	0,00	0,00	3.177.392,83	9.686,70	25.695,99
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.484.787,43	0,00	0,00	0,00	15.532.846,92	48.059,49	111.538,51
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	11.816.877,61	0,00	0,00	0,00	11.829.332,84	12.455,23	97.262,03
					30.539.572,59	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	6.086.901,11	0,00	0,00	0,00	6.052.949,31	-33.951,80	441.164,48
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	1.379.325,47	0,00	0,00	0,00	1.331.616,61	-47.708,86	12.955,62
FIA CAIXA CONSUMO	1.619.174,48	0,00	0,00	0,00	1.627.572,38	8.397,90	116.825,44
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	2.088.727,12	0,00	0,00	0,00	2.111.422,99	22.695,87	234.547,03
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.566.870,68	0,00	0,00	0,00	4.486.631,58	-80.239,10	282.056,76
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	7.873.537,97	359.264,11	0,00	0,00	8.363.627,62	130.825,54	721.616,40
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	5.319.358,98	0,00	0,00	0,00	5.308.133,58	-11.225,40	526.127,58
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	3.388.006,18	0,00	0,00	0,00	3.448.938,17	60.931,99	318.568,02
					32.730.892,24	0,00	0,00

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	20.533.292,59	2.470.929,80	0,00	0,00	23.566.589,34	562.366,95	1.166.443,43
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP	4.949.546,50	0,00	0,00	0,00	4.941.195,63	-8.350,87	115.643,44
					28.507.784,97	0,00	0,00

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	10.118.799,13	0,00	0,00	0,00	10.711.451,14	592.652,01	711.451,14
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	5.081.154,43	0,00	0,00	0,00	5.022.726,51	-58.427,92	22.726,51
					15.734.177,65	0,00	0,00

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	9.699.897,40	0,00	0,00	0,00	9.584.616,92	-115.280,48	-436.475,04
					9.584.616,92	0,00	0,00

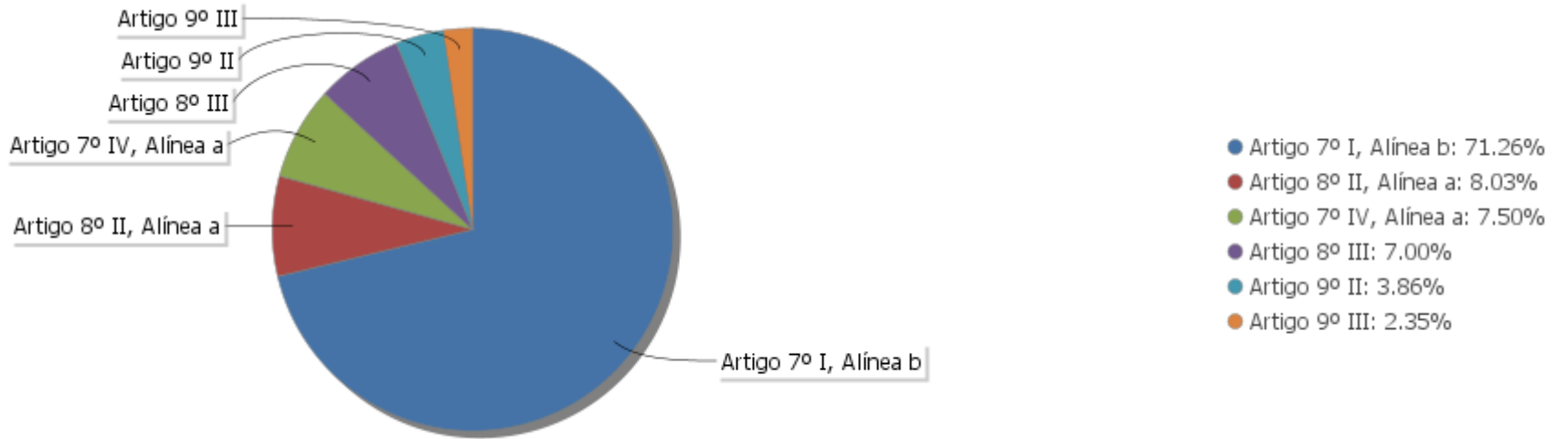
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

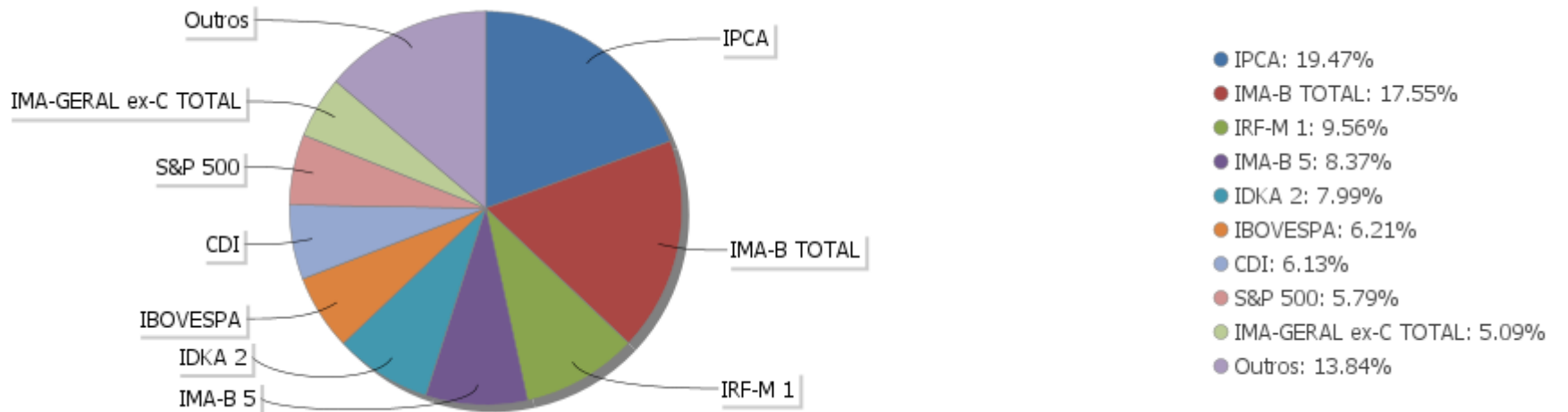
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	370.472.266,63	90,94	370.472.266,63	90,94	
de 31 dias a 365 dias	27.660.280,26	6,79	398.132.546,89	97,73	
acima de 365 dias	9.234.780,00	2,27	407.367.326,89	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

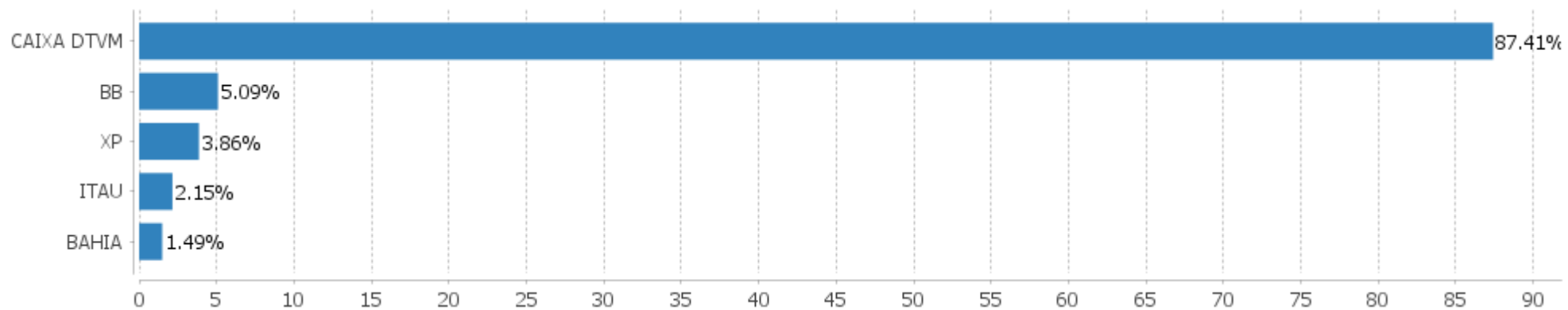


Alocação Por Estratégia



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	-0,35	-0,77	0,32	0,99	0,81	0,33							1,32
INPC + 5,42%	0,69	1,20	1,35	0,80	1,41	1,04							6,66
p.p. indexador	-1,04	-1,97	-1,02	0,19	-0,60	-0,72							-5,34
2020	0,52	-0,14	-3,86	1,35	1,57	1,44	1,98	-0,63	-0,87	-0,13	1,81	2,48	5,48
INPC + 5,87%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,96	0,84	1,35	1,37	1,41	1,97	11,61
p.p. indexador	-0,17	-0,72	-4,54	1,12	1,37	0,66	1,02	-1,47	-2,22	-1,50	0,40	0,51	-6,13

Performance Sobre a Meta Atuarial

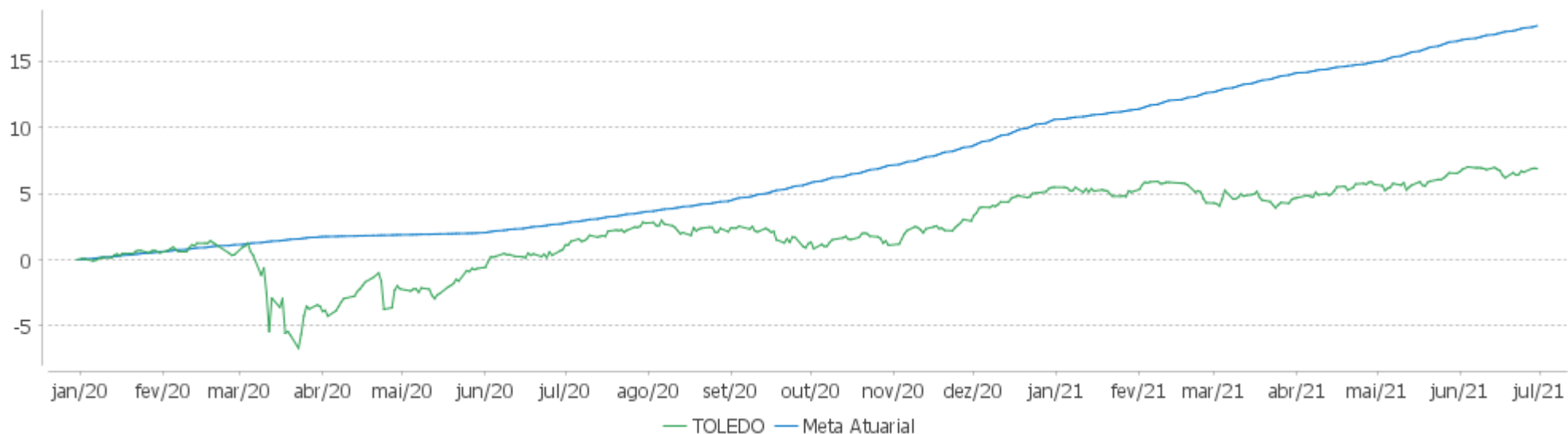
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	7	38,89	03 meses	2,14	3,28	-1,14	2,87
Meses abaixo - Meta Atuarial	11	61,11	06 meses	1,32	6,66	-5,34	3,30
			12 meses	6,06	15,37	-9,31	3,38
			24 meses				
Desde 31/12/2019				6,88	19,05	-12,17	6,39

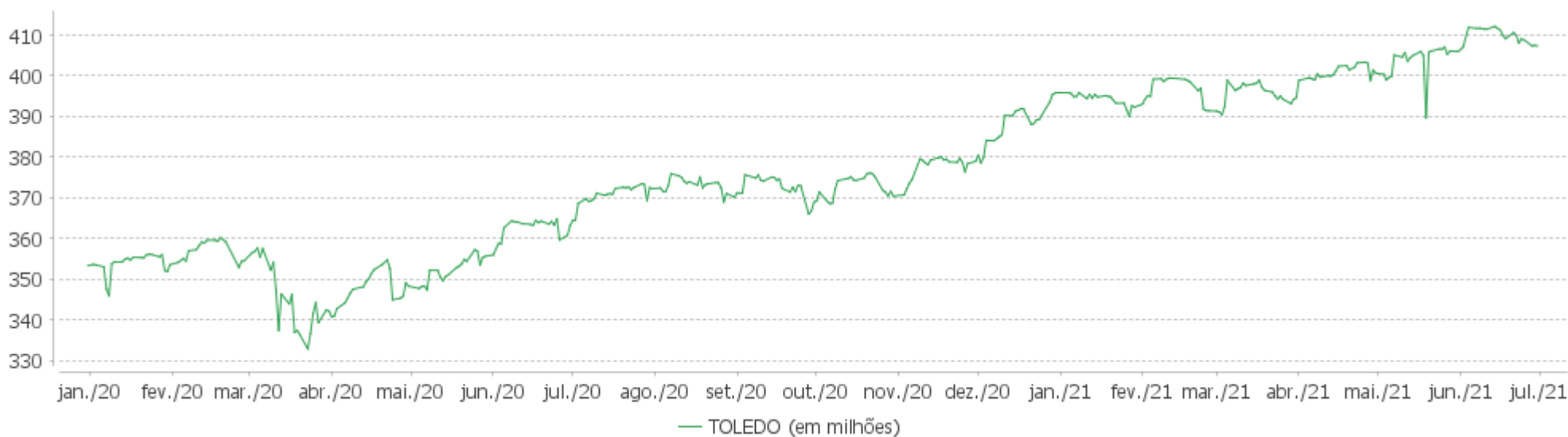
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,48	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-3,86	2020-03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

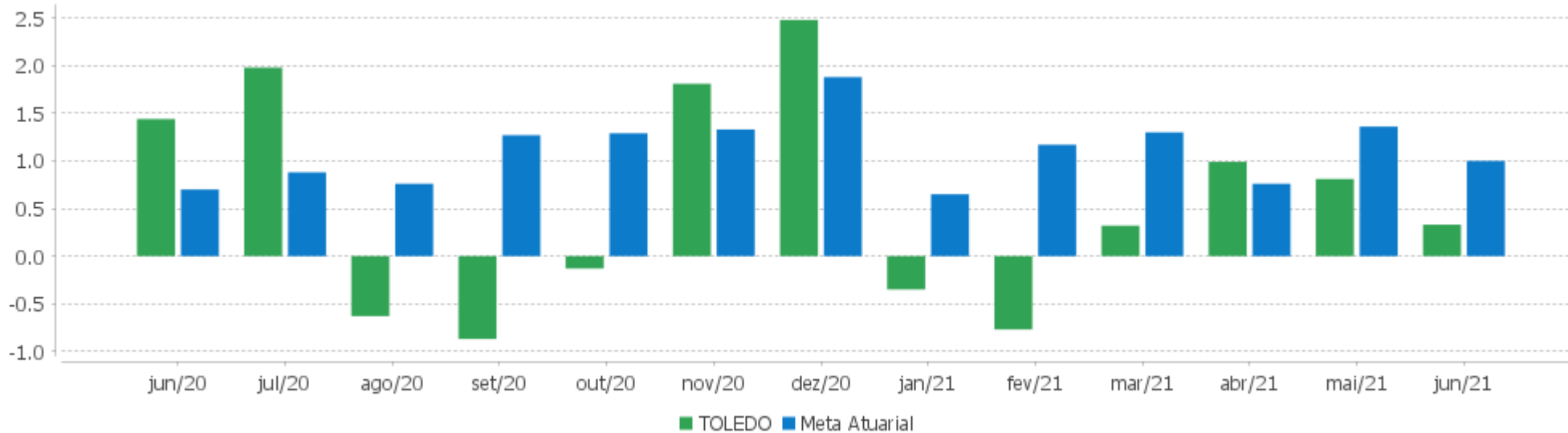


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,33 -0,75	1,69 -0,46	1,69 -0,46	0,14 0,86	4,84 -2,59	12,85 0,11	
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,40 -0,02	2,09 -0,06	2,09 -0,06	-0,84 -0,11	7,19 -0,24	12,04 -0,70	44,01 -1,16
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,15 -0,02	1,38 -0,05	1,38 -0,05	1,15 -0,13	5,77 -0,29	14,77 -0,64	31,38 -0,95
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,11 -0,21	1,22 -0,10	1,22 -0,10	-0,68 -0,34	2,58 -0,16	9,05 -0,18	26,47 0,17
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,00 -0,53	0,90 -0,78	0,90 -0,78	0,72 -3,05	2,68 -5,67	12,77 2,11	31,64 17,26
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,28 0,04	1,59 -0,32	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	0,64 -0,04	0,64 -0,04	0,70 -0,12	1,82 -0,21	7,71 -0,46	15,35 -0,64
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,18 -0,03	1,13 -0,13	1,13 -0,13	-1,69 -0,11	-0,09 -0,23	9,44 -0,53	26,47 -0,79
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	0,77 -0,06	2,63 -0,05	2,63 -0,05	-2,65 -0,11	8,33 -0,19	10,03 -0,63	53,95 -1,83
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,31 100,29	0,82 104,24	0,82 104,24	1,16 91,17	2,20 97,04	6,32 90,36	12,88 93,61
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,31 101,79	0,72 92,48	0,72 92,48	1,16 91,25	1,78 78,52	6,51 93,07	13,13 95,47
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,11 -0,42	0,83 -0,85	0,83 -0,85	0,72 -3,05	2,29 -6,06		
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	-0,17 -55,34	2,40 306,41	2,40 306,41	3,12 245,80	7,86 346,36	14,62 209,02	35,05 254,83
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	2,71 4,99	8,76 13,79	8,76 13,79	16,15 6,02	38,60 11,98	43,45 -47,24	
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	0,52 -0,12	7,73 -0,27	7,73 -0,27	2,70 -0,62	15,13 -1,76	31,80 -1,45	72,37 -6,41
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	1,09 0,62	12,50 3,78	12,50 3,78	11,45 4,91	37,31 3,91	42,22 16,63	95,16 20,90
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	1,80	10,18	10,18	2,73	26,66	27,74	79,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	1,33	1,46	1,46	-3,81	-6,74	2,15	5,58
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,56 -1,02	7,86 -0,86	7,86 -0,86	7,86 1,32	38,13 4,74	31,71 6,12	80,59 6,33
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL % do CDI	-3,46 -1.134,43	0,98 125,62	0,98 125,62	-7,63 -601,14	-1,27 -55,85	-6,81 -97,40	51,34 373,27
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	-0,21 -0,68	11,00 2,28	11,00 2,28	12,22 5,68	37,29 3,90	31,25 5,66	87,46 13,19
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,76 0,41	6,71 1,26	6,71 1,26	3,78 1,73	28,53 4,74	25,52 1,93	87,37 4,76
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	1,66 1,19	10,34 1,63	10,34 1,63	7,83 1,29	27,85 -5,55	34,45 8,87	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-1,19 -0,91	-4,36 -1,18	-4,36 -1,18	8,36 -1,70	26,23 -1,76	95,14 -2,99	110,45 -5,20
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	5,86 9,11	12,34 18,45	12,34 18,45	12,14 4,91	39,95 14,65		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,15 -2,17	-4,10 -7,24	-4,10 -7,24	2,21 -4,55	28,74 13,92		
TOLEDO Var. INPC + 4,90% p.p.	0,33 -0,72	2,14 -1,14	2,14 -1,14	1,32 -5,34	6,06 -9,06		
CDI	0,30	0,78	0,78	1,27	2,27	6,99	13,75
IBOVESPA	0,46	8,72	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27
INPC + 6,00%	1,09	3,42	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46
IPCA + 6,00%	1,02	3,15	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		0,80
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)	-	1,90
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
FIA CAIXA CONSUMO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,60
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	D+0	D+0		D +1		
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	D+1 du	D+0	D+23 du	D+25 du		1,50
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA DE UM DIA, APURADO PELA B3	2,50
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80

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	0,21	0,68	0,68	0,81	2,04	8,17	15,99	25,04	41,88
IRF-M 1+	0,22	1,54	1,54	-3,30	-1,09	10,57	31,78	44,01	70,12
IRF-M TOTAL	0,21	1,26	1,26	-1,58	0,14	9,97	27,26	38,64	61,89
IMA-B 5	-0,13	1,44	1,44	1,29	6,07	15,42	32,32	45,20	62,50
IMA-B 5+	0,83	2,69	2,69	-2,55	8,52	10,66	55,78	65,31	89,15
IMA-B TOTAL	0,42	2,14	2,14	-0,72	7,42	12,74	45,16	57,06	77,99
IMA-GERAL TOTAL	0,35	1,48	1,48	0,14	3,55	10,30	27,83	38,65	58,38
IDKA 2	-0,32	1,91	1,91	1,87	7,06	16,45	31,87	45,03	63,71
IDKA 20	1,07	3,85	3,85	-3,63	12,34	7,07	77,65	82,49	113,49
CDI	0,30	0,78	0,78	1,27	2,27	6,99	13,75	22,14	37,85

Renda Variável

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-2,27	-5,03	-5,03	10,13	26,62	90,69	105,09	168,14	219,09

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-2,19	-3,23	-3,23	-4,02	-1,83	4,90	29,63	32,82	68,17

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-3,25	-6,11	-6,11	7,23	25,29	79,54	84,88	134,07	181,00

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,53	1,68	1,68	3,77	8,35	10,66	14,38	19,40	22,99
INPC	0,60	1,95	1,95	3,95	9,22	11,78	15,49	19,56	22,62
IGPM	0,60	6,30	6,30	15,08	35,75	45,68	55,16	65,90	64,61
SELIC	0,30	0,78	0,78	1,27	2,27	6,99	13,76	22,15	37,89

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,86	2,66	2,66	5,77	12,66	19,69	28,60	39,56	49,47
IPCA + 5,00%	0,94	2,91	2,91	6,27	13,74	22,00	32,33	44,97	56,75
IPCA + 5,50%	0,98	3,03	3,03	6,51	14,28	23,16	34,23	47,73	60,50
IPCA + 5,89%	1,01	3,12	3,12	6,71	14,70	24,08	35,71	49,92	63,47
IPCA + 6,00%	1,02	3,15	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14	50,54	64,32
INPC + 4,00%	0,93	2,94	2,94	5,96	13,57	20,91	29,85	39,74	49,03
INPC + 6,00%	1,09	3,42	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
23	01/04/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.105.361,54	0,00	1.711.188,32709700	2,3991290000
24	13/04/2021	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	363.674,09	0,00	288.815,20942300	1,2591930000
25	15/04/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.913,29	0,00	4.125,19022200	2,4031110000
26	28/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	4.847.552,22	2.099.524,49764900	2,3088810000
27	29/04/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.470.929,80	0,00	1.640.373,99730800	1,5063210000
28	07/05/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.138.161,81	0,00	2.729.512,34795500	1,5160810000
29	11/05/2021	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	363.674,09	0,00	282.723,77155600	1,2863230000
30	19/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	15.000.000,00	6.539.455,36732000	2,2937690000
31	20/05/2021	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	10.000.000,00	0,00	67.148,93961755	148,9226793000
32	20/05/2021	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	5.000.000,00	0,00	24.949,46637777	200,4050878000
33	27/05/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.470.929,80	0,00	1.634.525,24986500	1,5117110000
34	27/05/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	4.873.004,58	2.000.948,76951300	2,4353470000
35	04/06/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.103.417,05	0,00	1.678.844,67703200	2,4441910000
36	08/06/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12.848,70	0,00	5.264,57903200	2,4405940000
37	11/06/2021	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	359.264,11	0,00	266.678,03112100	1,3471830000
38	23/06/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.964.920,04	811.789,07831600	2,4204810000
39	28/06/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	4.932.200,61	2.028.234,82624400	2,4317700000
40	28/06/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.470.929,80	0,00	1.600.033,28370900	1,5442990000
41	29/06/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	20.737,65	0,00	8.519,01817200	2,4342770000
Total			35.889.841,73	31.617.677,45		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 7.766.525,53

Value-At-Risk: 1,91%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO		1,91	1,91			407.367.326,89	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,35%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,67	0,30	0,02			62.269.556,79	15,29
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,15	0,01	0,01			38.961.888,68	9,56
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,48	0,10	0,01			34.116.654,02	8,37
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		3,62	0,04	0,07			6.738.715,85	1,65
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,51	0,09	0,28			32.563.057,61	7,99
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,44	0,05	0,06			18.191.689,67	4,47
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,24	0,05	0,27			20.720.525,39	5,09
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,15	0,15	1,16			67.473.414,51	16,56
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,03	0,03	1,35			9.234.780,00	2,27
Sub-total	2,80	1,45	0,82		-0,08	0,08	290.270.282,52	71,26

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,04	0,00	0,04			15.532.846,92	3,81
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,05	0,00	0,05			3.177.392,83	0,78
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		1,08	0,02	1,09			11.829.332,84	2,90
Sub-total	0,61	0,43	0,03		-0,12	0,23	30.539.572,59	7,50

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,38%

Artigo 8º II, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL		14,20	0,03	14,20			1.331.616,61	0,33
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA		8,43	0,10	4,08			6.052.949,31	1,49
FIA CAIXA CONSUMO		10,13	0,03	0,12			1.627.572,38	0,40
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		8,03	0,06	2,82			4.486.631,58	1,10
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		9,72	0,04	5,15			2.111.422,99	0,52
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI		10,40	0,07	5,62			3.448.938,17	0,85
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC		8,18	0,08	3,34			5.308.133,58	1,30
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		9,52	0,16	3,62			8.363.627,62	2,05
Sub-total	10,02	8,70	0,56		-0,01	0,16	32.730.892,24	8,03

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP		2,41	0,03	2,41			4.941.195,63	1,21
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,43	0,26	7,19			23.566.589,34	5,79
Sub-total	8,12	5,54	0,29		0,23	2,16	28.507.784,97	7,00

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,90%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		11,10	0,18	10,80			10.711.451,14	2,63
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		10,45	-0,00	10,45			5.022.726,51	1,23
Sub-total	8,22	8,94	0,18		0,39	3,51	15.734.177,65	3,86

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		9,34	0,04	1,35			9.584.616,92	2,35
Sub-total	11,23	9,34	0,04		-0,13	-1,19	9.584.616,92	2,35

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS