



**LDB**  
EMPRESAS

**TOLEDO**  
3º 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 30.09.2021.

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

RENDA FIXA

77,29%

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	5,31	-0,31	-0,16	-1,68	61.220.549,94	14,99	5.161.580.539,44	1,19
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,38	0,02	0,38	0,89	23.012.148,99	5,64	6.805.654.314,46	0,34
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,48	-0,06	0,98	1,13	34.502.265,89	8,45	11.150.255.278,19	0,31
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,27	-0,57	-1,27	-4,33	6.446.970,64	1,58	1.307.235.728,08	0,49
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,45	-0,04	1,08	1,21	40.532.726,87	9,93	11.068.272.487,58	0,37
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,91	-0,09	-0,37	-1,46	11.947.396,97	2,93	1.386.775.998,41	0,86
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,68	-0,10	-0,01	-0,70	20.574.924,87	5,04	8.672.013.980,14	0,24
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,43	-0,01	0,35	-1,87	61.310.708,30	15,02	14.407.320.968,51	0,43
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,66	-0,04	0,96	0,75	9.060.204,00	2,22	174.473.815,69	5,19
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,81</b>	<b>-0,11</b>	<b>0,34</b>	<b>-0,59</b>	<b>268.607.896,47</b>	<b>65,79</b>		

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	0,46	0,02	0,43	1,22	15.722.025,21	3,85	7.457.833.577,94	0,21
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,28	0,02	0,53	1,48	19.557.623,14	4,79	7.234.670.708,96	0,27
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,21	0,00	0,49	-1,52	11.649.791,64	2,85	1.036.012.764,97	1,12
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>0,89</b>	<b>0,01</b>	<b>0,49</b>	<b>0,32</b>	<b>46.929.439,99</b>	<b>11,49</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>2,60</b>	<b>-0,09</b>	<b>0,37</b>	<b>-0,50</b>	<b>315.537.336,46</b>	<b>77,29</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

16,31%

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	32,00	-0,34	-10,69	-23,22	1.022.413,20	0,25	273.686.159,23	0,37
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	19,91	0,01	-6,39	-14,86	5.153.502,29	1,26	863.750.937,27	0,60
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	21,66	0,02	-6,06	-14,65	1.389.073,79	0,34	328.305.295,69	0,42
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,49	-0,18	-6,49	-10,65	4.009.012,46	0,98	1.005.326.835,22	0,40
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	22,04	-0,13	-6,52	-15,87	1.776.250,04	0,44	1.047.084.854,27	0,17
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	20,58	0,10	-7,85	-12,60	3.014.469,70	0,74	1.904.987.634,24	0,16
ITAU	ITAU	ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	18,12	-0,26	-6,52	-11,40	4.703.245,22	1,15	3.106.281.742,93	0,15
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	18,60	-0,04	-5,52	-12,57	8.301.801,59	2,03	970.935.376,15	0,86
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>18,96</b>	<b>-0,09</b>	<b>-6,48</b>	<b>-13,25</b>	<b>29.369.768,29</b>	<b>7,19</b>		

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	3,71	-0,02	-0,74	-2,45	4.820.103,79	1,18	4.076.882.979,35	0,12
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,92	-1,29	-4,64	1,14	32.409.789,25	7,94	3.166.279.756,52	1,02
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>9,17</b>	<b>-1,13</b>	<b>-4,13</b>	<b>0,49</b>	<b>37.229.893,04</b>	<b>9,12</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>14,63</b>	<b>-0,67</b>	<b>-5,24</b>	<b>-6,55</b>	<b>66.599.661,33</b>	<b>16,31</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,40%

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	17,87	-0,18	-5,03	-0,77	10.628.460,75	2,60	610.901.887,68	1,74
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,66	-0,24	0,61	3,25	5.186.033,77	1,27	1.564.765.916,12	0,33
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>10,66</b>	<b>-0,20</b>	<b>-3,25</b>	<b>0,51</b>	<b>15.814.494,52</b>	<b>3,87</b>		

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	18,24	-0,44	-0,25	7,72	10.324.329,66	2,53	3.337.438.389,61	0,31
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>18,24</b>	<b>-0,44</b>	<b>-0,25</b>	<b>7,72</b>	<b>10.324.329,66</b>	<b>2,53</b>		
Investimentos no Exterior			17,36	-0,29	-2,09	3,24	26.138.824,18	6,40		
<b>Total</b>			<b>3,30</b>	<b>-0,20</b>	<b>-0,71</b>	<b>-1,26</b>	<b>408.275.821,97</b>	<b>100,00</b>		

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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	268.607.896,47	65,79	0,00	67,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	46.929.439,99	11,49	0,00	7,00	40,00	0,00	50,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>315.537.336,46</b>	<b>77,29</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	29.369.768,29	7,19	0,00	15,00	20,00	0,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	37.229.893,04	9,12	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>66.599.661,33</b>	<b>16,31</b>					40,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	15.814.494,52	3,87	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	10.324.329,66	2,53	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>26.138.824,18</b>	<b>6,40</b>					10,00
<b>Total</b>		<b>408.275.821,97</b>	<b>100,00</b>					

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	0,34 78,47	-0,59 -48,34	-0,59 -48,34	0,74 36,70	2,76 92,22	942.489,29	-1.758.287,42
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,49 111,24	0,32 25,81	0,32 25,81	1,09 54,20	2,20 73,57	227.656,38	195.303,63
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-6,48 0,08	-13,25 -0,78	-13,25 -0,78	-5,40 -0,55	11,83 -5,48	-2.030.837,20	-4.440.186,56
Artigo 8º III % do CDI	-4,13 -941,89	0,49 40,46	0,49 40,46	7,52 373,07	18,36 614,00	-1.520.884,25	-38.188,48
Artigo 9º II % do CDI	-3,25 -742,65	0,51 41,74	0,51 41,74			-531.981,55	80.316,87
Artigo 9º III % do CDI	-0,25 -57,07	7,72 631,10	7,72 631,10	3,03 150,20	18,25 610,37	-25.885,44	739.712,74
<b>TOLEDO (Total)</b>						<b>-2.939.442,77</b>	<b>-5.221.329,22</b>

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	20.576.017,88	0,00	0,00	0,00	20.574.924,87	-1.093,01	-145.600,52
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.974.026,00	0,00	0,00	0,00	9.060.204,00	86.178,00	65.455,47
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	35.855.714,75	4.251.170,70	0,00	0,00	40.532.726,87	425.841,42	482.038,07
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	34.167.064,76	0,00	0,00	0,00	34.502.265,89	335.201,13	385.611,87
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.529.581,08	0,00	0,00	0,00	6.446.970,64	-82.610,44	-291.745,21
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	61.316.065,64	0,00	0,00	0,00	61.220.549,94	-95.515,70	-1.049.006,85
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.925.444,85	0,00	0,00	0,00	23.012.148,99	86.704,14	244.824,08
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11.991.661,30	0,00	0,00	0,00	11.947.396,97	-44.264,33	-188.077,18
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	65.979.579,28	0,00	-4.900.919,06	0,00	61.310.708,30	232.048,08	-1.261.787,15
					268.607.896,47	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	19.454.562,88	0,00	0,00	0,00	19.557.623,14	103.060,26	185.666,54
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.654.569,04	0,00	0,00	0,00	15.722.025,21	67.456,17	189.178,29
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	11.592.651,69	0,00	0,00	0,00	11.649.791,64	57.139,95	-179.541,20
					46.929.439,99	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	5.505.557,35	0,00	0,00	0,00	5.153.502,29	-352.055,06	-899.447,02
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	1.144.732,76	0,00	0,00	0,00	1.022.413,20	-122.319,56	-309.203,41
FIA CAIXA CONSUMO	1.478.734,61	0,00	0,00	0,00	1.389.073,79	-89.660,82	-238.498,59
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.900.236,17	0,00	0,00	0,00	1.776.250,04	-123.986,13	-335.172,95
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.287.054,71	0,00	0,00	0,00	4.009.012,46	-278.042,25	-477.619,12
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	8.421.844,79	359.628,70	0,00	0,00	8.301.801,59	-479.671,90	-1.140.888,64
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	5.031.380,81	0,00	0,00	0,00	4.703.245,22	-328.135,59	-604.888,36
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	3.271.435,59	0,00	0,00	0,00	3.014.469,70	-256.965,89	-434.468,47
					29.369.768,29	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	31.423.819,17	2.470.929,80	0,00	0,00	32.409.789,25	-1.484.959,72	82.903,36
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	4.856.028,32	0,00	0,00	0,00	4.820.103,79	-35.924,53	-121.091,84
					37.229.893,04	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	11.191.809,44	0,00	0,00	0,00	10.628.460,75	-563.348,69	-82.990,39
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	5.154.666,63	0,00	0,00	0,00	5.186.033,77	31.367,14	163.307,26
					15.814.494,52	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	10.350.215,10	0,00	0,00	0,00	10.324.329,66	-25.885,44	739.712,74
					10.324.329,66	0,00	0,00

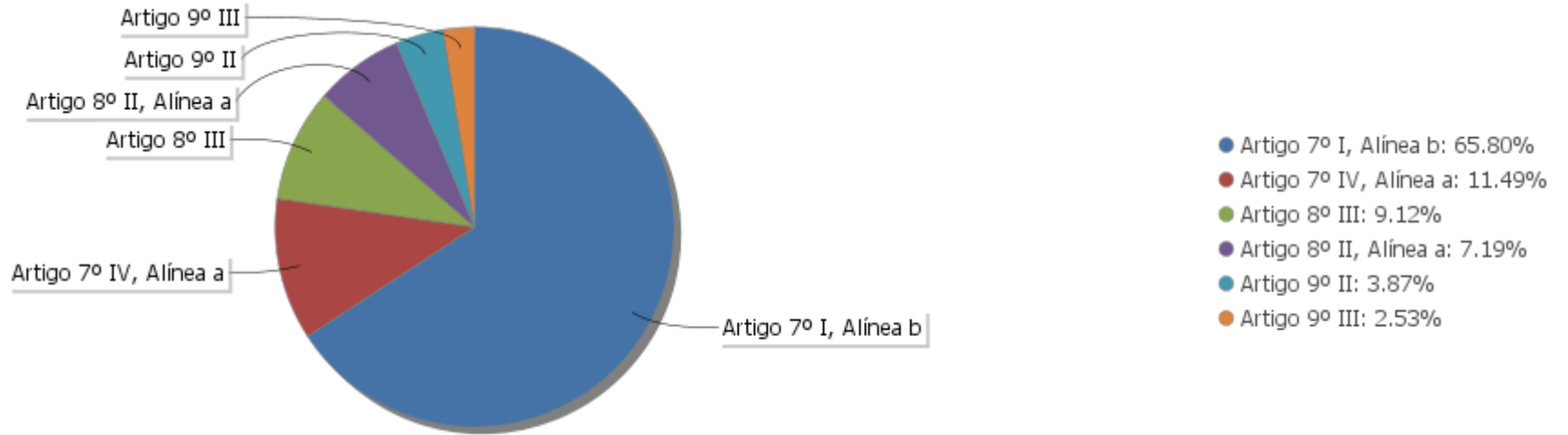
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

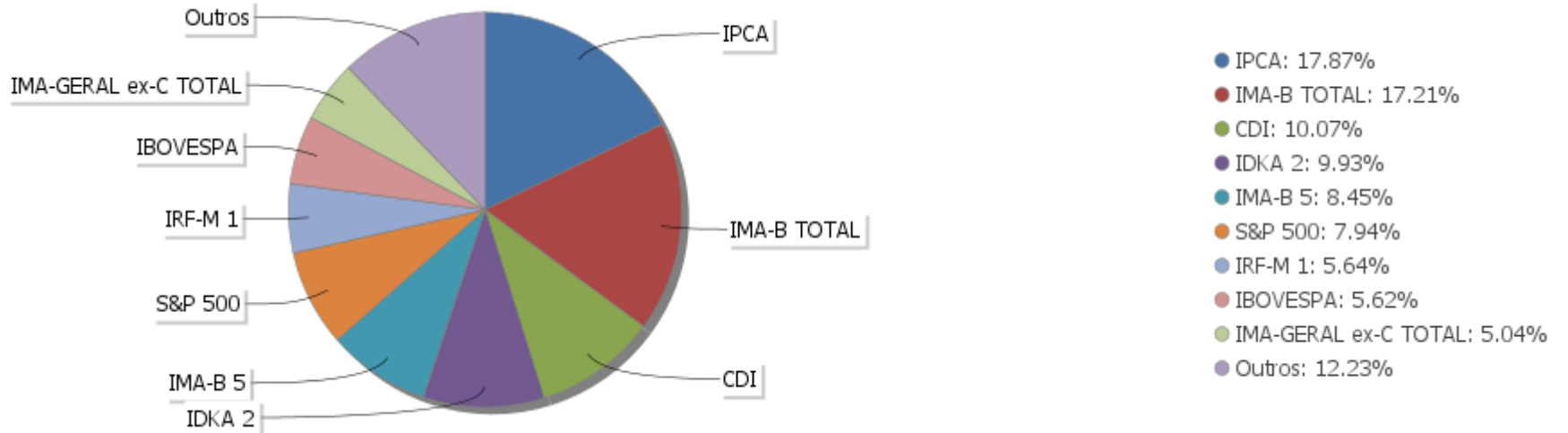
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	374.033.586,71	91,61	374.033.586,71	91,61	
de 31 dias a 365 dias	25.182.031,26	6,17	399.215.617,97	97,78	
acima de 365 dias	9.060.204,00	2,22	408.275.821,97	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

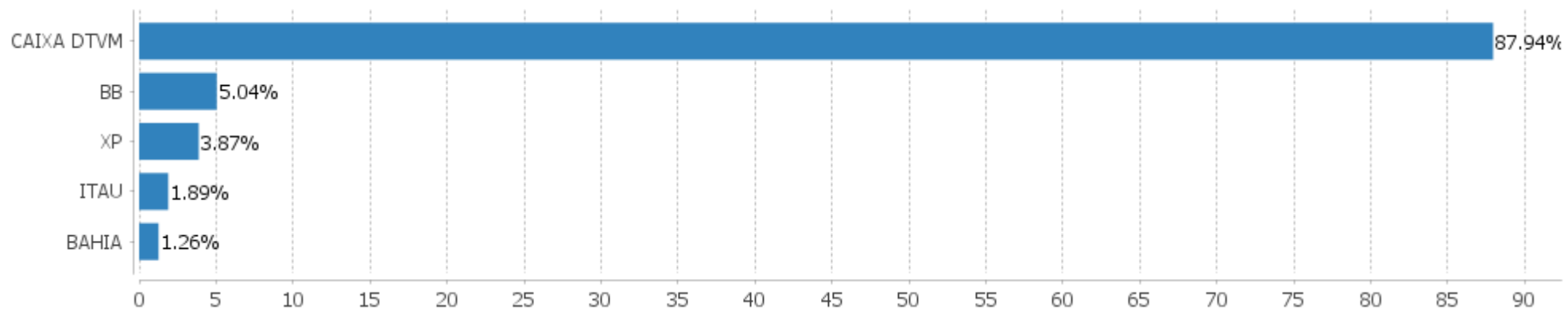


Alocação Por Estratégia



## 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	-0,23	-0,33	-0,71				0,05
INPC + 5,42%	0,69	1,20	1,35	0,80	1,41	1,04	1,49	1,35	1,65				11,51
p.p. indexador	-1,04	-1,97	-1,02	0,19	-0,60	-0,72	-1,71	-1,67	-2,36				-11,47
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**

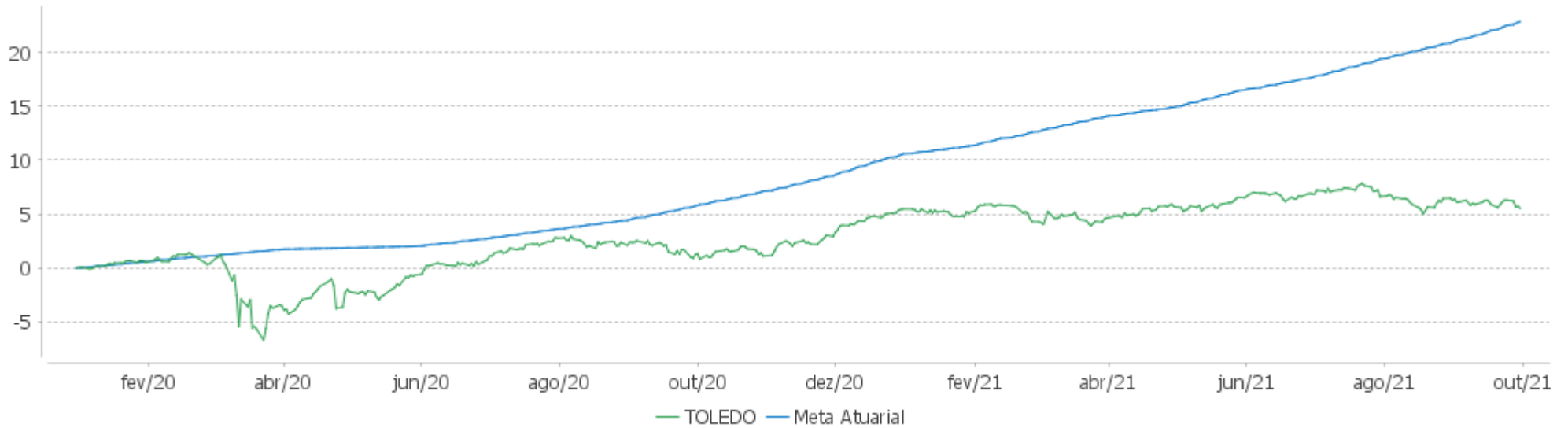
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	7	33,33	03 meses	-1,26	4,55	-5,81	3,49
Meses abaixo - Meta Atuarial	14	66,67	06 meses	0,85	7,98	-7,13	3,22
			12 meses	4,25	16,89	-12,64	3,30
			24 meses				
Desde 31/12/2019				5,53	24,46	-18,93	6,05

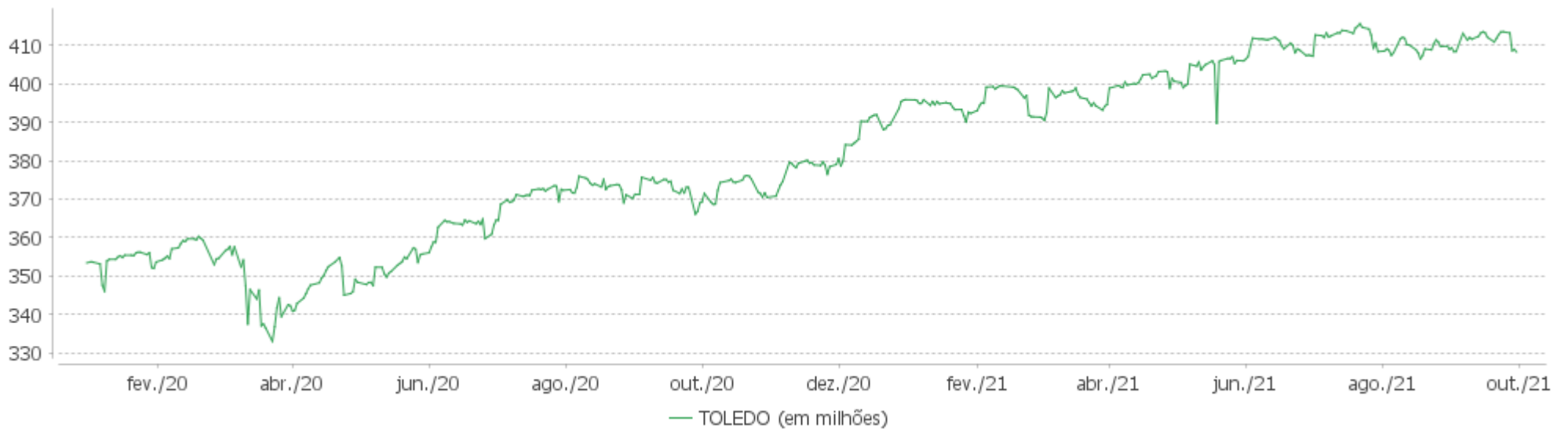
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,48	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-3,86	2020-03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

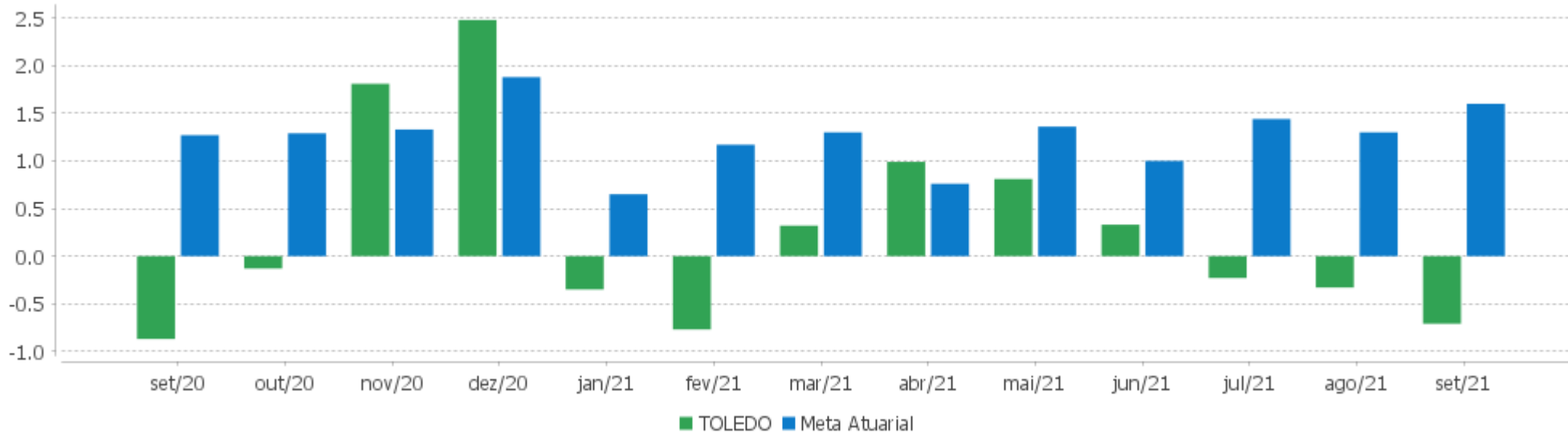


Patrimônio Líquido



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.	0,96 1,09	0,75 2,34	0,75 2,34	2,45 1,93	4,85 0,14	12,86 5,94	
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,16 -0,02	-1,68 -0,09	-1,68 -0,09	0,37 -0,15	4,45 -0,26	6,20 -0,72	39,29 -1,17
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,98 -0,02	1,13 -0,05	1,13 -0,05	2,53 -0,11	5,69 -0,26	13,00 -0,62	30,19 -0,93
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,01 -0,03	-0,70 -0,28	-0,70 -0,28	0,51 -0,38	1,75 -0,30	5,52 -0,51	23,63 0,04
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,35 -0,81	-1,87 -4,89	-1,87 -4,89	-0,98 -5,73	0,85 -9,39	7,32 -6,38	26,96 9,96
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,08 -0,02	1,21 0,03	1,21 0,03	2,82 -0,30	5,92 -0,29	13,71 -1,00	27,67 -1,78
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,38 -0,02	0,89 -0,07	0,89 -0,07	1,54 -0,11	2,25 -0,25	6,68 -0,47	14,44 -0,68
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,37 -0,04	-1,46 -0,07	-1,46 -0,07	-0,35 -0,20	-1,25 -0,24	4,97 -0,50	22,56 -0,66
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,27 -0,01	-4,33 -0,14	-4,33 -0,14	-1,81 -0,20	2,97 -0,24	0,80 -0,67	45,16 -1,83
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,43 98,33	1,22 99,59	1,22 99,59	1,95 96,79	2,87 95,82	6,17 92,70	12,78 95,72
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,53 120,89	1,48 120,99	1,48 120,99	2,31 114,51	3,31 110,66	6,30 94,74	12,82 96,01
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,49 -0,67	-1,52 -4,54	-1,52 -4,54	-0,70 -5,45	0,74 -9,50		
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	-0,74 -168,82	-2,45 -200,40	-2,45 -200,40	-0,11 -5,60	4,85 162,19	8,05 120,97	28,60 214,26
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-4,64 -5,36	1,14 -7,86	1,14 -7,86	9,99 6,48	30,71 7,20	42,05 -46,96	
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-6,06 -0,11	-14,65 -0,32	-14,65 -0,32	-8,05 -0,57	-3,11 -1,44	-4,25 -1,56	46,00 -4,47
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-7,85 -1,29	-12,60 -0,12	-12,60 -0,12	-3,70 1,15	6,92 -10,39	6,10 0,15	53,19 13,32
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-6,52	-15,87	-15,87	-5,36	13,95	9,19	65,50



## 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.	0,04	-3,40	-3,40	-0,51	-3,36	3,24	25,63
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,39 0,17	-14,86 -2,38	-14,86 -2,38	-8,17 -3,32	15,13 -2,18	9,21 3,26	41,75 1,88
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL % do CDI	-10,69 -2.438,38	-23,22 -1.898,77	-23,22 -1.898,77	-22,47 -1.115,15	-16,16 -540,27	-33,94 -510,08	17,09 128,03
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	-6,52 0,05	-11,40 1,08	-11,40 1,08	-1,65 3,20	19,26 1,95	6,71 0,75	56,58 16,71
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-6,49 -2,00	-10,65 -4,05	-10,65 -4,05	-4,65 -3,14	15,95 -3,63	7,86 0,01	66,44 1,61
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	-5,52 1,04	-12,57 -0,09	-12,57 -0,09	-3,53 1,32	12,03 -5,28	9,28 3,32	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-0,25 -0,08	7,72 -0,42	7,72 -0,42	3,03 -1,68	18,25 -2,79	90,64 -3,38	101,42 -4,69
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-5,03 -6,26	-0,77 -7,94	-0,77 -7,94	11,47 10,86	25,20 4,14		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,61 -1,04	3,25 -1,33	3,25 -1,33	-0,98 -8,85	8,39 -8,45		
TOLEDO Var. INPC + 4,90% p.p.	-0,71 -2,36	-1,26 -5,81	-1,26 -5,81	0,85 -7,13	4,25 -12,51		
CDI	0,44	1,22	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35
IBOVESPA	-6,57	-12,48	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87
INPC + 6,00%	1,69	4,69	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02
IPCA + 6,00%	1,65	4,58	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28

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

Renda Variável

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

**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	0,73	8,99	8,99	3,52	23,52	89,01	100,82	193,57	232,88

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,24	-1,42	-1,42	-4,61	-2,83	1,17	27,21	22,27	49,54

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	1,23	7,16	7,16	0,61	21,06	78,00	83,86	150,21	184,12

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	1,16	3,02	3,02	4,75	10,25	13,70	16,99	22,29	25,39
INPC	1,20	3,13	3,13	5,14	10,78	15,09	18,46	23,16	25,17
IGPM	-0,64	0,80	0,80	7,15	24,86	47,25	52,21	67,49	65,07
SELIC	0,44	1,22	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,91	34,89

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,49	4,07	4,07	6,84	14,64	22,96	31,56	42,95	52,39
IPCA + 5,00%	1,57	4,32	4,32	7,36	15,74	25,33	35,38	48,50	59,82
IPCA + 5,50%	1,61	4,45	4,45	7,61	16,29	26,53	37,32	51,33	63,64
IPCA + 5,89%	1,64	4,55	4,55	7,81	16,71	27,46	38,84	53,57	66,67
IPCA + 6,00%	1,65	4,58	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28	54,21	67,53
INPC + 4,00%	1,53	4,18	4,18	7,24	15,20	24,46	33,20	43,97	52,12
INPC + 6,00%	1,69	4,69	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
42	02/07/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.086.715,55	0,00	1.676.014,04472033	2,4383540000
43	12/07/2021	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	360.006,95	0,00	266.552,16251075	1,3506060000
44	28/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	6.056.215,52	2.620.109,54229319	2,3114360000
45	28/07/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.470.929,80	0,00	1.557.432,04871478	1,5865410000
46	29/07/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.107.475,68	0,00	697.257,92499040	1,5883300000
47	30/07/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	4.580,67	1.882,67937604	2,4330590000
48	09/08/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.117.236,87	0,00	1.695.675,95384000	2,4280800000
49	10/08/2021	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	359.426,96	0,00	280.072,37387500	1,2833360000
50	12/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	16.194.563,77	6.139.034,30234000	2,6379660000
51	12/08/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	15.385.185,51	0,00	4.042.368,42623800	3,8059830000
52	13/08/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	809.378,26	0,00	212.576,51016300	3,8074680000
53	20/08/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	240.031,47	0,00	149.360,80091600	1,6070580000
54	27/08/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.470.929,80	0,00	1.514.251,46603400	1,6317830000
55	27/08/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	4.962.911,26	2.036.398,66210900	2,4371020000
56	06/09/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.120.915,01	0,00	1.688.309,37791010	2,4408530000
57	14/09/2021	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	359.628,70	0,00	292.844,84696088	1,2280520000
58	28/09/2021	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	4.900.919,06	3.275.796,44408796	1,4961000000
59	28/09/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.470.929,80	0,00	1.561.367,59719489	1,5825420000
60	30/09/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	130.255,69	0,00	52.861,92297796	2,4640740000
<b>Total</b>			<b>38.489.046,05</b>	<b>32.119.190,28</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 7.192.884,72

Value-At-Risk: 1,76%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO		1,76	1,76			408.275.821,97	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,33%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,95	0,34	0,02			61.220.549,94	14,99
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,18	0,00	0,00			23.012.148,99	5,64
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,23	0,07	0,01			34.502.265,89	8,45
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		4,07	0,05	0,07			6.446.970,64	1,58
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,04	0,06	0,60			40.532.726,87	9,93
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,49	0,03	0,03			11.947.396,97	2,93
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,11	0,04	0,19			20.574.924,87	5,04
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,46	0,15	1,46			61.310.708,30	15,02
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,63	0,03	1,80			9.060.204,00	2,22
<b>Sub-total</b>	1,94	1,51	0,79		-0,05	0,34	268.607.896,47	65,79

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,03	0,00	0,02			15.722.025,21	3,85
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,05	0,00	0,04			19.557.623,14	4,79
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		1,20	0,02	1,20			11.649.791,64	2,85
<b>Sub-total</b>	0,18	0,31	0,02		0,28	0,49	46.929.439,99	11,49

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,25%

Artigo 8º II, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL		12,49	0,02	12,49			1.022.413,20	0,25
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA		9,56	0,10	3,54			5.153.502,29	1,26
FIA CAIXA CONSUMO		10,46	0,03	0,88			1.389.073,79	0,34
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		7,63	0,06	2,24			4.009.012,46	0,98
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		11,60	0,04	5,06			1.776.250,04	0,44
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI		9,59	0,06	4,26			3.014.469,70	0,74
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC		8,31	0,08	3,78			4.703.245,22	1,15
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		9,46	0,16	3,13			8.301.801,59	2,03
<b>Sub-total</b>	23,70	9,00	0,54		-0,29	-6,48	29.369.768,29	7,19

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP		2,01	0,02	2,01			4.820.103,79	1,18
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,26	0,34	6,33			32.409.789,25	7,94
<b>Sub-total</b>	11,58	5,57	0,36		-0,39	-4,13	37.229.893,04	9,12

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 4,93%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		5,96	0,08	7,33			10.628.460,75	2,60
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		7,72	-0,01	7,71			5.186.033,77	1,27
<b>Sub-total</b>	13,67	5,10	0,06		-0,27	-3,25	15.814.494,52	3,87

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,65	-0,00	1,22			10.324.329,66	2,53
<b>Sub-total</b>	14,25	6,65	-0,00		-0,05	-0,25	10.324.329,66	2,53



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS