



LDB
EMPRESAS

COTIA
JUNHO 2021



Prezados Senhores,

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

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

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

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

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA									63,81%
Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,35	0,18	0,65	18.559.665,32	2,22	7.575.446.149,90	0,24
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	6,81	0,42	-2,17	8.789.838,62	1,05	922.550.107,47	0,95
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,73	0,38	-0,82	35.524.937,89	4,25	7.399.889.507,38	0,48
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,72	0,40	-0,84	30.371.909,35	3,63	5.867.854.510,24	0,52
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,33	0,19	0,70	15.255.628,25	1,82	8.267.613.291,28	0,18
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,55	-0,15	1,15	156.724.212,38	18,74	14.363.834.668,17	1,09
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,32	-0,09	1,42	37.592.189,64	4,49	10.494.201.076,30	0,36
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,47	-0,28	1,56	59.701.257,58	7,14	11.796.463.834,87	0,51
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,33	-0,00	0,72	105.907.584,82	12,66	16.058.908.177,46	0,66
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,24	0,04	0,77	468.427.223,85	56,00		
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
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,14	0,46	-0,86	4.474.720,54	0,53	738.649.837,57	0,61
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,26	0,31	1,16	8.991.714,97	1,07	5.582.841.841,27	0,16
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	0,33	1,32	19.982.228,09	2,39	3.920.215.063,90	0,51
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,15	0,22	0,76	359.282,53	0,04	2.307.212.680,54	0,02
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,47	0,29	1,01	4.854.380,20	0,58	3.457.648.238,53	0,14
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	3,32	0,05	-0,39	16.484.278,38	1,97	4.294.022.962,49	0,38
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,63	0,25	1,03	10.188.024,74	1,22	2.266.031.148,62	0,45
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,17	0,25	0,59	65.334.629,45	7,81		
Renda Fixa			2,12	0,06	0,75	533.761.853,30	63,81		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

28,62%

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA BRASIL IBX-50	21,27	0,57	9,68	12.812.277,85	1,53	1.136.746.337,38	1,13
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,43	0,88	9,21	23.615.971,76	2,82	1.350.902.525,33	1,75
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			20,74	0,77	9,38	36.428.249,61	4,35		

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
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	18,86	-1,00	4,14	19.512.904,42	2,33	1.046.329.192,00	1,86
SAFRA	SAFRA	SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	18,82	-1,66	1,05	5.760.702,60	0,69	279.070.667,01	2,06
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	19,63	0,58	6,06	5.627.062,98	0,67	1.067.836.124,71	0,53
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	20,71	1,61	7,97	3.994.575,48	0,48	1.762.410.329,14	0,23
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	19,52	-0,48	5,60	15.611.115,22	1,87	840.588.804,87	1,86
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,69	-1,76	3,78	15.943.102,31	1,91	1.018.349.879,65	1,57
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	20,91	1,80	2,73	8.704.734,76	1,04	2.253.324.643,65	0,39
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,97	-0,21	12,22	4.114.341,96	0,49	3.594.423.115,17	0,11
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	20,64	-0,77	8,57	5.607.050,55	0,67	1.229.908.816,68	0,46
BB	BB	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	20,63	-0,80	8,97	5.051.495,33	0,60	1.117.769.353,36	0,45
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	18,75	1,66	7,83	11.358.280,27	1,36	1.144.591.390,81	0,99
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	19,39	0,53	5,83	9.932.609,79	1,19	400.277.137,03	2,48
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	18,13	3,15	12,82	6.486.344,17	0,78	479.987.956,76	1,35
SAFRA	SAFRA	SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	21,64	2,45	16,53	3.843.504,61	0,46	111.855.873,47	3,44
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			18,53	0,04	5,79	121.547.824,45	14,53		

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 PREV MULTIMERCADO FI LP	1,54	0,20	1,26	13.096.386,24	1,57	392.131.692,22	3,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	14,90	2,69	15,79	8.556.756,21	1,02	1.411.901.589,68	0,61
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	2,96	0,16	0,67	3.674.153,96	0,44	117.051.042,43	3,14
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	15,05	2,71	16,15	47.175.391,52	5,64	2.298.502.554,43	2,05
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	15,07	2,68	16,13	8.922.675,71	1,07	2.196.560.023,20	0,41
Sub-total Artigo 8º III			5,32	1,86	8,66	81.425.363,64	9,73		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			16,67	0,84	7,27	239.401.437,70	28,62		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,57%

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	21,15	-1,19	8,36	37.357.396,80	4,47	2.860.128.891,15	1,31
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	21,13	-0,21	10,51	25.987.840,93	3,11	3.078.622.401,97	0,84
Sub-total Artigo 9º A, III			20,73	-0,79	9,23	63.345.237,73	7,57		
Investimentos no Exterior			20,73	-0,79	9,23	63.345.237,73	7,57		
Total			3,95	0,12	2,69	836.508.528,73	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	468.427.223,85	56,00	58,00	58,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	65.334.629,45	7,81	5,00	5,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	533.761.853,30	63,81					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	36.428.249,61	4,35	0,00	4,00	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	121.547.824,45	14,53	11,00	18,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	81.425.363,64	9,73	5,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	239.401.437,70	28,62					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	63.345.237,73	7,57	7,00	7,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	63.345.237,73	7,57					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	0,04 13,04	0,77 59,89	1,29 164,14	0,77 59,89	4,41 193,58	89.436,61	3.742.256,47
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,25 80,20	0,59 46,33	1,07 135,55	0,59 46,33	2,57 112,87	161.552,79	400.429,29
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,77 0,31	9,38 2,84	10,12 1,40	9,38 2,84	35,76 2,36	278.412,91	3.122.805,51
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,04 -0,43	5,79 -0,75	9,00 0,28	5,79 -0,75	27,29 -6,11	-72.235,23	6.268.625,85
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	1,86 1,39	8,66 2,12	5,58 -3,13	8,66 2,12	10,41 -22,98	992.304,33	3.142.536,19
Artigo 9º A, III % do CDI	-0,79 -256,27	9,23 722,71	-3,02 -383,19	9,23 722,71	27,01 1.186,58	-499.308,61	4.967.813,93
COTIA (Total)						950.162,80	21.644.467,24

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 IDKA2	37.627.374,43	0,00	0,00	0,00	37.592.189,64	-35.184,79	525.562,19
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	35.363.889,86	28.443,69	0,00	0,00	35.524.937,89	132.604,34	-291.278,96
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	22.794.623,34	0,00	-4.275.335,39	0,00	18.559.665,32	40.377,37	166.029,39
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	59.867.268,78	0,00	0,00	0,00	59.701.257,58	-166.011,20	918.897,76
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	136.841.329,37	20.000.000,00	0,00	0,00	156.724.212,38	-117.116,99	1.647.133,07
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	30.250.494,50	0,00	0,00	0,00	30.371.909,35	121.414,85	-255.805,26
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	70.175.413,66	0,00	-55.000.000,00	0,00	15.255.628,25	80.214,59	472.373,75
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	105.910.778,92	0,00	0,00	0,00	105.907.584,82	-3.194,10	754.295,49
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	8.753.506,08	0,00	0,00	0,00	8.789.838,62	36.332,54	-194.950,96
					468.427.223,85	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	16.476.562,84	0,00	0,00	0,00	16.484.278,38	7.715,54	-65.179,23
BB PREV RF FLUXO FIC	661.481,04	756,05	-304.291,36	0,00	359.282,53	1.336,80	7.537,38
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	19.916.722,45	0,00	0,00	0,00	19.982.228,09	65.505,64	242.115,64
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.964.302,52	0,00	0,00	0,00	8.991.714,97	27.412,45	102.832,36
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	4.840.517,67	0,00	0,00	0,00	4.854.380,20	13.862,53	48.393,15
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	10.162.795,75	0,00	0,00	0,00	10.188.024,74	25.228,99	103.661,31
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4.454.229,70	0,00	0,00	0,00	4.474.720,54	20.490,84	-38.931,32
					65.334.629,45	0,00	0,00

Artigo 8º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	23.409.859,62	0,00	0,00	0,00	23.615.971,76	206.112,14	1.992.273,64
FIA BRASIL IBX-50	12.739.977,08	0,00	0,00	0,00	12.812.277,85	72.300,77	1.130.531,87
					36.428.249,61	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	3.187.683,04	750.000,00	0,00	0,00	3.994.575,48	56.892,44	244.575,48
BB AÇÕES DIVIDENDOS	19.709.963,75	0,00	0,00	0,00	19.512.904,42	-197.059,33	785.221,97
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	2.579.718,38	2.538.548,47	0,00	0,00	5.051.495,33	-66.771,52	103.384,55
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	3.143.372,15	2.535.148,02	0,00	0,00	5.607.050,55	-71.469,62	87.786,59
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	16.228.229,36	0,00	0,00	0,00	15.943.102,31	-285.127,05	598.167,78
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	15.685.799,74	0,00	0,00	0,00	15.611.115,22	-74.684,52	840.720,17
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	9.622.239,32	1.583.239,98	0,00	0,00	11.358.280,27	152.800,97	747.335,06
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	4.123.042,78	0,00	0,00	0,00	4.114.341,96	-8.700,82	448.096,69
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	5.594.486,29	0,00	0,00	0,00	5.627.062,98	32.576,69	344.729,36
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	8.550.949,24	0,00	0,00	0,00	8.704.734,76	153.785,52	231.170,81
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	9.667.738,45	215.100,00	0,00	0,00	9.932.609,79	49.771,34	534.481,02
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	5.980.424,53	315.100,00	0,00	0,00	6.486.344,17	190.819,64	697.919,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	5.857.751,21	0,00	0,00	0,00	5.760.702,60	-97.048,61	59.872,84
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	3.751.524,97	0,00	0,00	0,00	3.843.504,61	91.979,64	545.164,09
					121.547.824,45	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	3.073.808,01	600.165,49	0,00	0,00	3.674.153,96	180,46	15.484,41
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	13.070.223,62	0,00	0,00	0,00	13.096.386,24	26.162,62	162.979,55
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	9.531.407,45	37.100.000,00	0,00	0,00	47.175.391,52	543.984,07	1.303.632,98
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	7.746.593,51	960.000,00	0,00	0,00	8.922.675,71	216.082,20	862.262,61
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	7.490.861,23	860.000,00	0,00	0,00	8.556.756,21	205.894,98	798.176,64
					81.425.363,64	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	37.401.484,98	400.000,00	0,00	0,00	37.357.396,80	-444.088,18	2.625.461,32
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	26.043.061,36	0,00	0,00	0,00	25.987.840,93	-55.220,43	2.342.352,61
					63.345.237,73	0,00	0,00

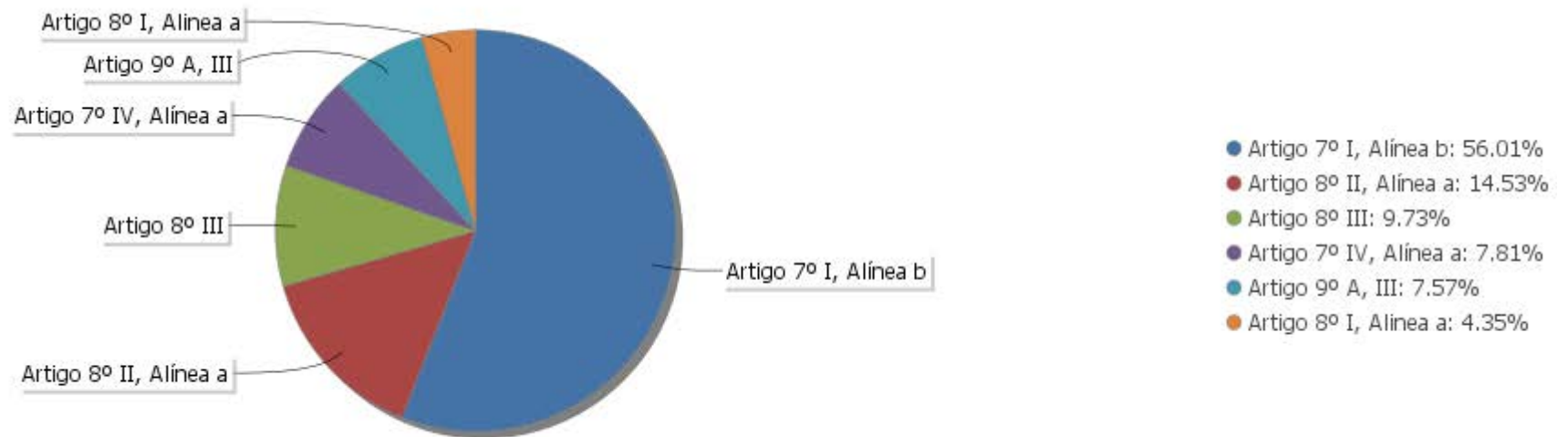
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

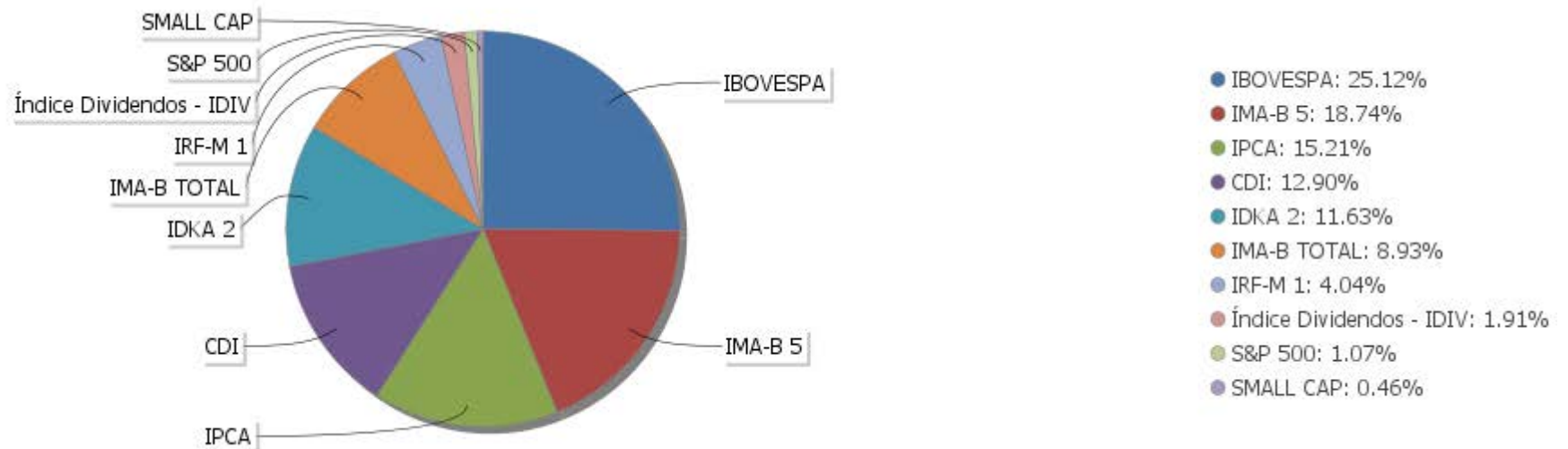
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	758.750.949,70	90,70	758.750.949,70	90,70
de 31 a 365 dias	77.757.579,03	9,30	836.508.528,73	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	836.508.528,73	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

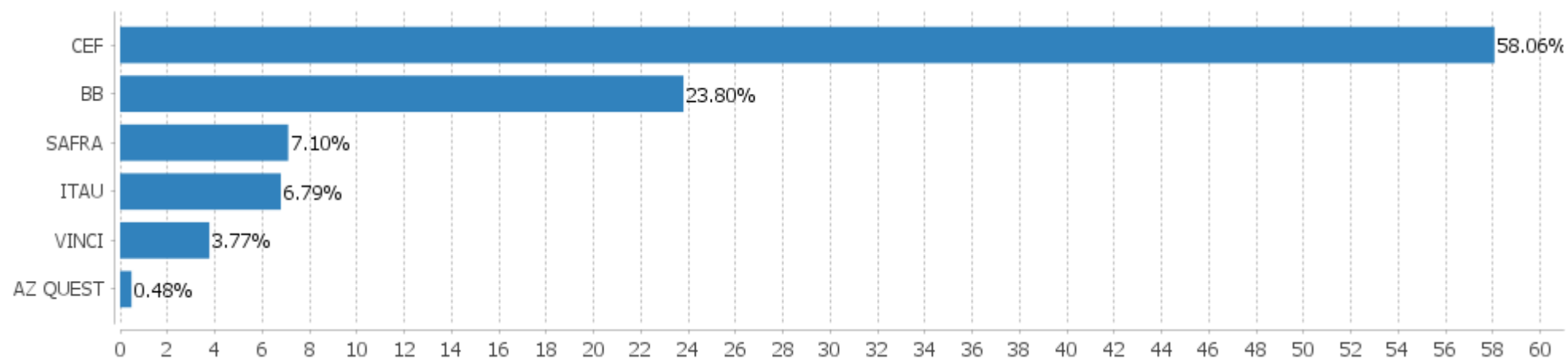


Alocação Por Estratégia



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	-0,21	-0,66	1,09	1,18	1,16	0,12							2,69
IPCA + 5,85%	0,70	1,27	1,46	0,76	1,31	1,01							6,69
p.p. indexador	-0,92	-1,93	-0,36	0,42	-0,15	-0,89							-3,99
2020	0,49	-0,32	-3,56	1,40	1,62	1,41	1,59	-0,08	-0,74	-0,16	2,49	2,57	6,75
IPCA + 5,85%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,85	10,61
p.p. indexador	-0,21	-0,98	-4,13	1,26	1,55	0,68	0,71	-0,80	-1,86	-1,50	1,14	0,72	-3,85
2019	1,23	0,48	0,57	0,84	0,95	1,23	0,79	0,30	1,39	1,36	-0,05	1,42	11,03
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	0,40	-0,41	-0,62	-0,22	0,31	0,78	0,07	-0,32	0,94	0,72	-1,02	-0,23	0,44
2018	0,86	0,51	0,95	0,49	-0,51	0,40	1,00	0,18	0,69	1,76	0,42	0,86	7,85
IPCA + 6,00%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	0,06	-0,23	0,37	-0,22	-1,40	-1,35	0,15	-0,27	-0,23	0,80	0,16	0,24	-2,07
2017	1,58	2,23	1,12	0,32	-0,10	0,50	2,52	1,12	1,18	0,19	-0,06	0,55	11,68
IPCA + 6,00%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	0,68	1,48	0,33	-0,23	-0,92	0,24	1,79	0,39	0,55	-0,72	-0,80	-0,35	2,64

Performance Sobre a Meta Atuarial

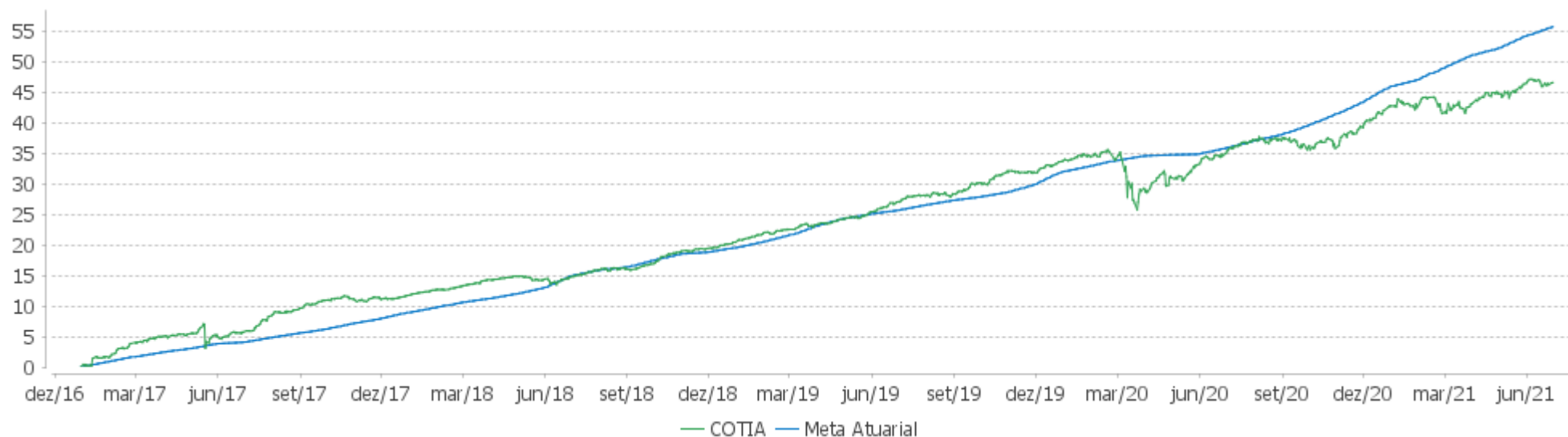
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	26	48,15	03 meses	2,48	3,11	-0,63	3,31
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	51,85	06 meses	2,69	6,69	-3,99	4,27
			12 meses	8,59	14,66	-6,07	3,95
			24 meses	15,45	24,07	-8,62	4,95
			36 meses	27,80	35,85	-8,06	4,12
			48 meses	38,63	50,22	-11,59	3,68
			Desde 30/12/2016	46,61	56,42	-9,81	4,05

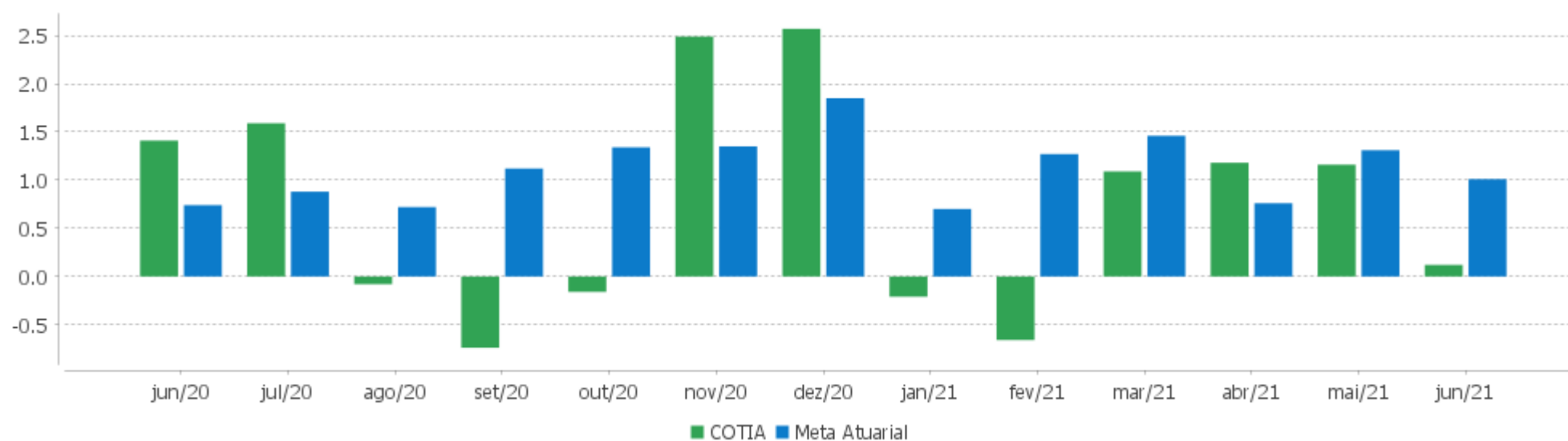
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,57	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-3,56	2020-03

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
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	0,46 149,47	-0,86 -67,51	2,62 331,96	-0,86 -67,51	6,96 305,93	14,15 202,56	48,06 349,65
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,33 106,86	1,32 103,34	0,81 103,39	1,32 103,34	2,35 103,14	6,51 93,15	13,10 95,32
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,22 72,90	0,76 59,28	0,53 66,67	0,76 59,28	1,16 50,75	4,70 67,24	10,13 73,73
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,05 -0,48	-0,39 -4,16	1,36 -0,32	-0,39 -4,16	3,22 -5,13		
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,31 99,36	1,16 90,55	0,82 103,48	1,16 90,55	2,20 96,71	6,32 90,47	12,88 93,68
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	0,25 80,66	1,03 80,46	0,89 112,61	1,03 80,46	2,24 98,24		
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,29 -0,24	1,01 -2,76	0,67 -1,01	1,01 -2,76	1,59 -6,75	7,30 -3,35	21,15 6,76
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,40 -0,02	-0,84 -0,11	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	1,15 -0,13	1,38 -0,05	1,15 -0,13	5,77 -0,29	14,77 -0,64	31,38 -0,95
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	-0,09 0,22	1,42 -0,45	1,42 -0,49	1,42 -0,45	6,38 -0,69	15,08 -1,37	28,85 -3,02
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,18 -0,03	0,65 -0,16	0,60 -0,08	0,65 -0,16	1,65 -0,38	7,46 -0,71	15,02 -0,97
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,00 -0,53	0,72 -3,05	0,90 -0,78	0,72 -3,05	2,68 -5,67	12,77 2,11	31,64 17,26
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,28 0,04	1,56 -0,30	1,59 -0,32	1,56 -0,30	6,40 -0,66	15,12 -1,34	29,13 -2,74
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,42 -0,01	-2,17 -1,45	2,29 0,15	-2,17 -1,45	5,63 -1,80	12,09 -0,65	47,41 2,25
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,38 -0,04	-0,82 -0,10	2,09 -0,05	-0,82 -0,10	7,15 -0,28	12,23 -0,51	44,09 -1,07
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,19 -0,02	0,70 -0,12	0,64 -0,04	0,70 -0,12	1,82 -0,21	7,71 -0,46	15,35 -0,64
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	0,16	0,67	1,70	0,67	3,08		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	53,27	52,06	215,67	52,06	135,48		
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	0,20	1,26	1,21	1,26	2,35	8,12	16,74
% do CDI	65,04	98,63	153,18	98,63	103,08	116,29	121,82
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2,71	16,15	8,76	16,15	38,60	43,45	
% do CDI	882,02	1.264,12	1.111,63	1.264,12	1.695,81	622,14	
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	2,69	15,79	8,64	15,79	38,51	44,84	62,28
Var. IBOVESPA p.p.	2,22	9,25	-0,07	9,25	5,11	19,25	-11,99
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	2,68	16,13	8,75	16,13	39,42	45,94	63,64
Var. S&P 500 p.p.	4,95	6,00	13,78	6,00	12,80	-44,75	-41,46
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	0,53	5,83	9,13	5,83	29,36	38,26	
Var. IBOVESPA p.p.	0,06	-0,71	0,41	-0,71	-4,04	12,67	
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	-0,48	5,60	8,51	5,60	28,59	35,83	101,75
Var. IBOVESPA p.p.	-0,94	-0,94	-0,20	-0,94	-4,81	10,24	27,48
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	-0,80	5,81	7,62	5,81	39,67	43,84	
Var. IBOVESPA p.p.	-1,26	-0,73	-1,09	-0,73	6,27	18,25	
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-0,21	12,22	11,00	12,22	37,29	31,25	87,46
Var. IBOVESPA p.p.	-0,68	5,68	2,28	5,68	3,90	5,66	13,19
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-1,76	3,78	6,71	3,78	28,53	25,52	87,37
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,41	1,73	1,26	1,73	4,74	1,93	4,76
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-0,77	4,52	7,31	4,52	35,20	28,53	105,52
Var. IBOVESPA p.p.	-1,24	-2,02	-1,41	-2,02	1,81	2,94	31,25
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	1,80	2,73	10,18	2,73	26,66	27,74	79,85
Var. IBOVESPA p.p.	1,33	-3,81	1,46	-3,81	-6,74	2,15	5,58
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	3,15	12,82	12,60	12,82	36,21	52,93	
Var. IBOVESPA p.p.	2,69	6,28	3,89	6,28	2,81	27,35	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	1,61	13,29	13,74	13,29	37,58	47,53	100,39
Var. IBOVESPA p.p.	1,14	6,75	5,02	6,75	4,18	21,95	26,12
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	-1,66	1,05	5,25	1,05	21,07	18,69	70,22
Var. IBOVESPA p.p.	-2,12	-5,49	-3,47	-5,49	-12,33	-6,89	-4,05
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	2,45	16,53	17,25	16,53	38,81	51,48	
Var. SMALL CAP p.p.	1,16	5,11	4,83	5,11	-0,83	4,65	
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	0,58	6,06	8,72	6,06	29,92	27,76	76,36
Var. IBOVESPA p.p.	0,12	-0,48	-0,00	-0,48	-3,48	2,17	2,09
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-1,00	4,14	7,99	4,14	23,38	8,45	53,18
Var. IBOVESPA p.p.	-1,46	-2,40	-0,73	-2,40	-10,01	-17,13	-21,08
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	1,66	7,83	10,34	7,83	27,85	34,45	

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.	1,19	1,29	1,63	1,29	-5,55	8,87	
FIA BRASIL IBX-50	0,57	9,68	10,51	9,68	36,49	27,14	70,85
Var. IBOVESPA p.p.	0,10	3,14	1,80	3,14	3,10	1,55	-3,41
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	0,88	9,21	9,90	9,21	35,33	30,01	83,50
Var. IBOVESPA p.p.	0,42	2,67	1,19	2,67	1,93	4,42	9,23
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-1,19	8,36	-4,36	8,36	26,23	95,14	110,45
Var. IBOVESPA p.p.	-1,65	1,82	-13,07	1,82	-7,17	69,55	36,18
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	-0,21	10,51	-1,04	10,51	29,16	81,37	116,00
Var. IBOVESPA p.p.	-0,68	3,97	-9,76	3,97	-4,24	55,78	41,73
COTIA	0,12	2,69	2,48	2,69	8,59	15,45	27,80
Var. IPCA + 5,85% p.p.	-0,89	-3,99	-0,63	-3,99	-6,07	-8,53	-7,77
CDI	0,31	1,28	0,79	1,28	2,28	6,98	13,74
IBOVESPA	0,46	6,54	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27
INPC + 6,00%	1,09	6,95	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46
IPCA + 6,00%	1,02	6,76	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

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

Renda Variável

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

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

Investimentos no Exterior

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

Meta Atuarial

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

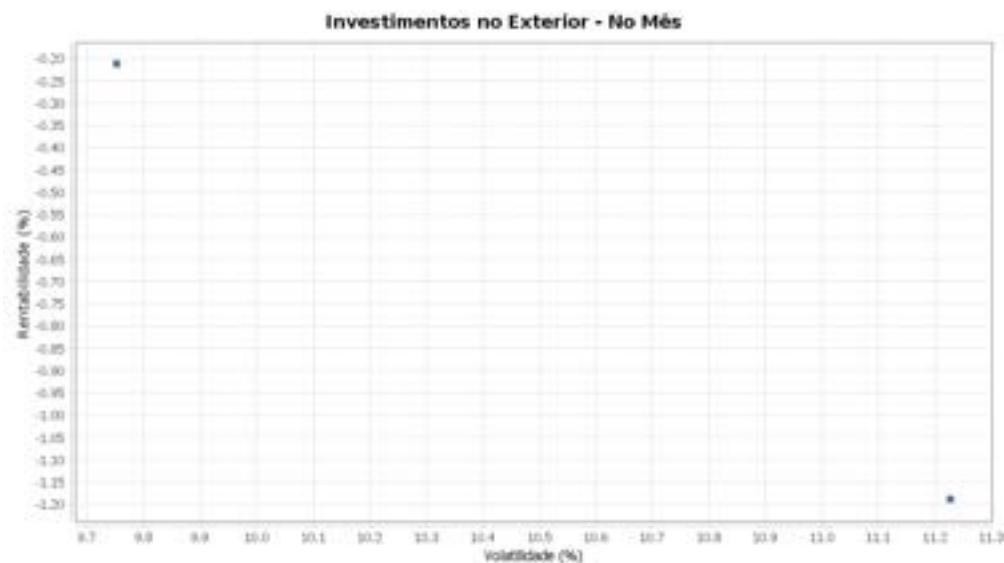
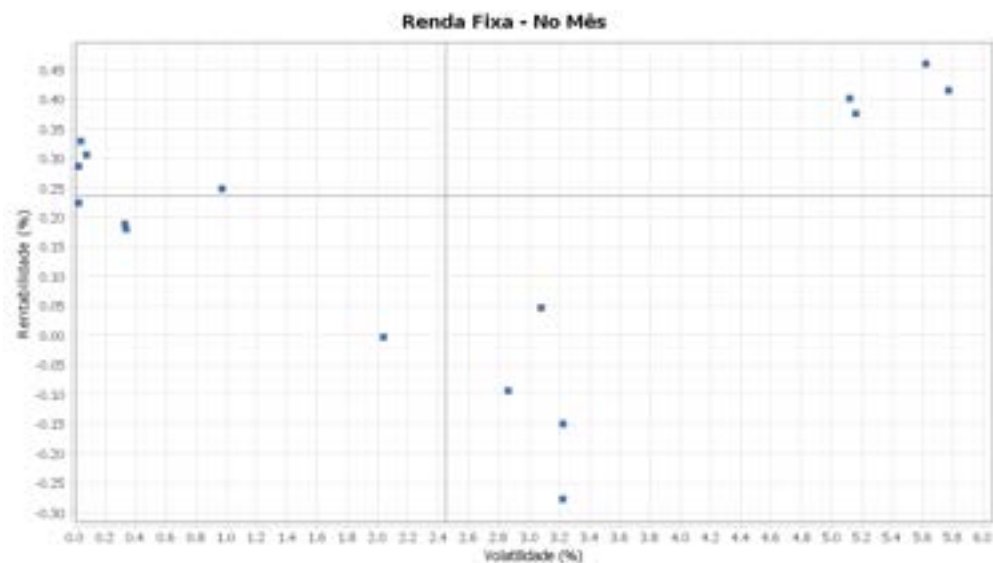
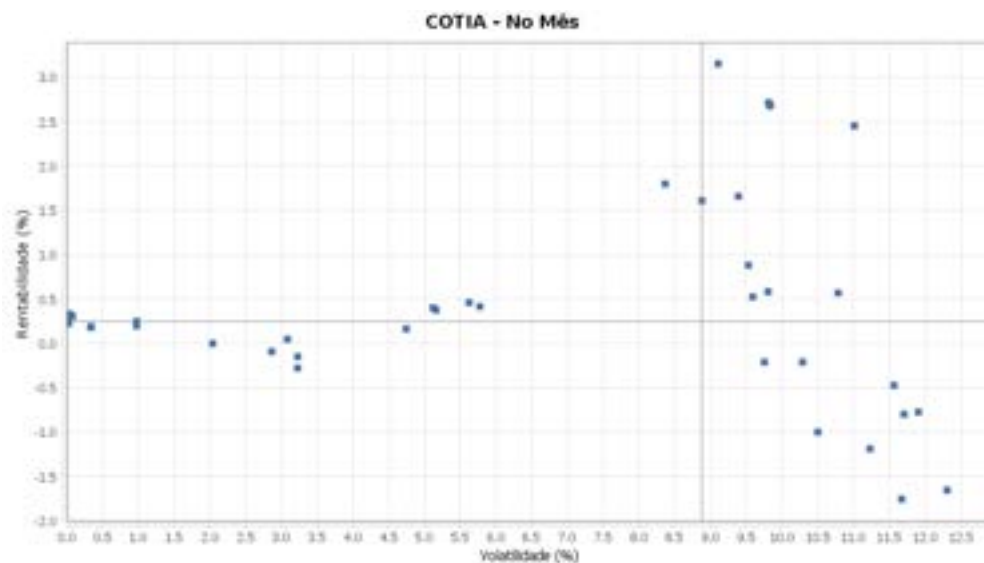
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
154	01/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	15.000,00	7.056,48680300	2,1257036850
148	02/06/2021	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	15.510,21	0,00	9.032,37363200	1,7171798500
155	02/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.370,04	3.937,15799600	2,1259090970
156	07/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	16.336,43	7.682,86773200	2,1263453400
144	08/06/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	111.663,31	40.759,03985200	2,7395961830
157	08/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.842,33	4.158,07995900	2,1265415980
167	08/06/2021	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	28.443,69	0,00	4.346,81002200	6,5435779000
158	09/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.713,00	2.686,28615000	2,1267280110
149	10/06/2021	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	946,18	0,00	553,10995000	1,7106544540
176	11/06/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	700.000,00	0,00	458.988,10171700	1,5250940000
145	11/06/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	750.000,00	273.774,44434700	2,7394814070
169	11/06/2021	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	400.000,00	0,00	18.854,93863401	21,2146010000
181	14/06/2021	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	1.055.945,00	0,00	777.797,01092300	1,3576100000
139	14/06/2021	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	1.090.500,00	0,00	373.275,14433500	2,9214374880
150	14/06/2021	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	1.094.500,00	0,00	637.621,54368600	1,7165354760
153	14/06/2021	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	600.165,49	0,00	569.096,03728500	1,0545943930
159	14/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	15.090,00	7.093,43814400	2,1273181910
168	14/06/2021	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	750.000,00	0,00	96.669,46496840	7,7583961000
172	14/06/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	400.000,00	0,00	70.400,32440469	5,6817920000
173	14/06/2021	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	300.000,00	0,00	1.080,29641600	277,7015600000
175	14/06/2021	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	315.100,00	0,00	1.903,58855000	165,5294680000
160	15/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	101,18	47,55768700	2,1275214810
161	16/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.812,09	1.321,65438100	2,1277045190
171	16/06/2021	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	215.100,00	0,00	15.000,00209205	14,3399980000
140	17/06/2021	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	12.745,40	0,00	4.472,18521500	2,8499266880
162	18/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	40,00	18,79550300	2,1281685990
141	21/06/2021	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	470.000,00	0,00	163.526,83590400	2,8741459920
151	21/06/2021	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	460.691,63	0,00	272.893,85360400	1,6881715140

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
163	21/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	756,05	0,00	355,21262000	2,1284435190
177	24/06/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.400.000,00	0,00	911.577,62181100	1,5357990000
178	24/06/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	35.000.000,00	0,00	22.789.440,54527900	1,5357990000
179	24/06/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	20.000.000,00	0,00	6.150.360,31885900	3,2518420000
180	24/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	55.000.000,00	20.922.921,48022000	2,6286960000
182	25/06/2021	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	527.294,98	0,00	391.523,60041700	1,3467770000
142	25/06/2021	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	963.500,00	0,00	339.097,97545300	2,8413617000
152	25/06/2021	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	963.500,00	0,00	577.510,95361100	1,6683666240
170	25/06/2021	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	560.000,00	0,00	26.150,73263612	21,4143140000
143	28/06/2021	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	1.803,07	0,00	635,49429100	2,8372717500
164	28/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.958,41	919,55339200	2,1297403900
174	28/06/2021	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	560.000,00	0,00	1.997,55195700	280,3431460000
146	29/06/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	3.221.208,02	1.174.195,90485800	2,7433309950
165	29/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	158.841,90	74.573,54307400	2,1300033960
147	30/06/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	192.464,06	70.166,38439700	2,7429667590
166	30/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	71.185,98	33.416,61131800	2,1302572940
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 20.764.171,30

Value-At-Risk: 2,48%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,03	0,00	-0,91	0,29	4.854.380,20	0,58
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,03	0,00	-3,44	0,22	359.282,53	0,04
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,04	0,00	0,55	0,33	19.982.228,09	2,39
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,08	0,05	0,00	-0,03	0,31	8.991.714,97	1,07
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,15	0,00	-0,36	0,19	15.255.628,25	1,82
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,34	0,15	0,00	-0,38	0,18	18.559.665,32	2,22
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	Artigo 8º III	0,97	0,74	0,01	-0,11	0,20	13.096.386,24	1,57
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,97	0,34	0,00	-0,06	0,25	10.188.024,74	1,22
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,04	1,15	0,10	-0,15	-0,00	105.907.584,82	12,66
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,86	1,37	0,04	-0,14	-0,09	37.592.189,64	4,49
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	3,08	1,39	0,02	-0,08	0,05	16.484.278,38	1,97
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,22	1,51	0,07	-0,18	-0,28	59.701.257,58	7,14
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,23	1,48	0,18	-0,14	-0,15	156.724.212,38	18,74
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	Artigo 8º III	4,74	1,95	0,01	-0,03	0,16	3.674.153,96	0,44
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,12	2,67	0,06	0,02	0,40	30.371.909,35	3,63
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,16	2,67	0,07	0,01	0,38	35.524.937,89	4,25
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	5,62	2,86	0,01	0,03	0,46	4.474.720,54	0,53
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	5,77	2,95	0,02	0,02	0,42	8.789.838,62	1,05
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	8,36	10,40	0,09	0,18	1,80	8.704.734,76	1,04
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	8,88	10,22	0,04	0,15	1,61	3.994.575,48	0,48
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	9,10	8,86	0,06	0,31	3,15	6.486.344,17	0,78
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	9,39	9,52	0,11	0,14	1,66	11.358.280,27	1,36
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	9,53	7,92	0,20	0,06	0,88	23.615.971,76	2,82
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	9,59	8,80	0,09	0,02	0,53	9.932.609,79	1,19
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	9,75	8,56	0,08	-0,05	-0,21	25.987.840,93	3,11
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	9,80	9,20	0,05	0,03	0,58	5.627.062,98	0,67
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	9,81	6,43	0,26	0,25	2,71	47.175.391,52	5,64
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	9,82	6,32	0,05	0,24	2,69	8.556.756,21	1,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	Artigo 8º III	9,84	6,40	0,05	0,24	2,68	8.922.675,71	1,07
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	10,28	8,18	0,03	-0,05	-0,21	4.114.341,96	0,49
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	10,50	7,60	0,14	-0,12	-1,00	19.512.904,42	2,33
FIA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	10,78	8,19	0,11	0,02	0,57	12.812.277,85	1,53
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	11,01	10,40	0,04	0,19	2,45	3.843.504,61	0,46
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	11,23	9,34	0,11	-0,13	-1,19	37.357.396,80	4,47
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	11,56	8,56	0,14	-0,07	-0,48	15.611.115,22	1,87
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	11,67	8,03	0,12	-0,18	-1,76	15.943.102,31	1,91
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	11,70	7,78	0,04	-0,09	-0,80	5.051.495,33	0,60
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	11,90	7,92	0,04	-0,09	-0,77	5.607.050,55	0,67
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	12,30	7,50	0,04	-0,16	-1,66	5.760.702,60	0,69

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de junho de 2021, vale observar que:

- Os recursos alocados no Artigo 7º, Inciso I, Alínea B, representavam 56,00 % dos recursos totais do Instituto, alocação está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos.