



**LDB**  
EMPRESAS

**CAMPO MOURÃO**  
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

66,28%

## 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	5.173.941,16	2,93	7.575.446.149,90	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,72	0,40	-0,84	10.192.977,96	5,78	5.867.854.510,24	0,17
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,33	0,19	0,70	6.742.109,69	3,82	8.267.613.291,28	0,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,55	-0,15	1,15	12.063.405,00	6,84	14.363.834.668,17	0,08
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,32	-0,09	1,42	13.777.113,37	7,81	10.494.201.076,30	0,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,47	-0,28	1,56	2.539.854,03	1,44	11.796.463.834,87	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,55	-0,19	1,17	14.121.040,74	8,01	5.768.393.191,74	0,24
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,33	-0,00	0,72	24.827.641,05	14,08	16.058.908.177,46	0,15
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,23</b>	<b>-0,02</b>	<b>0,88</b>	<b>89.438.083,00</b>	<b>50,72</b>		

## 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	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,47	0,29	1,01	3.126.725,52	1,77	3.457.648.238,53	0,09
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	3,14	0,33	-0,80	22.589.264,86	12,81	1.501.428.504,12	1,50
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>2,73</b>	<b>0,33</b>	<b>-0,55</b>	<b>25.715.990,38</b>	<b>14,58</b>		

## Artigo 7º VII, Alínea a (Cota Sênior de FIDC)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
AURORA	CM CAPITAL	FIDC GGR PRIME I	6,54	0,03	-0,50	1.724.461,63	0,98	155.844.626,83	1,11
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a</b>			<b>6,54</b>	<b>0,03</b>	<b>-0,50</b>	<b>1.724.461,63</b>	<b>0,98</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>2,26</b>	<b>0,06</b>	<b>0,56</b>	<b>116.878.535,01</b>	<b>66,28</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

29,55%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BEM	BRADERCO F I A SELECTION	20,82	2,09	5,73	2.775.264,05	1,57	776.844.725,37	0,36
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	18,53	0,78	10,33	1.651.921,11	0,94	378.293.616,12	0,44
BRAM	BRADERCO	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	20,05	0,67	6,99	4.324.163,93	2,45	322.546.994,90	1,34
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	22,36	1,46	9,96	1.381.852,15	0,78	776.499.773,00	0,18
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	20,64	-0,77	4,52	7.625.965,23	4,32	1.229.908.816,68	0,62
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	20,15	-0,87	19,92	8.745.284,10	4,96	517.658.364,97	1,69
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>19,37</b>	<b>-0,07</b>	<b>10,39</b>	<b>26.504.450,57</b>	<b>15,03</b>		

## Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	15,05	2,71	16,15	18.075.448,49	10,25	2.298.502.554,43	0,79
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>15,05</b>	<b>2,71</b>	<b>16,15</b>	<b>18.075.448,49</b>	<b>10,25</b>		

## Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
A5	PLANNER	W7 FIP MULTISTRATÉGIA	5,09	-0,12	4,12	3.191.071,83	1,81	137.628.709,00	2,32
LEGATUS	DAYCOVAL	FIP LA SHOPPING CENTERS	0,57	-0,14	-0,79	2.507.707,12	1,42	242.616.334,56	1,03
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b>			<b>4,91</b>	<b>-0,13</b>	<b>1,92</b>	<b>5.698.778,95</b>	<b>3,23</b>		

## Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
PLANNER	PLANNER	CARE11	52,80	2,75	16,52	1.829.031,03	1,04	288.155.071,03	0,63
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>			<b>52,80</b>	<b>2,75</b>	<b>16,22</b>	<b>1.829.031,03</b>	<b>1,04</b>		

## Renda Variável e Investimentos Estruturados

11,63 0,97 11,49 52.107.709,04 29,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,18%

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	7.362.916,87	4,18	2.860.128.891,15	0,26
<b>Sub-total Artigo 9º A, III</b>			<b>21,15</b>	<b>-1,19</b>	<b>8,36</b>	<b>7.362.916,87</b>	<b>4,18</b>		
Investimentos no Exterior			18,29	-1,19	8,36	7.362.916,87	4,18		
Total			4,23	0,28	3,71	176.349.160,92	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			ALM	Limite Legal
				Mínimo	Objetivo	Máximo		
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	89.438.083,00	50,72	0,00	47,91	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	25.715.990,38	14,58	0,00	13,25	40,00	0,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	1.724.461,63	0,98	0,00	1,17	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>116.878.535,01</b>	<b>66,28</b>					100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	26.504.450,57	15,03	0,00	12,64	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	18.075.448,49	10,25	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	5.698.778,95	3,23	0,00	3,82	5,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.829.031,03	1,04	0,00	1,21	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>52.107.709,04</b>	<b>29,55</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	7.362.916,87	4,18	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>7.362.916,87</b>	<b>4,18</b>					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	-0,02 -6,44	0,88 68,72	1,21 154,08	0,88 68,72	4,53 199,18	-21.617,01	763.378,83
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,33 105,75	-0,55 -42,90	1,22 154,29	-0,55 -42,90	1,96 86,09	82.569,60	-96.514,34
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	0,03 9,26	-0,50 -38,79	-0,42 -53,58	-0,50 -38,79	3,82 167,85	491,58	-6.191,18
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,07 -0,53	10,39 3,85	11,35 2,63	10,39 3,85	36,36 2,96	-17.847,16	2.495.529,03
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,71 2,25	16,15 9,61	8,76 0,04	16,15 9,61	21,77 -11,63	477.712,67	2.513.399,90
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,13 -0,59	1,92 -4,62	-0,39 -9,11	1,92 -4,62	4,98 -28,42	-7.440,98	108.744,38
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	2,75 2,29	16,22 9,68	50,65 41,94	16,22 9,68	14,58 -18,81	48.948,54	255.960,98
Artigo 9º A, III % do CDI	-1,19 -386,15	8,36 654,26	-4,36 -552,79	8,36 654,26		-88.558,64	136.941,33
<b>CAMPO MOURÃO (Total)</b>						<b>474.258,60</b>	<b>6.171.248,93</b>

## 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	13.790.008,20	0,00	0,00	0,00	13.777.113,37	-12.894,83	192.612,62
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	14.147.332,27	0,00	0,00	0,00	14.121.040,74	-26.291,53	163.084,82
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	5.164.642,32	0,00	0,00	0,00	5.173.941,16	9.298,84	33.651,27
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.546.916,60	0,00	0,00	0,00	2.539.854,03	-7.062,57	60.121,19
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12.081.492,12	0,00	0,00	0,00	12.063.405,00	-18.087,12	137.675,57
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7.893.918,67	2.276.391,73	0,00	0,00	10.192.977,96	22.667,56	-43.755,10
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.433.659,19	1.648.949,08	-352.000,00	0,00	6.742.109,69	11.501,42	43.160,93
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	24.828.389,83	0,00	0,00	0,00	24.827.641,05	-748,78	176.827,53
					89.438.083,00	-21.617,01	-0,01



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	22.251.829,11	263.795,05	0,00	0,00	22.589.264,86	73.640,70	-127.684,55
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3.117.796,62	0,00	0,00	0,00	3.126.725,52	8.928,90	31.170,21
					25.715.990,38	82.569,60	0,05

Artigo 7º VII, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC GGR PRIME I	1.723.970,05	0,00	0,00	0,00	1.724.461,63	491,58	-6.191,18
					1.724.461,63	491,58	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	7.685.462,34	0,00	0,00	0,00	7.625.965,23	-59.497,11	330.055,26
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	4.295.572,67	0,00	0,00	0,00	4.324.163,93	28.591,26	282.557,85
BRADESCO F I A SELECTION	2.718.409,70	0,00	0,00	0,00	2.775.264,05	56.854,35	150.475,46
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	1.639.215,59	0,00	0,00	0,00	1.651.921,11	12.705,52	154.678,63
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	8.821.685,49	0,00	0,00	0,00	8.745.284,10	-76.401,39	1.452.558,05
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	1.361.951,94	0,00	0,00	0,00	1.381.852,15	19.900,21	125.203,78
					26.504.450,57	-17.847,16	-0,01

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	17.597.735,82	0,00	0,00	0,00	18.075.448,49	477.712,67	2.513.399,90
					18.075.448,49	477.712,67	0,28

Artigo 8º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIP LA SHOPPING CENTERS	2.511.281,76	0,00	0,00	0,00	2.507.707,12	-3.574,64	-19.917,78



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	3.194.938,17	0,00	0,00	0,00	3.191.071,83	-3.866,34	128.662,16
					5.698.778,95	-7.440,98	-0,00

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CARE11	1.783.869,77	0,00	0,00	0,00	3.787,28	1.829.031,03	48.948,54	255.960,98
						1.829.031,03	48.948,54	0,03

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	7.451.475,51	0,00	0,00	0,00	7.362.916,87	-88.558,64	136.941,33
					7.362.916,87	-88.558,64	-0,05

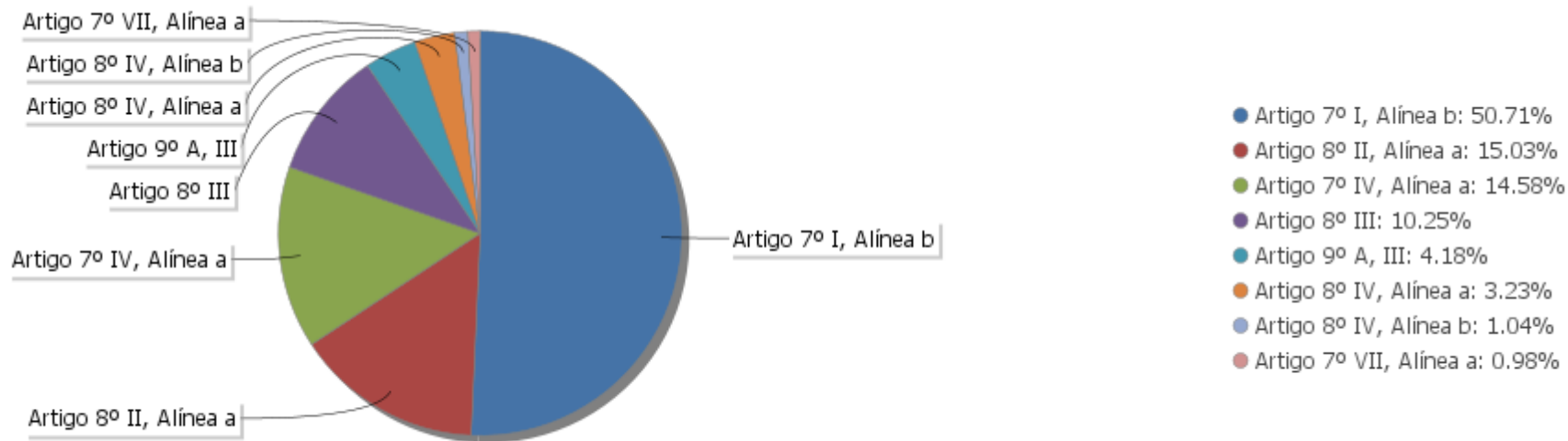
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

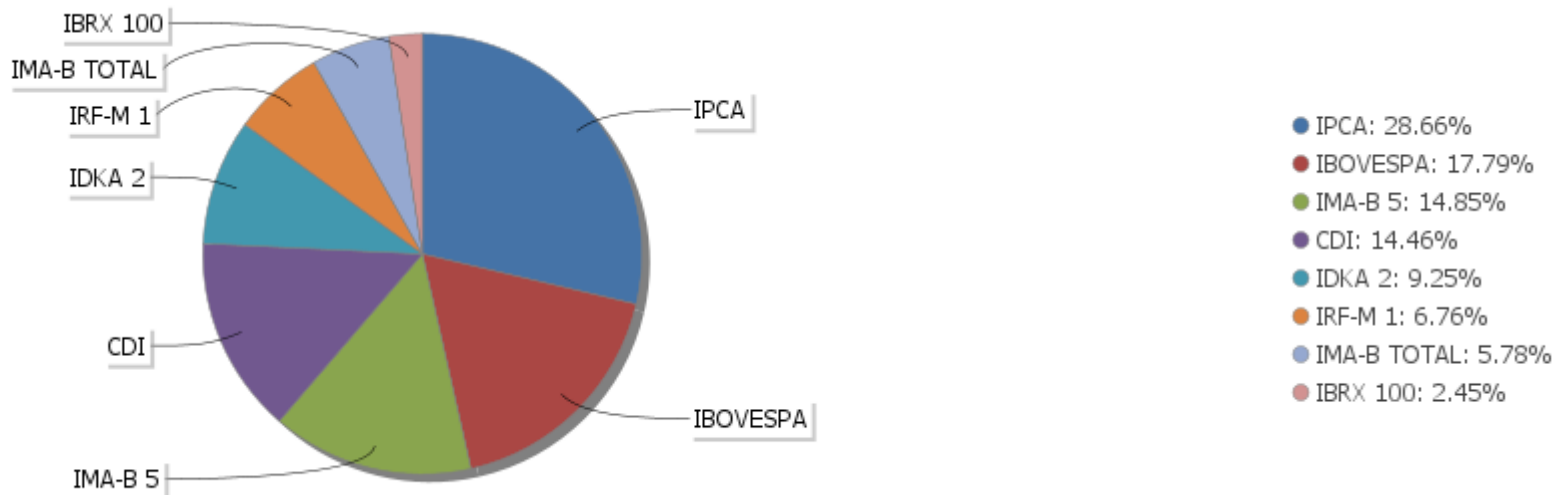
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	159.918.102,96	90,68	159.918.102,96	90,68
de 31 a 365 dias	9.007.817,38	5,11	168.925.920,34	95,79
acima de 365 dias	7.423.240,58	4,21	176.349.160,92	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

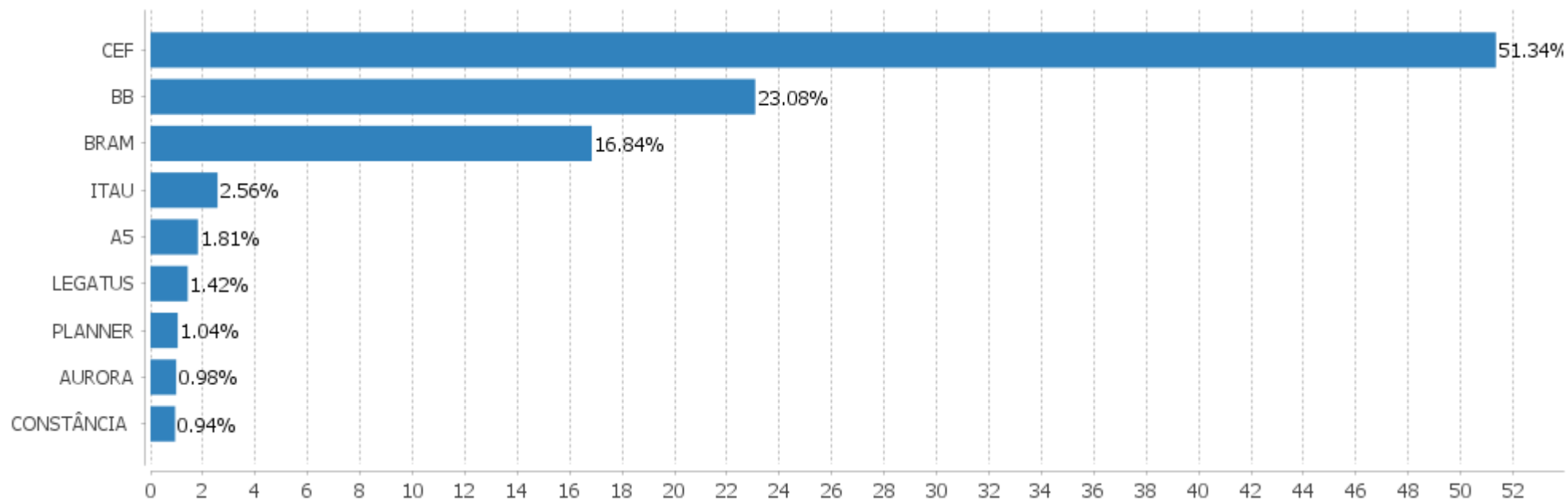


Alocação Por Estratégia



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	-0,51	-0,51	1,29	2,00	1,14	0,28							3,71
IPCA + 5,45%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,98							6,49
p.p. indexador	-1,19	-1,75	-0,13	1,27	-0,14	-0,70							-2,78
2020	0,13	-0,88	-5,49	1,11	1,81	1,72	2,31	-0,61	-1,04	0,13	2,62	2,64	4,25
IPCA + 5,88%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,64
p.p. indexador	-0,58	-1,54	-6,06	0,97	1,74	0,98	1,43	-1,33	-2,16	-1,21	1,27	0,79	-6,39

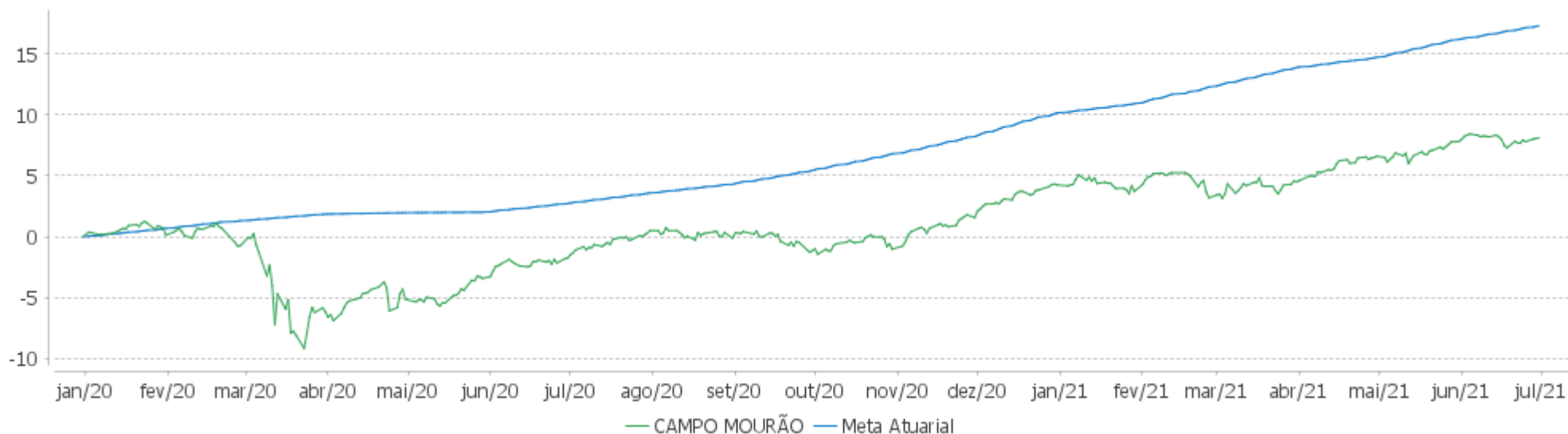
**Performance Sobre a Meta Atuarial**

**Relatório**

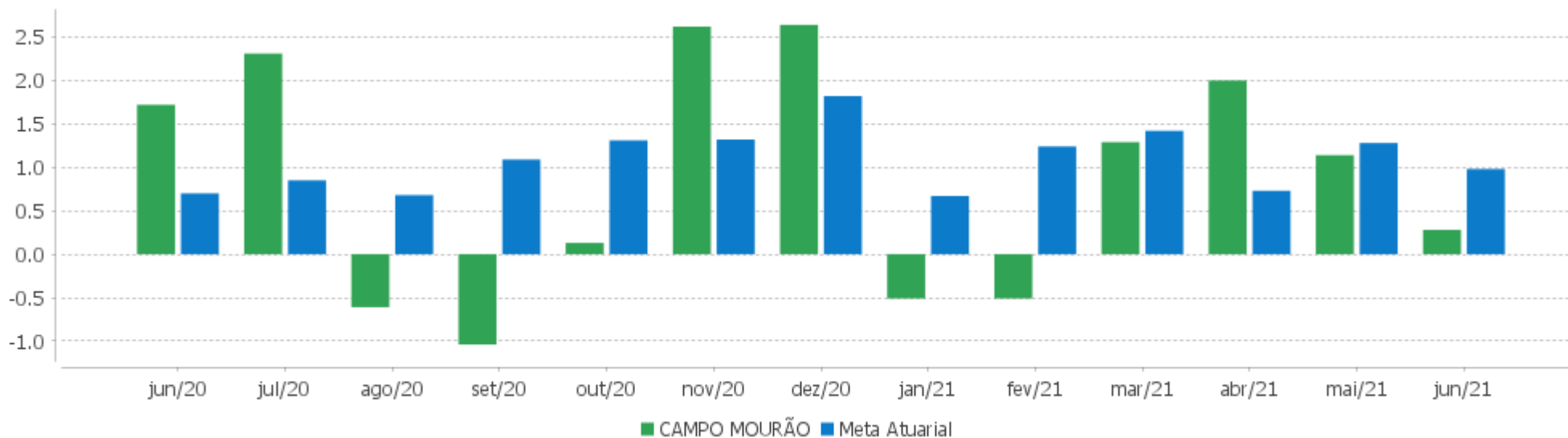
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	7	38,89	03 meses	3,45	3,01	0,43	3,55
Meses abaixo - Meta Atuarial	11	61,11	06 meses	3,71	6,49	-2,78	4,53
			12 meses	10,07	14,46	-4,39	4,23
			24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,64	2020-12	Desde 31/12/2019	8,12	17,82	-9,70	7,31
Menor rentabilidade da Carteira	-5,49	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
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
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
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
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
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-0,19 -0,06	1,17 -0,12	1,37 -0,07	1,17 -0,12	5,78 -0,29	14,87 -0,55	31,43 -0,90
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
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
BRADERCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA Var. IPCA p.p.	0,33 -0,20	-0,80 -4,56	1,29 -0,39	-0,80 -4,56	2,01 -6,33	8,37 -2,28	25,09 10,71
FIDC GGR PRIME I % do CDI	0,03 9,26	-0,50 -38,79	-0,42 -53,58	-0,50 -38,79	3,82 167,85	-3,43 -49,12	-3,67 -26,67
CARE11 Var. IBOVESPA p.p.	2,75 2,29	16,52 9,98	51,04 42,33	16,52 9,98	14,88 -18,52	-54,43 -80,02	-66,71 -140,98
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p.	-0,87 -1,33	19,92 13,38	15,78 7,06	19,92 13,38	42,87 9,48		
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA Var. IBRX 100 p.p.	0,67 0,03	6,99 -1,83	9,71 0,10	6,99 -1,83	33,76 -2,57	30,33 0,36	83,09 0,12
BRADERCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	2,09 1,63	5,73 -0,81	11,88 3,16	5,73 -0,81	34,96 1,56	16,77 -8,82	61,05 -13,21
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	1,46 1,00	9,96 3,42	14,26 5,54	9,96 3,42	21,16 -12,23	5,25 -20,33	49,04 -25,23
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	0,78	10,33	9,23	10,33	27,81	20,03	67,53



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.	0,31	3,79	0,51	3,79	-5,59	-5,56	-6,73
<b>BB AÇÕES VALOR FIC FIA</b>	<b>-0,77</b>	<b>4,52</b>	<b>7,31</b>	<b>4,52</b>	<b>35,20</b>	<b>28,53</b>	<b>105,52</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-1,24	-2,02	-1,41	-2,02	1,81	2,94	31,25
<b>W7 FIP MULTIESTRATÉGIA</b>	<b>-0,12</b>	<b>4,12</b>	<b>-0,38</b>	<b>4,12</b>	<b>2,96</b>	<b>0,93</b>	<b>-1,05</b>
% do CDI	-39,32	322,81	-48,70	322,81	130,01	13,35	-7,62
<b>FIP LA SHOPPING CENTERS</b>	<b>-0,14</b>	<b>-0,79</b>	<b>-0,41</b>	<b>-0,79</b>	<b>-1,80</b>	<b>20,43</b>	<b>19,29</b>
% do CDI	-46,25	-61,68	-52,59	-61,68	-78,90	292,52	140,37
<b>CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP</b>	<b>2,71</b>	<b>16,15</b>	<b>8,76</b>	<b>16,15</b>	<b>38,60</b>	<b>43,45</b>	
% do CDI	882,02	1.264,12	1.111,63	1.264,12	1.695,81	622,14	
<b>FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I</b>	<b>-1,19</b>	<b>8,36</b>	<b>-4,36</b>	<b>8,36</b>	<b>26,23</b>	<b>95,14</b>	<b>110,45</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-1,65	1,82	-13,07	1,82	-7,17	69,55	36,18
<b>CAMPO MOURÃO</b>	<b>0,28</b>	<b>3,71</b>	<b>3,45</b>	<b>3,71</b>	<b>10,07</b>		
Var. IPCA + 5,45% p.p.	-0,70	-2,78	0,43	-2,78	-4,16		
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

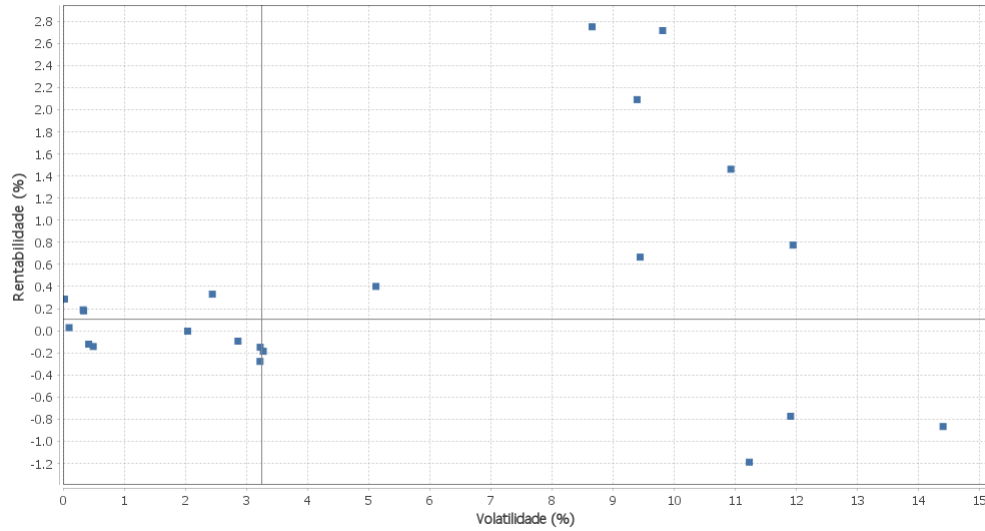
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
36	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	745.067,37	0,00	283.566,63746200	2,6274860000
41	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.004.920,15	0,00	272.470,54711800	3,6881790000
34	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	60.000,00	0,00	22.835,51653500	2,6274860000
42	08/06/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	266.501,76	0,00	72.148,30236000	3,6938050000
38	09/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	145.720,43	0,00	55.462,36452700	2,6273750000
39	28/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	280.000,00	106.444,33042000	2,6304830000
44	28/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	72.000,00	27.371,39896500	2,6304830000
37	30/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	655.322,62	0,00	249.059,50123600	2,6311890000
40	30/06/2021	BRDESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	263.795,05	0,00	206.338,52072990	1,2784576000
43	30/06/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.004.969,82	0,00	274.342,43058300	3,6631950000
35	30/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	42.838,66	0,00	16.281,10333300	2,6311890000
<b>Total</b>						

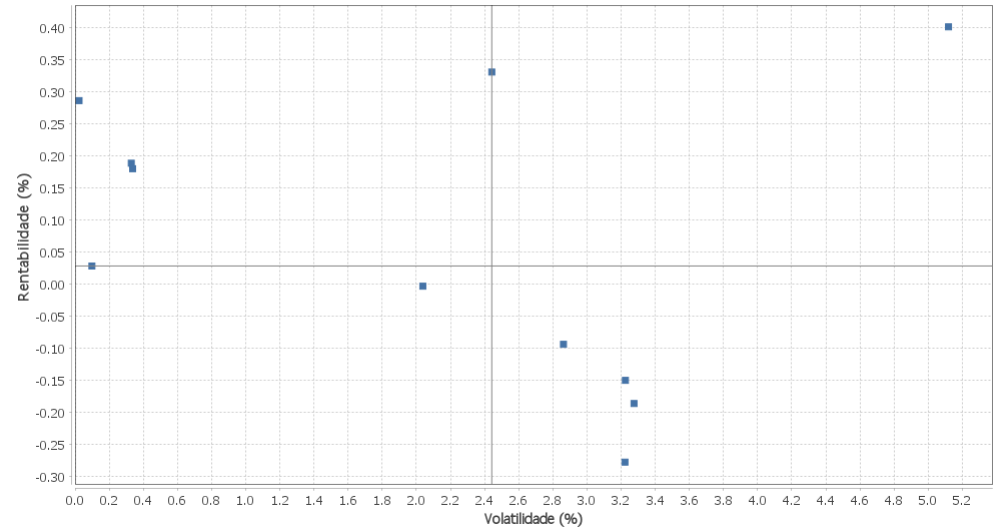
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

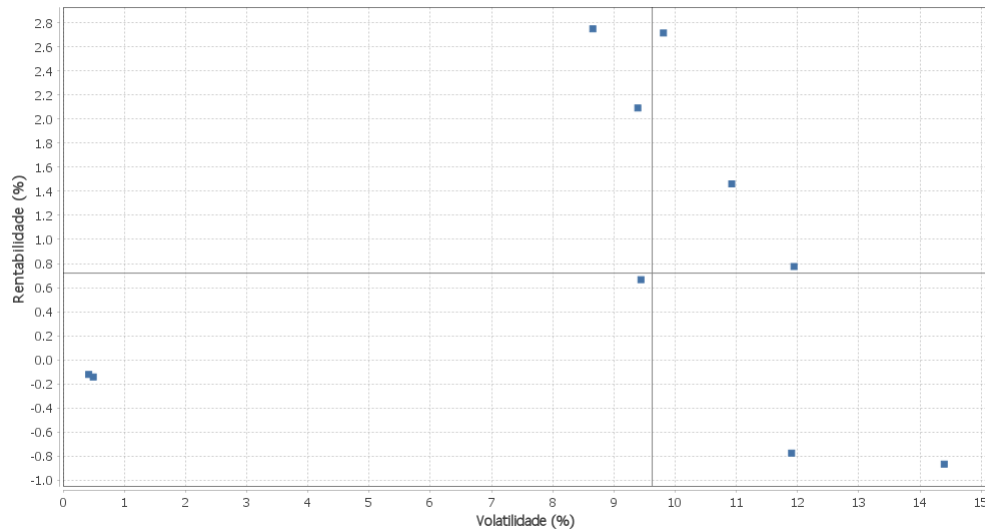
CAMPO MOURÃO - No Mês



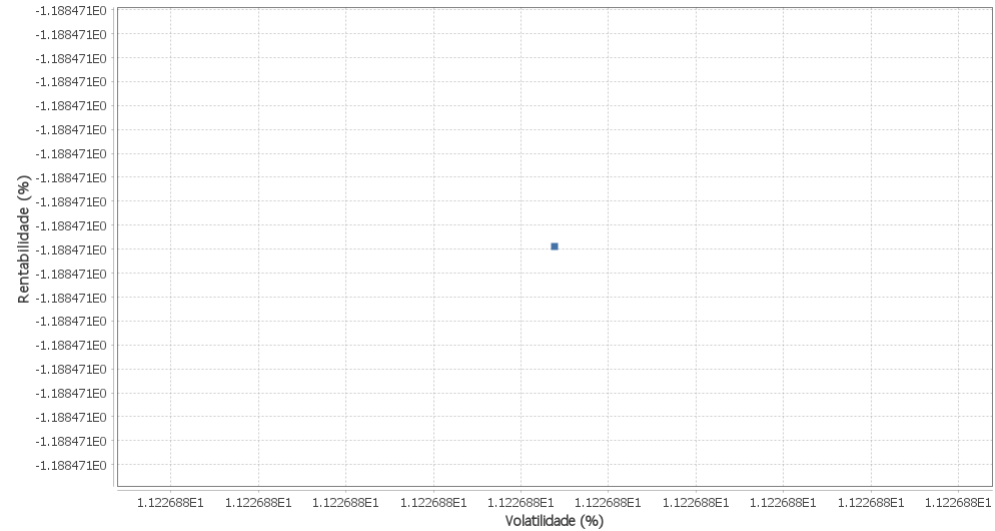
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 3.868.839,86

Value-At-Risk: 2,19%

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	3.126.725,52	1,77
FIDC GGR PRIME I	Artigo 7º VII, Alínea a	0,10	0,19	0,00	-2,83	0,03	1.724.461,63	0,98
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,15	0,00	-0,36	0,19	6.742.109,69	3,82
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,34	0,15	0,00	-0,38	0,18	5.173.941,16	2,93
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Artigo 8º IV, Alínea a	0,42	0,03	0,00	-1,02	-0,12	3.191.071,83	1,81
FIP LA SHOPPING CENTERS	Artigo 8º IV, Alínea a	0,49	0,02	0,00	-0,91	-0,14	2.507.707,12	1,42
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,04	1,15	0,12	-0,15	-0,00	24.827.641,05	14,08
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	2,44	1,24	0,11	0,01	0,33	22.589.264,86	12,81
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,86	1,37	0,08	-0,14	-0,09	13.777.113,37	7,81
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,22	1,51	0,02	-0,18	-0,28	2.539.854,03	1,44
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,23	1,48	0,07	-0,14	-0,15	12.063.405,00	6,84
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,28	1,48	0,08	-0,15	-0,19	14.121.040,74	8,01
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,12	2,67	0,10	0,02	0,40	10.192.977,96	5,78
CARE11	Artigo 8º IV, Alínea b	8,66	0,77	-0,00	0,28	2,75	1.829.031,03	1,04
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	9,39	8,50	0,11	0,19	2,09	2.775.264,05	1,57
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	Artigo 8º II, Alínea a	9,44	8,00	0,17	0,04	0,67	4.324.163,93	2,45
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	9,81	6,43	0,48	0,25	2,71	18.075.448,49	10,25
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	10,93	9,30	0,06	0,11	1,46	1.381.852,15	0,78
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	11,23	9,34	0,08	-0,13	-1,19	7.362.916,87	4,18
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	11,90	7,92	0,28	-0,09	-0,77	7.625.965,23	4,32
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	Artigo 8º II, Alínea a	11,94	7,84	0,06	0,04	0,78	1.651.921,11	0,94
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	Artigo 8º II, Alínea a	14,40	9,57	0,37	-0,08	-0,87	8.745.284,10	4,96

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

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

- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso III, (10,25% dos recursos) está superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010.
- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso III, (10,25% dos recursos) está superior ao limite máximo estipulado em Política de Investimentos;