



LDB
EMPRESAS

CAMPO MOURÃO
SETEMBRO 2021



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 30.09.2021.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

62,69%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,40	0,37	1,53	5.218.824,98	2,91	6.892.529.188,23	0,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,31	0,14	-2,21	0,00	0,00	5.161.580.539,44	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,38	0,38	1,59	14.952.543,78	8,35	6.805.654.314,46	0,22
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,48	0,98	2,30	12.199.754,60	6,81	11.150.255.278,19	0,11
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,29	1,03	2,73	13.955.972,14	7,79	9.425.482.510,34	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,45	1,08	2,79	15.434.521,91	8,62	11.068.272.487,58	0,14
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,49	0,98	2,29	14.277.081,11	7,97	6.090.651.961,96	0,23
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,43	0,29	-1,23	0,00	0,00	14.407.320.968,51	0,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,24	0,78	1,15	76.038.698,52	42,44		

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	0,68	0,84	2,32	10.951.755,60	6,11	3.094.123.781,71	0,35
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	2,86	-0,15	-1,65	23.653.515,72	13,20	1.272.446.776,14	1,86
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,49	0,14	-0,96	34.605.271,32	19,32		

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	7,07	-2,38	-4,12	1.661.577,37	0,93	153.317.399,93	1,08
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			7,07	-2,38	-4,12	1.661.577,37	0,93		
Renda Fixa			2,24	0,53	0,55	112.305.547,21	62,69		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

28,37%

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
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	21,80	-8,10	-3,72	3.973.919,84	2,22	724.734.758,47	0,55
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	20,56	-2,52	-2,28	7.129.855,14	3,98	1.139.604.291,88	0,63
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	20,35	-3,75	6,80	14.321.779,71	7,99	468.658.477,76	3,06
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			19,68	-4,09	-0,70	25.425.554,69	14,19		

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	13,92	-4,64	17,47	18.280.733,17	10,20	3.166.279.756,52	0,58
Sub-total Artigo 8º III			13,92	-4,64	17,47	18.280.733,17	10,20		

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	5,08	-0,10	3,74	3.179.378,47	1,77	137.628.709,00	2,31
LEGATUS	DAYCOVAL	FIP LA SHOPPING CENTERS	0,56	-0,14	-1,22	2.496.678,62	1,39	241.611.035,32	1,03
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			2,78	-0,12	1,52	5.676.057,09	3,17		

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	43,89	-12,13	-7,53	1.445.160,32	0,81	287.608.893,15	0,50
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			43,89	-12,13	-7,77	1.445.160,32	0,81		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			12,25	-4,12	5,46	50.827.505,27	28,37		
--	--	--	--------------	--------------	-------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

8,94%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,24	-0,25	16,72	16.019.457,20	8,94	3.337.438.389,61	0,48
Sub-total Artigo 9º A, III			18,24	-0,25	16,72	16.019.457,20	8,94		
Investimentos no Exterior			17,18	-0,25	16,72	16.019.457,20	8,94		
Total			4,40	-0,91	2,41	179.152.509,68	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		
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	76.038.698,52	42,44	0,00	47,91	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	34.605.271,32	19,32	0,00	13,25	40,00	0,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	1.661.577,37	0,93	0,00	1,17	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	112.305.547,21	62,69					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	25.425.554,69	14,19	0,00	12,64	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	18.280.733,17	10,20	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	5.676.057,09	3,17	0,00	3,82	5,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.445.160,32	0,81	0,00	1,21	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	50.827.505,27	28,37					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	16.019.457,20	8,94	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	16.019.457,20	8,94					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	0,78 177,31	1,15 45,95	0,27 22,21	1,49 73,91	3,98 133,03	591.663,85	884.968,70
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,14 31,16	-0,96 -38,22	-0,41 -33,73	0,80 39,62	1,64 54,90	46.240,05	-177.959,09
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-2,38 -544,09	-4,12 -164,49	-3,65 -298,19	-4,05 -201,20	-0,33 -11,06	-40.585,06	-69.075,44
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,09 2,47	-0,70 6,06	-10,05 2,43	0,16 5,01	23,53 6,22	-1.092.441,21	-140.506,02
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-4,64 1,93	17,47 24,22	1,14 13,61	9,99 14,84	22,73 5,42	-889.158,13	2.718.684,58
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,12 6,45	1,52 8,27	-0,40 12,08	-0,79 4,06	0,96 -16,35	-6.612,09	86.022,52
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-12,13 -5,56	-7,77 -1,02	-20,64 -8,16	19,56 24,40	-17,23 -34,54	-199.438,90	-120.335,68
Artigo 9º A, III % do CDI	-0,25 -57,07	16,72 666,93	7,72 631,10	3,03 150,20		-40.164,43	793.481,66
CAMPO MOURÃO (Total)						-1.630.495,92	3.975.281,23

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	13.813.219,91	0,00	0,00	0,00	13.955.972,14	142.752,23	371.471,39
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	14.138.861,69	0,00	0,00	0,00	14.277.081,11	138.219,42	319.125,19
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	5.199.777,34	0,00	0,00	0,00	5.218.824,98	19.047,64	78.535,09
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.543.137,03	12.814.148,88	0,00	0,00	15.434.521,91	77.236,00	140.640,19
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12.081.229,88	0,00	0,00	0,00	12.199.754,60	118.524,72	274.025,17
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.926.263,47	0,00	-9.940.388,80	0,00	0,00	14.125,33	-186.344,26
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.867.336,07	8.506.574,24	-476.000,00	0,00	14.952.543,78	54.633,47	133.374,77
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	9.377.829,64	0,00	-9.404.954,68	0,00	0,00	27.125,04	-245.858,84
					76.038.698,52	591.663,85	0,33

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	23.689.996,72	0,00	0,00	0,00	23.653.515,72	-36.481,00	-329.318,83
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	9.607.418,71	1.261.615,84	0,00	0,00	10.951.755,60	82.721,05	151.359,74
					34.605.271,32	46.240,05	0,03

Artigo 7º VII, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC GGR PRIME I	1.702.162,43	0,00	0,00	0,00	1.661.577,37	-40.585,06	-69.075,44
					1.661.577,37	-40.585,06	-0,02

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	7.314.293,91	0,00	0,00	0,00	7.129.855,14	-184.438,77	-166.054,83
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	14.879.108,85	0,00	0,00	0,00	14.321.779,71	-557.329,14	29.053,66
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	3.324.593,14	1.000.000,00	0,00	0,00	3.973.919,84	-350.673,30	-282.728,53
					25.425.554,69	-1.092.441,21	-0,61

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	19.169.891,30	0,00	0,00	0,00	18.280.733,17	-889.158,13	2.718.684,58
					18.280.733,17	-889.158,13	-0,50

Artigo 8º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIP LA SHOPPING CENTERS	2.500.206,87	0,00	0,00	0,00	2.496.678,62	-3.528,25	-30.946,28
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	3.182.462,31	0,00	0,00	0,00	3.179.378,47	-3.083,84	116.968,80
					5.676.057,09	-6.612,09	-0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CARE11	1.648.385,99	0,00	0,00	0,00	3.786,77	1.445.160,32	-199.438,90	-120.335,68
						1.445.160,32	-199.438,90	-0,11

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	16.059.621,63	0,00	0,00	0,00	16.019.457,20	-40.164,43	793.481,66
					16.019.457,20	-40.164,43	-0,02

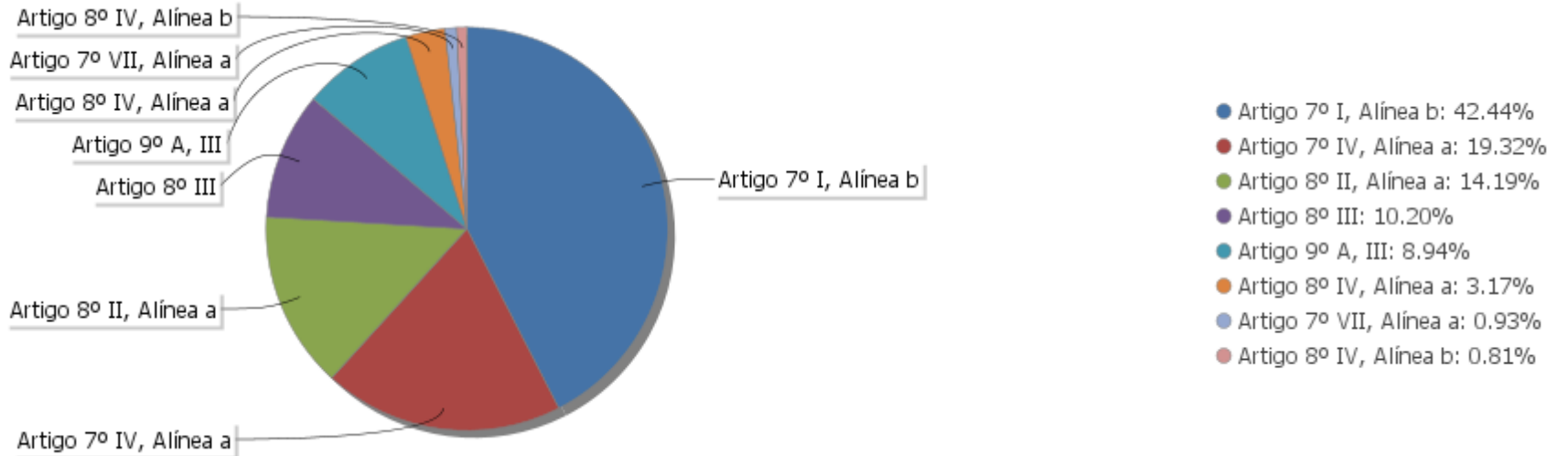
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

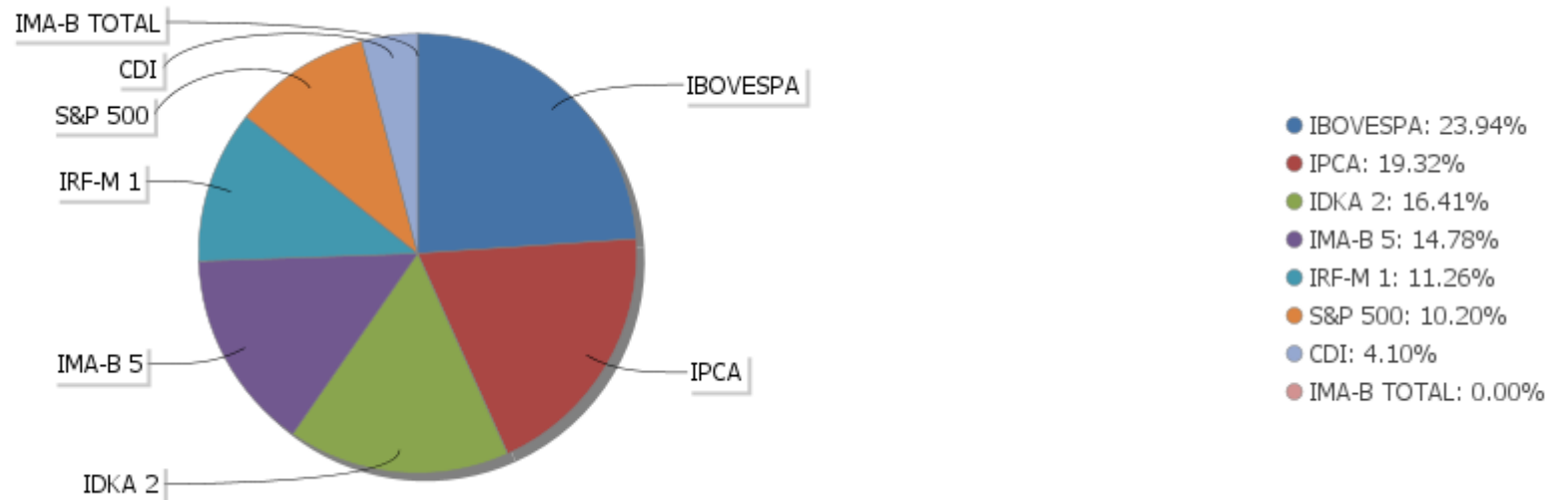
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	160.711.100,24	89,71	160.711.100,24	89,71
de 31 a 365 dias	14.283.153,45	7,97	174.994.253,69	97,68
acima de 365 dias	4.158.255,99	2,32	179.152.509,68	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

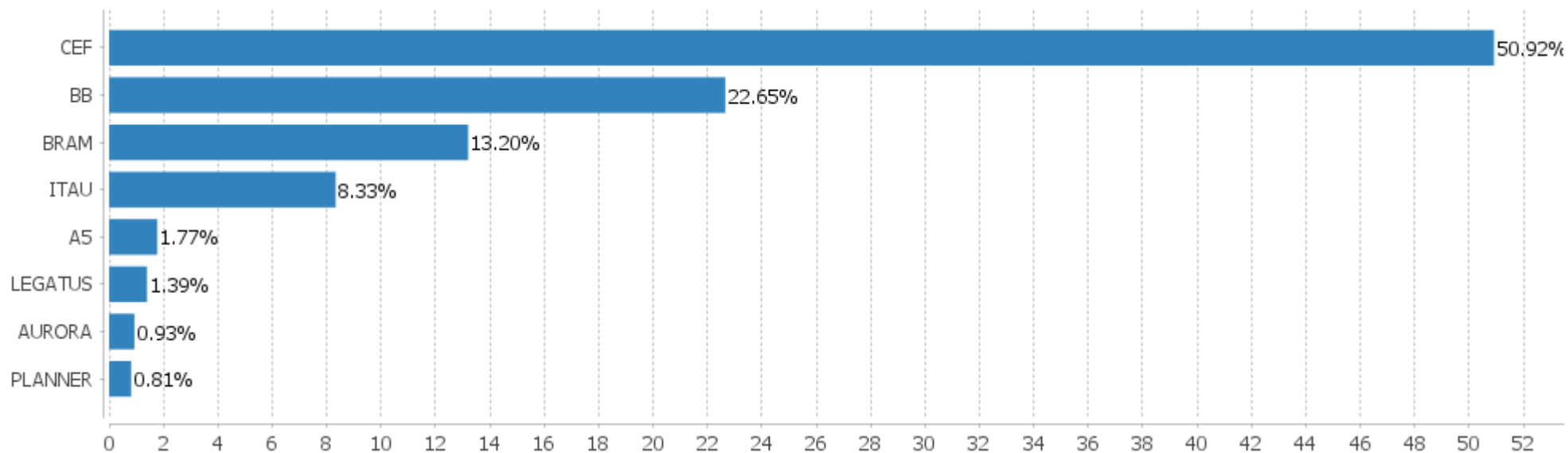


Alocação Por Estratégia



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	-0,25	-0,09	-0,91				2,41
IPCA + 5,45%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,98	1,43	1,34	1,61				11,22
p.p. indexador	-1,19	-1,75	-0,13	1,27	-0,14	-0,70	-1,68	-1,43	-2,52				-8,81
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

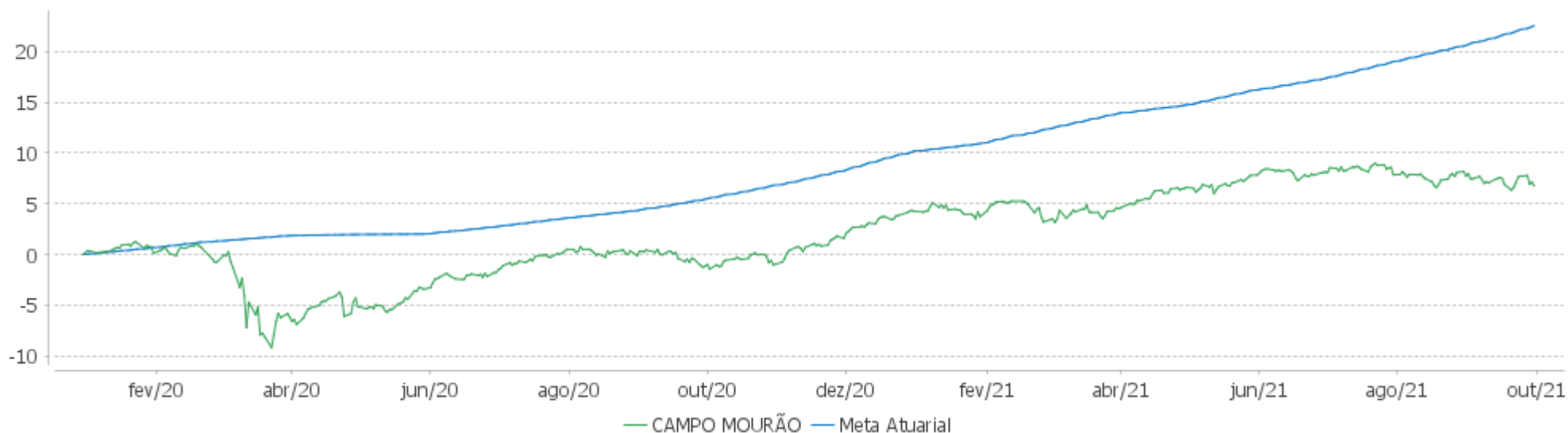
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	7	33,33	03 meses	-1,25	4,44	-5,69	4,67
Meses abaixo - Meta Atuarial	14	66,67	06 meses	2,15	7,59	-5,44	4,19
			12 meses	8,01	16,35	-8,34	4,40
			24 meses				
Desde 31/12/2019				6,76	23,05	-16,28	6,98

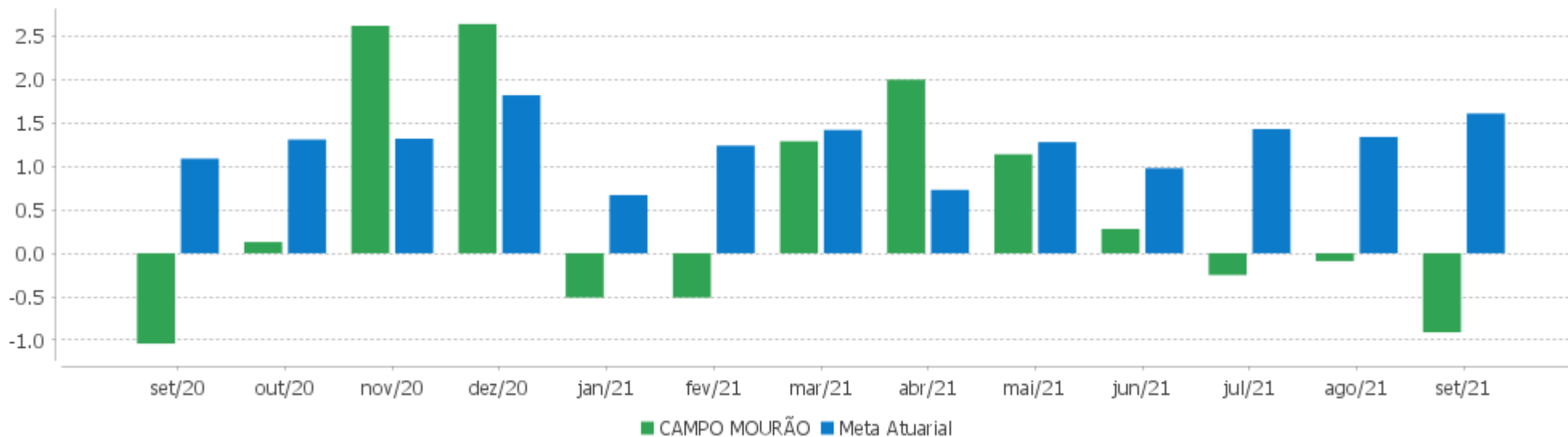
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,64	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-5,49	2020-03

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.	-0,16 -0,02	-2,51 -0,21	-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	2,30 -0,19	1,13 -0,05	2,53 -0,11	5,69 -0,26	13,00 -0,62	30,19 -0,93
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,03 -0,06	2,73 -0,34	1,30 0,11	2,74 -0,38	6,05 -0,17	13,77 -0,94	27,54 -1,91
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,37 -0,04	1,53 -0,25	0,87 -0,09	1,47 -0,18	2,16 -0,33	6,42 -0,73	14,11 -1,01
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,35 -0,81	-1,16 -8,06	-1,87 -4,89	-0,98 -5,73	0,85 -9,39	7,32 -6,38	26,96 9,96
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,08 -0,02	2,79 -0,28	1,21 0,03	2,82 -0,30	5,92 -0,29	13,71 -1,00	27,67 -1,78
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,98 -0,02	2,29 -0,20	1,11 -0,08	2,49 -0,15	5,70 -0,25	13,04 -0,58	30,18 -0,94
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,38 -0,02	1,59 -0,19	0,89 -0,07	1,54 -0,11	2,25 -0,25	6,68 -0,47	14,44 -0,68
FIDC GGR PRIME I % do CDI	-2,38 -544,09	-4,12 -164,49	-3,65 -298,19	-4,05 -201,20	-0,33 -11,06	-2,81 -42,20	-3,72 -27,84
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,84 -0,32	2,32 -4,58	1,30 -1,72	1,98 -2,77	2,72 -7,53	6,51 -7,19	21,07 4,08
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA Var. IPCA p.p.	-0,15 -1,31	-1,65 -8,55	-0,86 -3,88	0,43 -4,32	1,30 -8,95	4,80 -8,90	22,19 5,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-4,64 -5,36	17,47 -2,57	1,14 -7,86	9,99 6,48	30,71 7,20	42,05 -46,96	
CARE11 Var. IBOVESPA p.p.	-12,13 -5,56	-7,53 -0,78	-20,64 -8,16	19,87 24,71	-17,02 -34,33	-57,69 -63,65	-65,75 -105,63
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p.	-3,75 2,82	6,80 13,55	-10,94 1,54	3,12 7,96	28,12 10,81	29,33 23,38	
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-8,10 -1,53	-3,72 3,03	-12,45 0,03	0,03 4,88	13,48 -3,83	-13,14 -19,09	29,22 -10,65
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,52 4,05	-2,28 4,48	-6,51 5,97	0,33 5,18	29,38 12,07	17,40 11,45	82,81 42,94
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,10	3,74	-0,37	-0,75	3,19	1,09	-0,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-22,11	149,28	-29,96	-37,16	106,61	16,31	-6,75
FIP LA SHOPPING CENTERS	-0,14	-1,22	-0,44	-0,85	-1,79	6,01	18,35
% do CDI	-32,20	-48,83	-35,96	-42,31	-59,83	90,26	137,50
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-0,25	16,72	7,72	3,03	18,25	90,64	101,42
Var. IBOVESPA p.p.	6,32	23,48	20,20	7,87	0,94	84,69	61,54
CAMPO MOURÃO	-0,91	2,41	-1,25	2,15	8,01		
Var. IPCA + 5,45% p.p.	-2,52	-8,81	-5,69	-5,44	-8,22		
CDI	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35
IBOVESPA	-6,57	-6,75	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87
INPC + 6,00%	1,69	11,97	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02
IPCA + 6,00%	1,65	11,65	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,40	1,78	0,96	1,65	2,49	7,15	15,12	22,90	38,45
IRF-M 1+	-0,73	-5,87	-2,65	-1,15	-3,14	4,23	25,92	32,64	58,13
IRF-M TOTAL	-0,33	-2,95	-1,39	-0,15	-1,02	5,48	23,23	30,30	53,03
IMA-B 5	1,00	2,48	1,18	2,64	5,95	13,62	31,12	39,68	58,47
IMA-B 5+	-1,26	-6,63	-4,19	-1,61	3,20	1,48	46,98	45,78	70,99
IMA-B TOTAL	-0,13	-2,30	-1,59	0,52	4,71	6,92	40,46	44,04	66,75
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,02	-0,76	-0,42	0,89	2,05	6,02	23,59	29,99	49,60
IMA-GERAL TOTAL	-0,01	-0,38	-0,52	0,96	2,48	6,93	24,87	31,60	51,09
IDKA 2	1,10	3,07	1,18	3,12	6,21	14,71	29,45	40,48	59,67
IDKA 20	-3,03	-11,97	-8,65	-5,13	2,03	-7,04	59,98	49,40	80,44
CDI	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,90	34,86

Renda Variável

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	1,16	6,90	3,02	4,75	10,25	13,70	16,99	22,29	25,39
INPC	1,20	7,21	3,13	5,14	10,78	15,09	18,46	23,16	25,17
IGPM	-0,64	16,00	0,80	7,15	24,86	47,25	52,21	67,49	65,07
SELIC	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,91	34,89

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	0,73	20,04	8,99	3,52	23,52	89,01	100,82	193,57	232,88
MSCI ACWI	1,23	14,91	7,16	0,61	21,06	78,00	83,86	150,21	184,12
MSCI World	1,22	16,99	8,36	2,09	22,47	80,14	87,02	158,04	191,94

Meta Atuarial

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

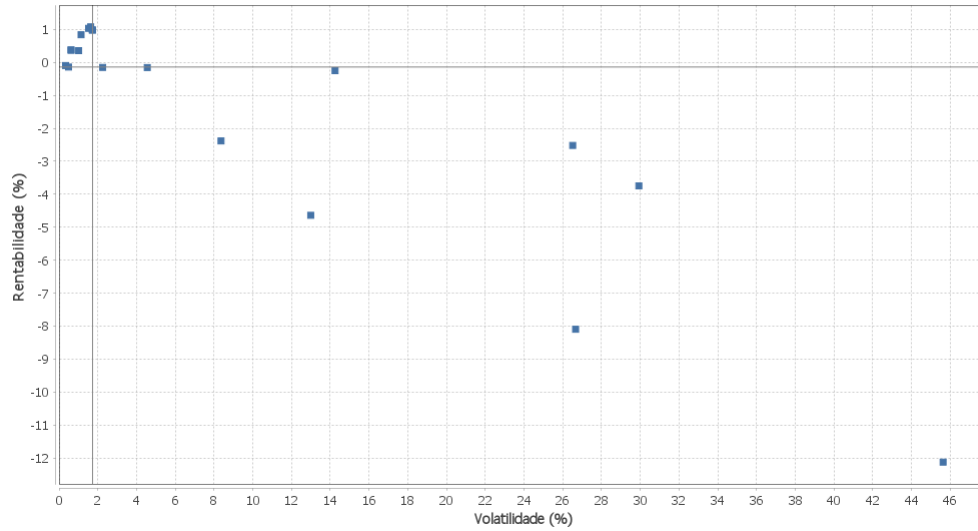
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
76	01/09/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	3.141.518,84	869.688,14845800	3,6122360000
77	01/09/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	6.798.869,96	1.882.177,67563600	3,6122360000
81	01/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	44.866,44	0,00	16.964,52669200	2,6447210000
78	01/09/2021	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	1.000.000,00	0,00	41.529,56545830	24,0792310000
63	01/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.720,82	0,00	17.665,68949900	2,6447210000
69	01/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	145.720,43	0,00	55.098,60208300	2,6447210000
66	01/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	646.544,57	0,00	244.466,07789600	2,6447210000
73	02/09/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.141.518,84	0,00	1.289.372,02643800	2,4364720000
82	02/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.802.656,73	0,00	2.572.154,49510700	2,6447310000
79	02/09/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	261.615,84	0,00	14.309,05713945	18,2832340000
72	22/09/2021	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	9.404.954,68	6.287.675,88137400	1,4957760000
74	23/09/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.404.847,57	0,00	3.822.560,24643600	2,4603530000
70	23/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	145.720,43	0,00	54.944,94775300	2,6521170000
67	23/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.573,77	0,00	3.232,80232300	2,6521170000
83	28/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	85.000,00	32.037,28137800	2,6531590000
65	28/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.000,00	2.261,45507100	2,6531590000
71	28/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	385.000,00	145.110,03533700	2,6531590000
75	30/09/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	267.782,47	0,00	108.674,68671800	2,4640740000
80	30/09/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1.000.000,00	0,00	54.215,31090258	18,4449740000
64	30/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.497,95	0,00	12.995,37939700	2,6546320000
68	30/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	631.273,10	0,00	237.800,60663700	2,6546320000

Total

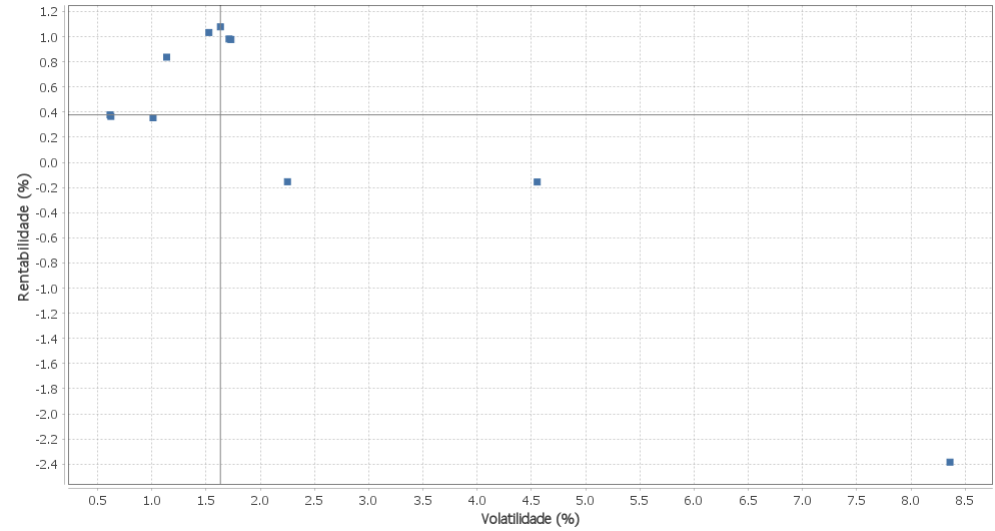
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

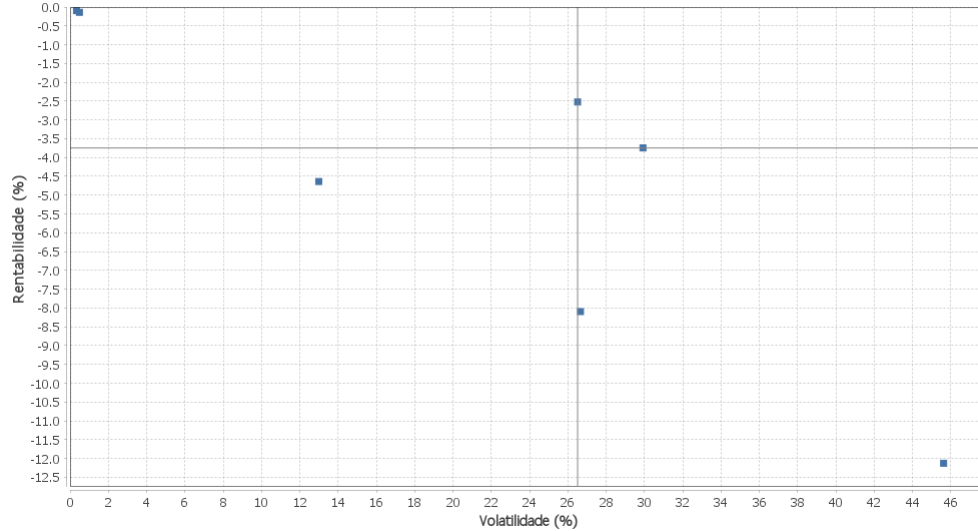
CAMPO MOURÃO - No Mês



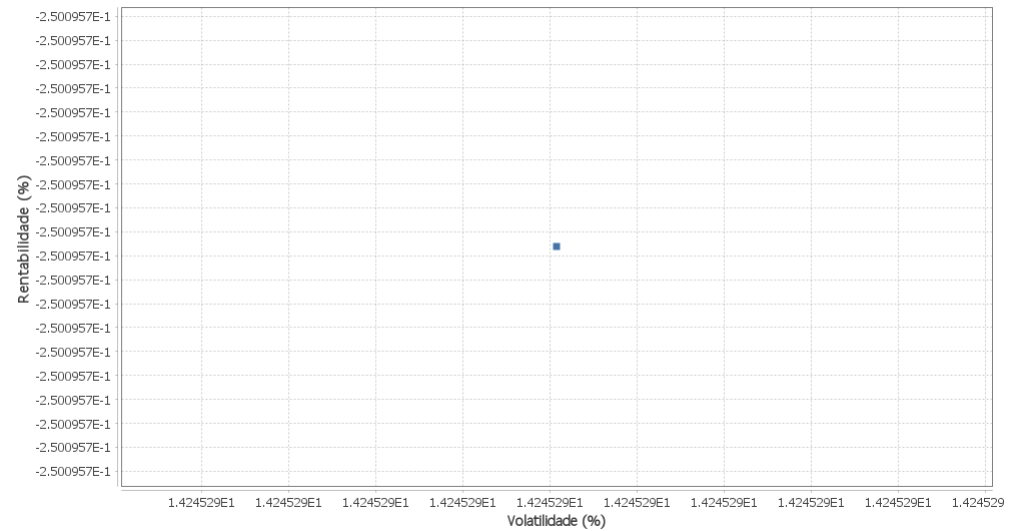
Renda Fixa - No Mês



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\$): 4.012.522,14

Value-At-Risk: 2,24%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Artigo 8º IV, Alínea a	0,34	0,03	0,00	-1,59	-0,10	3.179.378,47	1,77
FIP LA SHOPPING CENTERS	Artigo 8º IV, Alínea a	0,49	0,03	0,00	-1,18	-0,14	2.496.678,62	1,39
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,61	0,18	0,00	-0,10	0,38	14.952.543,78	8,35
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,62	0,18	0,00	-0,12	0,37	5.218.824,98	2,91
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,01	NaN	0,00	-0,08	0,35	0,00	0,00
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	1,14	0,52	0,01	0,35	0,84	10.951.755,60	6,11
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,53	1,07	0,04	0,39	1,03	13.955.972,14	7,79
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,63	1,04	0,04	0,39	1,08	15.434.521,91	8,62
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,71	1,23	0,04	0,32	0,98	12.199.754,60	6,81
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,73	1,25	0,05	0,31	0,98	14.277.081,11	7,97
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	2,25	1,26	0,09	-0,26	-0,15	23.653.515,72	13,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,55	NaN	0,00	-0,13	-0,16	0,00	0,00
FIDC GGR PRIME I	Artigo 7º VII, Alínea a	8,36	0,18	0,00	-0,34	-2,38	1.661.577,37	0,93
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	12,99	6,26	0,47	-0,39	-4,64	18.280.733,17	10,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	14,25	6,65	0,10	-0,05	-0,25	16.019.457,20	8,94
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	26,51	9,83	0,34	-0,11	-2,52	7.129.855,14	3,98
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	26,66	10,53	0,19	-0,32	-8,10	3.973.919,84	2,22
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	Artigo 8º II, Alínea a	29,92	11,96	0,84	-0,14	-3,75	14.321.779,71	7,99
CARE11	Artigo 8º IV, Alínea b	45,63	1,64	0,00	-0,28	-12,13	1.445.160,32	0,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso III, (10,20% 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, (10,20% dos recursos) está superior ao limite máximo estipulado em Política de Investimentos;