



LDB
EMPRESAS

CAMPO MOURÃO
NOVEMBRO 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 30.11.2021.

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

68,07%

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	0,62	0,77	1,78	5.231.876,34	2,90	7.084.325.912,32	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,62	0,78	1,84	14.299.837,19	7,92	6.377.941.010,36	0,22
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,76	2,47	3,52	12.345.304,74	6,84	11.929.906.744,63	0,10
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,57	2,43	3,91	21.004.482,88	11,64	9.400.574.561,59	0,22
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,73	2,42	3,91	19.005.166,19	10,53	10.904.431.852,46	0,17
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,78	2,47	3,48	14.443.683,46	8,00	6.334.560.730,61	0,23
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,43	2,03	2,09	86.330.350,80	47,83		

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	1,09	1,64	3,64	11.092.358,63	6,15	2.636.961.892,37	0,42
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	2,79	1,45	-0,93	23.825.912,63	13,20	1.191.144.678,26	2,00
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,46	1,52	-0,06	34.918.271,26	19,35		

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	7,19	-0,19	-3,12	1.612.520,76	0,89	149.634.564,82	1,08
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			7,19	-0,19	-3,12	1.612.520,76	0,89		
Renda Fixa			2,37	1,85	1,48	122.861.142,82	68,07		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

22,17%

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	22,20	-2,76	-17,42	3.408.779,46	1,89	632.869.840,70	0,54
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	19,86	1,72	-6,10	0,00	0,00	1.068.809.749,47	0,00
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	20,74	-0,52	-0,16	13.388.460,75	7,42	473.265.655,25	2,83
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			19,91	-1,58	-8,90	16.797.240,21	9,31		

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	12,73	-0,49	25,83	18.545.303,06	10,28	3.554.282.113,36	0,52
Sub-total Artigo 8º III			12,73	-0,49	25,83	18.545.303,06	10,28		

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 MULTIESTRATÉGIA	5,09	-0,12	3,50	3.171.968,79	1,76	137.124.382,37	2,31
LEGATUS	DAYCOVAL	FIP LA SHOPPING CENTERS	126,09	-71,52	-71,91	710.133,15	0,39	240.548.467,45	0,30
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			38,12	-31,52	-30,57	3.882.101,94	2,15		

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	62,16	-31,37	-49,43	790.322,05	0,44	285.292.727,14	0,28
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			62,16	-31,37	-49,56	790.322,05	0,44		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			14,09	-5,74	-1,98	40.014.967,26	22,17		
--	--	--	--------------	--------------	--------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

9,76%

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	17,25	-0,89	28,32	17.611.677,00	9,76	3.764.762.598,77	0,47
Sub-total Artigo 9º A, III			17,25	-0,89	28,32	17.611.677,00	9,76		
Investimentos no Exterior			17,39	-0,89	28,32	17.611.677,00	9,76		
Total			4,73	-0,18	2,26	180.487.787,08	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	86.330.350,80	47,83	0,00	47,91	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	34.918.271,26	19,35	0,00	13,25	40,00	0,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	1.612.520,76	0,89	0,00	1,17	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	122.861.142,82	68,07					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	16.797.240,21	9,31	0,00	12,64	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	18.545.303,06	10,28	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	3.882.101,94	2,15	0,00	3,82	5,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	790.322,05	0,44	0,00	1,21	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	40.014.967,26	22,17					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	17.611.677,00	9,76	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	17.611.677,00	9,76					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	2,03 346,43	2,09 58,10	1,72 113,39	1,19 45,27	3,74 99,16	1.580.911,83	1.637.989,06
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,52 258,22	-0,06 -1,73	1,04 68,89	0,82 31,15	2,10 55,62	521.164,00	135.040,85
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-0,19 -31,75	-3,12 -86,50	-1,36 -89,86	-2,61 -99,59	0,55 14,60	-3.009,32	-51.506,64
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,58 -0,05	-8,90 5,47	-12,02 2,18	-17,53 1,72	-1,08 5,33	-51.155,79	-1.917.921,33
Artigo 8º III % do CDI	-0,49 -83,51	25,83 716,63	2,15 141,90	11,27 430,59	28,26 748,81	-91.314,59	3.983.254,47
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-31,52 -29,99	-30,57 -16,20	-31,69 -17,49	-31,97 -12,71	-30,70 -24,29	-1.786.836,96	-1.707.932,63
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-31,37 -29,84	-49,56 -35,19	-51,94 -37,75	-55,41 -36,16	-55,31 -48,90	-361.290,08	-775.173,95
Artigo 9º A, III % do CDI	-0,89 -152,03	28,32 785,87	9,66 638,81	17,02 650,01		-158.521,51	2.385.701,46
CAMPO MOURÃO (Total)						-350.052,42	3.689.451,29

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IDKA2	13.781.137,43	6.850.899,17	0,00	0,00	21.004.482,88	372.446,28	569.082,96
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	14.095.082,49	0,00	0,00	0,00	14.443.683,46	348.600,97	485.727,54
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	5.191.752,72	0,00	0,00	0,00	5.231.876,34	40.123,62	91.586,45
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.217.419,35	2.373.588,94	0,00	0,00	19.005.166,19	414.157,90	337.695,53
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12.047.984,60	0,00	0,00	0,00	12.345.304,74	297.320,14	419.575,31
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.418.519,77	1.258.845,99	-485.791,49	0,00	14.299.837,19	108.262,92	166.524,37
					86.330.350,80	1.580.911,83	0,81

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 Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	23.484.263,27	0,00	0,00	0,00	23.825.912,63	341.649,36	-156.921,92
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	10.912.843,99	0,00	0,00	0,00	11.092.358,63	179.514,64	291.962,77
					34.918.271,26	521.164,00	0,27

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC GGR PRIME I	1.615.530,08	0,00	0,00	0,00	1.612.520,76	-3.009,32	-51.506,64
					1.612.520,76	-3.009,32	-0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	6.734.755,98	0,00	-6.850.899,17	0,00	0,00	116.143,19	-445.010,80
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	13.458.900,77	0,00	0,00	0,00	13.388.460,75	-70.440,02	-904.265,30
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	3.505.638,42	0,00	0,00	0,00	3.408.779,46	-96.858,96	-847.868,91
					16.797.240,21	-51.155,79	-0,03

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	18.636.617,65	0,00	0,00	0,00	18.545.303,06	-91.314,59	3.983.254,47
					18.545.303,06	-91.314,59	-0,05

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIP LA SHOPPING CENTERS	2.493.295,01	0,00	0,00	0,00	710.133,15	-1.783.161,86	-1.817.491,75
W7 FIP MULTIELSTRATÉGIA	3.175.643,89	0,00	0,00	0,00	3.171.968,79	-3.675,10	109.559,12
					3.882.101,94	-1.786.836,96	-0,92

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CARE11	1.151.612,13	0,00	0,00	0,00	0,00	790.322,05	-361.290,08	-775.173,95
						790.322,05	-361.290,08	-0,19

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17.770.198,51	0,00	0,00	0,00	17.611.677,00	-158.521,51	2.385.701,46
					17.611.677,00	-158.521,51	-0,08

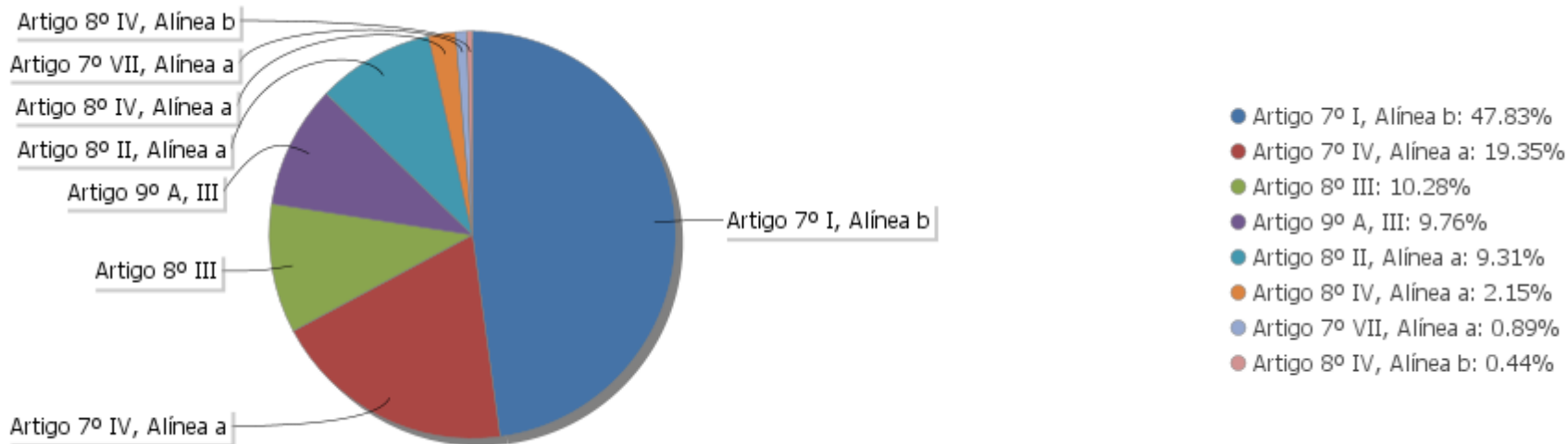
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

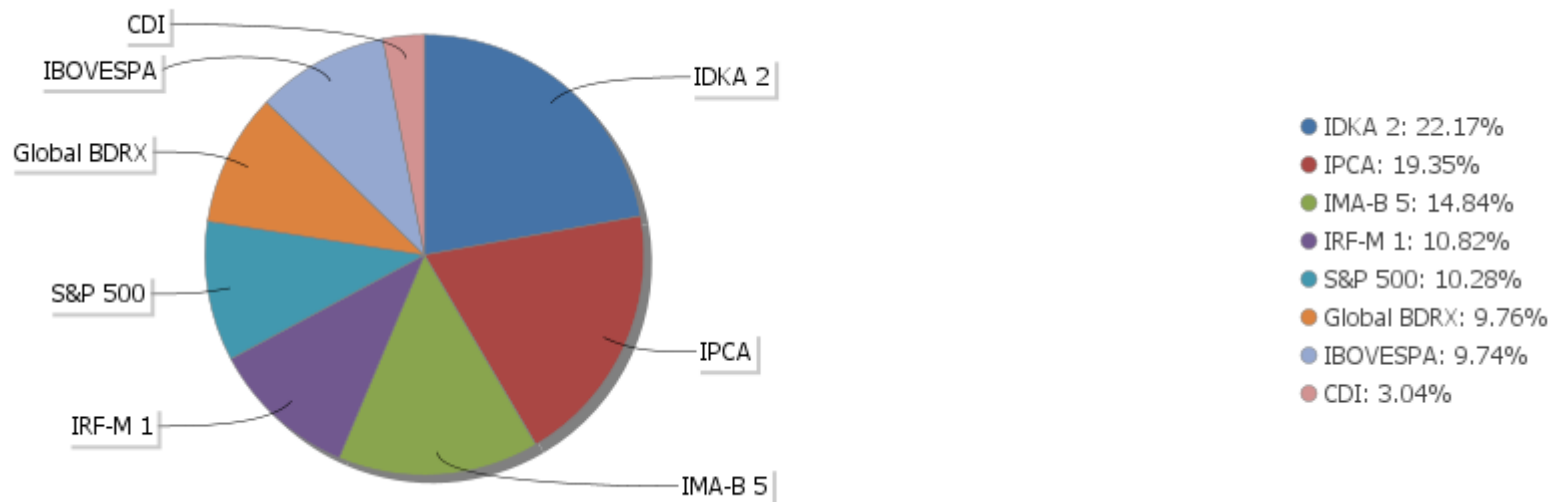
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	171.584.384,92	95,07	171.584.384,92	95,07
de 31 a 365 dias	6.580.748,25	3,65	178.165.133,17	98,71
acima de 365 dias	2.322.653,91	1,29	180.487.787,08	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

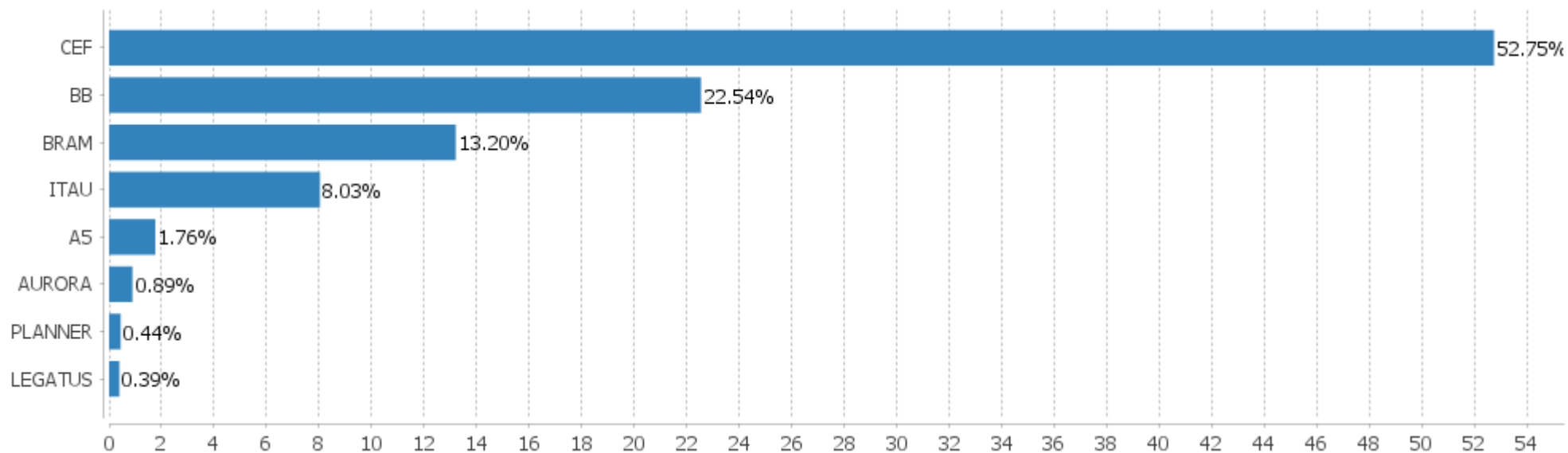


Alocação Por Estratégia



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	0,03	-0,18		2,26
IPCA + 5,45%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,98	1,43	1,34	1,61	1,68	1,38		14,64
p.p. indexador	-1,19	-1,75	-0,13	1,27	-0,14	-0,70	-1,68	-1,43	-2,52	-1,65	-1,56		-12,38
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

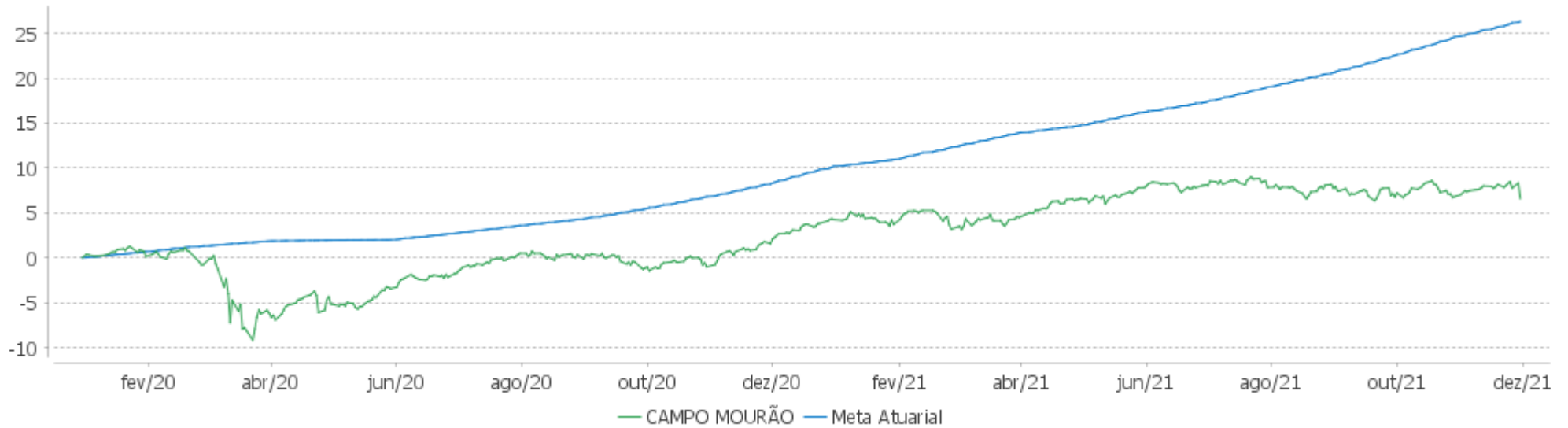
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	7	30,43
Meses abaixo - Meta Atuarial	16	69,57
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,64	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-5,49	2020-03

Relatório

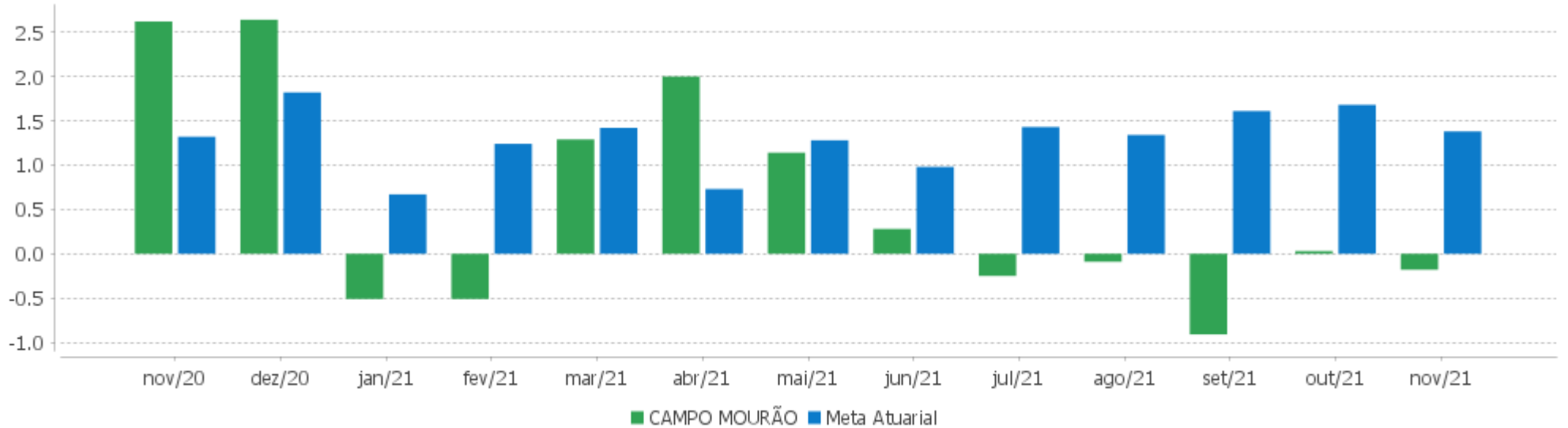
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	-1,06	4,73	-5,79	5,92
06 meses	-1,13	8,70	-9,83	4,94
12 meses	4,96	16,77	-11,81	4,73
24 meses				
Desde 31/12/2019	6,60	26,83	-20,23	6,90

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
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	1,64 0,69	3,64 -5,63	2,13 -1,27	2,90 -2,96	3,85 -6,89	6,97 -8,54	21,11 1,81
BRDESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA Var. IPCA p.p.	1,45 0,50	-0,93 -10,19	0,57 -2,82	0,20 -5,66	1,53 -9,21	4,57 -10,95	18,02 -1,28
FIDC GGR PRIME I % do CDI	-0,19 -31,75	-3,12 -86,50	-1,36 -89,86	-2,61 -99,59	0,55 14,60	-2,14 -31,07	-11,54 -86,22
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	2,47 -0,03	3,52 -0,23	2,19 -0,06	2,18 -0,12	5,40 -0,25	12,88 -0,59	27,61 -0,95
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	2,43 -0,08	3,91 -0,20	2,19 0,08	2,36 0,48	5,50 -0,42	13,43 -1,01	26,22 -1,81
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,77 -0,02	1,78 -0,25	0,62 -0,03	1,30 -0,12	2,10 -0,25	5,73 -0,67	12,75 -0,99
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	2,47 -0,03	3,48 -0,27	2,16 -0,09	2,09 -0,20	5,35 -0,30	12,86 -0,61	27,60 -0,96
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	2,42 -0,09	3,91 -0,19	2,18 0,07	2,03 0,15	5,63 -0,28	13,49 -0,95	26,27 -1,77
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,78 -0,01	1,84 -0,20	0,62 -0,03	1,32 -0,10	2,13 -0,22	5,96 -0,44	13,06 -0,69
CARE11 Var. IBOVESPA p.p.	-31,37 -29,84	-49,43 -35,06	-51,94 -37,75	-55,41 -36,16	-55,19 -48,78	-66,29 -60,45	-80,76 -94,63
W7 FIP MULTISTRATÉGIA % do CDI	-0,12 -19,72	3,50 97,14	-0,33 -21,79	-0,72 -27,46	3,30 87,53	1,19 17,34	-0,96 -7,15
FIP LA SHOPPING CENTERS % do CDI	-71,52 -12.188,79	-71,91 -1.995,11	-71,60 -4.732,52	-71,72 -2.739,70	-71,96 -1.906,39	-69,76 -1.015,10	-66,28 -495,26
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p.	-0,52 1,01	-0,16 14,21	-10,02 4,18	-17,46 1,79	6,32 12,72	13,57 19,41	
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-2,76 -1,23	-17,42 -3,05	-21,17 -6,97	-23,80 -4,55	-10,83 -4,43	-28,31 -22,47	-5,69 -19,56
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,87 0,66	-8,49 5,88	-8,72 5,48	-13,13 6,12	1,32 7,72	5,52 11,36	36,22 22,36
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-0,49 0,75	25,83 -5,66	2,15 -8,19	11,27 -5,41	29,78 -3,14	43,53 -49,92	69,64 -71,05
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-0,89	28,32	9,66	17,02	29,21	95,10	146,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Global BDRX p.p.	-0,22	-3,08	-0,55	-2,04	-3,41	-4,19	-7,16
CAMPO MOURÃO	-0,18	2,26	-1,06	-1,13	4,96		
Var. IPCA + 5,45% p.p.	-1,56	-12,38	-5,79	-9,83	-11,76		
CDI	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38
IBOVESPA	-1,53	-14,37	-14,20	-19,25	-6,41	-5,84	13,87
INPC + 6,00%	1,31	15,28	4,70	8,96	17,56	31,03	43,57
IPCA + 6,00%	1,42	15,18	4,87	8,99	17,33	29,67	41,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32	20.000000000000	2,00
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,10
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	D+0	D+0	D+3 du	D+4 du		0,40
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	1,20
CARE11	Não se aplica	Não se aplica				
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	0,70
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	D+1 du	D+0	D+13 du	D+15 du	0,00	2,00
FIDC GGR PRIME I	D+0	D+0		D+1600		
FIP LA SHOPPING CENTERS	Não se aplica	Não se aplica				
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du		2,50
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,40
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se aplica	Não se aplica				

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	0,79	2,03	0,65	1,42	2,35	6,40	13,74	21,69	36,07
IRF-M 1+	2,19	-7,11	-2,04	-3,73	-4,28	1,46	17,30	31,09	53,93
IRF-M TOTAL	1,79	-3,81	-1,21	-2,06	-1,93	3,27	16,74	28,91	49,37
IMA-B 5	2,50	3,75	2,25	2,30	5,65	13,47	28,56	40,58	59,06
IMA-B 5+	4,47	-6,23	-0,84	-2,98	0,81	1,50	31,39	50,00	74,04
IMA-B TOTAL	3,47	-1,49	0,70	-0,35	3,30	6,93	31,01	46,92	69,13
IMA-GERAL TOTAL	1,80	0,09	0,46	0,31	2,12	6,38	20,34	32,04	50,44
IDKA 2	2,51	4,11	2,12	1,88	5,91	14,44	28,04	40,40	59,70
IDKA 20	6,09	-12,50	-3,62	-8,23	-2,56	-7,04	31,71	56,52	86,71
CDI	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38	20,72	33,50

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-1,53	-14,37	-14,20	-19,25	-6,41	-5,84	13,87	41,61	64,63
IBRX 100	-1,69	-13,88	-14,79	-20,36	-6,00	-4,38	17,37	45,94	70,57
IBRX 50	-1,81	-13,79	-14,84	-20,46	-5,66	-4,80	12,95	40,34	62,89
SMALL CAP	-2,29	-19,26	-20,02	-26,60	-13,19	-9,64	29,55	46,85	103,82
IFIX	-3,64	-10,16	-6,23	-8,45	-8,19	-10,79	12,08	16,51	40,35
Índice Consumo - ICON	-7,50	-26,09	-21,46	-28,01	-22,40	-19,51	15,50	11,72	36,98
Índice Dividendos - IDIV	0,89	-7,89	-7,71	-11,70	0,34	0,29	33,23	61,08	90,61

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	0,95	9,26	3,40	5,86	10,74	15,51	19,30	24,12	27,60
INPC	0,84	9,36	3,23	5,84	10,96	16,73	20,66	24,95	27,38
IGPM	0,02	16,77	0,02	2,08	17,89	46,79	52,62	67,39	65,94
SELIC	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38	20,73	33,53

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	-1,24	31,49	10,34	16,68	32,92	93,45	140,69	197,22	243,65
MSCI ACWI	-2,91	21,57	7,09	9,69	23,86	76,81	115,31	147,67	190,75
MSCI World									

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,26	13,21	4,38	7,95	15,13	24,86	34,11	45,07	55,08
IPCA + 5,00%	1,34	14,19	4,63	8,47	16,23	27,25	37,99	50,70	62,64
IPCA + 5,50%	1,38	14,69	4,75	8,73	16,78	28,46	39,96	53,57	66,52
IPCA + 5,89%	1,41	15,07	4,84	8,93	17,21	29,40	41,51	55,84	69,61
IPCA + 6,00%	1,42	15,18	4,87	8,99	17,33	29,67	41,95	56,48	70,48
INPC + 4,00%	1,15	13,31	4,22	7,93	15,36	26,17	35,64	46,04	54,81
INPC + 6,00%	1,31	15,28	4,70	8,96	17,56	31,03	43,57	57,53	70,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
95	05/11/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.037.379,32	0,00	424.679,26128700	2,4427360000
96	05/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	639.839,76	0,00	241.863,69382000	2,6454560000
97	12/11/2021	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	0,00	6.850.899,17	4.590.304,17965600	1,4924717190
98	24/11/2021	BB PREV RF IDKA2	6.850.899,17	0,00	2.292.842,27524300	2,9879504770
99	25/11/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	331.062,54	0,00	133.634,24556100	2,4773780000
100	25/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	44.067,54	16.589,33945400	2,6563770000
101	25/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.776,25	2.174,48422800	2,6563770000
102	29/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	26.000,00	9.772,64358100	2,6604880000
103	29/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	119.488,80	44.912,36185100	2,6604880000
104	29/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	106.151,05	39.899,08815800	2,6604880000
105	29/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	184.307,85	69.275,95500900	2,6604880000
106	30/11/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.005.147,08	0,00	403.511,63529100	2,4909990000
107	30/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	619.006,23	0,00	232.620,87050400	2,6610090000

Total

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.734.413,96

Value-At-Risk: 2,07%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAMPO MOURÃO	7,26	2,07	2,07	-0,11	-0,18	180.487.787,08	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,18%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,67	0,59	0,01	0,03	0,28	0,77	5.231.876,34	2,90
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,68	0,59	0,02	0,02	0,29	0,78	14.299.837,19	7,92
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,52	1,51	0,05	0,03	0,75	2,47	12.345.304,74	6,84
BB PREV RF IDKA2	2,33	1,34	0,07	0,61	0,79	2,43	21.004.482,88	11,64
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,32	1,64	0,07	0,60	0,79	2,42	19.005.166,19	10,53
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,58	1,55	0,06	0,05	0,73	2,47	14.443.683,46	8,00
Sub-total	1,95	1,27	0,27		0,74	2,03	86.330.350,80	47,83

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,52	0,65	0,02	0,66	0,70	1,64	11.092.358,63	6,15
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	2,40	1,34	0,09	1,35	0,36	1,45	23.825.912,63	13,20
Sub-total	2,10	1,10	0,11		0,44	1,52	34.918.271,26	19,35

Artigo 7º VII, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC GGR PRIME I	0,66	0,12	0,00	0,13	-1,17	-0,19	1.612.520,76	0,89
Sub-total	0,66	0,12	0,00		-1,17	-0,19	1.612.520,76	0,89

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,14%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	25,34	13,48	0,18	4,96	-0,13	-2,76	3.408.779,46	1,89
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	20,40	NaN	0,00	NaN	-0,07	-0,87	0,00	0,00
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	21,53	12,33	0,69	4,39	-0,05	-0,52	13.388.460,75	7,42
Sub-total	21,46	12,33	0,87		-0,10	-1,58	16.797.240,21	9,31

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	15,00	7,20	0,56	7,16	-0,07	-0,49	18.545.303,06	10,28
Sub-total	15,00	7,20	0,56		-0,07	-0,49	18.545.303,06	10,28

Artigo 8º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	0,41	0,03	0,00	0,04	-1,71	-0,12	3.171.968,79	1,76
FIP LA SHOPPING CENTERS	445,80	5,78	0,00	5,79	-0,16	-71,52	710.133,15	0,39
Sub-total	134,40	1,07	0,00		-0,24	-31,52	3.882.101,94	2,15

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARE11	133,64	3,83	0,00	11,97	-0,24	-31,37	790.322,05	0,44
Sub-total	133,64	3,83	0,00		-0,24	-31,37	790.322,05	0,44

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,14%

Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	19,70	8,14	0,26	0,76	-0,08	-0,89	17.611.677,00	9,76
Sub-total	19,70	8,14	0,26		-0,08	-0,89	17.611.677,00	9,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso III, (10,28% 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, (10,28% dos recursos) está superior ao limite máximo estipulado em Política de Investimentos;