



LDB
EMPRESAS

GUARAPARI - CONSOLIDADO
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

66,14%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (3,650000%)	0,44	1,47	10,01	13.291.362,18	6,20
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,44	1,47	10,01	13.291.362,18	6,20

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-M	2,91	-0,38	-3,19	175.763,49	0,08	6.207.836.765,86	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	8,53	-0,87	-7,23	3.338.763,48	1,56	274.793.726,45	1,22
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,33	-0,15	-2,46	4.250.224,34	1,98	7.233.196.021,39	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,31	-0,16	-2,51	5.842.780,41	2,73	5.161.580.539,44	0,11
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,38	0,38	1,59	17.281.432,95	8,07	6.805.654.314,46	0,25
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,27	-1,27	-6,87	9.129.281,17	4,26	1.307.235.728,08	0,70
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,45	1,08	2,79	11.005.414,58	5,14	11.068.272.487,58	0,10
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,68	-0,01	-1,38	14.114.723,29	6,59	8.672.013.980,14	0,16
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,43	0,35	-1,16	35.165.680,93	16,41	14.407.320.968,51	0,24
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,87	0,14	-1,22	100.304.064,64	46,81		

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
CEF	CEF	FI CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,23	0,42	1,76	3.798.680,46	1,77	1.098.730.430,85	0,35
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,29	0,61	1,55	511.706,92	0,24	2.270.442.340,00	0,02
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,77	0,13	-0,83	20.974.080,54	9,79	141.942.485,35	14,78
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,65	0,18	-0,66	25.284.467,92	11,80		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado")

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	2,98	0,81	0,93	2.838.579,00	1,32	222.360.883,74	1,28
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			2,98	0,81	0,93	2.838.579,00	1,32		
Renda Fixa			2,49	0,29	-0,02	141.718.473,74	66,14		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

26,07%

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
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,39	-6,75	-5,50	5.816.945,26	2,71	1.120.979.496,53	0,52
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	20,85	-6,47	-6,78	11.076.835,24	5,17	107.055.897,14	10,35
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			20,65	-6,57	-6,34	16.893.780,50	7,88		

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 ENERGIA FI	18,75	-2,30	-8,03	5.632.220,69	2,63	337.073.560,97	1,67
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	18,73	-6,04	-10,92	1.466.569,31	0,68	745.348.218,75	0,20
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	32,00	-10,69	-29,08	215.731,28	0,10	273.686.159,23	0,08
CEF	CEF	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	21,58	-1,88	-4,23	381.422,84	0,18	378.964.582,69	0,10
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	19,68	-7,98	-9,65	8.390.646,42	3,92	732.667.418,23	1,15
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	21,66	-6,06	-12,35	333.851,25	0,16	328.305.295,69	0,10
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	20,82	-8,81	-15,27	9.026.966,23	4,21	196.446.321,75	4,60
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	19,70	-7,05	-8,20	2.318.967,59	1,08	461.684.635,98	0,50
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	20,56	-2,52	-2,28	6.258.016,06	2,92	1.139.604.291,88	0,55
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,49	-6,49	-7,26	4.047.681,77	1,89	1.005.326.835,22	0,40
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			18,49	-6,16	-9,54	38.072.073,44	17,77		

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
CEF	CEF	CXCE11B	63,50	14,16	-40,02	566.600,00	0,26	139.210.378,11	0,41
RIO BRAVO	VOTORANTIM	RBRD11	33,27	-2,34	-37,10	332.577,80	0,16	133.408.409,27	0,25
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			48,79	7,45	-38,91	899.177,80	0,42		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

18,55

-6,09

-9,33

55.865.031,74

26,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,78%

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	10.340.966,46	4,83	3.337.438.389,61	0,31
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	18,27	0,62	17,77	6.332.543,05	2,96	1.182.247.363,81	0,54
Sub-total Artigo 9º A, III			18,17	0,08	17,12	16.673.509,51	7,78		
Investimentos no Exterior			18,17	0,08	17,12	16.673.509,51	7,78		
Total			6,20	-1,47	-1,48	214.257.014,99	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	13.291.362,18	6,20	0,00	6,65	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	100.304.064,64	46,81	0,00	51,59	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	25.284.467,92	11,80	0,00	6,10	40,00	0,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.838.579,00	1,32	0,00	1,39	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	141.718.473,74	66,14					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	16.893.780,50	7,88	0,00	7,33	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	38.072.073,44	17,77	0,00	17,56	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	899.177,80	0,42	0,00	0,76	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	55.865.031,74	26,07					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	16.673.509,51	7,78	0,00	7,15	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	16.673.509,51	7,78					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 a % do CDI	1,47 335,78	10,01 399,40	3,69 301,96	6,50 322,50	14,10 471,61	192.742,32	1.233.409,61
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,14 32,71	-1,22 -48,49	-1,16 -94,66	0,14 6,96	2,41 80,62	143.970,59	-1.257.973,79
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,18 41,56	-0,66 -26,26	0,11 8,84	1,52 75,64	2,71 90,47	47.057,40	-28.199,01
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,81 185,25	0,93 37,24	-0,45 -36,41	1,35 67,13	3,83 128,22	22.858,50	26.256,00
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-6,57 -0,00	-6,34 0,41	-12,73 -0,25	-4,87 -0,02	17,02 -0,29	-1.188.021,92	-1.143.639,84
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-6,16 0,41	-9,54 -2,79	-12,46 0,02	-7,19 -2,34	9,41 -7,90	-2.498.962,71	-4.018.118,83
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	7,45 14,02	-38,91 -32,16	-28,35 -15,87	-22,21 -17,36	-33,24 -50,55	62.492,19	-590.406,95
Artigo 9º A, III % do CDI	0,08 17,98	17,12 682,79	8,23 672,86	3,38 167,67	18,38 614,69	13.125,59	2.437.171,57
GUARAPARI - CONSOLIDADO (Total)						-3.204.738,04	-3.341.501,24

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150850 (3,650000%)	13.098.619,86	0,00	0,00	0,00	13.291.362,18	192.742,32	1.233.409,61
					13.291.362,18	0,00	0,00

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	3.368.185,79	0,00	0,00	0,00	3.338.763,48	-29.422,31	-245.243,78
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	14.115.473,11	0,00	0,00	0,00	14.114.723,29	-749,82	-197.362,88
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.256.760,76	0,00	0,00	0,00	4.250.224,34	-6.536,42	-142.872,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IRF-M	176.426,55	0,00	0,00	0,00	175.763,49	-663,06	-5.785,97
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.888.007,66	0,00	0,00	0,00	11.005.414,58	117.406,92	298.830,03
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.246.262,41	0,00	0,00	0,00	9.129.281,17	-116.981,24	-673.387,30
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.851.896,26	0,00	0,00	0,00	5.842.780,41	-9.115,85	-150.168,96
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.390.599,14	0,00	-174.818,17	0,00	17.281.432,95	65.651,98	277.378,42
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	35.041.300,54	0,00	0,00	0,00	35.165.680,93	124.380,39	-419.360,63
					100.304.064,64	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	21.404.604,85	0,00	-458.400,00	0,00	20.974.080,54	27.875,69	-105.154,27
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	508.605,09	0,00	0,00	0,00	511.706,92	3.101,83	7.806,92
FI CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.866.475,17	0,00	-83.874,59	0,00	3.798.680,46	16.079,88	69.148,34
					25.284.467,92	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	2.815.720,50	0,00	0,00	0,00	2.838.579,00	22.858,50	26.256,00
					2.838.579,00	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	6.238.108,29	0,00	0,00	0,00	5.816.945,26	-421.163,03	-338.325,64
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVSPA	11.843.694,13	0,00	0,00	0,00	11.076.835,24	-766.858,89	-805.314,20
					16.893.780,50	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	9.898.905,17	0,00	0,00	0,00	9.026.966,23	-871.938,94	-1.626.547,81
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	2.494.909,72	0,00	0,00	0,00	2.318.967,59	-175.942,13	-207.202,83
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1.560.797,85	0,00	0,00	0,00	1.466.569,31	-94.228,54	-179.820,50
BB AÇÕES ENERGIA FI	5.764.524,88	0,00	0,00	0,00	5.632.220,69	-132.304,19	-491.985,03
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	6.419.901,65	0,00	0,00	0,00	6.258.016,06	-161.885,59	-145.749,64
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	241.540,96	0,00	0,00	0,00	215.731,28	-25.809,68	-90.687,76
FIA CAIXA CONSUMO	355.400,43	0,00	0,00	0,00	333.851,25	-21.549,18	-46.336,47
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	388.748,60	0,00	0,00	0,00	381.422,84	-7.325,76	-16.677,10
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.328.405,90	0,00	0,00	0,00	4.047.681,77	-280.724,13	-317.046,09
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	9.117.900,99	0,00	0,00	0,00	8.390.646,42	-727.254,57	-896.065,60
					38.072.073,44	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CXCE11B	505.300,00	0,00	0,00	0,00	9.152,47	566.600,00	70.452,47	-393.431,18
RBRD11	341.212,68	0,00	0,00	0,00	674,60	332.577,80	-7.960,28	-196.975,77
						899.177,80	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	6.293.490,30	0,00	0,00	0,00	6.332.543,05	39.052,75	955.694,64
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	10.366.893,62	0,00	0,00	0,00	10.340.966,46	-25.927,16	1.481.476,93
					16.673.509,51	0,00	0,00

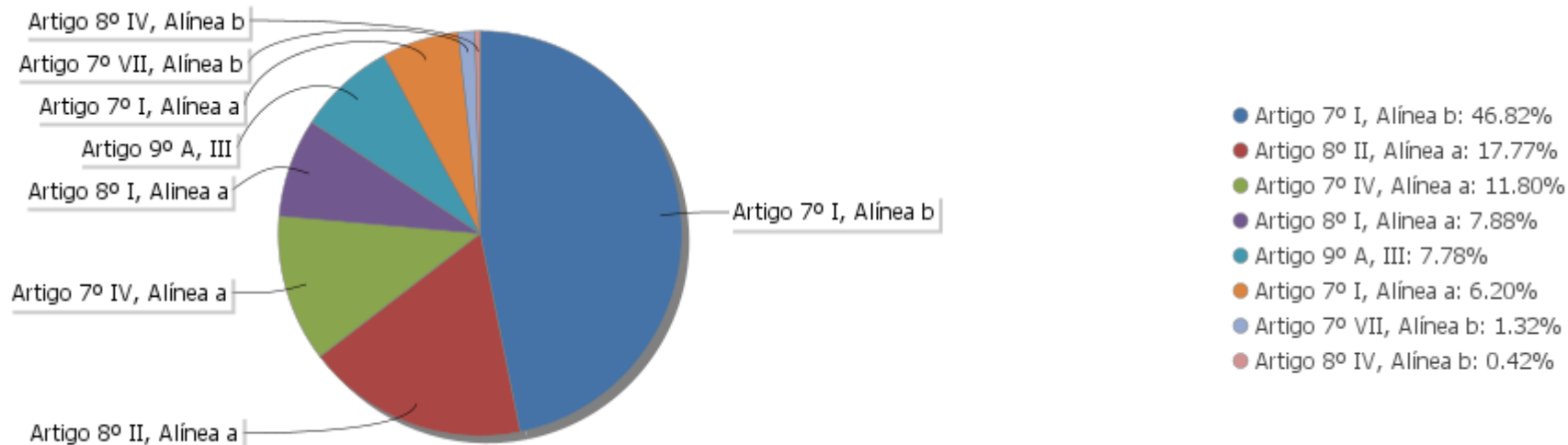
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

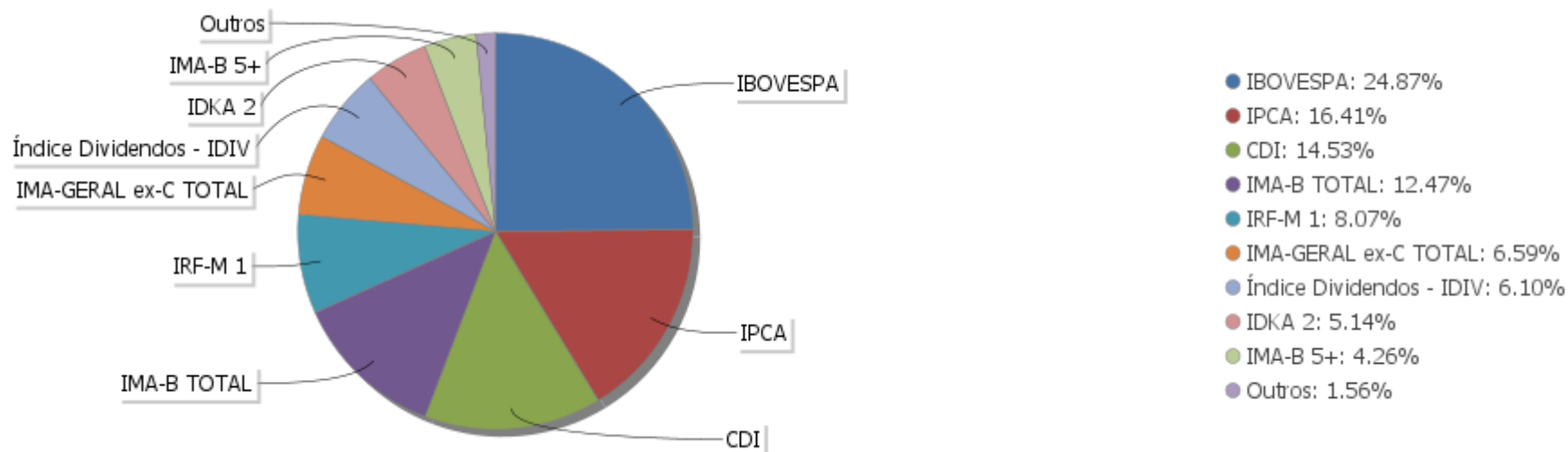
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	173.242.342,33	80,86	173.242.342,33	80,86
de 31 a 365 dias	27.723.310,48	12,94	200.965.652,81	93,80
acima de 365 dias	13.291.362,18	6,20	214.257.014,99	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

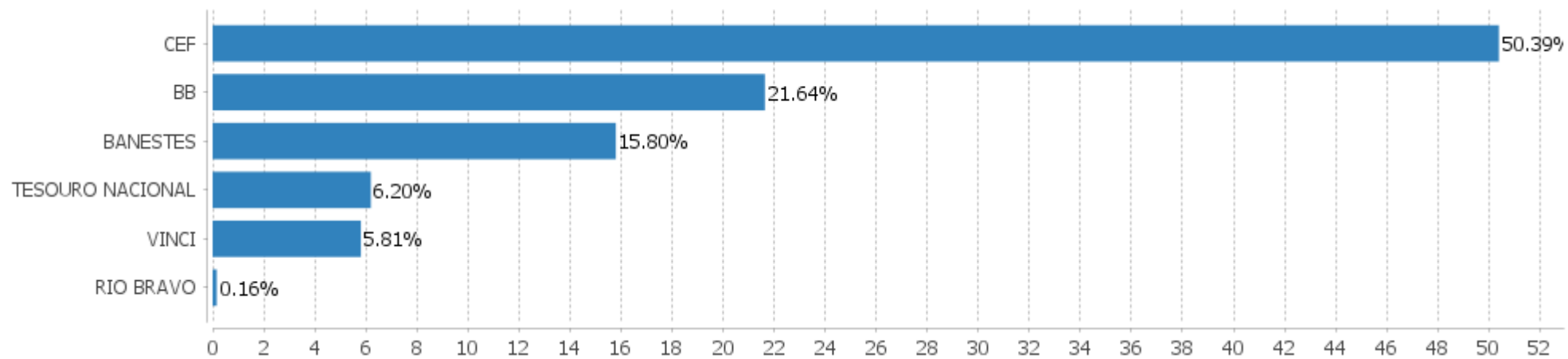


Alocação Por Estratégia



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	-0,76	-1,44	1,70	1,04	1,53	-0,01	-0,86	-1,14	-1,47				-1,48
INPC + 5,44%	0,69	1,20	1,35	0,80	1,41	1,05	1,49	1,35	1,65				11,53
p.p. indexador	-1,45	-2,65	0,35	0,23	0,12	-1,06	-2,35	-2,49	-3,12				-13,01
2020	0,77	-2,12	-9,27	3,74	2,00	3,51	3,38	-0,51	-1,76	-0,15	4,27	3,83	7,06
INPC + 5,87%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,96	0,84	1,35	1,37	1,41	1,97	11,61
p.p. indexador	0,08	-2,70	-9,95	3,52	1,79	2,73	2,41	-1,35	-3,12	-1,52	2,86	1,87	-4,56
2019	2,55	0,43	0,66	1,14	1,49	2,59	1,23	0,29	2,11	1,83	0,00	3,04	18,74
INPC + 6,00%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,44	0,57	1,01	1,71	10,78
p.p. indexador	1,68	-0,58	-0,56	0,05	0,83	2,14	0,60	-0,34	1,67	1,25	-1,00	1,32	7,97
2018	1,29	0,58	1,16	0,41	-1,31	0,30	1,07	-0,09	0,62	2,66	1,08	0,41	8,45
INPC + 6,00%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	0,74	0,91	0,21	0,60	9,59
p.p. indexador	0,55	-0,02	0,61	-0,29	-2,22	-1,62	0,30	-0,63	-0,12	1,75	0,86	-0,19	-1,14
2017	1,21	1,17	1,22	0,80	-0,24	1,39	1,86	1,05	1,01	0,45	0,10	0,85	11,41
INPC + 6,00%	0,93	0,66	0,85	0,50	0,87	0,19	0,66	0,50	0,44	0,86	0,64	0,72	8,12
p.p. indexador	0,28	0,51	0,36	0,30	-1,11	1,21	1,20	0,55	0,56	-0,41	-0,54	0,13	3,30

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	32	56,14
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	43,86

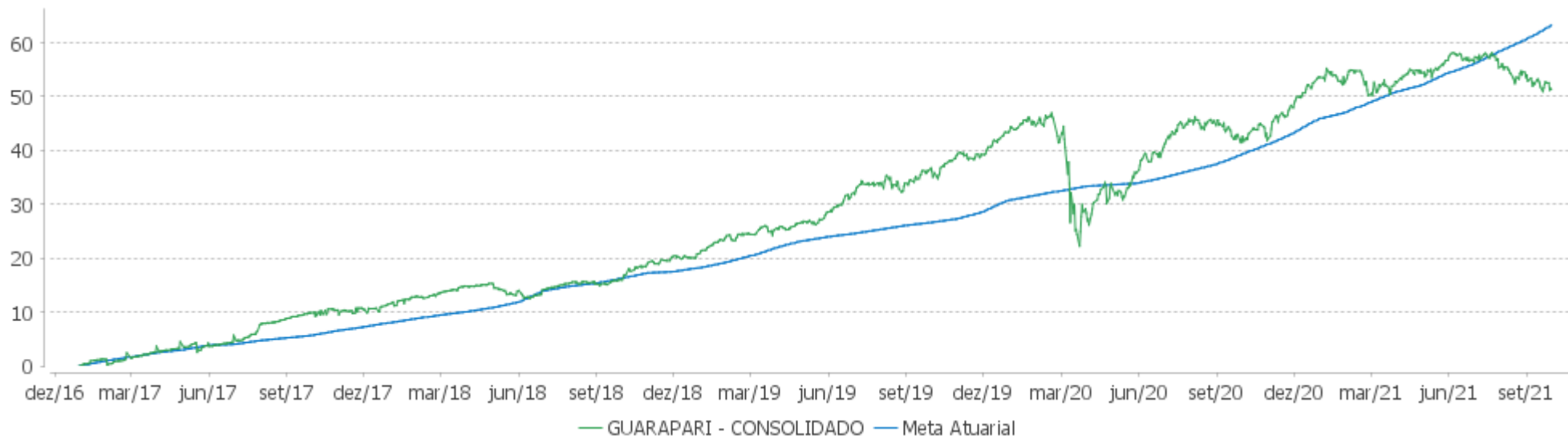
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,27	2020-11
Menor rentabilidade da Carteira	-9,27	2020-03

Relatório

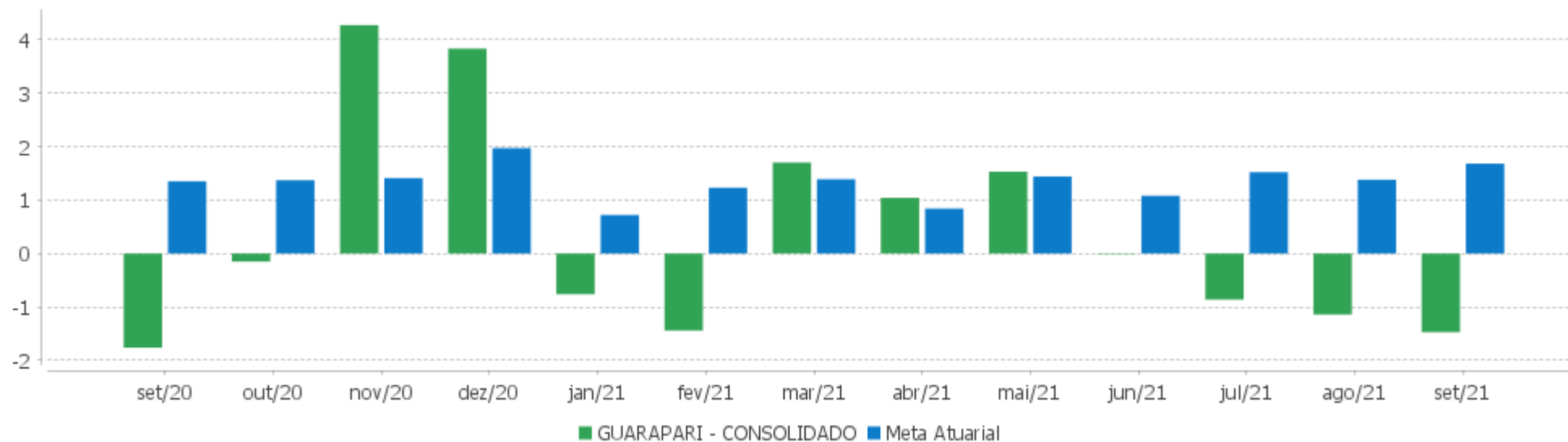
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	-3,44	4,55	-7,99	6,15
06 meses	-0,96	7,99	-8,95	5,39
12 meses	6,50	16,90	-10,40	6,20
24 meses	10,66	28,62	-17,95	10,38
36 meses	30,50	40,29	-9,79	8,81
48 meses	37,73	54,51	-16,77	7,87
Desde 30/12/2016	51,32	63,38	-12,06	7,45

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 IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,81 -0,84	0,93 -10,71	-0,45 -5,02	1,35 -6,52	3,83 -13,00	11,46 -16,27	30,76 -8,51
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,61 139,17	3,44 137,39	1,55 126,69	2,55 126,74	4,07 136,13	4,74 71,17	11,76 88,13
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	0,13 29,52	-0,83 -33,03	-0,11 -9,40	1,35 67,04	2,53 84,61	4,44 66,74	25,62 191,92
FI CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS RF % do CDI	0,42 95,44	2,28 90,75	1,18 96,90	1,90 94,48	2,87 95,98	6,32 95,04	12,96 97,10
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
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,87 -0,74	-7,23 -4,93	-3,51 -1,92	-0,95 -1,47	2,86 -1,85	-4,59 -11,51	37,72 -2,74
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,01 -0,03	-1,38 -0,62	-0,70 -0,28	0,51 -0,38	1,75 -0,30	5,52 -0,51	23,63 0,04
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,35 -0,81	-1,16 -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 IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,38 -0,05	-3,19 -0,24	-1,51 -0,12	-0,38 -0,23	-1,26 -0,24	4,87 -0,60	22,26 -0,96
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
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,15 -0,02	-2,46 -0,16	-1,66 -0,07	0,40 -0,12	4,49 -0,22	6,40 -0,52	39,39 -1,07
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,27 -0,01	-6,87 -0,24	-4,33 -0,14	-1,81 -0,20	2,97 -0,24	0,80 -0,67	45,16 -1,83
NTN-B 150850 (3,650000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,47 1,60	10,01 12,31	3,69 5,28	6,50 5,98	14,10 9,39	17,03 10,11	24,74 -15,72
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-8,81 -4,32	-15,27 -10,60	-18,88 -12,28	-14,02 -12,51	-4,84 -24,42	0,39 -7,46	52,80 -12,03
BB AÇÕES ENERGIA FI % do CDI	-2,30 -523,74	-8,03 -320,40	-3,54 -289,73	-4,93 -244,89	11,02 368,50	4,96 74,56	84,44 632,58
FIA CAIXA CONSUMO	-6,06	-12,35	-14,65	-8,05	-3,11	-4,25	46,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,11	-0,86	-0,32	-0,57	-1,44	-1,56	-4,47
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	-1,88	-4,23	-6,58	-0,76	15,82	9,79	86,15
Var. IBOVESPA p.p.	4,68	2,52	5,90	4,09	-1,49	3,84	46,28
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	-7,05	-8,20	-14,12	-5,86	14,97	0,89	28,85
Var. IBOVESPA p.p.	-0,48	-1,45	-1,64	-1,01	-2,34	-5,06	-11,02
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	-7,98	-9,65	-14,44	-7,16	9,34	9,32	71,08
Var. IBOVESPA p.p.	-1,41	-2,90	-1,96	-2,31	-7,97	3,37	31,20
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	-10,69	-29,08	-23,22	-22,47	-16,16	-33,94	17,09
% do CDI	-2.438,38	-1.159,69	-1.898,77	-1.115,15	-540,27	-510,08	128,03
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-6,49	-7,26	-10,65	-4,65	15,95	7,86	66,44
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-2,00	-2,59	-4,05	-3,14	-3,63	0,01	1,61
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-6,04	-10,92	-14,46	-7,63	7,38	-10,29	22,14
Var. IBOVESPA p.p.	0,53	-4,17	-1,98	-2,78	-9,93	-16,24	-17,73
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-2,52	-2,28	-6,51	0,33	29,38	17,40	82,81
Var. IBOVESPA p.p.	4,05	4,48	5,97	5,18	12,07	11,45	42,94
CXCE11B	14,16	-40,02	-33,62	-25,14	-36,87	-27,72	-9,68
Var. IBOVESPA p.p.	20,73	-33,27	-21,14	-20,29	-54,18	-33,67	-49,56
RBRD11	-2,34	-37,10	-16,85	-16,62	-25,61	-41,94	-18,14
Var. IBOVESPA p.p.	4,23	-30,34	-4,37	-11,77	-42,92	-47,89	-58,02
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	-6,47	-6,78	-12,33	-4,85	16,73	5,37	38,01
Var. IBOVESPA p.p.	0,09	-0,02	0,15	-0,00	-0,58	-0,58	-1,86
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-6,75	-5,50	-13,47	-4,90	17,56	7,93	46,90
Var. IBOVESPA p.p.	-0,18	1,26	-0,99	-0,05	0,25	1,97	7,02
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
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	0,62	17,77	9,07	3,96	18,60	85,75	81,06
Var. IBOVESPA p.p.	7,19	24,53	21,55	8,81	1,29	79,79	41,19
GUARAPARI - CONSOLIDADO	-1,47	-1,48	-3,44	-0,96	6,50	10,66	30,50
Var. INPC + 5,87% p.p.	-3,15	-13,35	-8,10	-9,17	-10,76	-18,31	-10,00
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

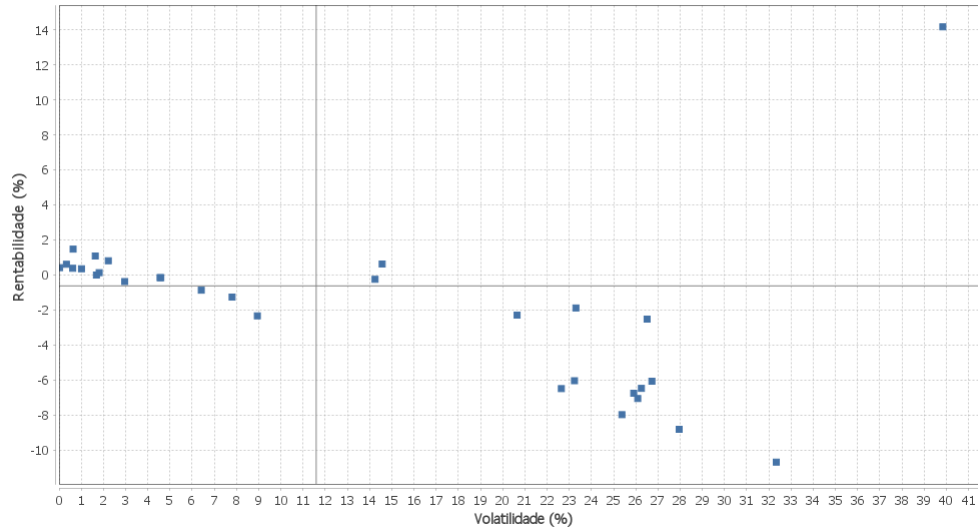
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
199	10/09/2021	FI CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.000,00	2.298,33433500	4,3509770000
200	22/09/2021	FI CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.000,00	4.589,69713100	4,3575860000
198	27/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	174.818,17	65.898,96916100	2,6528210000
201	27/09/2021	FI CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	53.874,59	12.355,43516100	4,3603960000
196	27/09/2021	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	0,00	277.629,09	218.497,81926056	1,2706263500
197	27/09/2021	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	0,00	180.770,91	142.269,13343147	1,2706263500

Total

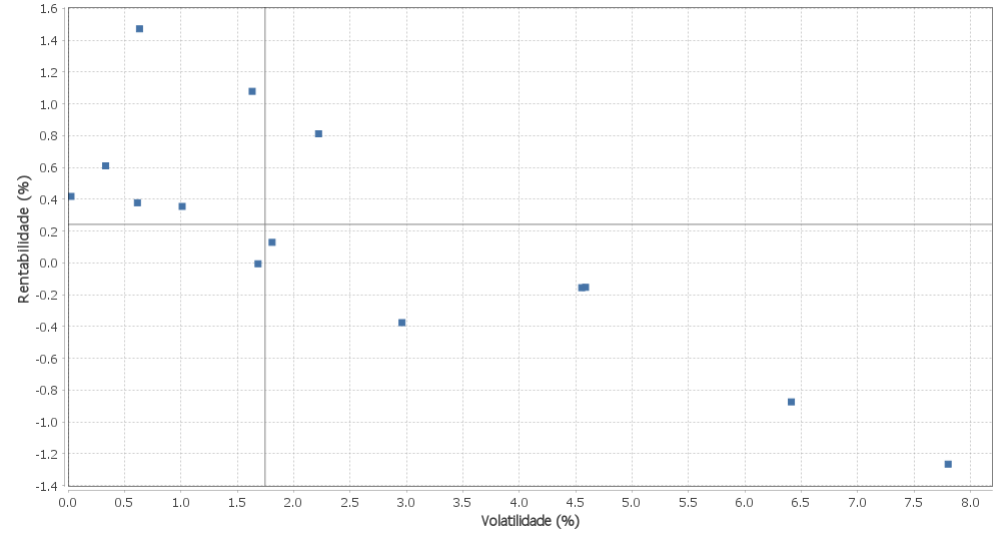
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

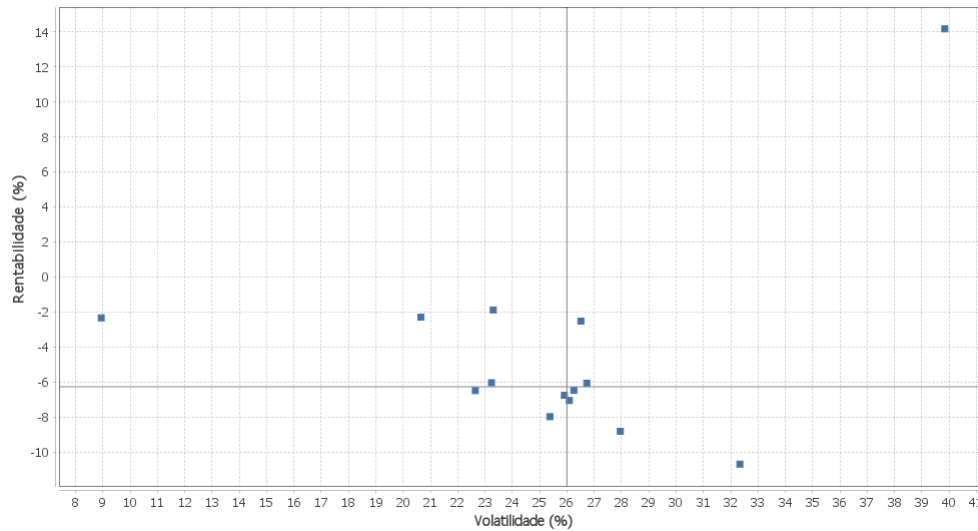
GUARAPARI - CONSOLIDADO - No Mês



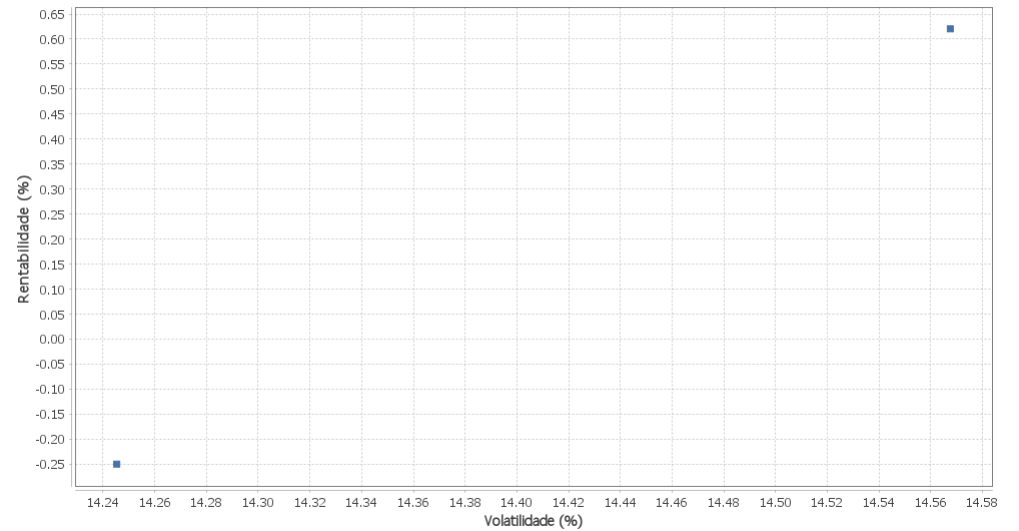
Renda Fixa - No Mês



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\$): 5.897.477,29

Value-At-Risk: 2,75%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	-0,00	-0,76	0,42	3.798.680,46	1,77
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,33	0,06	-0,00	0,52	0,61	511.706,92	0,24
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,61	0,18	0,00	-0,10	0,38	17.281.432,95	8,07
NTN-B 150850 (3,650000%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,63	0,13	0,00	1,63	1,47	13.291.362,18	6,20
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,01	1,46	0,13	-0,08	0,35	35.165.680,93	16,41
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,63	1,04	0,02	0,39	1,08	11.005.414,58	5,14
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,68	1,11	0,05	-0,26	-0,01	14.114.723,29	6,59
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	1,81	1,23	0,08	-0,17	0,13	20.974.080,54	9,79
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	Artigo 7º VII, Alínea b	2,22	1,87	0,02	0,17	0,81	2.838.579,00	1,32
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,96	1,48	0,00	-0,27	-0,38	175.763,49	0,08
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,55	2,95	0,05	-0,13	-0,16	5.842.780,41	2,73
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,59	2,97	0,04	-0,13	-0,15	4.250.224,34	1,98
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	6,41	3,54	0,04	-0,20	-0,87	3.338.763,48	1,56
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,80	4,07	0,12	-0,22	-1,27	9.129.281,17	4,26
RBRD11	Artigo 8º IV, Alínea b	8,94	1,40	0,00	-0,31	-2,34	332.577,80	0,16
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	14,25	6,65	-0,03	-0,05	-0,25	10.340.966,46	4,83
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	14,57	6,16	-0,01	0,01	0,62	6.332.543,05	2,96
BB AÇÕES ENERGIA FI	Artigo 8º II, Alínea a	20,65	9,52	0,20	-0,13	-2,30	5.632.220,69	2,63
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	22,64	7,63	0,13	-0,31	-6,49	4.047.681,77	1,89
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	23,24	9,42	0,06	-0,28	-6,04	1.466.569,31	0,68
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	Artigo 8º II, Alínea a	23,30	9,09	0,01	-0,10	-1,88	381.422,84	0,18
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	25,37	8,90	0,33	-0,33	-7,98	8.390.646,42	3,92
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	25,91	8,65	0,22	-0,28	-6,75	5.816.945,26	2,71
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	26,09	9,50	0,10	-0,29	-7,05	2.318.967,59	1,08
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	26,25	9,93	0,49	-0,26	-6,47	11.076.835,24	5,17
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	26,51	9,83	0,26	-0,11	-2,52	6.258.016,06	2,92
FIA CAIXA CONSUMO	Artigo 8º II, Alínea a	26,73	10,46	0,01	-0,24	-6,06	333.851,25	0,16
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	27,96	10,65	0,40	-0,33	-8,81	9.026.966,23	4,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	Artigo 8º II, Alínea a	32,33	12,49	0,01	-0,34	-10,69	215.731,28	0,10
CXCE11B	Artigo 8º IV, Alínea b	39,84	6,73	0,00	0,34	14,16	566.600,00	0,26