



LDB
EMPRESAS

SÃO JOSÉ DO CALÇADO
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 91,06%

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	2,97	0,17	-1,70	957.793,62	4,21	7.001.217.927,34	0,01
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	9,81	0,74	-3,85	3.156.910,58	13,87	293.125.458,62	1,08
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,35	0,18	0,65	821.513,45	3,61	7.575.446.149,90	0,01
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,73	0,38	-0,82	1.258.101,13	5,53	7.399.889.507,38	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,72	0,40	-0,84	1.181.040,15	5,19	5.867.854.510,24	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,55	0,29	-0,45	1.092.676,05	4,80	1.081.995.665,41	0,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,55	-0,15	1,15	4.572.393,05	20,09	14.363.834.668,17	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,84	0,77	-2,63	849.413,09	3,73	1.332.390.532,50	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,88	0,77	-2,65	2.323.289,84	10,21	1.599.152.888,14	0,15
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,55	0,35	-1,20	16.213.130,96	71,23		

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
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,37	0,32	1,77	869.181,24	3,82	282.008.653,97	0,31
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,26	0,31	1,16	1.183.283,69	5,20	5.582.841.841,27	0,02
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	0,33	1,32	2.460.840,29	10,81	3.920.215.063,90	0,06
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,19	0,32	1,36	4.513.305,22	19,83		
Renda Fixa			3,61	0,34	-0,69	20.726.436,18	91,06		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

8,94%

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
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,69	-1,76	3,78	206.174,02	0,91	1.018.349.879,65	0,02
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			18,69	-1,76	3,78	206.174,02	0,91		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO FI LP	1,54	0,20	1,26	1.829.745,49	8,04	392.131.692,22	0,47
Sub-total Artigo 8º III			1,54	0,20	1,26	1.829.745,49	8,04		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			2,96	-0,00	1,51	2.035.919,51	8,94		
Total			3,44	0,31	-0,50	22.762.355,69	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 b	Fundos 100% Títulos Públicos	16.213.130,96	71,23	0,00	71,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	4.513.305,22	19,83	0,00	17,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	20.726.436,18	91,06					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	206.174,02	0,91	0,00	2,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	1.829.745,49	8,04	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	2.035.919,51	8,94					30,00

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	0,35 114,33	-1,20 -94,69	1,91 244,70	-1,20 -94,69	5,47 241,09	56.318,63	-197.165,80
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,32 105,16	1,36 106,92	0,82 104,29	1,36 106,92	2,44 107,53	14.425,44	58.982,40
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,76 -2,22	3,78 -2,76	6,71 -2,01	3,78 -2,76	28,53 -4,87	-3.687,23	7.517,99
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,20 -0,26	1,26 -5,28	1,21 -7,51	1,26 -5,28	2,36 -31,04	3.655,28	22.770,49
SÃO JOSÉ DO CALÇADO (Total)						70.712,12	-107.894,92

RESULTADO POR ATIVO

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	3.133.779,96	0,00	0,00	0,00	3.156.910,58	23.130,62	-126.571,92
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	1.253.392,69	0,00	0,00	0,00	1.258.101,13	4.708,44	-10.377,26
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	842.942,01	0,00	0,00	0,00	849.413,09	6.471,08	-22.971,11
BB PREV RF IRF-M	956.140,86	0,00	0,00	0,00	957.793,62	1.652,76	-16.565,67
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	820.036,99	0,00	0,00	0,00	821.513,45	1.476,46	5.343,12
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.305.488,01	0,00	0,00	0,00	2.323.289,84	17.801,83	-63.365,32
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.089.464,37	0,00	0,00	0,00	1.092.676,05	3.211,68	-4.893,59
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.579.248,62	0,00	0,00	0,00	4.572.393,05	-6.855,57	52.183,17
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.176.318,82	0,00	0,00	0,00	1.181.040,15	4.721,33	-9.947,22
					16.213.130,96	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 VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	866.430,31	0,00	0,00	0,00	869.181,24	2.750,93	13.914,34
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.452.773,17	0,00	0,00	0,00	2.460.840,29	8.067,12	32.067,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.179.676,30	0,00	0,00	0,00	1.183.283,69	3.607,39	13.000,88
					4.513.305,22	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	209.861,25	0,00	0,00	0,00	206.174,02	-3.687,23	7.517,99
					206.174,02	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	1.826.090,21	0,00	0,00	0,00	1.829.745,49	3.655,28	22.770,49
					1.829.745,49	0,00	0,00

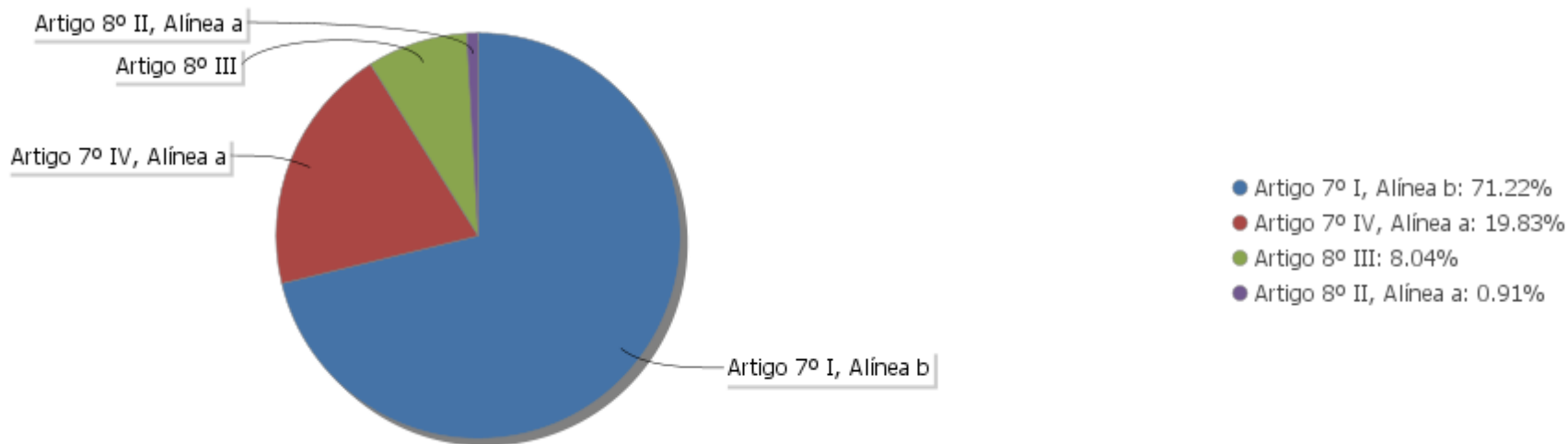
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

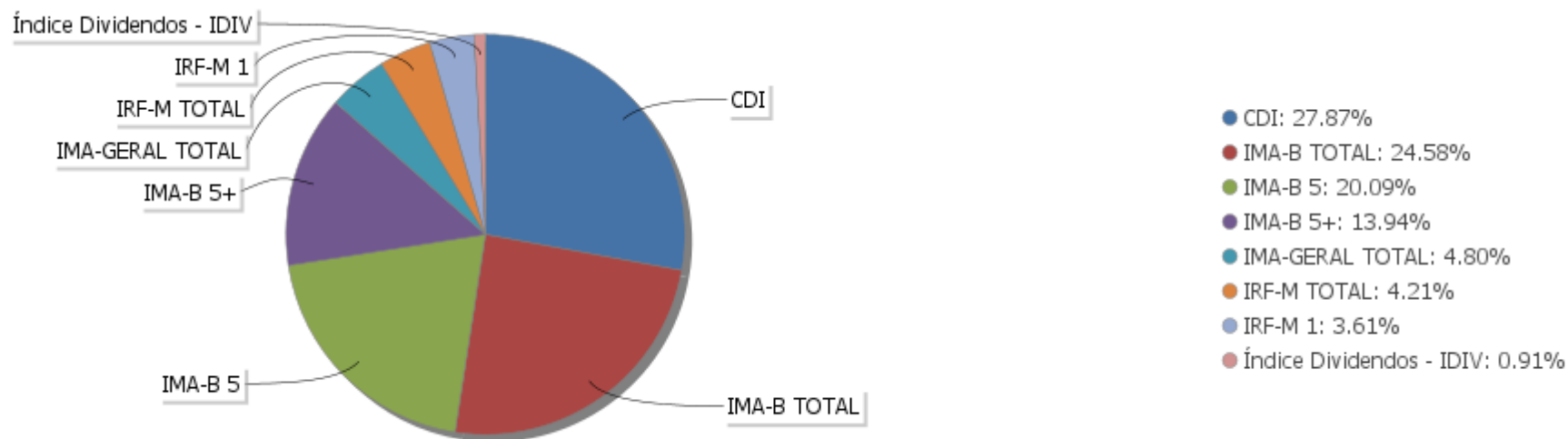
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	22.556.181,67	99,09	22.556.181,67	99,09
de 31 a 365 dias	206.174,02	0,91	22.762.355,69	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	22.762.355,69	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

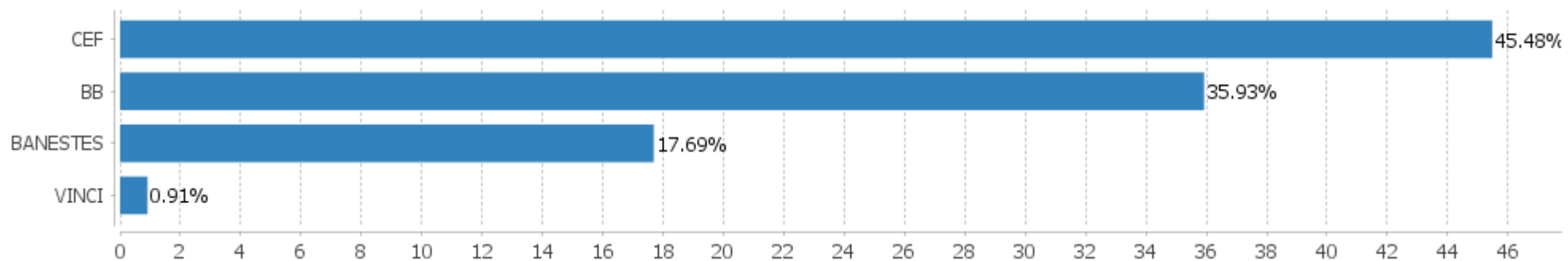


Alocação Por Estratégia



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	-0,75	-1,11	-0,30	0,59	0,77	0,31							-0,50
IPCA + 5,89%	0,71	1,27	1,46	0,77	1,31	1,01							6,71
p.p. indexador	-1,46	-2,38	-1,75	-0,18	-0,54	-0,70							-7,20
2020	0,38	0,28	-5,06	0,93	1,11	1,35	3,03	-1,27	-1,45	0,21	1,35	3,48	4,12
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,65
p.p. indexador	-0,34	-0,38	-5,63	0,78	1,04	0,61	2,15	-1,99	-2,57	-1,13	-0,00	1,62	-6,53
2019	1,69	0,58	0,58	0,93	1,62	1,86	1,17	-0,28	2,24	2,39	-1,54	1,42	13,35
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	0,86	-0,32	-0,61	-0,13	0,98	1,41	0,44	-0,90	1,80	1,76	-2,52	-0,22	2,76
2018	1,43	0,56	1,04	0,30	-1,37	0,23	1,36	-0,11	0,59	3,01	0,46	1,20	9,01
IPCA + 6,00%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	0,63	-0,17	0,46	-0,40	-2,26	-1,52	0,52	-0,55	-0,33	2,05	0,21	0,58	-0,91
2017							2,16	1,05	1,03	0,38	0,12	0,76	5,61
IPCA + 6,00%							0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	4,73
p.p. indexador							1,44	0,33	0,41	-0,53	-0,63	-0,15	0,89

Performance Sobre a Meta Atuarial

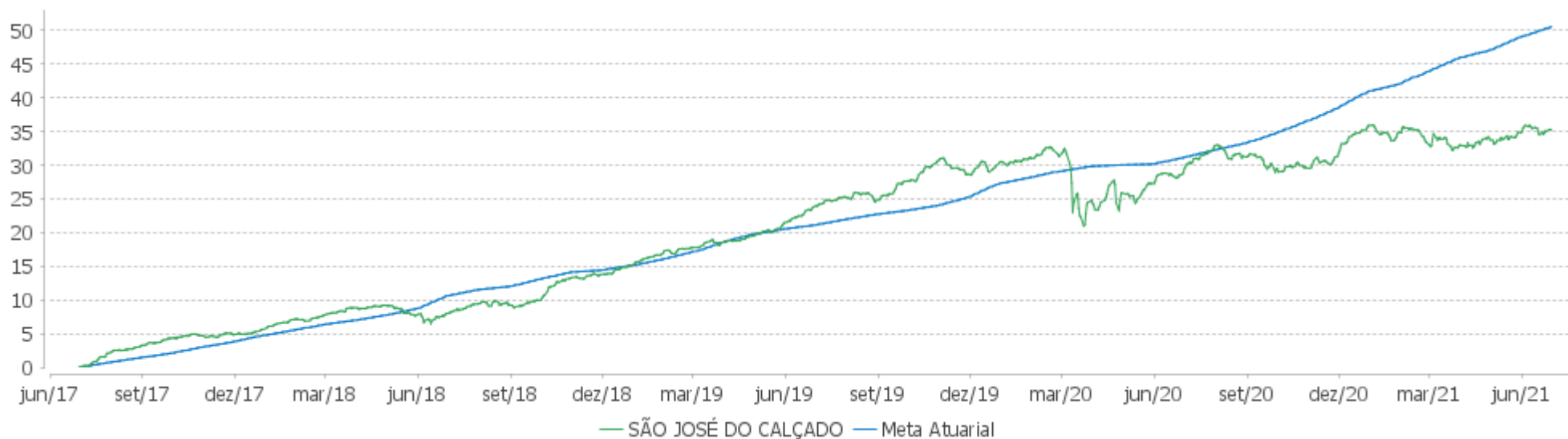
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	20	41,67	03 meses	1,68	3,12	-1,44	3,32
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	58,33	06 meses	-0,50	6,71	-7,20	3,59
			12 meses	4,83	14,70	-9,88	3,44
			24 meses	9,27	24,14	-14,88	5,24
			36 meses	25,27	35,93	-10,66	4,42
			48 meses	35,20	50,31	-15,11	3,93
			Desde 30/06/2017	35,20	50,31	-15,11	3,93

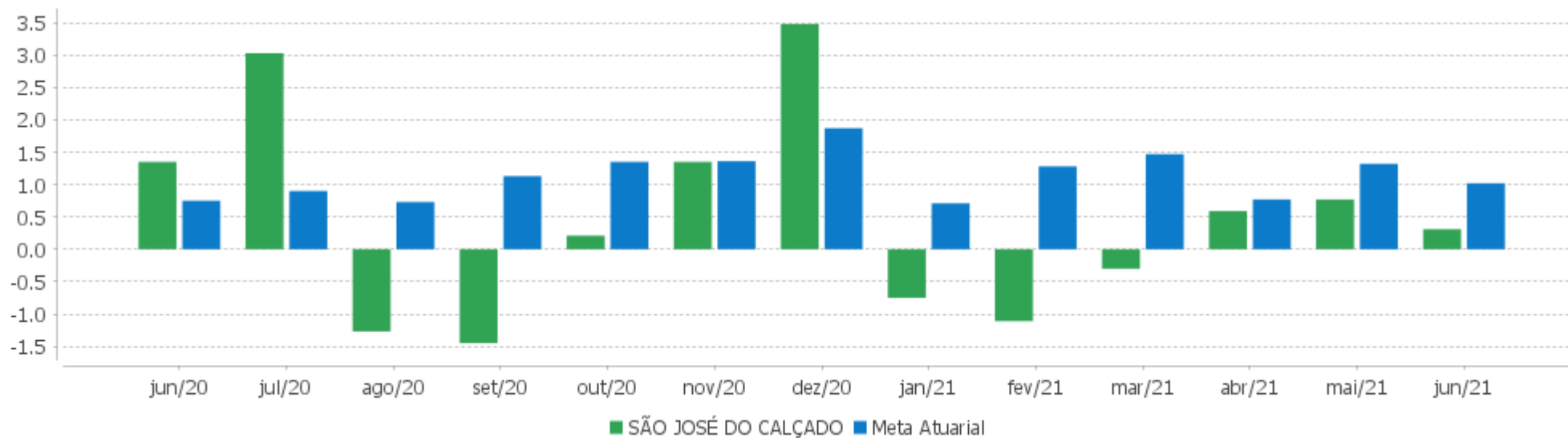
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,48	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-5,06	2020-03

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
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,32 104,13	1,77 139,28	0,82 105,41	1,77 139,28	3,23 142,44	4,27 61,13	10,66 77,50
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,33 107,87	1,32 104,05	0,81 104,16	1,32 104,05	2,35 103,50	6,51 93,03	13,10 95,25
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,31 100,29	1,16 91,17	0,82 104,24	1,16 91,17	2,20 97,04	6,32 90,36	12,88 93,61
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,74 0,32	-3,85 -3,13	2,65 0,51	-3,85 -3,13	4,94 -2,48	4,17 -8,57	45,37 0,21
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 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
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,17 -0,04	-1,70 -0,12	1,15 -0,11	-1,70 -0,12	-0,09 -0,23	9,41 -0,56	26,38 -0,88
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,38 -0,04	-0,82 -0,10	2,09 -0,05	-0,82 -0,10	7,15 -0,28	12,23 -0,51	44,09 -1,07
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,29 -0,06	-0,45 -0,59	1,25 -0,24	-0,45 -0,59	2,70 -0,85	8,96 -1,34	25,78 -2,05
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	0,77 -0,06	-2,65 -0,11	2,63 -0,05	-2,65 -0,11	8,33 -0,19	10,03 -0,63	53,95 -1,83
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	0,77 -0,06	-2,63 -0,08	2,62 -0,07	-2,63 -0,08	8,11 -0,41	10,13 -0,53	54,38 -1,41
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,76 0,41	3,78 1,73	6,71 1,26	3,78 1,73	28,53 4,74	25,52 1,93	87,37 4,76
BB PREV MULTIMERCADO FI LP % do CDI	0,20 65,65	1,26 99,31	1,21 154,31	1,26 99,31	2,35 103,44	8,12 116,13	16,74 121,74
SÃO JOSÉ DO CALÇADO Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,31 -0,71	-0,50 -7,26	1,68 -1,47	-0,50 -7,26	4,83 -9,99	9,27 -15,07	25,27 -10,87
CDI	0,30	1,27	0,78	1,27	2,27	6,99	13,75
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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 6,00%	1,02	6,76	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,80
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	D+0	D+0	D+0	D+4 du	0,00	0,60
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+2 du	D+2 du	0,00	0,20
BB PREV RF IRF-M	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
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	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 IMA GERAL 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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du	0,00	1,72

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 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	0,30	1,27	0,78	1,27	2,27	6,99	13,75	22,14	37,85

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	0,30	1,27	0,78	1,27	2,27	6,99	13,76	22,15	37,89

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	-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
	Total					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 387.190,32

Value-At-Risk: 1,70%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SÃO JOSÉ DO CALÇADO		1,70	1,70			22.762.355,69	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,78%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M		1,46	0,05	0,04			957.793,62	4,21
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B		3,50	0,48	0,99			3.156.910,58	13,87
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,15	0,00	0,01			821.513,45	3,61
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,67	0,15	0,04			1.258.101,13	5,53
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,67	0,14	0,02			1.181.040,15	5,19
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,02	0,05	0,09			1.092.676,05	4,80
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,48	0,26	0,01			4.572.393,05	20,09
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		3,59	0,13	0,10			849.413,09	3,73
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		3,62	0,36	0,07			2.323.289,84	10,21
Sub-total	4,45	2,27	1,62		0,01	0,35	16.213.130,96	71,23

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI		0,08	0,00	0,08			869.181,24	3,82
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,05	0,00	0,05			1.183.283,69	5,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,04	0,00	0,04			2.460.840,29	10,81
Sub-total	0,05	0,04	0,00		0,32	0,32	4.513.305,22	19,83

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 1,40%

Artigo 8º II, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS		8,03	0,04	2,82			206.174,02	0,91
Sub-total	11,67	8,03	0,04		-0,18	-1,76	206.174,02	0,91

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV MULTIMERCADO FI LP		0,74	0,04	0,74			1.829.745,49	8,04
Sub-total	0,97	0,74	0,04		-0,11	0,20	1.829.745,49	8,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 20,09% dos seus recursos alocados no fundo FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP, percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;