



LDB
EMPRESAS

HORTOLÂNDIA
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 75,81%

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 150824	4,01	-0,31	0,26	36.003.161,63	5,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	9,61	0,66	-1,63	16.503.494,71	2,55
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		3,67	-0,00	4,74	52.506.656,34	8,12

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,35	0,18	0,65	88.732.206,49	13,72	7.575.446.149,90	1,17
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,73	0,38	-0,82	71.823.772,10	11,10	7.399.889.507,38	0,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,47	-0,28	1,56	97.553.336,35	15,08	11.796.463.834,87	0,83
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,97	0,18	-1,69	13.681.840,91	2,11	1.645.783.274,49	0,83
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,94	0,11	-0,68	48.145.325,92	7,44	9.201.718.777,36	0,52
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,33	-0,00	0,72	61.605.124,86	9,52	16.058.908.177,46	0,38
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b		2,66	0,06	-0,08	381.541.606,63	58,98			

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
QUELUZ	ORLA	BRA1 FI RENDA FIXA	1,45	-0,57	-1,47	488.465,98	0,08	11.711.563,64	4,17
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	0,47	0,29	1,01	47.632.894,02	7,36	3.457.648.238,53	1,38
VERITAS	RJI	FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	30,05	-0,11	-0,27	1.074.568,15	0,17	163.831.989,36	0,66
GRAPHEN	RJI	LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1,94	0,19	-0,15	3.741.647,02	0,58	70.895.642,78	5,28
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a		0,86	0,26	0,87	52.937.575,17	8,18			

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	3,65	0,12	-2,10	1.797.266,94	0,28	71.155.452,59	2,53
FINAXIS	FINAXIS	FIDC PREMIUM	11,72	-0,16	-4,21	1.696.349,78	0,26	81.898.860,94	2,07
BRPP	BRPP	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
BRPP	GENIAL	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4.957,59	0,00
BRPP	GENIAL	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	7.125,27	0,00
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			6,09	-0,02	-3,14	3.493.616,72	0,54		
Renda Fixa			2,49	0,08	0,82	490.479.454,86	75,81		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

19,94%

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
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	20,14	0,48	7,71	30.971.783,32	4,79	675.981.146,43	4,58
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	20,71	1,61	13,29	26.500.950,12	4,10	1.762.410.329,14	1,50
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	20,09	1,67	5,49	31.342.177,14	4,84	329.722.027,08	9,51
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,97	-0,21	12,22	31.738.932,19	4,91	3.594.423.115,17	0,88
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			19,21	0,85	9,46	120.553.842,77	18,63		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GRAPHEN	ORLA	LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	0,35	-0,40	-2,40	224.775,43	0,03	1.591.859,96	14,12
Sub-total Artigo 8º III			0,35	-0,40	-2,40	224.775,43	0,03		

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
BRPP	BNY MELLON	GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	92,99	152,79	147,33	539.219,80	0,08	19.806.928,69	2,72
VALORA	BEM	FIP BRASIL ÓLEO & GÁS	264,21	2.030,23	-128,47	-29,86	-0,00	5.876,23	-0,51
QUELUZ	BNY MELLON	BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	0,50	-0,10	-0,66	1.520.964,53	0,24	28.066.112,58	5,42
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			17,19	18,69	17,78	2.060.154,47	0,32		

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
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	19,98	2,70	0,24	2.257.000,00	0,35	1.322.246.699,64	0,17
QUELUZ	PLANNER	VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	45,31	1,64	0,13	1.645.588,24	0,25	31.376.185,18	5,24
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BRCR11	12,38	-1,75	-5,65	262.926,00	0,04	2.861.919.636,26	0,01
AQUILLA	ÍNDIGO	ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	2,18	-0,15	-1,80	2.003.605,00	0,31	145.414.852,76	1,38
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			16,65	1,28	1,45	6.169.119,24	0,95		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	26,77	1,11	9,20	129.007.891,91	19,94
---	-------	------	------	----------------	-------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,25%

Artigo 9º A, II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	24,39	-1,15	-10,26	13.461.606,26	2,08	1.609.258.405,72	0,84
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	21,58	-3,72	9,31	14.003.310,24	2,16	226.389.289,04	6,19
Sub-total Artigo 9º A, II			18,69	-2,48	8,02	27.464.916,50	4,25		
Investimentos no Exterior			18,69	-2,48	8,02	27.464.916,50	4,25		
Total			5,41	0,17	2,10	646.952.263,27	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	52.506.656,34	8,12	5,00	10,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	381.541.606,63	58,98	10,00	52,50	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	52.937.575,17	8,18	0,00	10,00	40,00	0,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	3.493.616,72	0,54	0,00	0,50	3,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	490.479.454,86	75,81					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	120.553.842,77	18,63	5,00	17,50	20,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	224.775,43	0,03	0,00	0,50	5,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	2.060.154,47	0,32	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	6.169.119,24	0,95	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	129.007.891,91	19,94					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	27.464.916,50	4,25	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	27.464.916,50	4,25					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	-0,00 -1,37	4,74 370,88	2,22 281,98	4,74 370,88	16,22 712,73	-2.210,83	3.495.603,70
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,06 20,74	-0,08 -6,37	1,18 149,18	-0,08 -6,37	3,59 157,86	237.570,13	163.234,23
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,26 85,26	0,87 68,13	0,63 80,36	0,87 68,13	1,46 64,34	138.655,61	457.436,56
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-0,02 -5,82	-3,14 -245,52	-1,55 -196,95	-3,14 -245,52	-5,62 -246,80	-626,01	-113.137,61
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,85 0,38	9,46 2,92	11,19 2,47	9,46 2,92	32,27 -1,13	1.014.285,06	10.414.627,51
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,40 -0,86	-2,40 -8,94	-1,19 -9,91	-2,40 -8,94	-4,73 -38,13	-893,81	-5.530,15
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	18,69 18,23	17,78 11,24	18,34 9,62	17,78 11,24	16,22 -17,18	324.406,84	310.985,17
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	1,28 0,82	1,45 -5,09	2,76 -5,96	1,45 -5,09	1,28 -32,12	78.296,75	155.157,43
Artigo 9º A, II % do CDI	-2,48 -805,17	8,02 627,48	-5,34 -677,77	8,02 627,48		-697.909,79	-1.775.422,68
HORTOLÂNDIA (Total)						1.091.573,95	13.102.954,16

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 150545	16.394.640,44	0,00	0,00	0,00	16.503.494,71	108.854,27	-285.270,01
NTN-B 150824	36.114.226,73	0,00	0,00	0,00	36.003.161,63	-111.065,10	92.399,12
					52.506.656,34	0,00	0,00

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	48.091.705,52	0,00	0,00	0,00	48.145.325,92	53.620,40	-330.163,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	71.554.971,80	0,00	0,00	0,00	71.823.772,10	268.800,30	-592.427,26
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	86.138.891,37	5.450.000,00	-3.020.000,00	0,00	88.732.206,49	163.315,12	598.399,22
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	97.804.538,31	20.000,00	0,00	0,00	97.553.336,35	-271.201,96	1.057.482,61
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	13.656.946,66	0,00	0,00	0,00	13.681.840,91	24.894,25	-983.002,86
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	61.606.982,84	0,00	0,00	0,00	61.605.124,86	-1.857,98	412.945,73
					381.541.606,63	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRA1 FI RENDA FIXA	537.505,14	0,00	0,00	45.878,80	488.465,98	-3.160,36	-8.633,41
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	1.088.920,75	0,00	0,00	13.117,93	1.074.568,15	-1.234,67	-3.292,36
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	47.496.869,98	0,00	0,00	0,00	47.632.894,02	136.024,04	474.850,68
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.734.620,42	0,00	0,00	0,00	3.741.647,02	7.026,60	-5.488,35
					52.937.575,17	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC PREMIUM	1.699.083,62	0,00	0,00	0,00	1.696.349,78	-2.733,84	-74.542,68
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1.795.159,11	0,00	0,00	0,00	1.797.266,94	2.107,83	-38.594,93
					3.493.616,72	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST ACOES FIC FIA	30.823.866,81	0,00	0,00	0,00	30.971.783,32	147.916,51	2.218.050,89
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	26.081.371,89	0,00	0,00	0,00	26.500.950,12	419.578,23	3.108.429,25
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	30.828.266,79	0,00	0,00	0,00	31.342.177,14	513.910,35	1.631.431,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	31.806.052,22	0,00	0,00	0,00	31.738.932,19	-67.120,03	3.456.715,69
					120.553.842,77	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	225.669,24	0,00	0,00	0,00	224.775,43	-893,81	-5.530,15
					224.775,43	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	1.522.438,44	0,00	0,00	0,00	1.520.964,53	-1.473,91	-10.086,80
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS	-1,41	0,00	0,00	0,00	-29,86	-28,45	-135,78
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA	213.310,60	0,00	0,00	0,00	539.219,80	325.909,20	321.207,75
					2.060.154,47	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\$)
BRCR11	269.093,40	0,00	0,00	0,00	1.493,16	262.926,00	-4.674,24	-15.872,11
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	2.214.600,00	0,00	0,00	0,00	17.000,00	2.257.000,00	59.400,00	3.000,00
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	1.619.091,85	0,00	0,00	0,00	0,00	1.645.588,24	26.496,39	204.710,50
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	2.006.530,40	0,00	0,00	0,00	0,00	2.003.605,00	-2.925,40	-36.680,96
						6.169.119,24	0,00	0,00

Artigo 9º A, II

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	13.618.201,22	0,00	0,00	0,00	13.461.606,26	-156.594,96	-1.538.393,74
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	14.544.625,07	0,00	0,00	0,00	14.003.310,24	-541.314,83	-237.028,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					27.464.916,50	0,00	0,00

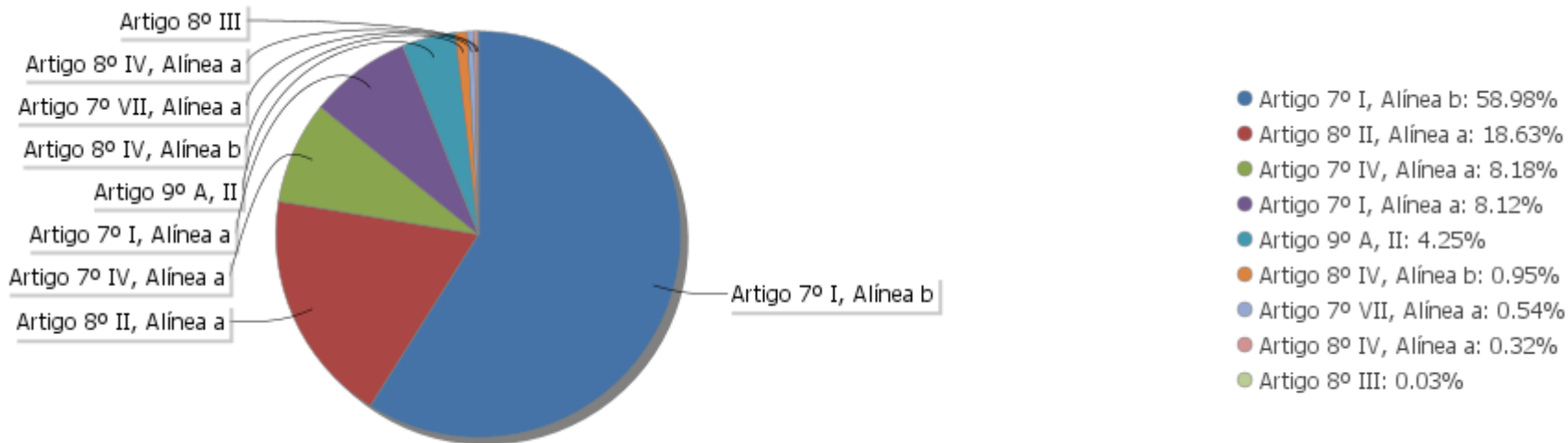
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

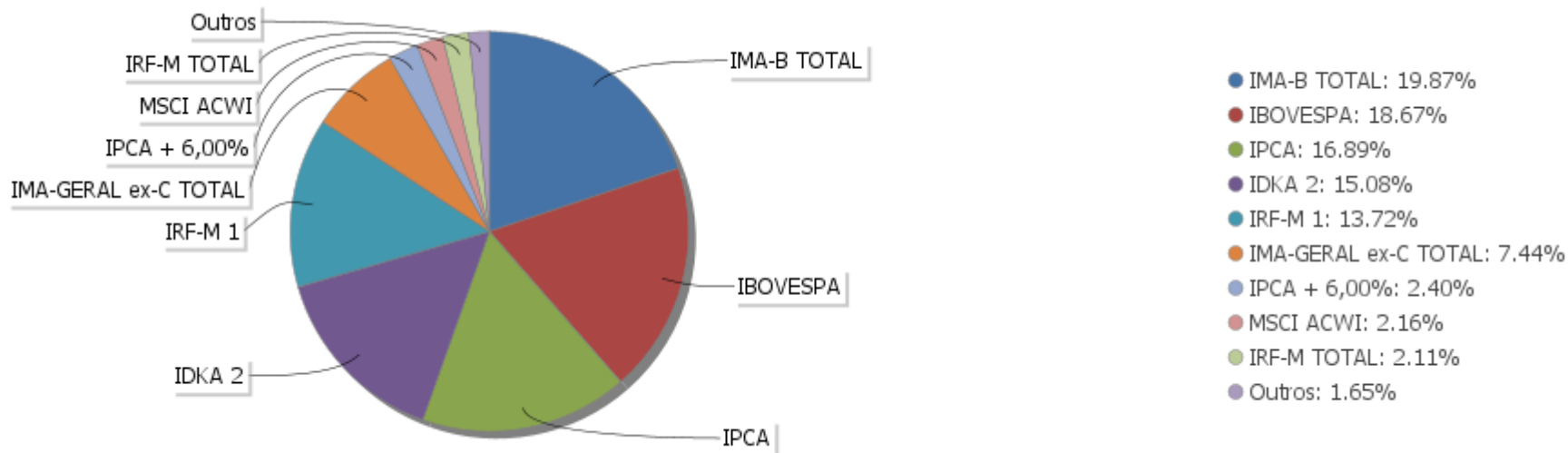
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	551.495.800,35	85,25	551.495.800,35	85,25
de 31 a 365 dias	31.738.932,19	4,91	583.234.732,54	90,15
acima de 365 dias	63.717.530,73	9,85	646.952.263,27	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

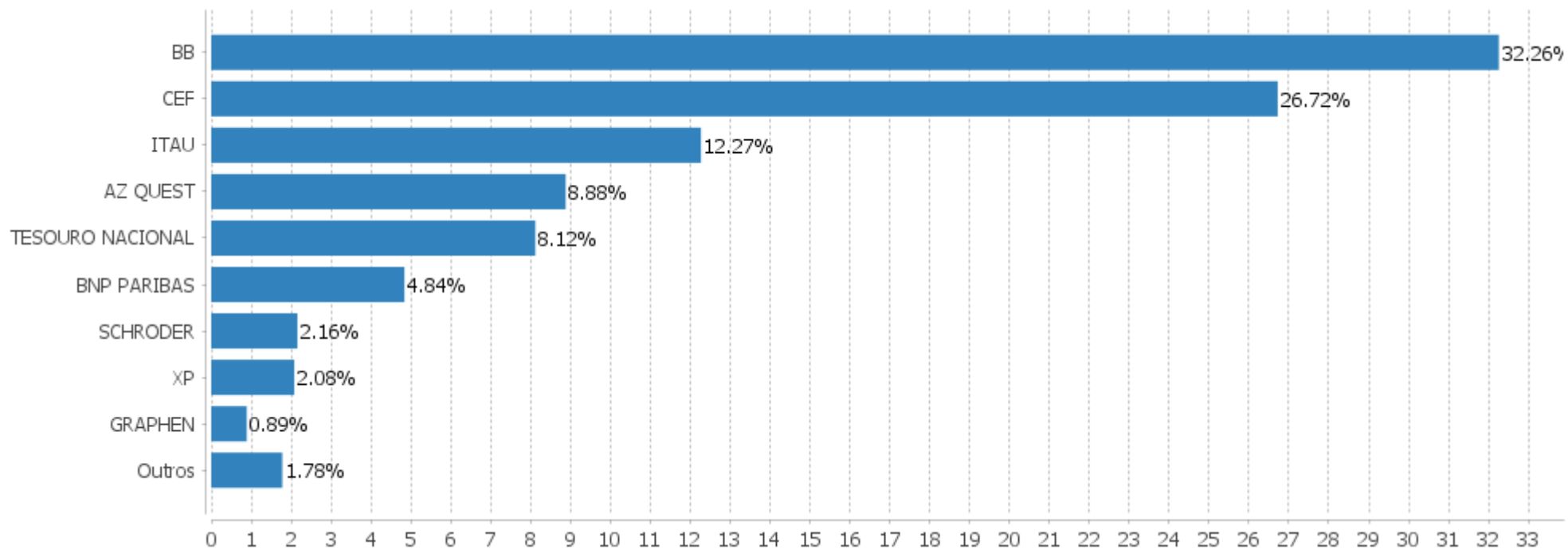


Alocação Por Estratégia



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	-0,37	-0,60	0,51	1,09	1,28	0,17							2,10
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97							6,47
p.p. indexador	-1,04	-1,84	-0,90	0,36	0,01	-0,80							-4,37
2020	0,74	-0,95	-6,76	0,85	2,01	1,95	2,67	-0,62	-1,01	0,15	2,81	2,88	4,40
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,63
p.p. indexador	0,03	-1,61	-7,33	0,71	1,94	1,21	1,79	-1,34	-2,13	-1,19	1,46	1,02	-6,22
2019	2,83	0,10	0,40	1,16	1,59	2,44	1,21	0,05	1,70	1,87	-0,25	2,19	16,35
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	2,00	-0,79	-0,79	0,10	0,95	1,99	0,49	-0,57	1,25	1,24	-1,23	0,55	5,76

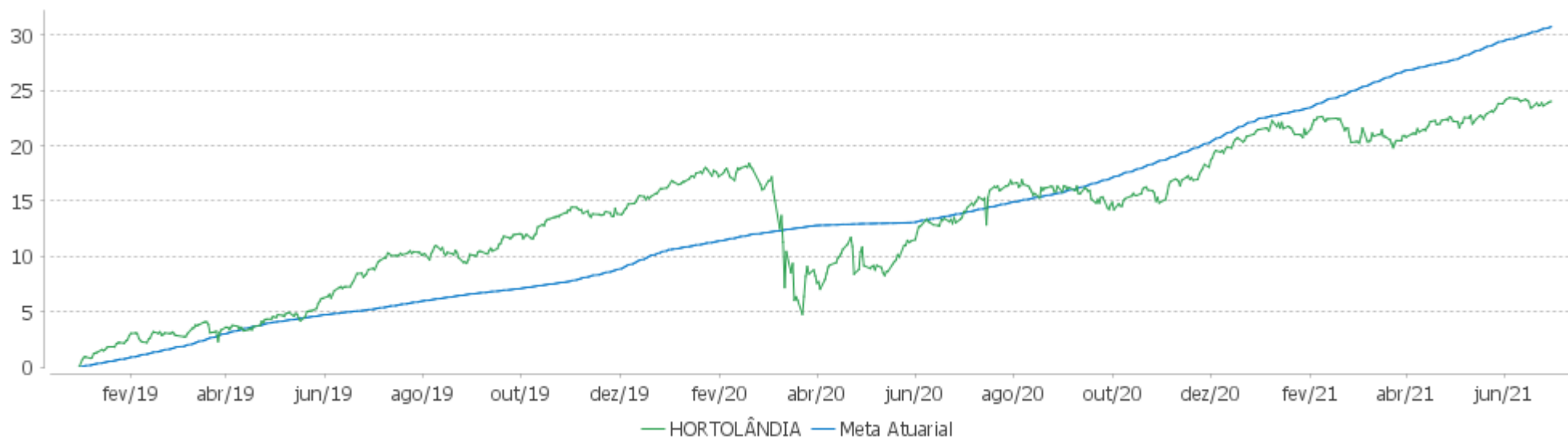
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

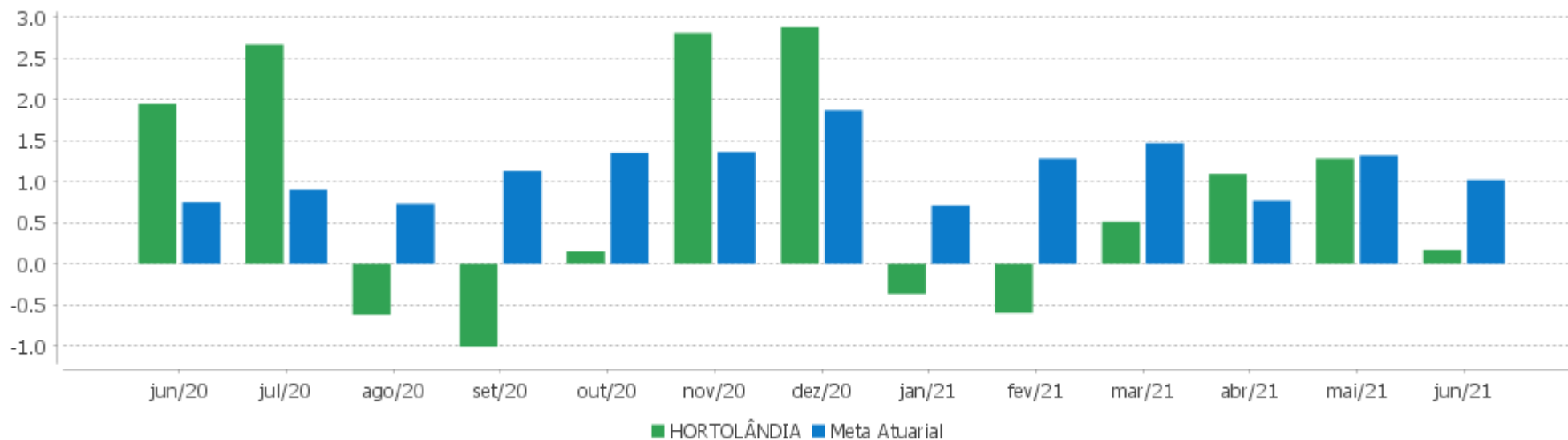
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	17	56,67	03 meses	2,57	3,01	-0,44	3,30
Meses abaixo - Meta Atuarial	13	43,33	06 meses	2,10	6,47	-4,37	4,38
			12 meses	9,23	14,44	-5,21	5,41
			24 meses	13,99	23,84	-9,86	7,54
Maior rentabilidade da Carteira	2,88	2020-12	Desde 31/12/2018	24,02	30,26	-6,24	6,96
Menor rentabilidade da Carteira	-6,76	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
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,11 -0,21	-0,68 -0,34	1,22 -0,10	-0,68 -0,34	2,58 -0,16	9,05 -0,18	26,47 0,17
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,00 -0,53	0,72 -3,05	0,90 -0,78	0,72 -3,05	2,68 -5,67	12,77 2,11	31,64 17,26
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,18 -0,03	0,65 -0,16	0,60 -0,08	0,65 -0,16	1,65 -0,38	7,46 -0,71	15,02 -0,97
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,28 0,04	1,56 -0,30	1,59 -0,32	1,56 -0,30	6,40 -0,66	15,12 -1,34	29,13 -2,74
BB PREV RF IMA-B 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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,18 -0,03	-1,69 -0,11	1,13 -0,13	-1,69 -0,11	-0,09 -0,23	9,44 -0,53	26,47 -0,79
BRA1 FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,57 -0,99	-1,47 -0,75	-0,36 -2,50	-1,47 -0,75	-1,95 -9,37	-69,07 -81,81	-66,58 -111,74
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,29 -0,24	1,01 -2,76	0,67 -1,01	1,01 -2,76	1,59 -6,75	7,30 -3,35	21,15 6,76
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,19 -0,23	-0,15 0,58	0,76 -1,38	-0,15 0,58	0,81 -6,61	0,57 -12,17	-12,97 -58,13
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-0,11 0,02	-0,27 -1,56	-0,69 -2,13	-0,27 -1,56	0,25 -5,82	-5,61 -21,03	-13,25 -45,57
NTN-B 150824 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,31 -0,73	0,26 0,98	1,75 -0,39	0,26 0,98	5,11 -2,31	16,19 3,45	41,25 -3,91
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,66 0,24	-1,63 -0,91	2,97 0,82	-1,63 -0,91	10,27 2,85	10,42 -2,32	57,12 11,96
FIDC PREMIUM % do CDI	-0,16 -52,28	-4,21 -329,46	-3,63 -460,95	-4,21 -329,46	-7,40 -324,93	-15,22 -217,86	-18,57 -135,11
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3 % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-95,23 -1.363,51	-98,32 -715,35
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4 % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-95,23 -1.363,51	-98,32 -715,35
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2 % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-95,23 -1.363,51	-98,32 -715,35
LEME MULTISETORIAL IPCA FIDC	0,12	-2,10	0,50	-2,10	-3,88	-10,88	1.295,97

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	38,15	-164,54	62,91	-164,54	-170,25	-155,72	9.429,03
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	-0,40	-2,40	-1,19	-2,40	-4,70	-3,73	-94,90
% do CDI	-128,69	-187,94	-151,14	-187,94	-206,69	-53,34	-690,44
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	1,67	5,49	9,28	5,49	28,54	24,17	74,34
Var. IBOVESPA p.p.	1,20	-1,05	0,56	-1,05	-4,86	-1,42	0,07
AZ QUEST ACOES FIC FIA	0,48	7,71	11,21	7,71	25,92	21,09	60,40
Var. IBOVESPA p.p.	0,02	1,17	2,50	1,17	-7,48	-4,50	-13,87
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	1,61	13,29	13,74	13,29	37,58	47,53	100,39
Var. IBOVESPA p.p.	1,14	6,75	5,02	6,75	4,18	21,95	26,12
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-0,21	12,22	11,00	12,22	37,29	31,25	87,46
Var. IBOVESPA p.p.	-0,68	5,68	2,28	5,68	3,90	5,66	13,19
BRCR11	-1,75	-5,65	0,42	-5,65	-6,55	-5,03	18,95
Var. IBOVESPA p.p.	-2,21	-12,19	-8,29	-12,19	-39,94	-30,62	-55,32
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	-0,15	-1,80	-0,77	-1,80	-1,10	-2,17	-20,34
Var. IFIX p.p.	2,04	2,22	2,45	2,22	0,73	-7,07	-49,97
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	2,70	0,24	4,32	0,24	-17,23	0,23	-86,27
% do CDI	876,26	18,86	548,32	18,86	-756,81	3,25	-627,70
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	1,64	0,13	2,38	0,13	16,87	3,62	18,09
Var. IFIX p.p.	3,82	4,14	5,61	4,14	18,70	-1,28	-11,54
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	152,79	147,33	150,42	147,33	136,01	-92,57	-92,52
Var. IPCA + 6,00% p.p.	151,77	140,58	147,27	140,58	121,19	-116,91	-128,66
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	-0,10	-0,66	-0,30	-0,66	-1,67	30,40	-21,67
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,12	-7,42	-3,45	-7,42	-16,50	6,07	-57,81
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS	0,00	-74,35	15,55	-74,35	-50,24	-78,50	-99,19
% do CDI	0,00	-5.819,70	1.974,16	-5.819,70	-2.207,22	-1.123,91	-721,69
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	-3,72	9,31	-4,20	9,31			
Var. MSCI ACWI p.p.	-0,47	2,08	1,91	2,08			
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-1,15	2,21	-4,10	2,21	28,74		
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-2,17	-4,55	-7,24	-4,55	13,92		
HORTOLÂNDIA	0,17	2,10	2,57	2,10	9,23	13,99	
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,85	-4,66	-0,58	-4,66	-5,59	-10,35	
CDI	0,31	1,28	0,79	1,28	2,28	6,98	13,74
IBOVESPA	0,46	6,54	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27
INPC + 6,00%	1,09	6,95	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46
IPCA + 6,00%	1,02	6,76	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,21	0,81	0,68	0,81	2,04	8,17	15,99	25,04	41,88
IRF-M 1+	0,22	-3,30	1,54	-3,30	-1,09	10,57	31,78	44,01	70,12
IRF-M TOTAL	0,21	-1,58	1,26	-1,58	0,14	9,97	27,26	38,64	61,89
IMA-B 5	-0,13	1,29	1,44	1,29	6,07	15,42	32,32	45,20	62,50
IMA-B 5+	0,83	-2,55	2,69	-2,55	8,52	10,66	55,78	65,31	89,15
IMA-B TOTAL	0,42	-0,72	2,14	-0,72	7,42	12,74	45,16	57,06	77,99
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,32	-0,34	1,32	-0,34	2,74	9,23	26,31	36,75	56,76
IMA-GERAL TOTAL	0,35	0,14	1,48	0,14	3,55	10,30	27,83	38,65	58,38
IDKA 2	-0,32	1,87	1,91	1,87	7,06	16,45	31,87	45,03	63,71
IDKA 20	1,07	-3,63	3,85	-3,63	12,34	7,07	77,65	82,49	113,49
CDI	0,31	1,28	0,79	1,28	2,28	6,98	13,74	22,11	37,80

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,46	6,54	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27	101,60	146,09
IBRX 100	0,63	8,82	9,61	8,82	36,33	29,97	82,97	109,81	156,78
IBRX 50	0,66	9,11	9,99	9,11	37,48	27,96	75,42	102,75	146,44
SMALL CAP	1,29	11,42	12,41	11,42	39,64	46,83	108,08	137,16	216,68
IFIX	-2,19	-4,02	-3,23	-4,02	-1,83	4,90	29,63	32,82	68,17
Índice Consumo - ICON	0,64	3,32	8,00	3,32	16,90	33,24	78,77	81,45	99,34
Índice Dividendos - IDIV	-2,17	2,06	5,45	2,06	23,79	23,60	82,61	98,77	171,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,53	3,77	1,68	3,77	8,35	10,66	14,38	19,40	22,99
INPC	0,60	3,95	1,95	3,95	9,22	11,78	15,49	19,56	22,62
IGPM	0,60	15,08	6,30	15,08	35,75	45,68	55,16	65,90	64,61
SELIC	0,31	1,28	0,79	1,28	2,28	6,98	13,75	22,12	37,84

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-2,27	10,13	-5,03	10,13	26,62	90,69	105,09	168,14	219,09
MSCI ACWI	-3,25	7,23	-6,11	7,23	25,29	79,54	84,88	134,07	181,00
MSCI World	-3,06	7,96	-5,78	7,96	25,18	80,80	87,35	138,06	184,42

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,86	5,77	2,66	5,77	12,66	19,69	28,60	39,56	49,47
IPCA + 5,00%	0,94	6,27	2,91	6,27	13,74	22,00	32,33	44,97	56,75
IPCA + 5,50%	0,98	6,51	3,03	6,51	14,28	23,16	34,23	47,73	60,50
IPCA + 5,89%	1,01	6,71	3,12	6,71	14,70	24,08	35,71	49,92	63,47
IPCA + 6,00%	1,02	6,76	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14	50,54	64,32
INPC + 4,00%	0,93	5,96	2,94	5,96	13,57	20,91	29,85	39,74	49,03
INPC + 6,00%	1,09	6,95	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46	50,74	63,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

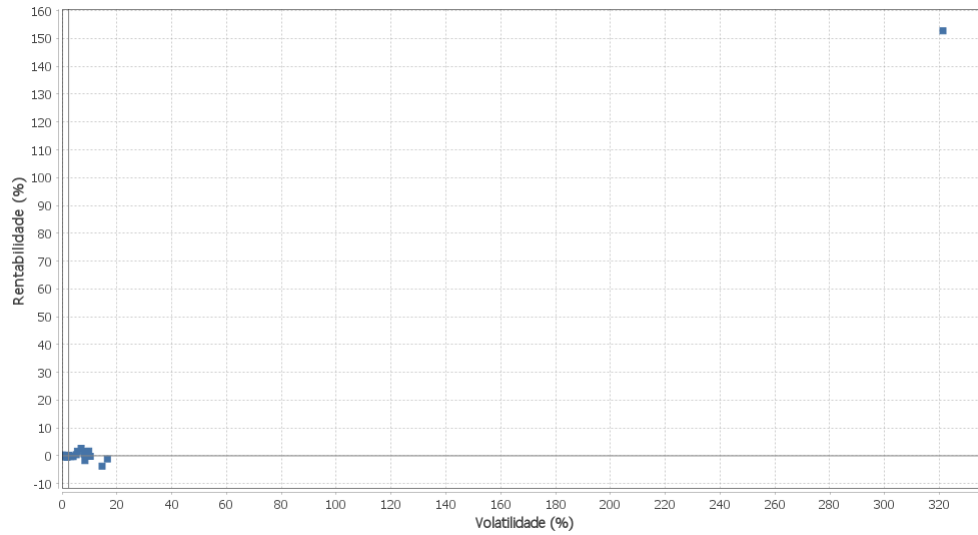
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
42	10/06/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	4.870.000,00	0,00	1.778.095,40249200	2,7388856600
40	10/06/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	380.000,00	0,00	138.742,55707300	2,7388856600
47	16/06/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	20.000,00	0,00	8.218,39564589	2,4335650000
46	29/06/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	230.000,00	83.839,68264100	2,7433309950
43	29/06/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	2.700.000,00	984.204,97013300	2,7433309950
41	29/06/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	90.000,00	32.806,83233800	2,7433309950
45	30/06/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	200.000,00	0,00	72.913,75272500	2,7429667590
Total						

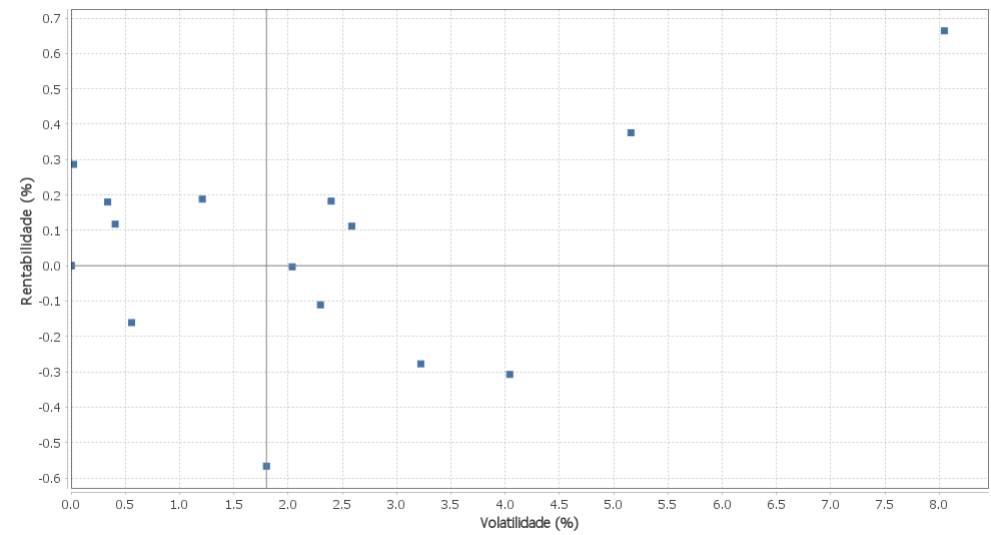
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

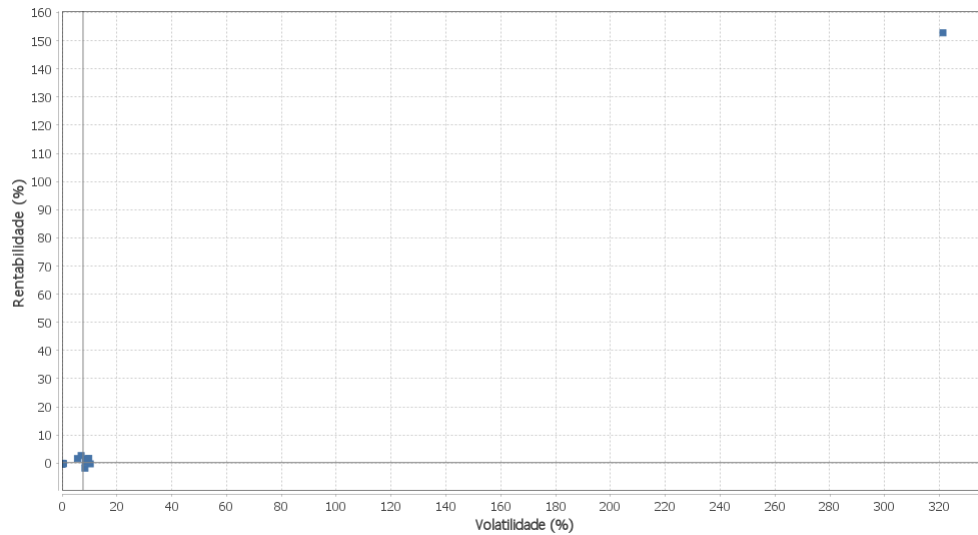
HORTOLÂNDIA - No Mês



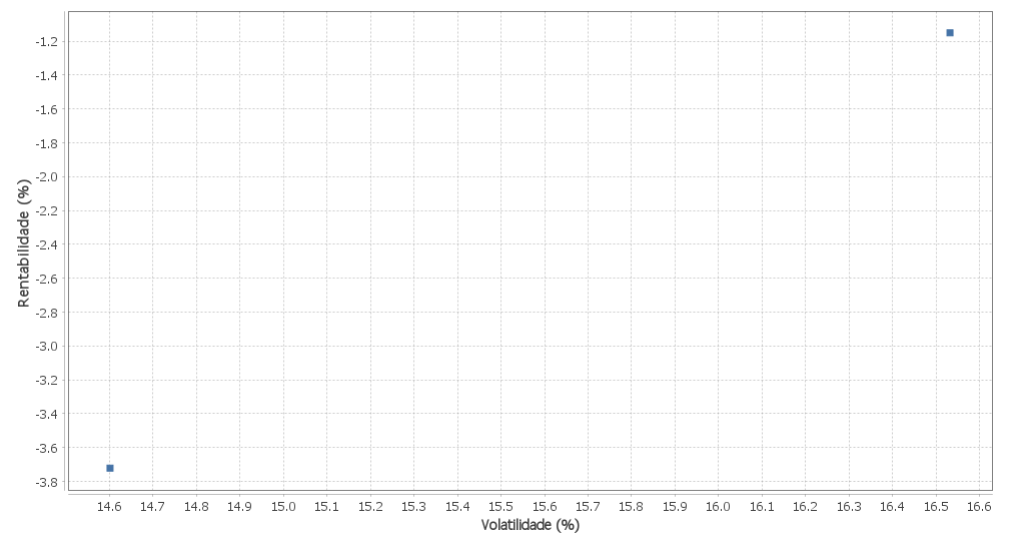
Renda Fixa - No Mês



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\$): 13.390.395,16

Value-At-Risk: 2,07%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3	Artigo 7º VII, Alínea a	0,00	NaN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4	Artigo 7º VII, Alínea a	0,00	NaN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	Artigo 7º VII, Alínea a	0,00	NaN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS	Artigo 8º IV, Alínea a	0,00	-4,88	-0,00	0,00	0,00	-29,86	-0,00
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	Artigo 8º III	0,00	0,03	0,00	-1.616,28	-0,40	224.775,43	0,03
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,03	0,00	-0,91	0,29	47.632.894,02	7,36
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	Artigo 8º IV, Alínea a	0,34	0,02	0,00	-1,21	-0,10	1.520.964,53	0,24
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,34	0,15	0,01	-0,38	0,18	88.732.206,49	13,72
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	Artigo 7º VII, Alínea a	0,41	0,10	0,00	-0,47	0,12	1.797.266,94	0,28
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	Artigo 8º IV, Alínea b	0,51	0,08	0,00	-0,90	-0,15	2.003.605,00	0,31
FIDC PREMIUM	Artigo 7º VII, Alínea a	0,56	0,19	-0,00	-0,84	-0,16	1.696.349,78	0,26
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	Artigo 7º IV, Alínea a	1,21	0,74	0,00	-0,10	0,19	3.741.647,02	0,58
BRA1 FI RENDA FIXA	Artigo 7º IV, Alínea a	1,80	0,82	0,00	-0,49	-0,57	488.465,98	0,08
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,04	1,15	0,08	-0,15	-0,00	61.605.124,86	9,52
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	2,30	1,90	0,00	-0,18	-0,11	1.074.568,15	0,17
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,40	1,44	0,02	-0,05	0,18	13.681.840,91	2,11
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,59	1,24	0,07	-0,08	0,11	48.145.325,92	7,44
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,22	1,51	0,17	-0,18	-0,28	97.553.336,35	15,08
NTN-B 150824	Artigo 7º I, Alínea a	4,04	2,04	0,08	-0,15	-0,31	36.003.161,63	5,57
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,16	2,67	0,21	0,01	0,38	71.823.772,10	11,10
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	Artigo 8º IV, Alínea b	5,62	0,49	0,00	0,24	1,64	1.645.588,24	0,25
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	Artigo 8º IV, Alínea b	6,96	3,36	0,00	0,34	2,70	2.257.000,00	0,35
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	8,05	3,95	0,07	0,04	0,66	16.503.494,71	2,55
BRCR11	Artigo 8º IV, Alínea b	8,35	2,81	0,00	-0,25	-1,75	262.926,00	0,04
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	8,44	8,34	0,37	0,02	0,48	30.971.783,32	4,79
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	8,88	10,22	0,36	0,15	1,61	26.500.950,12	4,10
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	9,74	7,89	0,34	0,14	1,67	31.342.177,14	4,84
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	10,28	8,18	0,35	-0,05	-0,21	31.738.932,19	4,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	Artigo 9º A, II	14,60	8,53	-0,04	-0,28	-3,72	14.003.310,24	2,16
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	16,53	10,45	-0,01	-0,09	-1,15	13.461.606,26	2,08
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA	Artigo 8º IV, Alínea a	321,25	4,17	-0,00	0,47	152,79	539.219,80	0,08

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 14,12% do patrimônio líquido do fundo LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V (Art. 8, Inciso III), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- O Instituto está com 5,42% do patrimônio líquido do fundo BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP (Art. 8, Inciso IV, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- O Instituto está com 5,24% do patrimônio líquido do fundo VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII (Art. 8, Inciso IV, Alínea B), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;