



**LDB**  
EMPRESAS

**SÃO VICENTE - 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

72,42%

## 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
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	6,57	-0,49	-4,90	1.756.548,00	0,88	64.664.276,21	2,72
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,33	-0,15	-2,46	4.230.687,21	2,13	7.233.196.021,39	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,31	-0,16	-2,51	12.959.069,16	6,52	5.161.580.539,44	0,25
ITAU	ITAU	ITAU RF IMAB5+ FIC DE FI	8,24	-1,28	-6,80	6.363.379,39	3,20	222.863.219,51	2,86
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,27	-1,27	-6,87	13.859.154,59	6,97	1.307.235.728,08	1,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,45	1,08	2,79	33.946.392,01	17,08	11.068.272.487,58	0,31
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,68	-0,01	-1,38	13.264.704,24	6,67	8.672.013.980,14	0,15
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>4,51</b>	<b>0,08</b>	<b>-1,66</b>	<b>86.379.934,60</b>	<b>43,45</b>		

## 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 RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,70	0,26	-1,84	7.961.582,58	4,01	727.038.371,49	1,10
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,19	0,45	2,43	1.892.765,57	0,95	22.400.320.442,81	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	8,23	-1,27	-6,75	3.357.342,30	1,69	191.374.527,85	1,75
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,64	0,95	1,69	16.255.088,39	8,18	1.161.932.475,65	1,40
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,68	0,84	2,32	24.223.673,88	12,19	3.094.123.781,71	0,78
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,18	0,49	2,84	784.175,44	0,39	3.692.592.328,71	0,02
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>2,28</b>	<b>0,63</b>	<b>0,80</b>	<b>54.474.628,16</b>	<b>27,40</b>		

## 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
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,34	0,71	2,81	3.093.370,56	1,56	580.931.724,08	0,53
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>0,34</b>	<b>0,71</b>	<b>2,81</b>	<b>3.093.370,56</b>	<b>1,56</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

3,69

0,29

-0,76

143.947.933,32

72,42

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL

27,58%

## 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
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	20,15	-5,97	-7,21	3.302.895,25	1,66	1.325.718.074,85	0,25
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	18,99	-4,58	-7,51	925.232,80	0,47	510.385.612,47	0,18
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	18,09	-6,61	-9,86	468.978,15	0,24	1.127.988.215,22	0,04
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	21,65	-5,27	-3,44	8.661.315,13	4,36	548.501.127,80	1,58
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	20,91	-8,84	-15,32	6.398.452,10	3,22	2.403.304.462,99	0,27
QUELUZ	BEM	QUELUZ VALOR FI EM ACOES	20,03	-8,92	-18,48	1.222.866,57	0,62	114.454.437,78	1,07
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	19,84	-6,13	-9,31	4.213.492,75	2,12	262.817.562,00	1,60
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	19,68	-7,98	-13,52	2.594.537,36	1,31	732.667.418,23	0,35
SOMMA	BEM	SOMMA BRASIL FIA	18,91	-5,45	-12,09	1.318.630,60	0,66	344.199.619,92	0,38
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	21,66	-6,06	-14,62	2.134.572,59	1,07	328.305.295,69	0,65
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	22,04	-6,52	-14,09	1.718.248,91	0,86	1.047.084.854,27	0,16
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	20,34	-6,93	-8,92	488.698,13	0,25	1.069.194.291,65	0,05
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	20,69	-7,71	-10,10	478.255,13	0,24	418.622.916,70	0,11
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>19,50</b>	<b>-6,66</b>	<b>-8,79</b>	<b>33.926.175,47</b>	<b>17,07</b>		

## Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SAFRA	SAFRA	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,96	0,33	1,53	2.482.826,58	1,25	502.446.812,53	0,49
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	13,77	-4,57	17,12	16.336.762,39	8,22	1.884.756.886,81	0,87
SICREDI	SICREDI	SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP	13,89	-4,64	4,93	2.087.786,18	1,05	306.456.875,03	0,68
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>11,68</b>	<b>-4,02</b>	<b>14,69</b>	<b>20.907.375,15</b>	<b>10,52</b>		

## Renda Variável

15,11

-5,67

-0,70

54.833.550,62

27,58

## Total

5,43

-1,44

-1,42

198.781.483,94

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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	86.379.934,60	43,45	0,00	55,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	54.474.628,16	27,40	0,00	10,00	40,00	0,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	3.093.370,56	1,56	0,00	0,00	5,00	0,00	10,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>143.947.933,32</b>	<b>72,42</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	33.926.175,47	17,07	0,00	20,00	20,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	20.907.375,15	10,52	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>54.833.550,62</b>	<b>27,58</b>					35,00
<b>Total</b>		<b>198.781.483,94</b>	<b>100,00</b>					

## 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	0,08 17,38	-1,66 -66,41	-1,05 -86,26	0,84 41,88	4,50 150,52	66.645,48	-1.501.828,04
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,63 144,49	0,80 31,78	0,50 40,66	1,81 90,01	3,84 128,50	343.502,05	478.297,21
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,71 162,55	2,81 112,07	1,82 149,10	2,53 125,65	3,42 114,42	7.733,34	29.884,21
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-6,66 -0,09	-8,79 -2,03	-14,85 -2,37	-7,19 -2,34	8,93 -8,38	-2.419.146,93	-4.025.598,38
Artigo 8º III % do CDI	-4,02 -917,50	14,69 585,78	1,08 88,47	8,70 431,94	25,63 856,93	-875.824,87	2.332.336,10
<b>SÃO VICENTE - CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>-2.877.090,93</b>	<b>-2.686.908,90</b>

## 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 ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	13.265.408,91	0,00	0,00	0,00	13.264.704,24	-704,67	-185.477,26
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.237.193,58	0,00	0,00	0,00	4.230.687,21	-6.506,37	-106.918,23
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	1.765.111,00	0,00	0,00	0,00	1.756.548,00	-8.563,00	-93.885,10
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	33.584.248,32	0,00	0,00	0,00	33.946.392,01	362.143,69	879.145,84
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	14.036.743,73	0,00	0,00	0,00	13.859.154,59	-177.589,14	-1.022.268,72
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	13.287.299,59	0,00	-308.486,18	0,00	12.959.069,16	-19.744,25	-508.332,57
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	6.445.770,17	0,00	0,00	0,00	6.363.379,39	-82.390,78	-464.092,00
					86.379.934,60	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	780.332,40	0,00	0,00	0,00	784.175,44	3.843,04	21.668,57
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	16.102.061,27	0,00	0,00	0,00	16.255.088,39	153.027,12	270.743,63

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	3.400.407,46	0,00	0,00	0,00	3.357.342,30	-43.065,16	-243.089,07
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	23.978.342,21	44.598,11	0,00	0,00	24.223.673,88	200.733,56	537.239,42
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	1.583.442,33	414.826,88	-113.683,34	0,00	1.892.765,57	8.179,70	39.865,91
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	7.940.798,79	0,00	0,00	0,00	7.961.582,58	20.783,79	-148.131,25
					54.474.628,16	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	1.085.637,22	2.000.000,00	0,00	0,00	3.093.370,56	7.733,34	29.884,21
					3.093.370,56	0,00	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\$)
AZ QUEST ACOES FIC FIA	969.648,83	0,00	0,00	0,00	925.232,80	-44.416,03	-75.159,64
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	4.488.862,15	0,00	0,00	0,00	4.213.492,75	-275.369,40	-432.784,79
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	9.142.738,13	0,00	0,00	0,00	8.661.315,13	-481.423,00	-432.567,04
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	3.512.416,27	0,00	0,00	0,00	3.302.895,25	-209.521,02	-256.803,15
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	7.019.007,98	0,00	0,00	0,00	6.398.452,10	-620.555,88	-1.157.578,81
FIA CAIXA CONSUMO	2.272.353,27	0,00	0,00	0,00	2.134.572,59	-137.780,68	-365.427,41
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.838.186,44	0,00	0,00	0,00	1.718.248,91	-119.937,53	-281.751,09
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	2.819.417,43	0,00	0,00	0,00	2.594.537,36	-224.880,07	-405.462,64
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	502.150,73	0,00	0,00	0,00	468.978,15	-33.172,58	-51.277,37
OCCAM FIC FIA	525.073,98	0,00	0,00	0,00	488.698,13	-36.375,85	-47.833,29
QUELUZ VALOR FI EM ACOES	1.342.617,90	0,00	0,00	0,00	1.222.866,57	-119.751,33	-277.133,43
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	518.227,10	0,00	0,00	0,00	478.255,13	-39.971,97	-53.712,11
SOMMA BRASIL FIA	1.394.622,19	0,00	0,00	0,00	1.318.630,60	-75.991,59	-181.369,40
					33.926.175,47	0,00	0,00

## Artigo 8º III (Fundos Multimercados)



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	2.474.577,12	0,00	0,00	0,00	2.482.826,58	8.249,46	37.322,10
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	17.119.243,58	0,00	0,00	0,00	16.336.762,39	-782.481,19	2.207.227,82
SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP	2.189.379,32	0,00	0,00	0,00	2.087.786,18	-101.593,14	87.786,18
					20.907.375,15	0,00	0,00

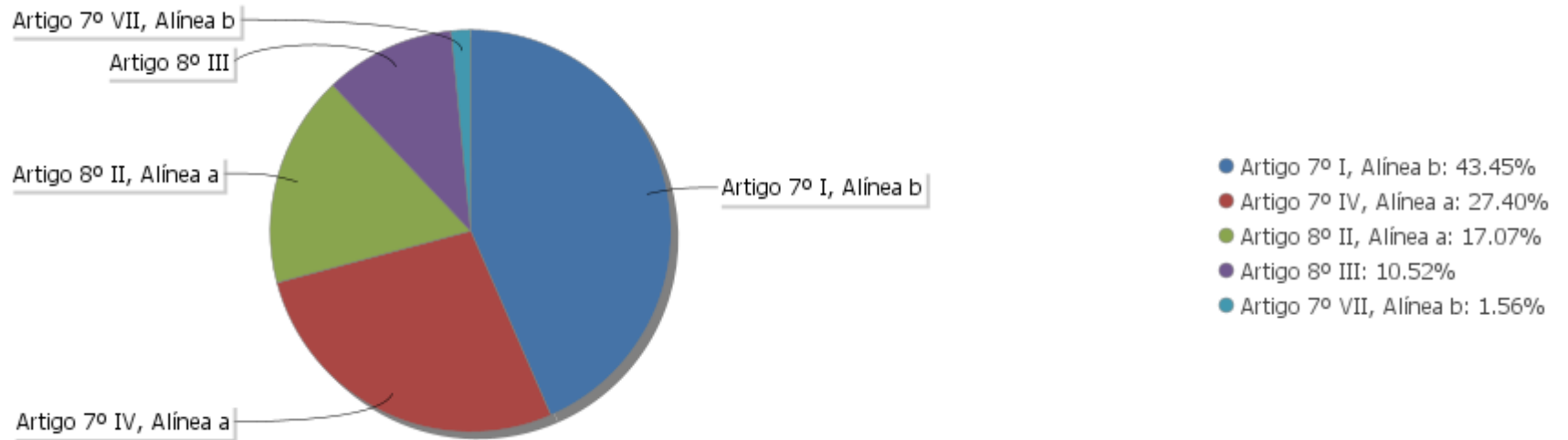
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

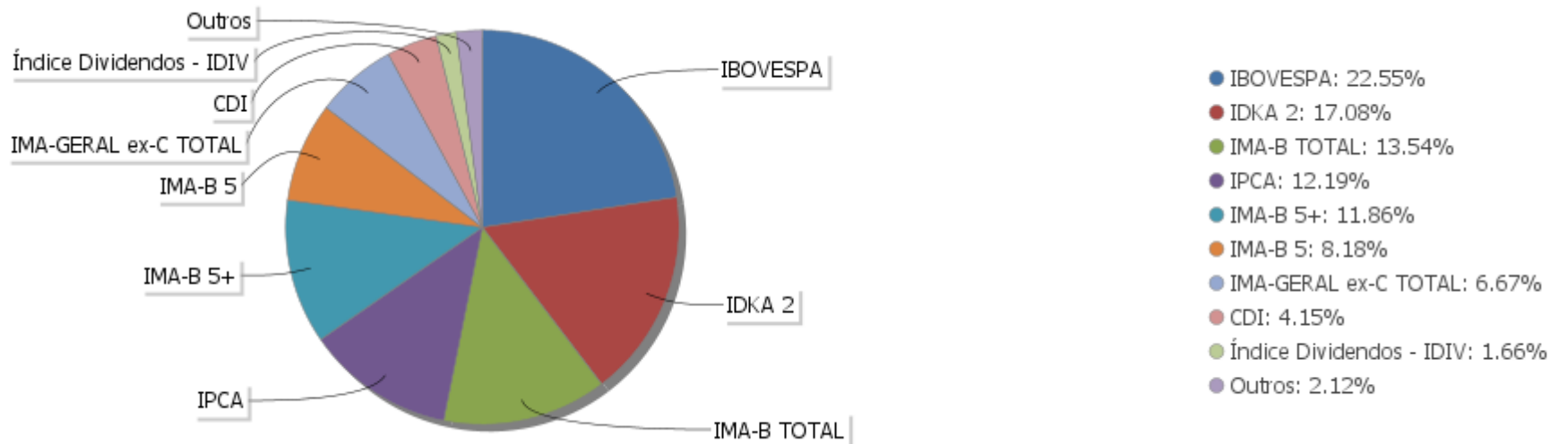
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	188.031.946,48	94,59	188.031.946,48	94,59
de 31 a 365 dias	8.992.989,46	4,52	197.024.935,94	99,12
acima de 365 dias	1.756.548,00	0,88	198.781.483,94	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

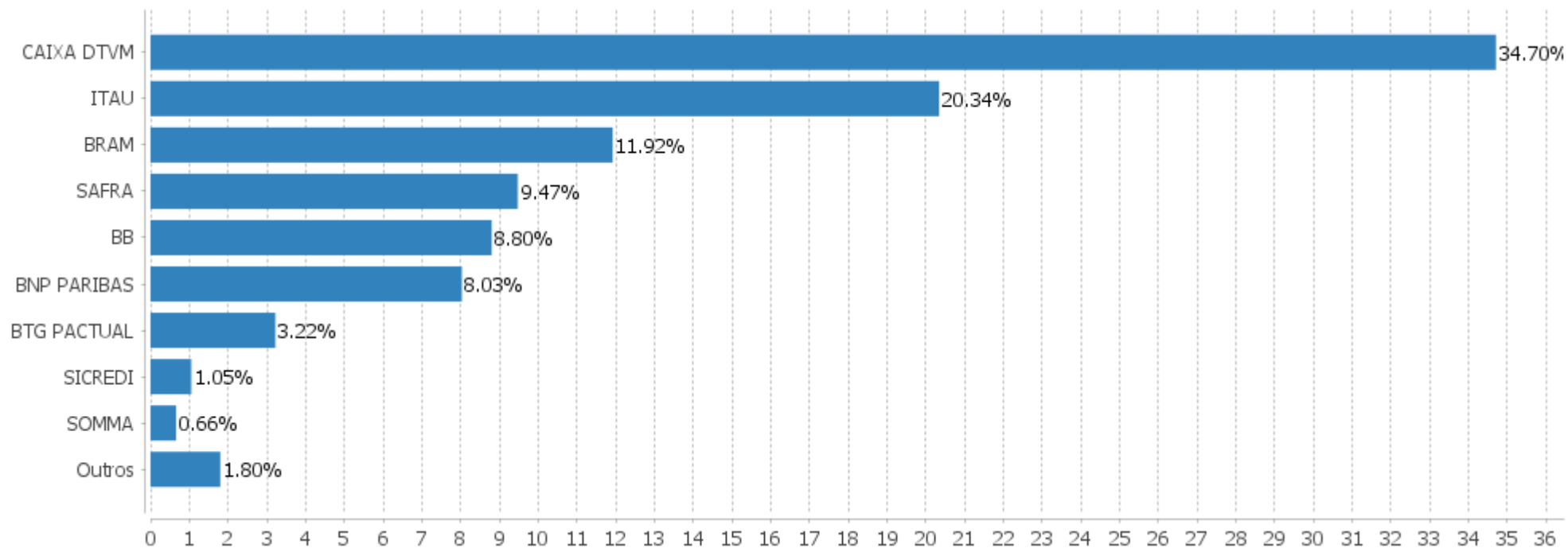


Alocação Por Estratégia



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	-0,80	-1,08	0,50	1,25	1,35	0,53	-0,83	-0,87	-1,44				-1,42
INPC + 5,47%	0,69	1,20	1,35	0,81	1,41	1,05	1,49	1,35	1,65				11,55
p.p. indexador	-1,50	-2,29	-0,85	0,44	-0,06	-0,51	-2,32	-2,22	-3,09				-12,97
2020	0,37	-1,02	-8,71	2,51	2,16	2,34	3,92	-0,89	-1,68	-0,23	3,36	3,94	5,49
INPC + 6,00%	0,70	0,59	0,69	0,23	0,21	0,79	0,98	0,85	1,36	1,38	1,42	1,98	11,75
p.p. indexador	-0,34	-1,61	-9,40	2,27	1,94	1,55	2,94	-1,74	-3,04	-1,62	1,94	1,96	-6,26
2019	3,68	0,35	0,43	1,28	2,33	2,92	1,33	-0,10	2,15	2,38	-1,05	2,74	19,95
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	2,81	-0,66	-0,78	0,19	1,67	2,47	0,69	-0,73	1,72	1,81	-2,06	1,03	9,17
2018	1,94	0,51	0,85	0,19	-2,24	-0,23	1,89	-0,53	0,08	5,08	0,90	1,26	9,96
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	1,20	-0,08	0,29	-0,51	-3,16	-2,15	1,13	-1,07	-0,66	4,16	0,69	0,66	0,37
2017	1,43	2,24	1,15	0,15	-0,53	0,43	2,86	1,21	1,36	0,03	-0,23	0,89	11,50
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	0,50	1,58	0,29	-0,34	-1,40	0,24	2,21	0,71	0,91	-0,83	-0,88	0,16	3,39

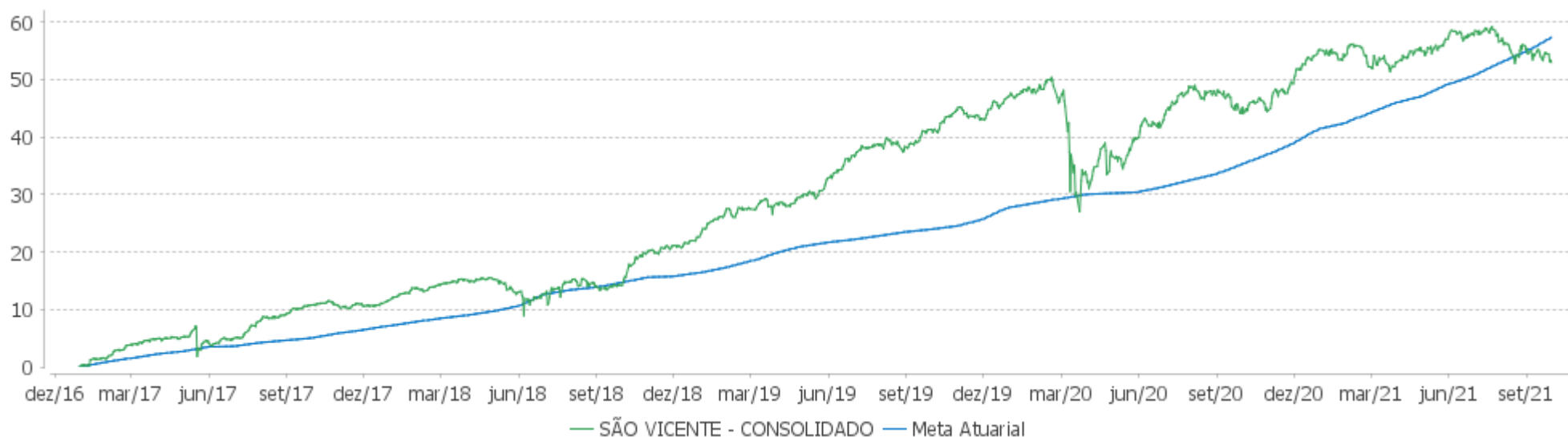
## Performance Sobre a Meta Atuarial

## Relatório

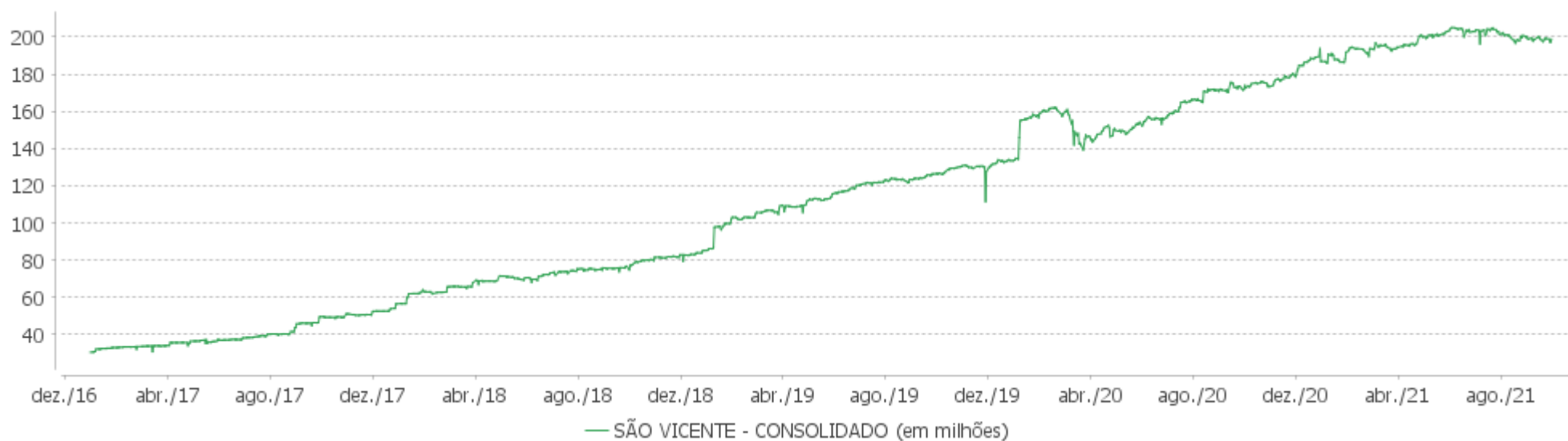
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	29	50,88	03 meses	-3,11	4,56	-7,66	5,97
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	49,12	06 meses	-0,04	8,00	-8,04	5,25
			12 meses	5,66	16,96	-11,30	5,43
			24 meses	8,24	28,80	-20,56	9,78
Maior rentabilidade da Carteira	5,08	2018-10	36 meses	33,93	40,49	-6,56	8,36
Menor rentabilidade da Carteira	-8,71	2020-03	48 meses	38,10	54,73	-16,63	7,89
			Desde 30/12/2016	52,94	63,62	-10,68	7,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

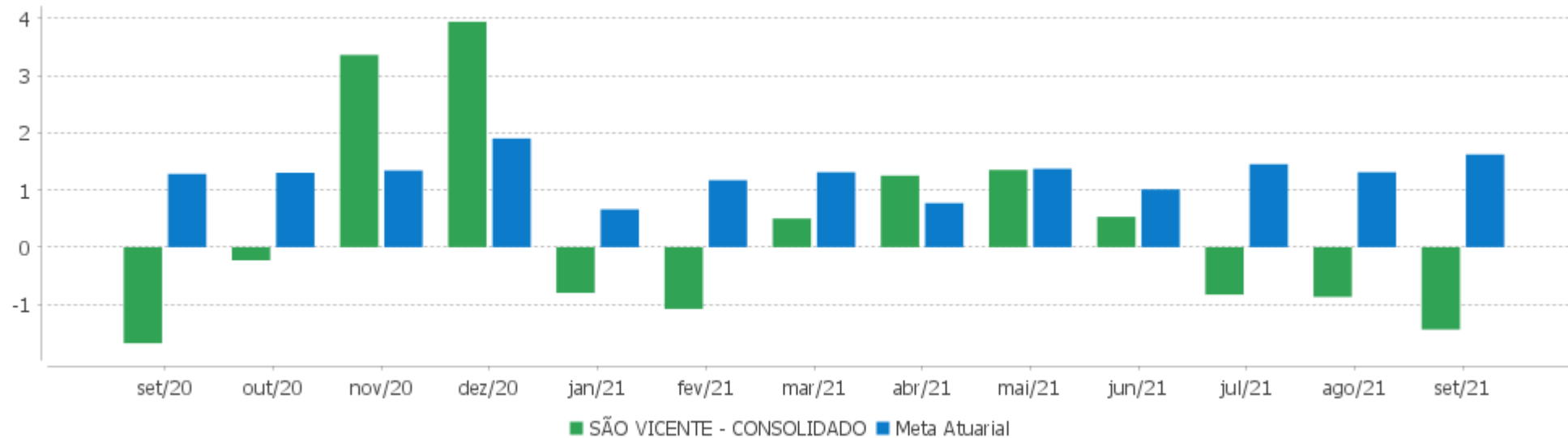


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,16 -0,02	-2,51 -0,21	-1,68 -0,09	0,37 -0,15	4,45 -0,26	6,20 -0,72	39,29 -1,17
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,49 -0,35	-4,90 -2,60	-1,95 -0,36	0,04 -0,48	2,94 -1,77	5,78 -1,14	43,03 2,57
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
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,08 -0,02	2,79 -0,28	1,21 0,03	2,82 -0,30	5,92 -0,29	13,71 -1,00	27,67 -1,78
BB PREV RF IMA B 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
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,28 -0,02	-6,80 -0,17	-4,24 -0,05	-1,74 -0,13	2,91 -0,30	0,75 -0,73	45,17 -1,81
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	0,71 162,55	2,81 112,07	1,82 149,10	2,53 125,65	3,42 114,42	5,67 85,28	12,15 90,99
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,95 -0,05	1,69 -0,79	1,01 -0,18	2,43 -0,21	4,98 -0,97	12,47 -1,16	29,72 -1,40
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,49 112,38	2,84 113,34	1,38 112,49	2,28 113,27	3,26 109,08	6,25 93,96	12,84 96,20
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,26 0,39	-1,84 0,46	-0,98 0,61	1,61 1,09	5,15 0,44	8,50 1,58	44,27 3,81
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	0,45 102,14	2,43 96,94	1,25 102,47	2,00 99,35	2,89 96,78	6,23 93,69	12,74 95,42
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,27 -0,01	-6,75 -0,12	-4,34 -0,15	-1,89 -0,28	2,92 -0,29	0,38 -1,10	44,66 -2,33
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,84 -0,32	2,32 -4,58	1,30 -1,72	1,98 -2,77	2,72 -7,53	6,51 -7,19	21,07 4,08
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO % do CDI	0,33 76,07	1,53 60,87	0,55 45,19	1,55 77,11	3,05 102,02	6,16 92,50	13,58 101,73
SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP Var. S&P 500 p.p.	-4,64 -5,37	17,80 -2,24	1,20 -7,80	10,09 6,57	30,89 7,37		
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-4,57	17,12	1,15	9,89	30,43	43,41	51,80



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	2,00	23,87	13,63	14,74	13,12	37,46	11,93
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	-7,98 -1,41	-9,65 -2,90	-14,44 -1,96	-7,16 -2,31	9,34 -7,97	9,32 3,37	71,08 31,20
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,61 -0,04	-11,00 -4,24	-13,82 -1,34	-8,35 -3,50	6,94 -10,37	-11,33 -17,28	40,12 0,24
SOMMA BRASIL FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,45 1,12	-3,29 3,47	-12,34 0,14	-4,25 0,59	17,01 -0,30	2,20 -3,75	34,32 -5,56
BRADESCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-5,97 -1,48	-7,21 -2,54	-11,25 -4,66	-5,35 -3,84	16,71 -2,86	-4,77 -12,62	23,23 -41,60
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-8,84 -2,27	-15,32 -8,57	-18,94 -6,47	-14,07 -9,22	-4,83 -22,14	0,46 -5,50	52,93 13,05
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-6,13 0,43	-9,31 -2,56	-14,04 -1,56	-6,06 -1,21	11,21 -6,10	2,43 -3,52	53,89 14,02
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-6,06 -0,11	-12,35 -0,86	-14,65 -0,32	-8,05 -0,57	-3,11 -1,44	-4,25 -1,56	46,00 -4,47
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,58 1,99	-7,51 -0,76	-14,14 -1,66	-4,51 0,34	8,01 -9,30	-2,82 -8,77	30,28 -9,59
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-6,52 0,04	-6,24 0,51	-15,87 -3,40	-5,36 -0,51	13,95 -3,36	9,19 3,24	65,50 25,63
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA Var. IBOVESPA p.p.	-7,71 -1,14	-10,10 -3,34	-14,00 -1,53	-6,70 -1,85	12,61 -4,70	5,64 -0,31	40,74 0,86
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,93 -0,36	-8,92 -2,16	-12,94 -0,46	-6,39 -1,54	11,87 -5,44	5,28 -0,67	48,86 8,98
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-5,27 1,30	-3,44 3,31	-13,97 -1,49	-3,02 1,82	18,00 0,69	13,74 7,79	77,94 38,07
QUELUZ VALOR FI EM ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-8,92 -2,35	-15,28 -8,53	-19,24 -6,76	-11,62 -6,77	-2,59 -19,90	-13,08 -19,03	21,81 -18,07
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO Var. INPC + 5,04% p.p.	-1,44 -3,09	-1,42 -12,97	-3,11 -7,66	-0,04 -8,04	5,66 -11,16	8,24 -19,75	33,93 -4,99
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

## Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AZ QUEST ACOES FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	Para informações adicionais, vide o Regulamento	2,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+1 du	D+0	D+27	D+29	20% s/ 100 IBOVESPA	2,00
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	D+1 du	D+0	D+5 du	D+7 du	Cobrança semestral, no último dia útil de dezembro e junho ou no resgate total ou parcial das cotas, o que ocorrer primeiro	2,00
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	D+0	D+0	D+0	D+0		0,35
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADERCO FIA DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)		3,00
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA CONSUMO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,60
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	D+1 du	D+0	D+21 du	D+23 du		1,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du		0,18
OCCAM FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+15 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+17 (isento de taxa de resgate)	-	3,00
QUELUZ VALOR FI EM ACOES	D+1 du	D+0	D+10	D+12	-	2,00
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+2 du		1,00
SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP	D+0	D+0	D+0	D+1		
SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA - FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
SOMMA BRASIL FIA	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du	-	2,00

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 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

**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
153	01/09/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	20.002,62	0,00	401,76908000	49,7863610000
157	03/09/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	3.885,47	78,00781000	49,8087310000
154	08/09/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	251.214,09	0,00	5.041,36831000	49,8305370000
155	10/09/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	126.275,12	0,00	2.533,08713000	49,8502870000
167	10/09/2021	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	18.832,37	5.219,29933900	3,6082180000
162	10/09/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	5.530,56	0,00	302,04959000	18,3101060000
158	14/09/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	20.057,42	402,19098000	49,8703900000
159	15/09/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	14.946,35	299,64380000	49,8804080000
160	20/09/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	63.600,61	1.274,29485000	49,9104350000
166	20/09/2021	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	14.620,01	4.043,45298100	3,6157240000
161	24/09/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	11.193,49	224,08484000	49,9520200000
156	28/09/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	17.335,05	0,00	346,87246000	49,9752850000
163	28/09/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	39.067,55	0,00	2.118,73870000	18,4390600000
165	29/09/2021	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	275.033,80	76.127,60189200	3,6128000000
164	30/09/2021	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	2.000.000,00	0,00	6.478,80958950	308,6986849000
<b>Total</b>			<b>2.459.424,99</b>	<b>422.169,52</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.500.954,15

Value-At-Risk: 2,77%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO		2,77	2,77			198.781.483,94	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,68%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF		3,37	0,02	0,85			1.756.548,00	0,88
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,97	0,05	0,04			4.230.687,21	2,13
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,95	0,15	0,02			12.959.069,16	6,52
ITAU RF IMAB5+ FIC DE FI		4,06	0,10	0,01			6.363.379,39	3,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		4,07	0,22	0,07			13.859.154,59	6,97
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,04	0,10	0,60			33.946.392,01	17,08
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,11	0,06	0,19			13.264.704,24	6,67
<b>Sub-total</b>	3,45	2,06	0,71		-0,10	0,08	86.379.934,60	43,45

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO		3,02	0,09	0,26			7.961.582,58	4,01
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI		0,03	-0,00	0,01			1.892.765,57	0,95
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+		4,06	0,05	0,13			3.357.342,30	1,69
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5		1,26	0,07	0,07			16.255.088,39	8,18
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		0,52	0,04	0,52			24.223.673,88	12,19
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,04	-0,00	0,03			784.175,44	0,39
<b>Sub-total</b>	2,11	1,20	0,25		0,09	0,63	54.474.628,16	27,40

Artigo 7º VII, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV		0,15	-0,00	0,14			3.093.370,56	1,56
<b>Sub-total</b>	0,31	0,15	-0,00		0,90	0,71	3.093.370,56	1,56

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,09%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FIA DIVIDENDOS		8,90	0,12	3,83			3.302.895,25	1,66
AZ QUEST ACOES FIC FIA		8,39	0,03	3,24			925.232,80	0,47
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA		8,13	0,02	3,66			468.978,15	0,24
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES		9,76	0,38	4,92			8.661.315,13	4,36
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		10,69	0,30	5,59			6.398.452,10	3,22
QUELUZ VALOR FI EM ACOES		8,96	0,05	3,33			1.222.866,57	0,62
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES		9,24	0,18	2,47			4.213.492,75	2,12
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS		8,90	0,10	2,00			2.594.537,36	1,31
SOMMA BRASIL FIA		9,80	0,06	1,69			1.318.630,60	0,66
FIA CAIXA CONSUMO		10,46	0,09	0,88			2.134.572,59	1,07
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		11,60	0,09	5,06			1.718.248,91	0,86
OCCAM FIC FIA		9,59	0,02	2,29			488.698,13	0,25
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA		9,31	0,02	2,57			478.255,13	0,24
<b>Sub-total</b>	25,24	9,33	1,46		-0,28	-6,66	33.926.175,47	17,07

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO		0,41	0,00	0,41			2.482.826,58	1,25
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		6,19	0,31	8,55			16.336.762,39	8,22
SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP		6,27	0,04	6,34			2.087.786,18	1,05
<b>Sub-total</b>	11,39	5,48	0,35		-0,39	-4,02	20.907.375,15	10,52



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

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

- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso III, (10,52% 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, (10,52% dos recursos) está superior ao limite máximo estipulado em Política de Investimentos;