



LDB
EMPRESAS

SÃO JOSÉ DO RIO PARDO
2º TRIMESTRE 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

95,60%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,73	0,38	2,09	21.820.644,98	9,06	7.399.889.507,38	0,29
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,72	0,40	2,09	47.444.762,98	19,69	5.867.854.510,24	0,81
BB	BB	BB PREV IPCA I	1,78	0,36	1,53	8.509.344,95	3,53	516.660.063,12	1,65
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,94	0,11	1,22	44.780.728,94	18,58	9.201.718.777,36	0,49
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,33	-0,00	0,90	45.477.002,82	18,87	16.058.908.177,46	0,28
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,72	0,21	1,50	168.032.484,67	69,73		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,26	0,31	0,72	540.545,63	0,22	14.040.360.809,73	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	5,73	0,40	2,12	19.624.760,68	8,14	1.247.835.733,51	1,57
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	0,47	0,29	0,67	16.723.412,12	6,94	3.457.648.238,53	0,48
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FI RF IDKA PRE 2	3,22	0,02	0,81	17.121.948,01	7,11	422.596.480,69	4,05
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,94	0,23	1,21	54.010.666,44	22,41		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	2,88	-0,07	1,44	8.323.975,89	3,45	630.534.374,83	1,32
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			2,88	-0,07	1,44	8.323.975,89	3,45		
Renda Fixa			3,47	0,20	1,43	230.367.127,00	95,60		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,85%

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAÚ PRIVATE AÇÕES INDEX IBOVESPA FIC DE FI	21,07	0,46	8,70	3.194.415,03	1,33	522.496.103,87	0,61
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			21,07	0,46	8,70	3.194.415,03	1,33		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	19,52	-0,48	8,51	3.062.633,87	1,27	840.588.804,87	0,36
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,69	-1,76	6,71	3.029.390,77	1,26	1.018.349.879,65	0,30
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			18,77	-1,12	7,61	6.092.024,64	2,53		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			19,39	-0,58	7,99	9.286.439,67	3,85		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,54%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	21,15	0,81	0,81	1.310.574,51	0,54	2.860.128.891,15	0,05
Sub-total Artigo 9º A, III			21,15	0,81	0,81	1.310.574,51	0,54		
Investimentos no Exterior			10,44	0,81	0,81	1.310.574,51	0,54		
Total			3,70	0,18	1,66	240.964.141,18	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			ALM	Limite Legal
				Mínimo	Objetivo	Máximo		
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	168.032.484,67	69,73	40,00	45,00	80,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	54.010.666,44	22,41	10,00	30,00	40,00	0,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	8.323.975,89	3,45	1,00	1,50	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	230.367.127,00	95,60					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	3.194.415,03	1,33	0,75	7,00	10,00	0,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	6.092.024,64	2,53	1,55	10,00	15,00	0,00	20,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	9.286.439,67	3,85					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	1.310.574,51	0,54	0,50	0,75	1,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	1.310.574,51	0,54					10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,21 67,93	1,50 190,96	1,50 190,96	-0,22 -17,47	4,65 204,33	350.588,52	2.490.769,43
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,23 75,18	1,21 153,44	1,21 153,44	-0,68 -52,84	2,75 120,91	133.619,00	673.394,77
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,07 -22,62	1,44 182,54	1,44 182,54	0,65 51,26	5,83 256,26	-5.798,96	118.021,43
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,46 -0,01	8,70 -0,02	8,70 -0,02	6,51 -0,03	33,34 -0,06	12.827,52	246.364,06
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,12 -1,58	7,61 -1,11	7,61 -1,11	4,69 -1,85	28,56 -4,84	-71.736,76	409.860,40
Artigo 9º A, III % do CDI	0,81 378,94	0,81 378,94				10.574,51	10.574,51
SÃO JOSÉ DO RIO PARDO (Total)						430.073,83	3.948.984,60

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV IPCA I	8.478.587,10	0,00	0,00	0,00	8.509.344,95	30.757,85	128.095,13
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	44.730.855,76	0,00	0,00	0,00	44.780.728,94	49.873,18	538.863,04
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	21.738.981,27	0,00	0,00	0,00	21.820.644,98	81.663,71	447.206,43
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	47.255.097,65	0,00	0,00	0,00	47.444.762,98	189.665,33	970.176,26
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	45.478.374,37	0,00	0,00	0,00	45.477.002,82	-1.371,55	406.428,57
					168.032.484,67	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF IMA-B	19.546.867,24	0,00	0,00	0,00	19.624.760,68	77.893,44	407.546,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	17.386.656,64	380.000,00	-650.000,00	0,00	17.121.948,01	5.291,37	144.669,37
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	638.712,72	0,00	-100.000,00	0,00	540.545,63	1.832,91	4.787,08
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	17.974.810,84	0,00	-1.300.000,00	0,00	16.723.412,12	48.601,28	116.391,41
					54.010.666,44	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	8.329.774,85	0,00	0,00	0,00	8.323.975,89	-5.798,96	118.021,43
					8.323.975,89	0,00	0,00

Artigo 8º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
ITAÚ PRIVATE AÇÕES INDEX IBOVESPA FIC DE FI	3.120.393,41	61.194,10	0,00	0,00	3.194.415,03	12.827,52	246.364,06
					3.194.415,03	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	3.023.747,25	61.194,10	0,00	0,00	3.029.390,77	-55.550,58	180.519,57
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	3.017.625,95	61.194,10	0,00	0,00	3.062.633,87	-16.186,18	229.340,83
					6.092.024,64	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,00	1.300.000,00	0,00	0,00	1.310.574,51	10.574,51	10.574,51
					1.310.574,51	0,00	0,00

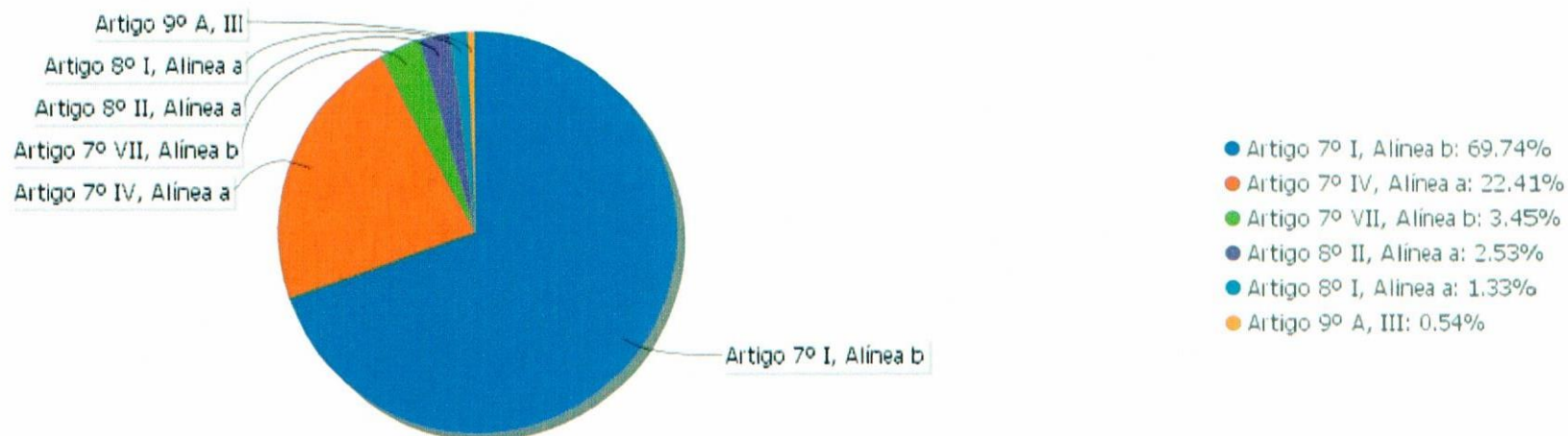
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

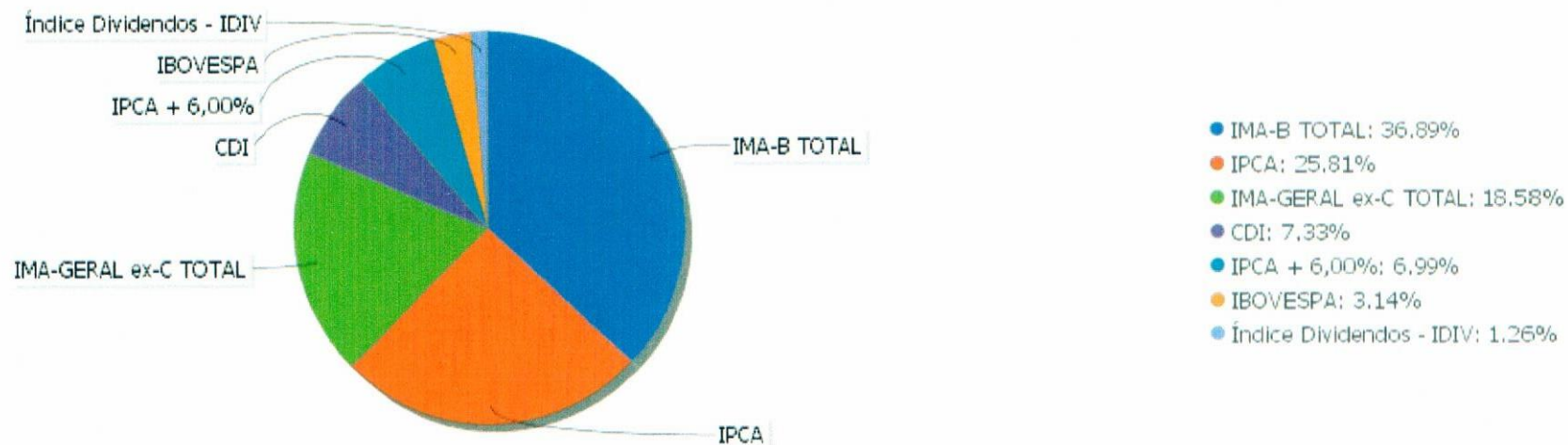
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	218.038.795,70	90,49	218.038.795,70	90,49
de 31 a 365 dias	6.092.024,64	2,53	224.130.820,34	93,01
acima de 365 dias	16.833.320,84	6,99	240.964.141,18	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

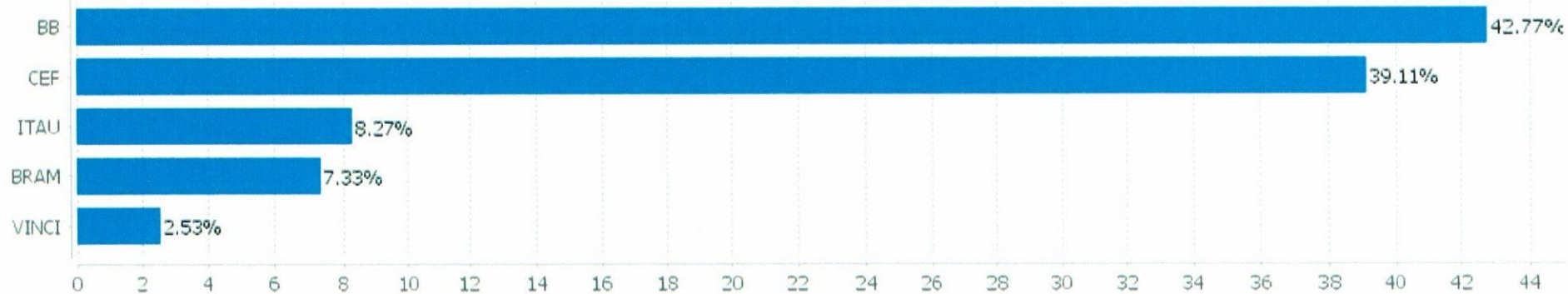


Alocação Por Estratégia



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	-0,57	-1,11	-0,06	0,67	0,80	0,18							-0,10
INPC + 5,47%	0,69	1,20	1,35	0,81	1,41	1,05							6,69
p.p. indexador	-1,27	-2,31	-1,41	-0,13	-0,61	-0,87							-6,79
2020	0,42	0,34	-3,70	1,08	1,50	1,39	2,42	-0,97	-0,96	-0,03	1,53	3,01	6,03
INPC + 5,89%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,97	0,84	1,35	1,37	1,41	1,97	11,63
p.p. indexador	-0,28	-0,24	-4,38	0,86	1,30	0,61	1,45	-1,81	-2,31	-1,40	0,12	1,04	-5,61
2019	1,87	0,46	0,56	1,11	2,30	2,49	1,07	-0,12	2,05	2,15	-1,15	1,33	14,99
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	0,99	-0,54	-0,65	0,02	1,64	2,04	0,44	-0,75	1,61	1,57	-2,15	-0,39	4,21
2018										2,22	0,51	1,15	3,92
INPC + 6,00%										0,91	0,21	0,60	1,74
p.p. indexador										1,31	0,29	0,55	2,18

Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	16	48,48	03 meses	1,66	3,30	-1,63	3,26
Meses abaixo - Meta Atuarial	17	51,52	06 meses	-0,10	6,69	-6,79	3,57
			12 meses	4,93	15,40	-10,47	3,70
			24 meses	11,64	25,17	-13,52	6,08
Maior rentabilidade da Carteira	3,01	2020-12	Desde 28/09/2018	26,58	34,23	-7,65	5,41
Menor rentabilidade da Carteira	-3,70	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 Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,07 -1,09	1,44 -1,71	1,44 -1,71	0,65 -6,10	5,83 -8,99	14,23 -10,10	31,29 -4,85
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,40 -0,02	2,09 -0,06	2,09 -0,06	-0,84 -0,11	7,19 -0,24	12,04 -0,70	44,01 -1,16
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,36 -0,66	1,53 -1,62	1,53 -1,62	2,22 -4,54	7,12 -7,70	16,78 -7,56	37,07 0,93
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,11 -0,21	1,22 -0,10	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	0,90 -0,78	0,90 -0,78	0,72 -3,05	2,68 -5,67	12,77 2,11	31,64 17,26
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,38 -0,04	2,09 -0,05	2,09 -0,05	-0,82 -0,10	7,15 -0,28	12,23 -0,51	44,09 -1,07
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,40 -0,02	2,12 -0,02	2,12 -0,02	-0,83 -0,11	7,12 -0,31	11,94 -0,80	43,82 -1,35
BRADERCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	0,02 6,52	0,81 102,42	0,81 102,42	-2,17 -170,07	-0,57 -25,24	10,84 155,16	27,32 198,77
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA % do CDI	0,31 100,09	0,72 91,84	0,72 91,84	1,15 90,07	1,89 82,93	6,38 91,29	12,91 93,92
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,29 -0,24	0,67 -1,01	0,67 -1,01	1,01 -2,76	1,59 -6,75	7,30 -3,35	21,15 6,76
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	-0,48 -0,94	8,51 -0,20	8,51 -0,20	5,60 -0,94	28,59 -4,81	35,83 10,24	101,75 27,48
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,76 0,41	6,71 1,26	6,71 1,26	3,78 1,73	28,53 4,74	25,52 1,93	87,37 4,76
ITAU PRIVATE AÇÕES INDEX IBOVESPA FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	0,46 -0,01	8,70 -0,02	8,70 -0,02	6,51 -0,03	33,34 -0,06	25,43 -0,16	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-1,19 -1,65	-4,36 -13,07	-4,36 -13,07	8,36 1,82	26,23 -7,17	95,14 69,55	110,45 36,18
SÃO JOSÉ DO RIO PARDO Var. INPC + 5,89% p.p.	0,18 -0,90	1,66 -1,74	1,66 -1,74	-0,10 -6,99	4,93 -10,70	11,64 -13,70	
CDI	0,31	0,79	0,79	1,28	2,28	6,98	13,74
IBOVESPA	0,46	8,72	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27
INPC + 6,00%	1,09	3,42	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores
Renda Fixa

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

Renda Variável

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

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

Investimentos no Exterior

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

Meta Atuarial

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

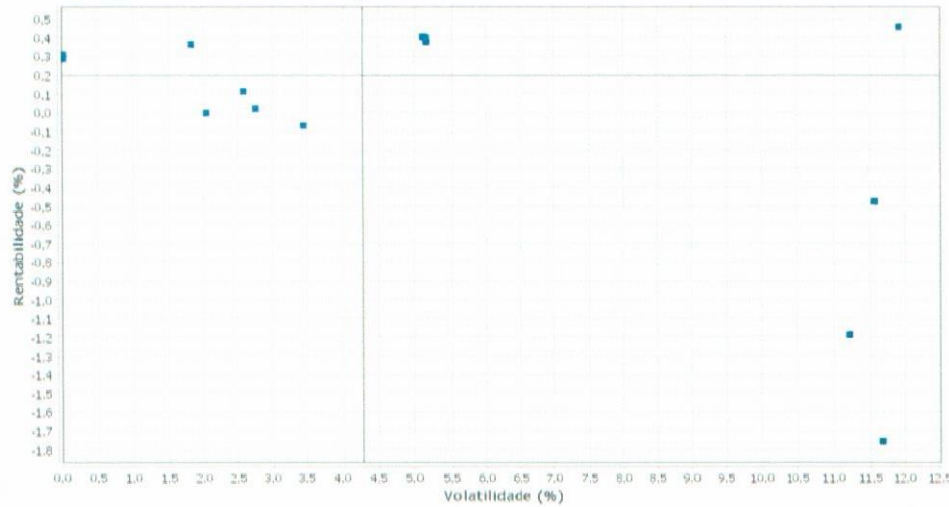
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
19	09/04/2021	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	10.000,00	819,85407150	12,1972926000
20	09/04/2021	BRDESCO FI RF IDKA PRE 2	0,00	360.000,00	219.535,90232210	1,6398229000
21	09/04/2021	ITAÚ PRIVATE AÇÕES INDEX IBOVESPA FIC DE FI	61.194,10	0,00	2.517,11194433	24,3112350000
22	12/04/2021	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	61.194,10	0,00	28.421,12840900	2,1531200000
23	12/04/2021	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	61.194,10	0,00	32.540,84482476	1,8805320000
24	23/04/2021	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	60.000,00	4.916,32037600	12,2042494000
25	27/04/2021	BRDESCO FI RF IDKA PRE 2	0,00	190.000,00	114.717,09195310	1,6562484000
26	05/05/2021	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	20.000,00	1.637,90997675	12,2106833000
27	05/05/2021	BRDESCO FI RF IDKA PRE 2	0,00	380.000,00	230.254,13269812	1,6503504000
28	10/05/2021	ITAÚ PRIVATE AÇÕES INDEX IBOVESPA FIC DE FI	61.194,10	0,00	2.429,70362421	25,1858290000
29	11/05/2021	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	61.194,10	0,00	31.063,16837302	1,9699890000
30	11/05/2021	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	61.194,10	0,00	27.160,78917689	2,2530310000
31	25/05/2021	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	60.000,00	4.903,53893063	12,2360607000
32	27/05/2021	BRDESCO FI RF IDKA PRE 2	0,00	120.000,00	72.432,49005215	1,6567151000
33	08/06/2021	ITAÚ PRIVATE AÇÕES INDEX IBOVESPA FIC DE FI	61.194,10	0,00	2.282,23708695	26,8132090000
34	08/06/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	0,00	1.300.000,00	71.556,68541727	18,1674150000
35	08/06/2021	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	50.000,00	4.081,44840480	12,2505530000
36	08/06/2021	BRDESCO FI RF IDKA PRE 2	0,00	450.000,00	271.385,23163780	1,6581595000
37	09/06/2021	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	61.194,10	0,00	25.815,41548264	2,3704480000
38	09/06/2021	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	61.194,10	0,00	29.509,33587948	2,0737200000
39	10/06/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1.300.000,00	0,00	230.421,56689146	5,6418330000
40	11/06/2021	BRDESCO FI RF IDKA PRE 2	380.000,00	0,00	230.100,22136240	1,6514543000
41	28/06/2021	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	50.000,00	4.073,09494730	12,2756775000
42	28/06/2021	BRDESCO FI RF IDKA PRE 2	0,00	200.000,00	120.665,81951210	1,6574702000
Total						

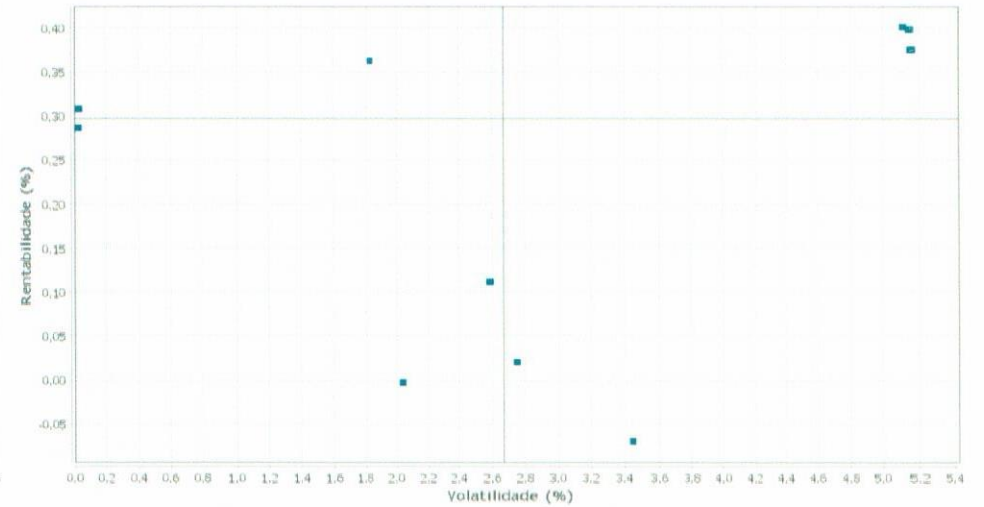
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

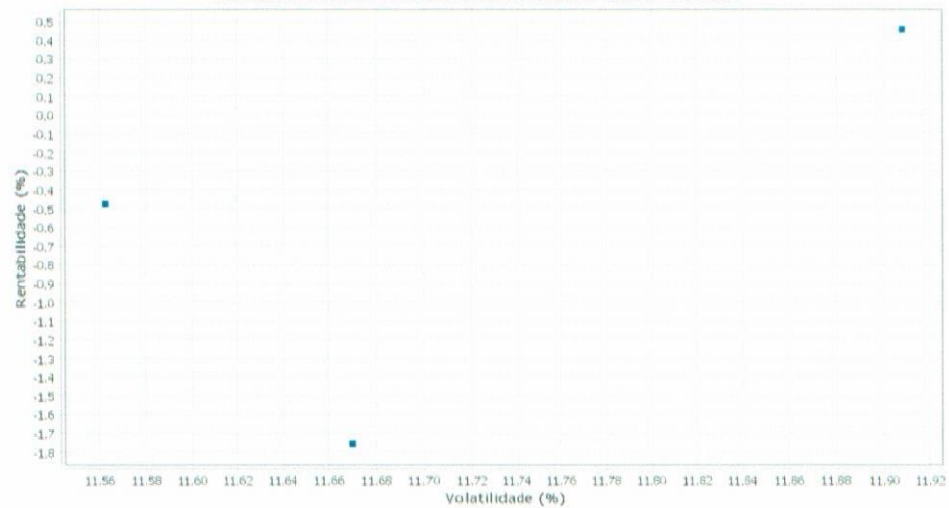
SÃO JOSÉ DO RIO PARDO - No Mês



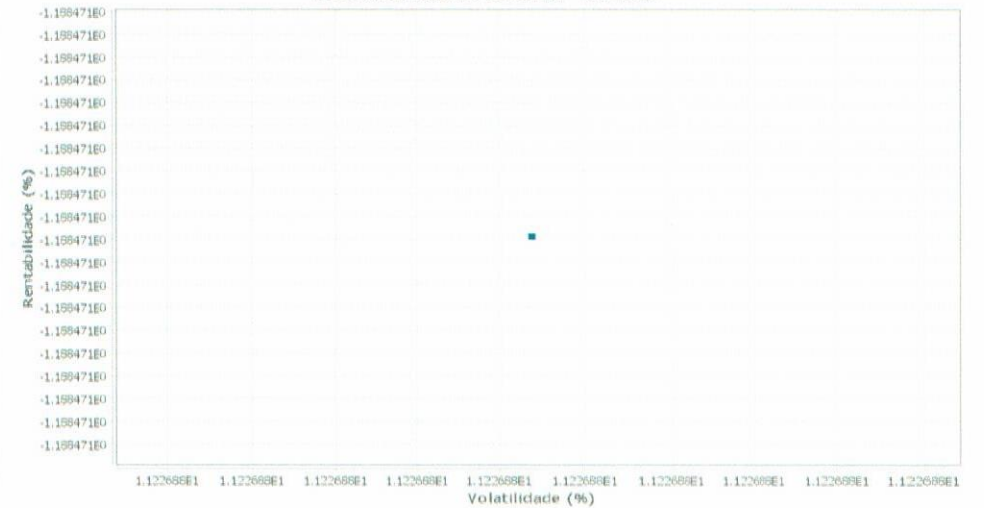
Renda Fixa - No Mês



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\$): 4.248.598,53

Value-At-Risk: 1,76%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,03	0,00	-0,91	0,29	16.723.412,12	6,94
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,03	0,00	0,01	0,31	540.545,63	0,22
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	1,83	0,94	0,02	0,03	0,36	8.509.344,95	3,53
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,04	1,15	0,20	-0,15	-0,00	45.477.002,82	18,87
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,59	1,24	0,23	-0,08	0,11	44.780.728,94	18,58
BRADERCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	2,75	1,70	0,10	-0,10	0,02	17.121.948,01	7,11
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	3,45	1,82	0,06	-0,11	-0,07	8.323.975,89	3,45
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,12	2,67	0,51	0,02	0,40	47.444.762,98	19,69
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	5,15	2,69	0,21	0,02	0,40	19.624.760,68	8,14
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,16	2,67	0,24	0,01	0,38	21.820.644,98	9,06
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	11,23	9,34	-0,01	-0,13	-1,19	1.310.574,51	0,54
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	11,56	8,56	0,07	-0,07	-0,48	3.062.633,87	1,27
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	11,67	8,03	0,06	-0,18	-1,76	3.029.390,77	1,26
ITAÚ PRIVATE AÇÕES INDEX IBOVESA FIC DE FI	Artigo 8º I, Alínea a	11,91	8,38	0,07	0,01	0,46	3.194.415,03	1,33

ABRIL/2021

O mercado brasileiro de renda fixa e variável conseguiram surfar a mesma onda dos mercados internacionais, com o fechamento de taxas de juros e a valorização dos nossos principais índices de bolsa. Adicionalmente e de modo favorável, tivemos a aprovação do orçamento federal de 2021, respeitando-se, de maneira geral, a regra do teto de gastos, ainda que com diversos ruídos políticos e de alguma desconfiança prévia dos mercados. A questão dos gastos públicos continua sendo sensível, mas com eventuais críticas, até que enfim a página do orçamento federal para 2021 foi virada.

Indicadores de renda fixa apresentaram valorização em abril, tais como o IRF-M+1 (+1,12%), o IMA-B 5 (+0,87%), o IRF-M (+0,84%) e o IMA-B (+0,65%), dentre outros. Já do lado da bolsa e liderada por empresas ligadas à exportação do minério de ferro, o SMLL se valorizou em 4,38%, seguido pelo IBRX-50 (+2,90%), IBRX (+2,84%), IVBX-2 (2,75%), IDIV (+2,03%), até chegarmos ao Ibovespa, com alta de 1,94%.

MAIO/2021

Em termos econômicos e até de dívida pública, o mês de maio foi para lá de positivo, sendo que a grande surpresa do cenário doméstico foi a expressiva revisão para cima do PIB, conforme expectativas de mercado trazidas pelo Relatório Focus, que até então vinham sendo revisadas para baixo desde meados de fevereiro, como resultado do agravamento da pandemia.

Além disso, e em face da maior atividade econômica, o governo federal teve um aumento de arrecadação, com impacto positivo sobre o estoque de dívida pública. Conforme comunicado da Fitch, acerca da manutenção do rating BB- para o Brasil, a agência projeta que a dívida pública bruta deve cair, de 88,8% do PIB, no final do ano passado, para 86,8% do PIB, no final desse ano.

Indicadores de renda fixa apresentaram valorização em maio, tais como o IDkA IPCA 20A (+2,37%), o IMA-B 5+ (+1,38%), o IMA-B (+1,06%) e o IDkA IPCA 2A (+0,88%), dentre outros. Já do lado da bolsa e liderada por empresas ligadas ao setor doméstico, o SMLL se valorizou em 6,32%, seguido pelo IBRX-50 (+6,18%), Ibovespa (+6,16%) e IBRX (+5,92%).

JUNHO/2021

Em termos econômicos, o BCB endureceu o discurso, sinalizando aumento maior da taxa Selic. Com isso, os juros da parte curta da curva subiram enquanto os da parte longa recuaram, já inflação implícita nas NTN-B também recuou.

Indicadores de renda fixa apresentaram valorização em junho, tais como o IDkA IPCA 20A (+1,07%), o IMA-B 5+ (+0,83%), o IMA-B (+0,42%) e o IMA Geral (+0,35%), dentre outros, ficando na ponta negativa o IDkA IPCA 2A (-0,32%) e o IMA-B 5 (-0,13%). Já do lado da bolsa, que num primeiro momento foram positivamente influenciadas pela melhora nas expectativas fiscais e de crescimento do PIB, acabaram devolvendo parte dos ganhos devido ao tom mais agressivo do FED e do BCB. Assim, o SMLL se valorizou em 1,29%, seguido pelo ISE (+1,28%), IBRX-50 (+0,66%), IBRX (+0,63%) e o Ibovespa (+0,46%).

Dúvidas sobre os possíveis impactos trazidos pelas propostas tributárias, apresentadas no pacote trazido pelo governo federal, também acabaram influenciando negativamente.

Fonte: LDB Consultoria Financeira

O Comitê de Investimentos do RPPS de São José do Rio Pardo analisou o relatório do 2º trimestre de 2021 da carteira de investimentos com as seguintes considerações:

No comportamento da carteira de investimentos do IMP o trimestre analisado pode ser avaliado como misto, com recuperação em comparação ao trimestre anterior, no mês de abril a rentabilidade foi de 0,67% contra a meta atuarial de 0,81%, em maio a rentabilidade foi de 0,80% contra a meta atuarial de 1,41%, em junho a rentabilidade foi de 0,18% contra a meta atuarial de 1,05%, no acumulado a carteira fechou com -0,10% e a meta atuarial com 6,69%.

Conforme mencionado pela consultoria financeira LDB, a crise enfrentada contra o Corona-Virus começou a animar a economia mundial, como a vacinação avançada especialmente no EUA, Eurpóra e Asia, as exportações impulsionaram os índices de renda variável, abrindo sinal verde para o investimento acionário como principal desenvolvimento para diversificação dos ativos financeiros, o que o IMP vem realizando gradativamente.

São José do Rio Pardo, 22 de julho de 2021.

ANBIMA: CPA – 10	Anderson Luis Fonseca Pirola	Validade 26/04/2024
ANBIMA: CPA – 10	Cintia Ribeiro da Silva	Validade 03/10/2022
ANBIMA: CPA – 10	Fabiano Boaro de Sousa	Validade 30/01/2024
ANBIMA: CPA – 10	Eduardo de Paula Marin	Validade 21/08/2023
ANBIMA: CPA – 10	Filipe Giordan Santos Garcia	Validade 04/09/2023

The image shows five horizontal lines, each with a handwritten signature in blue ink written over it. The signatures are stylized and vary in length and complexity. The top signature is the most prominent, followed by the second and third ones. The fourth and fifth signatures are less distinct.