



LDB
EMPRESAS

SÃO JOSÉ DO RIO PARDO
3º 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 30.09.2021.

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 92,06%

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	5,33	-0,15	-1,66	21.458.332,71	9,11	7.233.196.021,39	0,30
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,31	-0,16	-1,68	46.645.497,93	19,81	5.161.580.539,44	0,90
BB	BB	BB PREV IPCA I	1,59	1,30	2,44	8.484.797,12	3,60	515.171.032,99	1,65
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,68	-0,01	-0,70	44.466.060,40	18,89	8.672.013.980,14	0,51
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,43	0,35	-1,87	44.628.008,12	18,95	14.407.320.968,51	0,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,49	0,10	-1,26	165.682.696,28	70,37		

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	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,27	0,45	1,25	290.761,02	0,12	9.148.556.896,00	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	5,32	-0,13	-1,62	19.306.090,85	8,20	1.163.721.806,55	1,66
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,68	0,84	1,30	7.735.499,92	3,29	3.094.123.781,71	0,25
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	3,31	-0,57	-1,80	15.324.695,38	6,51	332.263.801,49	4,61
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,92	-0,09	-0,98	42.657.047,17	18,12		

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	2,95	0,92	1,05	8.411.641,32	3,57	634.085.763,40	1,33
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			2,95	0,92	1,05	8.411.641,32	3,57		
Renda Fixa			3,31	0,09	-1,11	216.751.384,77	92,06		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

5,67%

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	20,96	-6,59	-12,49	2.963.923,12	1,26	456.397.730,08	0,65
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			20,96	-6,59	-12,49	2.963.923,12	1,26		

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	19,68	-7,98	-14,44	2.786.304,63	1,18	732.667.418,23	0,38
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,49	-6,49	-10,65	2.877.432,26	1,22	1.005.326.835,22	0,29
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	22,04	-6,52	-10,23	4.731.854,44	2,01	1.047.084.854,27	0,45
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			19,14	-7,01	-13,10	10.395.591,33	4,42		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			19,64	-6,92	-12,93	13.359.514,45	5,67		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,27%

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	18,24	-0,25	7,72	5.342.452,27	2,27	3.337.438.389,61	0,16
Sub-total Artigo 9º A, III			18,24	-0,25	7,72	5.342.452,27	2,27		
Investimentos no Exterior			13,94	-0,25	7,72	5.342.452,27	2,27		
Total			3,57	-0,32	-1,69	235.453.351,49	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	165.682.696,28	70,37	40,00	45,00	80,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	42.657.047,17	18,12	10,00	26,25	40,00	0,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	8.411.641,32	3,57	1,00	1,50	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	216.751.384,77	92,06					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	2.963.923,12	1,26	0,75	7,00	10,00	0,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	10.395.591,33	4,42	1,55	10,00	15,00	0,00	20,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	13.359.514,45	5,67					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	5.342.452,27	2,27	0,25	4,50	6,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	5.342.452,27	2,27					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	0,10 21,90	-1,26 -103,13	-1,26 -103,13	0,22 11,14	2,90 97,03	158.877,00	-2.121.116,50
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,09 -20,67	-0,98 -79,96	-0,98 -79,96	0,22 10,89	1,25 41,72	-50.056,62	-498.619,27
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,92 210,81	1,05 86,12	1,05 86,12	2,51 124,42	5,47 183,02	76.995,72	87.665,43
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-6,59 -0,02	-12,49 -0,01	-12,49 -0,01	-4,88 -0,03	17,25 -0,06	-207.116,34	-414.074,21
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-7,01 -0,44	-13,10 -0,62	-13,10 -0,62	-6,49 -1,64	11,90 -5,41	-749.263,59	-1.263.597,91
Artigo 9º A, III % do CDI	-0,25 -57,07	7,72 631,10	7,72 631,10			-8.376,98	131.877,76
SÃO JOSÉ DO RIO PARDO (Total)						-778.940,81	-4.077.864,70

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	8.375.629,81	0,00	0,00	0,00	8.484.797,12	109.167,31	204.124,06
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	44.468.422,60	0,00	0,00	0,00	44.466.060,40	-2.362,20	-314.668,54
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	21.491.333,46	0,00	0,00	0,00	21.458.332,71	-33.000,75	-362.312,27
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	46.718.273,78	0,00	0,00	0,00	46.645.497,93	-72.775,85	-799.265,05
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	44.470.159,63	0,00	0,00	0,00	44.628.008,12	157.848,49	-848.994,70
					165.682.696,28	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	19.331.254,79	0,00	0,00	0,00	19.306.090,85	-25.163,94	-318.669,83

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	15.987.391,14	0,00	-570.000,00	0,00	15.324.695,38	-92.695,76	-297.252,63
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	374.202,30	0,00	-85.000,00	0,00	290.761,02	1.558,72	5.215,39
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	10.269.255,56	0,00	-2.600.000,00	0,00	7.735.499,92	66.244,36	112.087,80
					42.657.047,17	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	8.334.645,60	0,00	0,00	0,00	8.411.641,32	76.995,72	87.665,43
					8.411.641,32	0,00	0,00

Artigo 8º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
ITAU PRIVATE AÇÕES INDEX IBOVESPA FIC DE FI	3.109.845,36	61.194,10	0,00	0,00	2.963.923,12	-207.116,34	-414.074,21
					2.963.923,12	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	3.745.278,37	1.300.000,00	0,00	0,00	4.731.854,44	-313.423,93	-468.145,56
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	3.013.333,86	61.194,10	0,00	0,00	2.877.432,26	-197.095,70	-335.540,81
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	2.963.854,49	61.194,10	0,00	0,00	2.786.304,63	-238.743,96	-459.911,54
					10.395.591,33	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	4.050.829,25	1.300.000,00	0,00	0,00	5.342.452,27	-8.376,98	131.877,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
					5.342.452,27	0,00	0,00

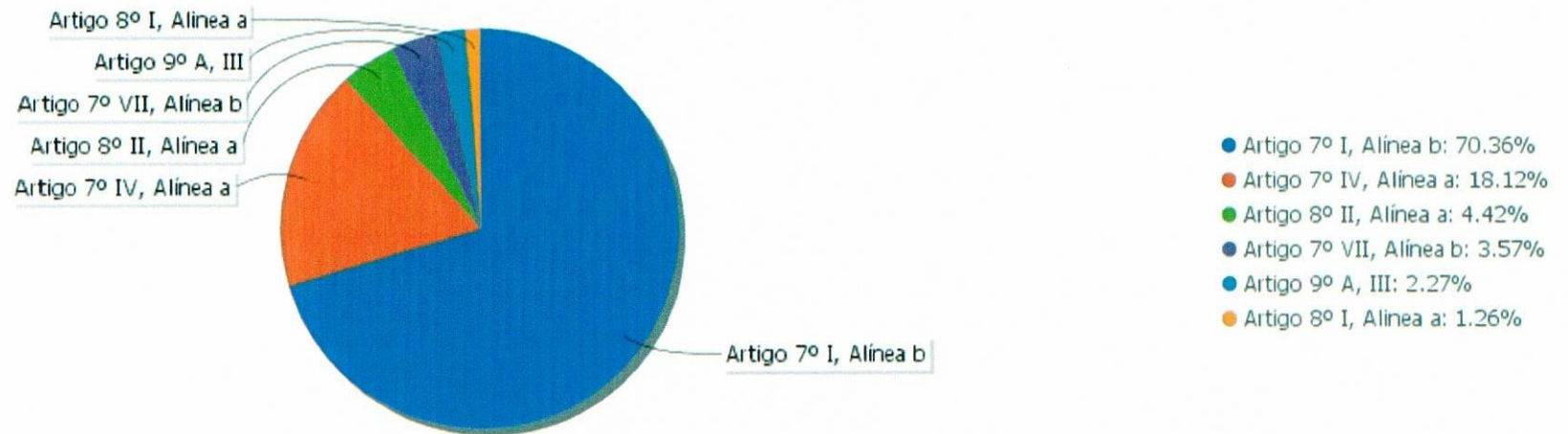
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

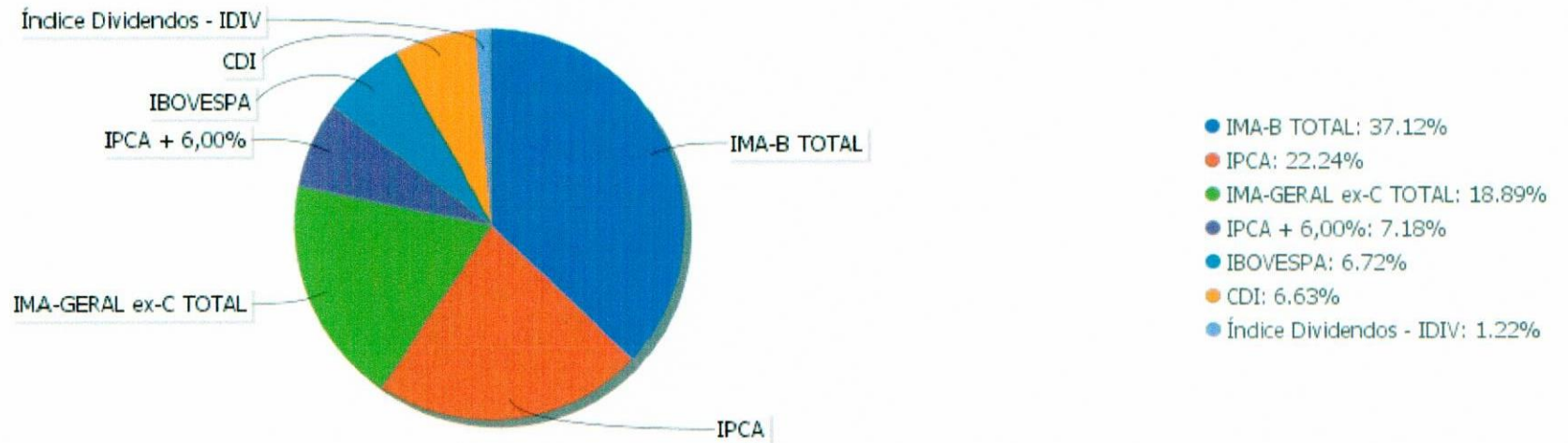
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	212.893.176,16	90,42	212.893.176,16	90,42
de 31 a 365 dias	14.148.534,01	6,01	227.041.710,17	96,43
acima de 365 dias	8.411.641,32	3,57	235.453.351,49	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

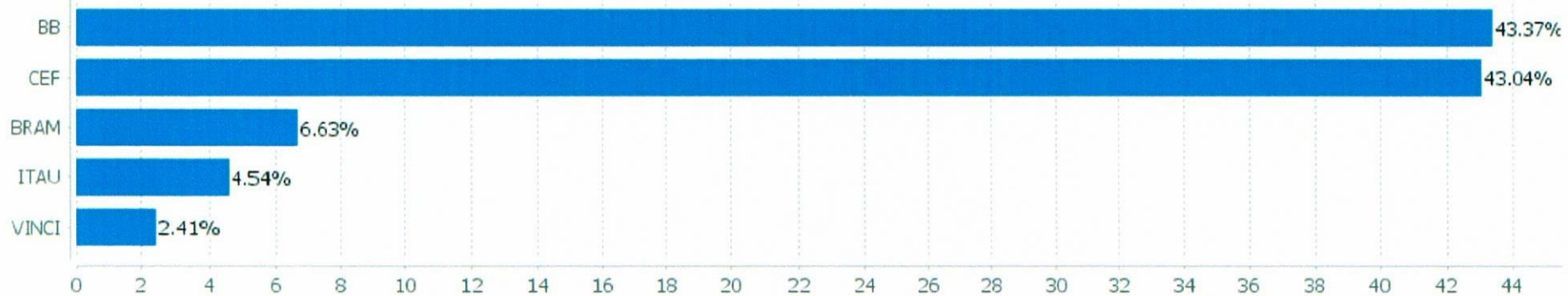


Alocação Por Estratégia



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	-0,47	-0,90	-0,32				-1,79
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	-1,27	-2,31	-1,41	-0,13	-0,61	-0,87	-1,97	-2,25	-1,97				-13,34
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

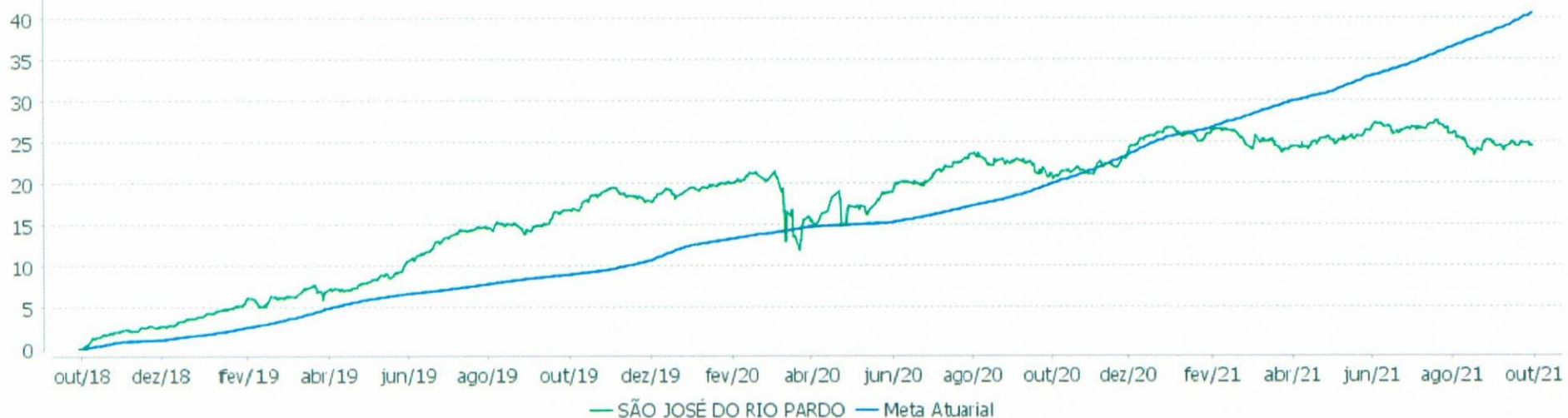
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Periodo	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	16	44,44	03 meses	-1,69	4,56	-6,25	3,81
Meses abaixo - Meta Atuarial	20	55,56	06 meses	-0,06	8,00	-8,07	3,56
			12 meses	2,69	16,93	-14,25	3,57
			24 meses	6,54	28,67	-22,13	6,15
Maior rentabilidade da Carteira	3,01	2020-12	36 meses	24,43	40,35	-15,91	5,30
Menor rentabilidade da Carteira	-3,70	2020-03	Desde 28/09/2018	24,43	40,35	-15,91	5,30

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.	0,92 -0,73	1,05 -3,53	1,05 -3,53	2,51 -5,36	5,47 -11,36	12,48 -15,24	28,59 -10,69
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,13 0,00	-1,62 -0,03	-1,62 -0,03	0,46 -0,06	4,43 -0,28	6,22 -0,70	39,06 -1,40
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA % do CDI	0,45 101,94	1,25 102,05	1,25 102,05	1,98 98,32	2,85 95,45	6,11 91,88	12,58 94,23
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	-0,57 -129,58	-1,80 -147,02	-1,80 -147,02	-1,01 -49,90	-2,31 -77,30	5,81 87,26	22,93 171,81
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,84 -0,32	1,30 -1,72	1,30 -1,72	1,98 -2,77	2,72 -7,53	6,51 -7,19	21,07 4,08
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,16 -0,02	-1,68 -0,09	-1,68 -0,09	0,37 -0,15	4,45 -0,26	6,20 -0,72	39,29 -1,17
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,30 -0,35	2,44 -2,14	2,44 -2,14	4,01 -3,86	7,77 -9,06	16,25 -11,48	37,46 -1,82
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,01 -0,03	-0,70 -0,28	-0,70 -0,28	0,51 -0,38	1,75 -0,30	5,52 -0,51	23,63 0,04
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,35 -0,81	-1,87 -4,89	-1,87 -4,89	-0,98 -5,73	0,85 -9,39	7,32 -6,38	26,96 9,96
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,15 -0,02	-1,66 -0,07	-1,66 -0,07	0,40 -0,12	4,49 -0,22	6,40 -0,52	39,39 -1,07
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-6,52 0,04	-15,87 -3,40	-15,87 -3,40	-5,36 -0,51	13,95 -3,36	9,19 3,24	65,50 25,63
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	-7,98 -1,41	-14,44 -1,96	-14,44 -1,96	-7,16 -2,31	9,34 -7,97	9,32 3,37	71,08 31,20
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-6,49 -2,00	-10,65 -4,05	-10,65 -4,05	-4,65 -3,14	15,95 -3,63	7,86 0,01	66,44 1,61
ITAU PRIVATE AÇÕES INDEX IBOVESPA FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-6,59 -0,02	-12,49 -0,01	-12,49 -0,01	-4,88 -0,03	17,25 -0,06	5,83 -0,12	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-0,25 6,32	7,72 20,20	7,72 20,20	3,03 7,87	18,25 0,94	90,64 84,69	101,42 61,54
SÃO JOSÉ DO RIO PARDO Var. INPC + 5,89% p.p.	-0,32 -2,01	-1,69 -6,36	-1,69 -6,36	-0,06 -8,28	2,69 -14,59	6,54 -22,48	24,43 -16,15
CDI	0,44	1,22	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	-6,57	-12,48	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87
INPC + 6,00%	1,69	4,69	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02
IPCA + 6,00%	1,65	4,58	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28

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	0,40	0,96	0,96	1,65	2,49	7,15	15,12	22,90	38,45
IRF-M 1+	-0,73	-2,65	-2,65	-1,15	-3,14	4,23	25,92	32,64	58,13
IRF-M TOTAL	-0,33	-1,39	-1,39	-0,15	-1,02	5,48	23,23	30,30	53,03
IMA-B 5	1,00	1,18	1,18	2,64	5,95	13,62	31,12	39,68	58,47
IMA-B 5+	-1,26	-4,19	-4,19	-1,61	3,20	1,48	46,98	45,78	70,99
IMA-B TOTAL	-0,13	-1,59	-1,59	0,52	4,71	6,92	40,46	44,04	66,75
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,02	-0,42	-0,42	0,89	2,05	6,02	23,59	29,99	49,60
IMA-GERAL TOTAL	-0,01	-0,52	-0,52	0,96	2,48	6,93	24,87	31,60	51,09
IDKA 2	1,10	1,18	1,18	3,12	6,21	14,71	29,45	40,48	59,67
IDKA 20	-3,03	-8,65	-8,65	-5,13	2,03	-7,04	59,98	49,40	80,44
CDI	0,44	1,22	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,90	34,86

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-6,57	-12,48	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87	49,38	90,14
IBRX 100	-6,99	-13,61	-13,61	-5,31	17,82	7,71	45,23	53,72	95,90
IBRX 50	-7,47	-14,15	-14,15	-5,58	18,46	6,59	37,53	47,56	87,32
SMALL CAP	-6,43	-15,22	-15,22	-4,70	15,75	13,69	78,82	65,15	133,65
IFIX	-1,24	-1,42	-1,42	-4,61	-2,83	1,17	27,21	22,27	49,54
Índice Consumo - ICON	-5,95	-14,34	-14,34	-7,48	-1,67	-2,69	50,48	25,77	51,19
Índice Dividendos - IDIV	-4,48	-6,59	-6,59	-1,51	19,58	7,85	64,83	56,04	121,60

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	1,16	3,02	3,02	4,75	10,25	13,70	16,99	22,29	25,39
INPC	1,20	3,13	3,13	5,14	10,78	15,09	18,46	23,16	25,17
IGPM	-0,64	0,80	0,80	7,15	24,86	47,25	52,21	67,49	65,07
SELIC	0,44	1,22	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,91	34,89

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	0,73	8,99	8,99	3,52	23,52	89,01	100,82	193,57	232,88
MSCI ACWI	1,23	7,16	7,16	0,61	21,06	78,00	83,86	150,21	184,12
MSCI World	1,22	8,36	8,36	2,09	22,47	80,14	87,02	158,04	191,94

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,49	4,07	4,07	6,84	14,64	22,96	31,56	42,95	52,39
IPCA + 5,00%	1,57	4,32	4,32	7,36	15,74	25,33	35,38	48,50	59,82
IPCA + 5,50%	1,61	4,45	4,45	7,61	16,29	26,53	37,32	51,33	63,64
IPCA + 5,89%	1,64	4,55	4,55	7,81	16,71	27,46	38,84	53,57	66,67
IPCA + 6,00%	1,65	4,58	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28	54,21	67,53
INPC + 4,00%	1,53	4,18	4,18	7,24	15,20	24,46	33,20	43,97	52,12
INPC + 6,00%	1,69	4,69	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
43	05/07/2021	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	30.000,00	2.441,90591860	12,2854856000
44	05/07/2021	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	0,00	370.000,00	223.780,77129240	1,6534039000
45	07/07/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	1.300.000,00	71.377,14458808	18,2131130000
46	08/07/2021	ITAU PRIVATE AÇÕES INDEX IBOVESPA FIC DE FI	61.194,10	0,00	2.361,35603217	25,9148130000
47	12/07/2021	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	61.194,10	0,00	26.676,48676901	2,2939340000
48	12/07/2021	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	61.194,10	0,00	30.214,69810285	2,0253090000
49	12/07/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1.300.000,00	0,00	216.098,07661075	6,0157870000
50	22/07/2021	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	50.000,00	4.060,92036790	12,3124798000
51	28/07/2021	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	0,00	100.000,00	60.622,86232420	1,6495427000
52	04/08/2021	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	20.000,00	1.621,85281890	12,3315752000
53	04/08/2021	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	0,00	460.000,00	279.780,69329530	1,6441449000
54	05/08/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	5.200.000,00	285.697,34795000	18,2010790000
55	09/08/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1.300.000,00	0,00	213.004,55043259	6,1031560000
56	10/08/2021	ITAU PRIVATE AÇÕES INDEX IBOVESPA FIC DE FI	61.194,10	0,00	2.423,92845000	25,2458360000
57	10/08/2021	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	3.900.000,00	0,00	1.919.932,89096100	2,0313210000
58	11/08/2021	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	61.194,10	0,00	32.012,83357109	1,9115490000
59	11/08/2021	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	61.194,10	0,00	27.890,14416766	2,1941120000
60	16/08/2021	BB PREV IPCA I	0,00	228.671,89	90.982,67469200	2,5133564250
61	19/08/2021	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	20.000,00	1.618,37478120	12,3580769000
62	23/08/2021	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	50.000,00	4.044,40563250	12,3627560000
63	09/09/2021	ITAU PRIVATE AÇÕES INDEX IBOVESPA FIC DE FI	61.194,10	0,00	2.567,88417793	23,8305530000
64	09/09/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	2.600.000,00	142.027,92607709	18,3062590000
65	09/09/2021	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	20.000,00	1.613,71824460	12,3937373000
68	09/09/2021	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	0,00	390.000,00	241.114,73648750	1,6174872000
71	10/09/2021	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	61.194,10	0,00	29.265,40108703	2,0910050000
72	10/09/2021	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	61.194,10	0,00	34.185,46396716	1,7900620000
70	14/09/2021	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.300.000,00	0,00	675.063,76756200	1,9257440000
73	14/09/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1.300.000,00	0,00	212.472,73811329	6,1184320000

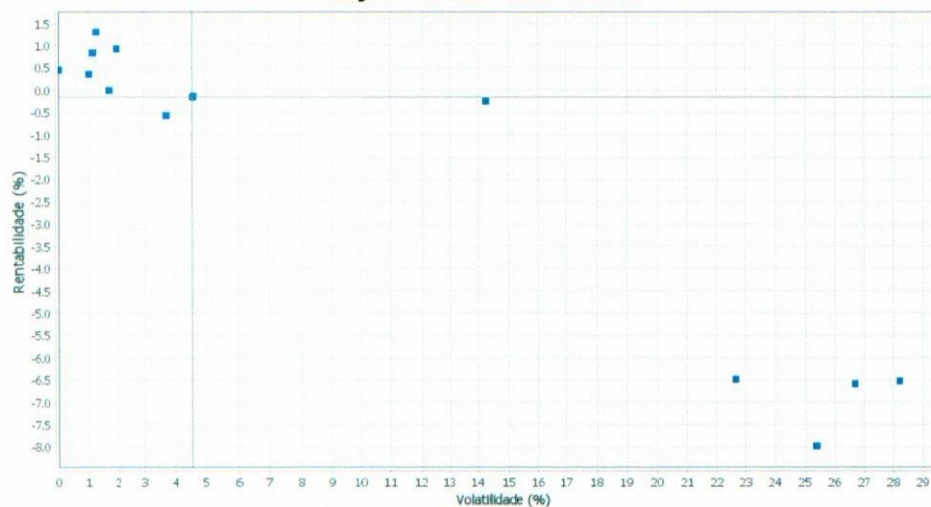
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
66	24/09/2021	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	50.000,00	4.025,32330890	12,4213625000
67	29/09/2021	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	15.000,00	1.206,76659120	12,4299099000
69	29/09/2021	BRDESCO FI RF IDKA PRE 2	0,00	180.000,00	110.559,43997950	1,6280835000
		Total				

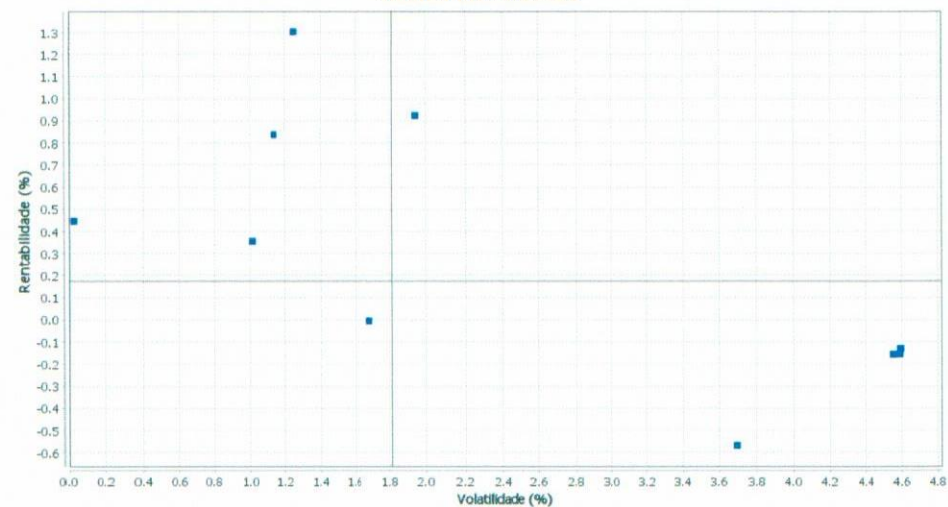
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

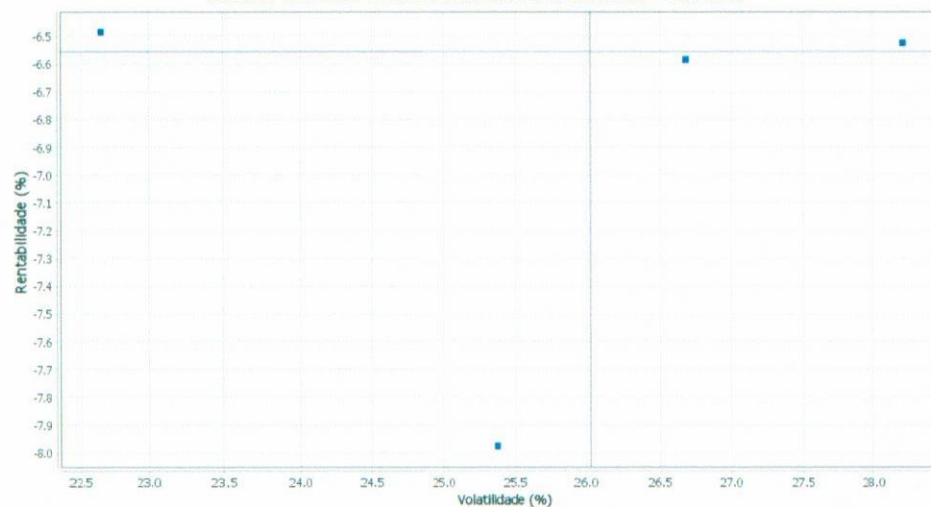
SÃO JOSÉ DO RIO PARDO - No Mês



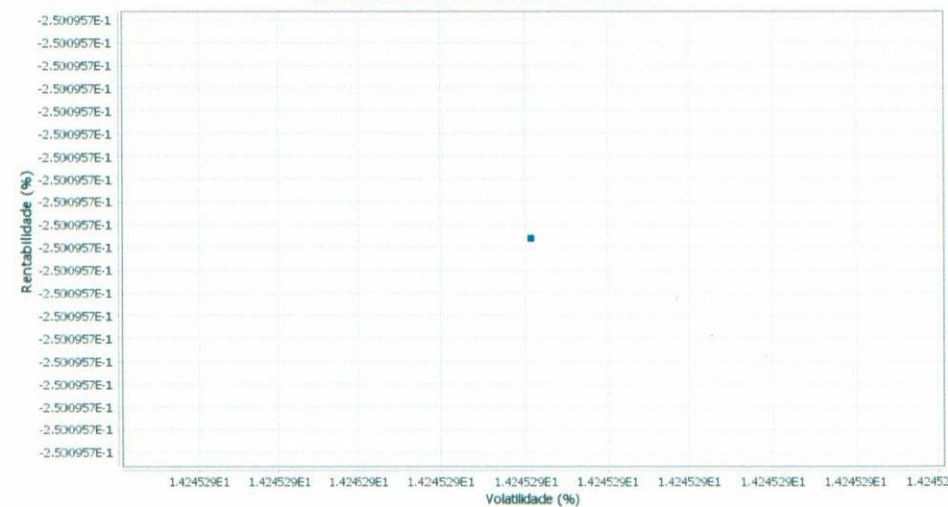
Renda Fixa - No Mês



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\$): 4.608.991,46

Value-At-Risk: 1,96%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	-0,00	0,32	0,45	290.761,02	0,12
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,01	1,46	0,23	-0,08	0,35	44.628.008,12	18,95
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	1,14	0,52	0,01	0,35	0,84	7.735.499,92	3,29
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	1,25	0,55	0,01	0,69	1,30	8.484.797,12	3,60
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,68	1,11	0,20	-0,26	-0,01	44.466.060,40	18,89
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	1,94	1,27	0,04	0,25	0,92	8.411.641,32	3,57
BRDESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	3,70	1,57	0,08	-0,27	-0,57	15.324.695,38	6,51
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,55	2,95	0,56	-0,13	-0,16	46.645.497,93	19,81
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,59	2,97	0,26	-0,13	-0,15	21.458.332,71	9,11
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	4,59	2,96	0,23	-0,12	-0,13	19.306.090,85	8,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	14,25	6,65	-0,04	-0,05	-0,25	5.342.452,27	2,27
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	22,64	7,63	0,06	-0,31	-6,49	2.877.432,26	1,22
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	25,37	8,90	0,07	-0,33	-7,98	2.786.304,63	1,18
ITAU PRIVATE AÇÕES INDEX IBOVESPA FIC DE FI	Artigo 8º I, Alínea a	26,68	10,10	0,08	-0,26	-6,59	2.963.923,12	1,26
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	28,20	11,60	0,16	-0,25	-6,52	4.731.854,44	2,01

JULHO/2021

No mês de julho, a inflação continuou não dando trégua. O último número do IPCA-15 veio acima das expectativas. Adicionalmente, dúvidas sobre uma possível piora no quadro fiscal, com rumores a respeito de um suposto aumento do Bolsa-Família por fora do teto de gastos, e, gastos bem acima do previsto com o pagamento de precatórios em 2022, trouxeram impactos negativos nos mercados domésticos.

Os indicadores de renda fixa ficaram aquém do CDI (+ 0,36%) ou mesmo com retornos negativos, em especial os indicadores que agregam ativos de renda fixa com vencimentos mais longos, tais como o IRF-M (- 0,47%), o IMA-B 5+ (- 0,76%) IRF-M 1+ (- 0,83%), dentre outros. Sobre o mercado de renda variável, até o penúltimo dia útil de julho, a bolsa apresentava resultado levemente negativo. Porém, no último dia do mês houve uma queda expressiva, também em resposta a uma piora da percepção de risco associada a preocupação com a política fiscal. Assim, julho apresentou queda quase que generalizada dos principais índices de bolsa local. O Ibovespa caiu 3,94%, seguido pelo IBrX – 100 (- 3,99%), o ISE (-5,11%) e o SMLL (-5,80%), dentre outras baixas.

AGOSTO/2021

Avanço inflacionário, dúvidas fiscais e acirramento de tensões políticas foram determinantes para mais um mês de má performance nos mercados locais. Sobre dúvidas fiscais e acirramento de tensões políticas, até o momento não há sinais claros de que possa haver melhora no curto prazo, em especial em ano pré-eleitoral.

Os indicadores de renda fixa ficaram novamente aquém do CDI (+ 0,43%) ou mesmo ainda com retornos negativos, em especial os indicadores que agregam ativos de renda fixa com vencimentos mais longos, tais como o IMA-Geral (-0,41%), o IRF-M (- 0,60%), o IMA-B (-1,09%), IRF-M 1+ (- 1,11%) e o IMA-B 5+ (- 2,22%), dentre outros. Sobre o mercado de renda variável, também afetado por discussões políticas e dúvidas no âmbito fiscal, os índices de bolsa locais apresentaram mais um mês com retornos negativos. Assim, o Ibovespa caiu mais 2,48%, seguido pelo IBrX - 100 (- 3,25%), o IBrX - 50 (-3,50%) e o SMLL (-3,82%), dentre outras baixas em maior ou menor proporção.

SETEMBRO/2021

A má performance dos mercados locais no mês de setembro, e a exemplo de julho e agosto, a inflação continuou não dando trégua, também vindo acima das expectativas. Adicionalmente ao mal humor externo, tensões políticas e dúvidas sobre uma possível piora no quadro fiscal, em especial sobre uma provável acomodação do pagamento de precatórios no orçamento, seja por dentro ou por fora do teto de gastos, contribuíram para a abertura da curva de juros, com abertura mais forte nos vencimentos mais longos.

Na renda fixa com exposição mais longa acabaram sofrendo um pouco mais, sendo que o destaque positivo ficou por conta do IDKa IPCA 2A (+1,10%) e pelo IMA-B5 (+1,00%), seguidos pelo CDI (+ 0,44%) e pelo IRF-M 1 (+0,40%). Na ponta negativa tivemos o IMA-GERAL (-0,01%), o IMA-B (-0,13%), o IRF-M (-0,33%), o IRF-M 1+ (-0,73%) e o IMA-B5+ (-1,26%), dentre outros. Sobre o mercado de renda variável, também afetados pelo mal humor internacional, discussões políticas e dúvidas no âmbito fiscal,

os índices de bolsa locais apresentaram mais um mês com retornos negativos de forma generalizada. Assim, partindo do IDIV, com queda (-4,48%), o SMLL caiu (-6,43%), seguidos pelo Ibovespa (-6,57%), o IBrX – 100 (-6,99%) e o IBRX – 50 (-7,47%)

Fonte: LDB Consultoria Financeira

O Comitê de Investimentos do RPPS de São José do Rio Pardo analisou o relatório do 3º trimestre de 2021 da carteira de investimentos com as seguintes considerações:

A carteira de investimentos fecha o 3º trimestre de 2021 com resultado negativo, sendo acumulado (-1,79%) contra uma meta atuarial de 11,55%.

Os principais ativos financeiros presentes na carteira de investimentos do IMP estão sofrendo com as consequências da pandemia do Covid-19, as sucessivas elevações na taxa Selic realizada pelo COPOM, não surtiram resultados favoráveis para a contenção da inflação, resultando instabilidade no mercado financeiro, amargando com a marcação a mercado para os títulos públicos.

Diante de um cenário desafiador, não é recomendado mudanças nos investimentos em zerar posições alocadas, ao se desfazer das cotas desvalorizadas no momento de crise, poderá acarretar em prejuízo irreversível, estamos enfrentando o momento com cautela e aguardando a recuperação do mercado.

São José do Rio Pardo, 21 de outubro 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

