



LDB
EMPRESAS

MOGI DAS CRUZES
DEZEMBRO 2020



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 13.01.2021.

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 **64,68%**

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	0,57	0,31	3,47	61.764,62	0,01	8.522.749.810,66	0,00
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	12,74	4,83	6,05	14.804.557,77	2,09	770.268.981,55	1,92
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,80	4,84	6,06	115.060.354,77	16,23	6.193.173.925,17	1,86
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,65	0,40	3,45	15.413,26	0,00	141.840.853,58	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,55	0,28	3,63	79.212,44	0,01	16.753.976.831,37	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,02	1,82	7,75	116.219.374,41	16,39	20.761.505.098,56	0,56
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	12,78	4,83	5,85	21.144.279,23	2,98	1.116.892.204,20	1,89
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,06	1,96	6,43	14.559.300,59	2,05	3.566.953.490,56	0,41
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,23	3,24	10,18	2.577.795,31	0,36	941.494.565,53	0,27
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,99	1,81	7,78	13.609.266,88	1,92	4.987.516.426,31	0,27
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,39	1,21	7,76	14.272.234,05	2,01	470.288.944,40	3,03
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,27	2,38	5,09	57.262.651,93	8,08	9.568.490.825,39	0,60
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	1,32	6,66	67.444.648,75	9,51	14.722.139.597,34	0,46
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,19	1,61	6,92	2.929.014,50	0,41	588.486.078,32	0,50
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			7,46	2,81	7,09	440.039.868,51	62,06		

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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,37	0,27	2,10	9.135.758,37	1,29	1.591.072.731,33	0,57
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	14,06	5,01	5,88	6.154.691,77	0,87	262.576.035,48	2,34
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	12,75	4,81	5,91	3.090.047,79	0,44	1.391.144.513,85	0,22
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,66	0,20	2,86	199.386,42	0,03	3.882.685.363,65	0,01
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			3,34	2,84	5,34	18.579.884,35	2,62		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

7,13

2,81

6,94

458.619.752,86

64,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

28,29%

Artigo 8º I, Alínea b (Fundos de Índices Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	71,40	9,32	2,91	37.611.586,07	5,30	5.488.909.215,82	0,69
ITAU	ITAU	IT NOW S&P 500 TRN FUNDO DE ÍNDICE	4,96	0,24	1,77	6.122.219,24	0,86	1.386.977.005,75	0,44
Sub-total Artigo 8º I, Alínea b			70,82	7,95	0,30	43.733.805,31	6,17		

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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	43,68	7,61	-6,07	4.708.990,14	0,66	601.590.009,52	0,78
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	40,19	7,96	-9,45	836.558,58	0,12	1.793.128.513,73	0,05
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	41,21	6,28	11,90	1.197.372,64	0,17	1.217.691.164,96	0,10
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	47,91	8,50	-2,65	19.815.586,64	2,79	655.833.944,65	3,02
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	41,85	8,55	2,60	29.695.965,29	4,19	323.099.492,65	9,19
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	41,94	9,08	64,38	10.849.120,15	1,53	756.510.912,48	1,43
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	38,86	7,88	12,13	1.529.998,98	0,22	567.847.062,72	0,27
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	42,06	10,11	17,45	1.256.694,78	0,18	1.060.739.165,08	0,12
XP	INTRAG	XP INVESTOR 30 FIC FIA	48,77	6,83	-5,21	19.205.828,23	2,71	589.693.431,88	3,26
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	42,17	10,72	5,98	2.369.442,87	0,33	1.169.052.019,30	0,20
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,92	9,37	3,05	12.019.247,74	1,70	1.002.176.394,28	1,20
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	45,15	7,65	68,68	11.133.171,35	1,57	1.038.280.774,77	1,07
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	40,15	7,95	29,61	8.554.112,03	1,21	268.718.538,49	3,18
INDIE CAPITAL	INTRAG	INDIE FIC FIA	48,98	6,93	36,83	2.290.771,52	0,32	1.283.871.181,12	0,18
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	38,44	7,81	-1,52	14.694.139,86	2,07	234.022.233,15	6,28
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			43,51	8,19	-2,45	140.157.000,80	19,77		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	33,38	3,19	12,17	13.158.820,12	1,86	1.201.804.027,43	1,09
BRAM	BRADERCO	BRADERCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	4,77	1,41	6,47	3.534.303,78	0,50	281.867.686,51	1,25
Sub-total Artigo 8º III			25,66	2,81	10,92	16.693.123,90	2,35		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			39,12	7,67	2,99	200.583.930,01	28,29		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,03%

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
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	29,05	1,53	75,99	9.701.466,40	1,37	180.785.683,23	5,37
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	31,19	5,26	7,87	2.128.245,69	0,30	404.257.247,02	0,53
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	29,49	0,18	91,31	23.635.551,78	3,33	1.275.079.811,13	1,85
Sub-total Artigo 9º A, II			27,09	0,84	90,29	35.465.263,87	5,00		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	29,55	2,95	2,95	6.596.358,90	0,93	1.987.917.698,76	0,33
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	33,07	0,35	44,45	1.881.485,91	0,27	1.875.936.369,20	0,10
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	29,74	-0,22	-1,06	5.936.309,56	0,84	2.312.094.734,72	0,26
Sub-total Artigo 9º A, III			33,00	-0,23	42,45	14.414.154,37	2,03		
Investimentos no Exterior			28,28	0,73	71,27	49.879.418,24	7,03		
Total			11,22	4,01	13,08	709.083.101,11	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	440.039.868,51	62,06	30,00	5,00	90,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	18.579.884,35	2,62	2,00	1,14	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	458.619.752,86	64,68				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea b	Fundos de Índices Referenciados	43.733.805,31	6,17	0,00	5,00	15,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	140.157.000,80	19,77	0,00	18,00	15,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	16.693.123,90	2,35	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	200.583.930,01	28,29				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	35.465.263,87	5,00	0,00	4,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	14.414.154,37	2,03	0,00	1,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	49.879.418,24	7,03				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

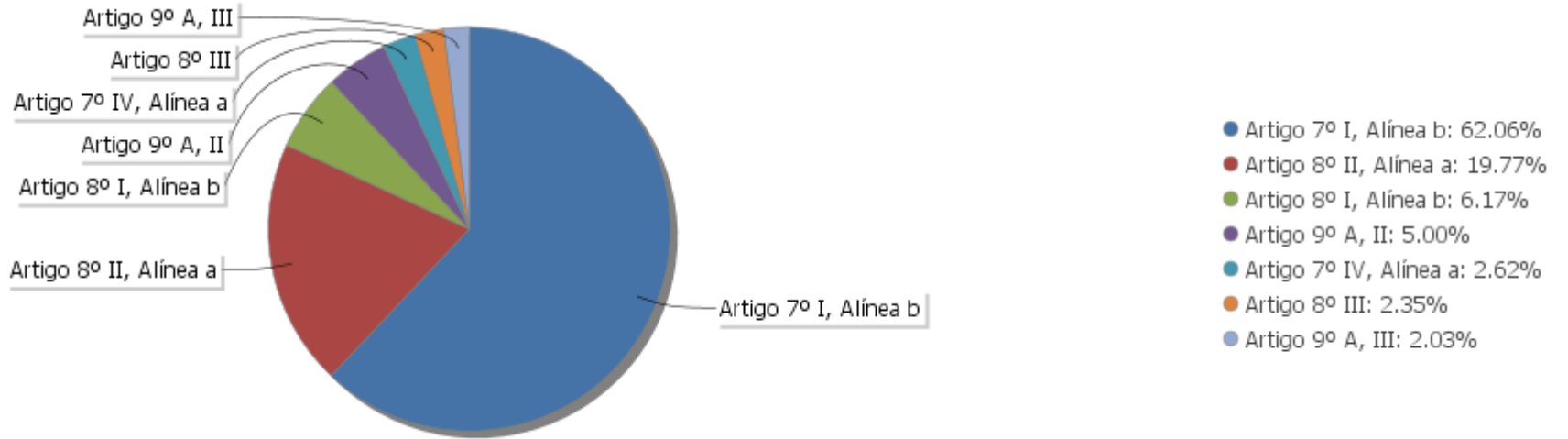
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	2,81 1.711,27	7,09 256,93	4,26 903,92	4,94 501,30	7,09 256,93	12.192.818,70	27.648.933,80
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	2,84 1.725,17	5,34 193,57	3,86 818,39	4,17 422,58	5,34 193,57	456.263,73	1.231.709,67
Artigo 8º I, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	7,95 -1,34	0,30 -2,62	22,61 -3,19	22,03 -3,18	0,30 -2,62	3.222.148,65	13.767.598,73
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,19 -1,11	-2,45 -5,37	20,31 -5,50	19,79 -5,42	-2,45 -5,37	10.608.959,41	26.033.410,92
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,81 -6,49	10,92 8,00	9,37 -16,44	15,55 -9,66	10,92 8,00	455.853,84	1.642.816,24
Artigo 9º A, II % do CDI	0,84 508,62	90,29 3.274,06	3,36 711,58	25,52 2.587,95	90,29 3.274,06	294.186,07	11.562.982,64
Artigo 9º A, III % do CDI	-0,23 -142,78	42,45 1.539,25	-0,07 -15,39	15,26 1.547,74	42,45 1.539,25	126.621,91	1.787.718,28
MOGI DAS CRUZES (Total)						27.356.852,31	83.675.170,28

Análise de Liquidez

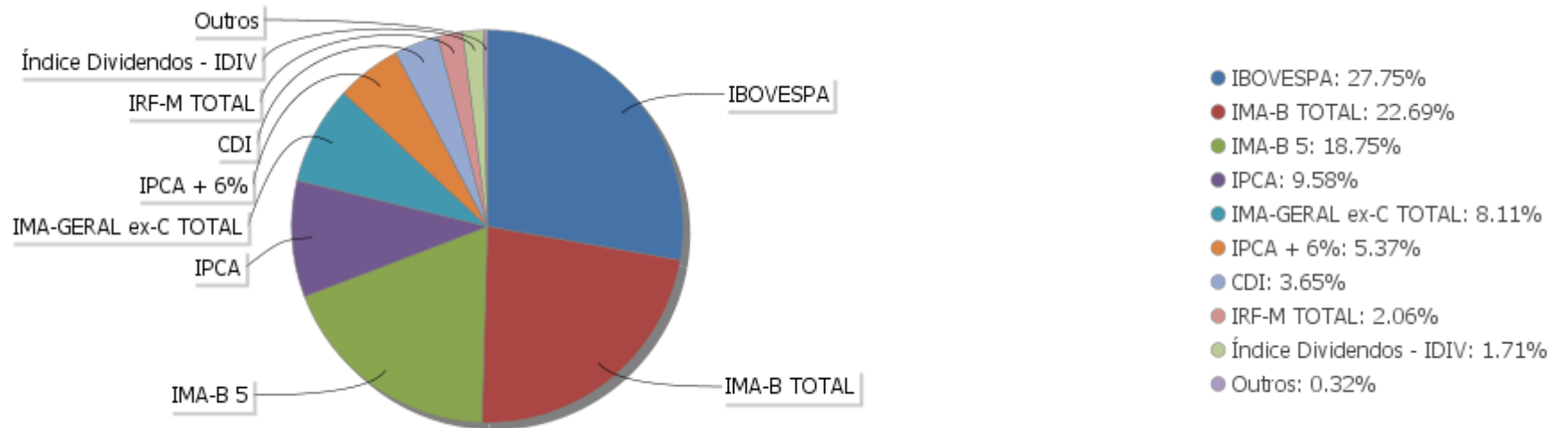
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	623.930.159,69	87,99	623.930.159,69	87,99
de 31 a 364 dias	67.951.692,87	9,58	691.881.852,56	97,57
acima de 365 dias	17.201.248,55	2,43	709.083.101,11	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

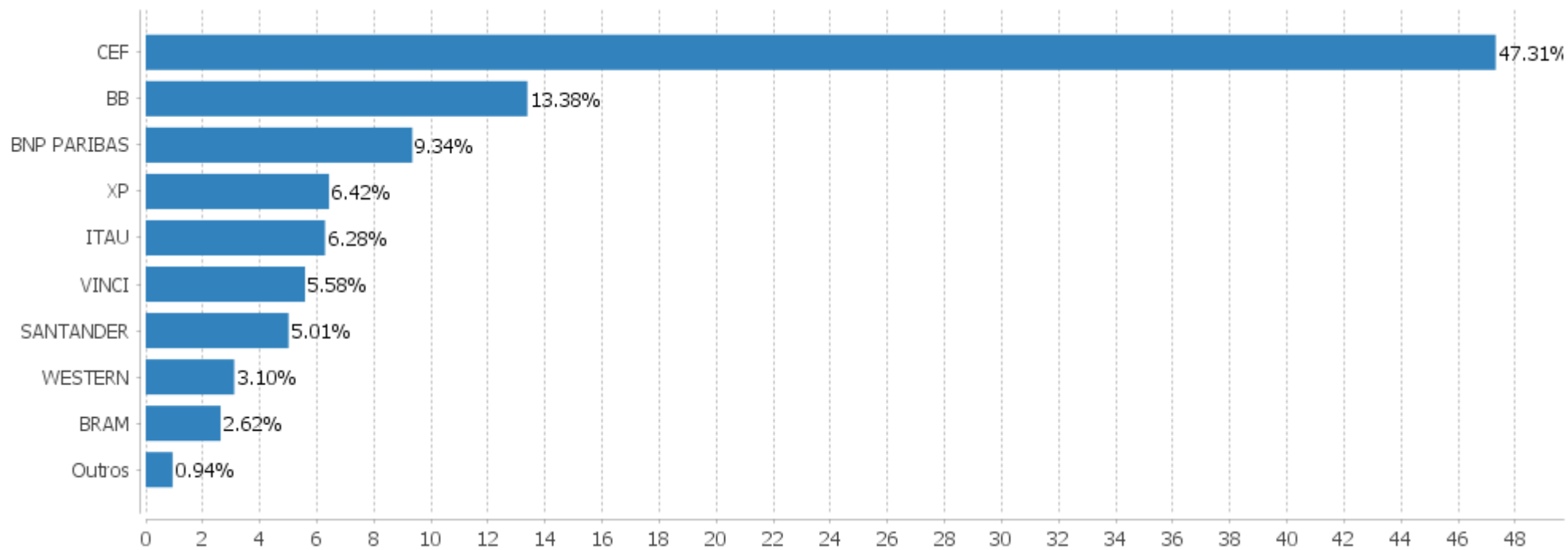


Alocação Por Estratégia



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
2020	0,64	-0,53	-5,69	3,28	2,94	2,96	3,43	-0,44	-1,65	-0,40	4,30	4,01	13,08
IPCA + 5,86%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,62
p.p. indexador	-0,07	-1,19	-6,26	3,14	2,87	2,22	2,55	-1,16	-2,77	-1,74	2,96	2,16	2,46
2019	2,62	0,40	0,42	1,14	1,92	2,62	1,15	-0,04	2,03	2,09	-0,62	1,88	16,71
IPCA + 6%	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	1,79	-0,50	-0,77	0,09	1,28	2,17	0,42	-0,66	1,58	1,46	-1,59	0,24	6,12
2018	1,78	0,59	0,91	0,37	-1,50	0,13	1,83	-0,52	0,58	3,66	0,79	1,09	10,06
IPCA + 6%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	0,98	-0,15	0,34	-0,34	-2,38	-1,62	0,99	-0,96	-0,34	2,70	0,53	0,48	0,14

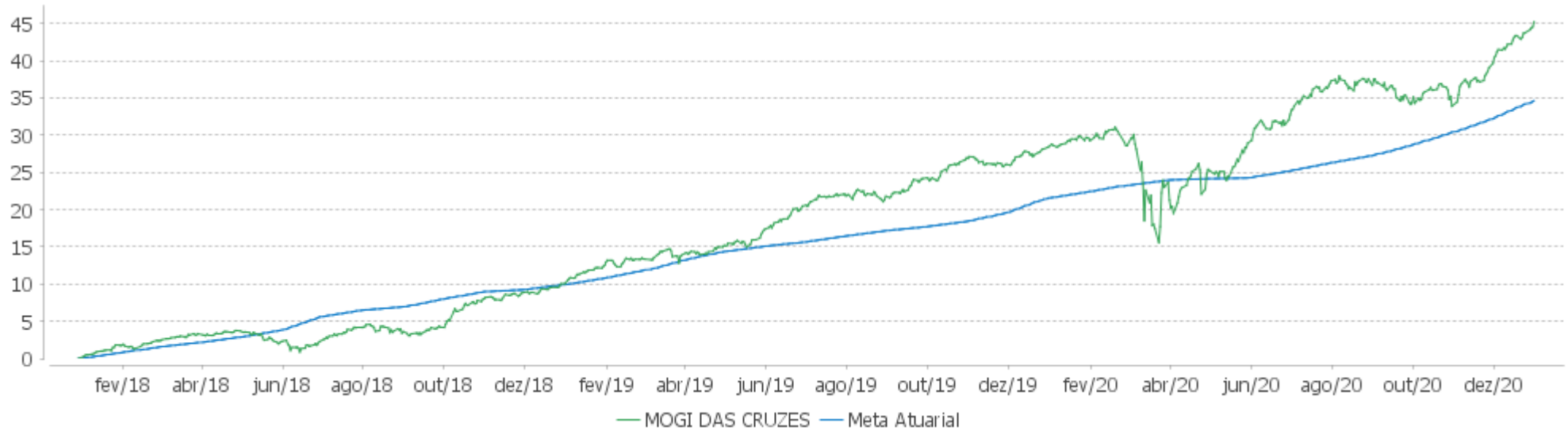
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

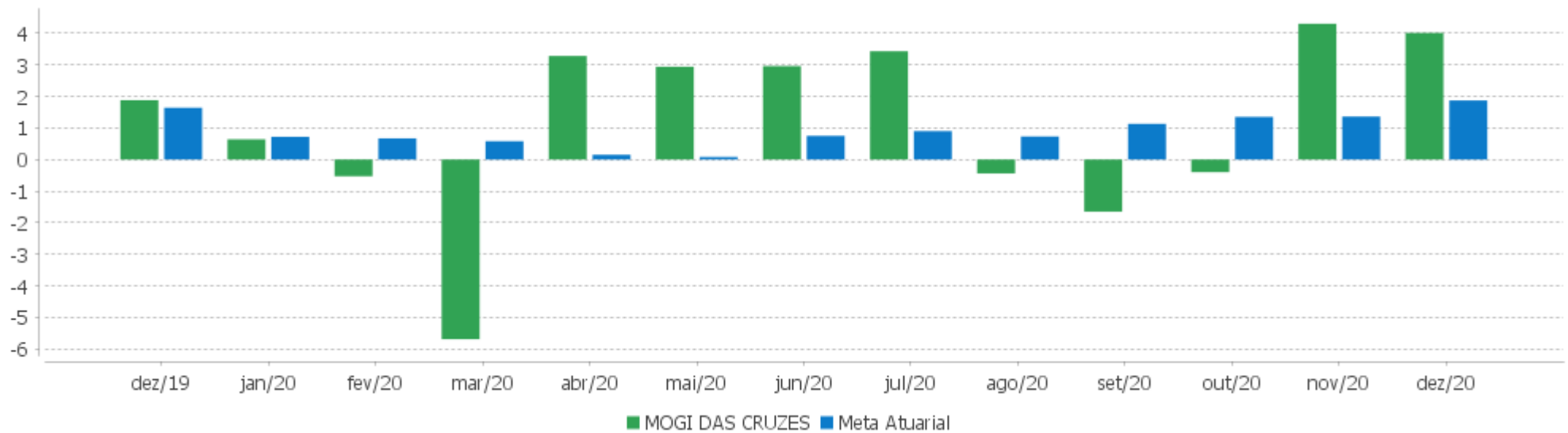
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	20	55,56	03 meses	8,06	4,61	3,45	5,51
Meses abaixo da Meta Atuarial	16	44,44	06 meses	9,43	7,48	1,95	5,64
			12 meses	13,08	10,62	2,46	11,22
			24 meses	31,98	22,33	9,65	8,24
			36 meses	45,25	34,47	10,78	6,98
Maior rentabilidade da Carteira	4,30	2020-11					
Menor rentabilidade da Carteira	-5,69	2020-03	Desde 29/12/2017	45,25	34,47	10,78	6,98

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
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,84 -0,01	6,06 -0,34	7,13 -0,04	8,09 -0,12	6,06 -0,34	30,02 -0,81	46,71 -1,20
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	3,24 1,41	10,18 2,15	4,43 1,05	5,13 0,41	10,18 2,15	27,76 5,51	42,78 8,47
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,82 -0,01	7,75 -0,29	3,32 -0,06	4,57 -0,15	7,75 -0,29	21,60 -0,65	33,35 -0,96
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,31 0,00	3,47 -0,37	0,63 -0,08	0,99 -0,22	3,47 -0,37	10,19 -0,67	17,63 -0,96
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,81 -0,02	7,78 -0,26	3,34 -0,05	4,56 -0,16	7,78 -0,26	21,67 -0,58	33,42 -0,90
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p.	1,61 -0,36	6,92 -4,83	3,22 -1,63	4,30 -3,93	6,92 -4,83	20,48 -3,31	42,15 6,49
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,96 0,01	6,43 -0,26	1,93 -0,06	1,62 -0,12	6,43 -0,26	18,87 -0,67	31,59 -0,76
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,83 -0,03	6,05 -0,36	7,09 -0,08	8,04 -0,17	6,05 -0,36	29,95 -0,88	46,40 -1,51
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	2,38 0,26	5,09 0,24	3,17 0,34	3,28 0,19	5,09 0,24	18,83 0,74	30,59 0,94
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6% p.p.	1,21 -0,66	7,76 -3,01	2,91 -1,74	4,60 -2,95	7,76 -3,01	22,13 -0,37	43,71 9,07
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,32 -0,03	6,66 2,15	2,04 -1,09	1,95 -2,47	6,66 2,15	24,19 15,17	33,90 20,80
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,40 0,09	3,45 -0,39	0,77 0,06	0,99 -0,22	3,45 -0,39	10,18 -0,68	17,72 -0,87
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,28 -0,03	3,63 -0,21	0,64 -0,06	1,12 -0,09	3,63 -0,21	10,42 -0,44	17,94 -0,66
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,83 -0,03	5,85 -0,55	7,10 -0,07	8,05 -0,16	5,85 -0,55	29,76 -1,07	46,35 -1,56
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,81 -0,05	5,91 -0,49	7,04 -0,14	8,01 -0,19	5,91 -0,49	29,81 -1,01	46,46 -1,45
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	5,01 0,16	5,88 -0,52	7,13 -0,05	8,01 -0,19	5,88 -0,52	30,88 0,05	47,49 -0,42
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	0,20	2,86	0,38	0,58	2,86	15,12	24,58

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	-1,15	-1,66	-2,75	-3,83	-1,66	6,10	11,47
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,27 166,02	2,10 76,05	0,62 132,12	1,18 119,99	2,10 76,05	8,03 90,42	14,89 93,81
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	9,08 -0,22	2,38 -0,53	21,02 -4,79	21,77 -3,44	2,38 -0,53	54,11 18,69	78,18 22,40
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,95 -1,35	-9,41 -12,33	20,13 -5,68	13,28 -11,93	-9,41 -12,33		
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	9,37 0,43	3,05 4,05	25,03 -0,40	23,84 2,55	3,05 4,05	46,40 2,69	62,13 -4,50
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	7,61 -1,68	-6,07 -8,99	18,87 -6,93	21,69 -3,51	-6,07 -8,99	24,85 -10,57	43,51 -12,27
XP INVESTOR 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	6,83 -2,47	-5,21 -8,13	13,16 -12,65	15,19 -10,02	-5,21 -8,13	41,54 6,12	70,67 14,89
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,81 -1,49	-1,52 -4,43	19,15 -6,65	14,12 -11,09	-1,52 -4,43	42,11 6,69	64,47 8,69
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,96 -1,33	-9,45 -12,36	20,15 -5,66	13,27 -11,93	-9,45 -12,36	29,14 -6,28	57,09 1,31
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	10,72 1,42	5,98 3,06	32,39 6,59	29,35 4,14	5,98 3,06	49,89 14,47	
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	6,28 -3,01	-6,23 -9,14	18,58 -7,22	15,16 -10,05	-6,23 -9,14	41,49 6,07	73,82 18,04
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	8,55 -0,74	2,60 -0,31	22,63 -3,17	21,85 -3,36	2,60 -0,31	45,60 10,18	48,36 -7,42
VINCI SELECTION EQUITIES FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,88 -1,42	9,26 6,34	18,34 -7,47	19,95 -5,26	9,26 6,34	46,62 11,20	75,00 19,22
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	6,93 -2,37	7,45 4,53	19,25 -6,56	21,89 -3,32	7,45 4,53		
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	10,11 0,81	7,87 4,95	22,82 -2,99	24,40 -0,80	7,87 4,95	46,10 10,68	79,48 23,71
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	8,50 -0,79	-2,65 -5,57	22,21 -3,60	24,82 -0,39	-2,65 -5,57	53,82 18,40	54,79 -0,98
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	7,65 -1,65	1,18 -1,74	18,83 -6,98	18,56 -6,64	1,18 -1,74		
IT NOW S&P 500 TRN FUNDO DE ÍNDICE Var. IBOVESPA p.p.	0,24 -9,06	1,77 -17,73	1,77 -24,03				
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	9,32	2,91	25,81	25,21	2,91	55,95	

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.	0,03	-0,00	-0,00	0,00	-0,00	20,53	
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	3,19 1.939,35	12,17 441,42	11,55 2.449,51	19,85 2.012,61	12,17 441,42	48,40 544,90	44,80 282,22
BRADESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL % do CDI	1,41 857,57	6,47 234,58	1,94 410,78	1,95 197,42	6,47 234,58	14,80 166,62	20,81 131,13
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	0,69 -8,60	54,76 51,85	1,31 -24,49	16,49 -8,72	54,76 51,85	108,09 72,67	129,28 73,50
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	0,35 -8,95	44,45 41,53	1,33 -24,48	16,88 -8,33	44,45 41,53	98,40 62,98	
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-0,22 -9,52	66,02 63,10	0,44 -25,37	18,11 -7,10	66,02 63,10	125,04 89,62	147,14 91,36
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IBOVESPA p.p.	1,53 -7,77	75,99 73,08	3,86 -21,95	18,56 -6,65	75,99 73,08	141,02 105,60	
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	5,26 3,38	42,77 -4,64	12,51 7,16	24,79 7,95	42,77 -4,64		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6% p.p.	0,18 -1,69	91,31 80,54	2,70 -1,94	25,96 18,41	91,31 80,54		
MOGI DAS CRUZES Var. IPCA + 6% p.p.	4,01 2,15	13,08 2,32	8,06 3,41	9,43 1,88	13,08 2,32	31,98 9,48	45,25 10,61
CDI	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
INPC + 6%	1,98	11,75	4,85	8,23	11,75	23,79	35,66
IPCA + 6%	1,87	10,76	4,64	7,55	10,76	22,49	34,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,31	3,84	0,70	1,21	3,84	10,86	18,59
IRF-M 1+	3,05	8,45	2,90	2,29	8,45	23,90	39,09
IRF-M TOTAL	1,95	6,69	1,99	1,75	6,69	19,53	32,36
IMA-B 5	1,83	8,04	3,38	4,72	8,04	22,25	34,31
IMA-B 5+	7,51	5,50	10,53	11,36	5,50	37,54	58,72
IMA-B TOTAL	4,85	6,41	7,18	8,21	6,41	30,83	47,91
IMA-C TOTAL	-1,12	22,07	3,64	13,59	22,07	45,76	72,56
IMA-GERAL ex-C TOTAL	2,12	4,85	2,83	3,09	4,85	18,09	29,65
IMA-GERAL TOTAL	2,02	5,34	2,86	3,40	5,34	18,84	30,77
IDKA 2	1,73	8,62	3,05	5,10	8,62	21,46	33,31
IDKA 20	11,36	2,20	15,90	16,58	2,20	47,44	77,53
CDI	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87
Renda Variável							
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
IBRX 100	9,15	3,50	25,34	25,28	3,50	38,06	59,35
IBRX 50	9,42	3,62	26,47	26,00	3,62	33,83	53,28
SMALL CAP	7,52	-0,65	22,54	25,33	-0,65	57,16	69,94
IFIX	2,19	-10,24	2,69	2,28	-10,24	22,05	28,91
Índice Consumo - ICON							
Índice Dividendos - IDIV	8,94	-1,00	25,44	21,29	-1,00	43,71	66,63
Indicadores Econômicos							
IPCA	1,35	4,52	3,13	4,42	4,52	9,02	13,10
INPC	1,46	5,45	3,34	5,07	5,45	10,17	13,96
IGPM	0,96	23,14	7,64	17,96	23,14	32,13	42,09
SELIC	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,88
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

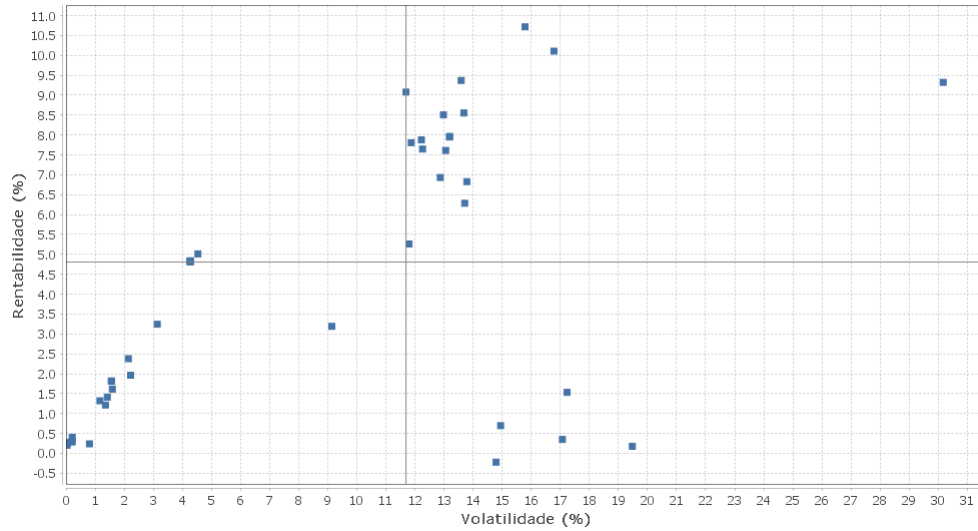
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
195	02/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	9.000.000,00	3.873.478,42457600	2,3234930000
205	02/12/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	9.000.000,00	0,00	48.276,14332500	186,4274853000
197	03/12/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	17.000,00	91,17705500	186,4504189000
201	03/12/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	771.000,00	0,00	4.135,14758900	186,4504189000
207	03/12/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	3.011.000,00	16.149,06535400	186,4504189000
203	09/12/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	771.000,00	4.133,16807700	186,5397162000
210	09/12/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2.472.000,00	0,00	484.847,24859973	5,0985130000
198	11/12/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	1.000,00	5,35950500	186,5844239000
202	11/12/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	352.000,00	0,00	1.886,54547200	186,5844239000
208	11/12/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	2.387.000,00	12.793,13648100	186,5844239000
199	17/12/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	24.000,00	128,56849000	186,6709333000
209	17/12/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	2.066.000,00	11.067,60417200	186,6709333000
200	21/12/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	13.000,00	69,62377700	186,7178228000
204	21/12/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	352.000,00	1.885,19764600	186,7178228000
211	22/12/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	3.991.000,00	0,00	771.851,01322126	5,1706870000
196	28/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	4.000.000,00	1.703.632,65521200	2,3479240000
206	29/12/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	4.000.000,00	0,00	21.408,58407300	186,8409413000

Total

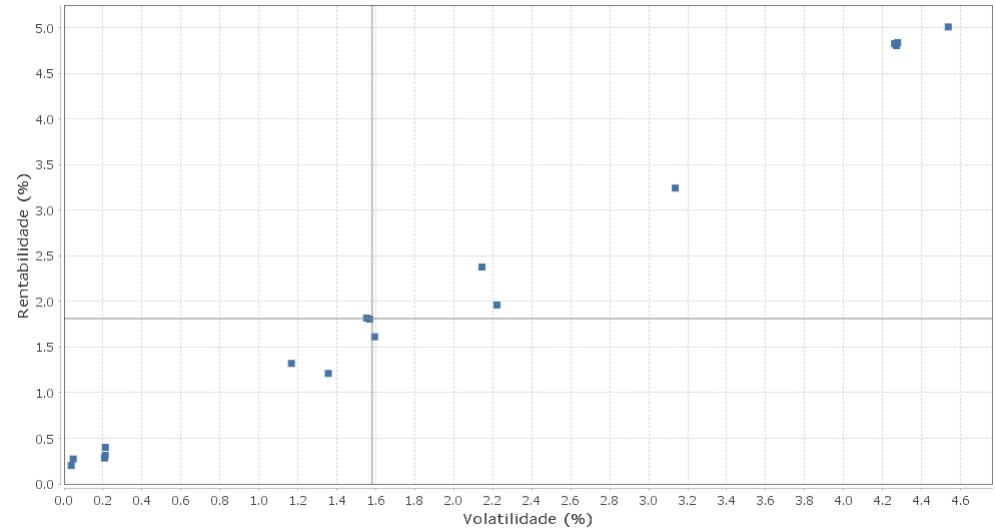
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

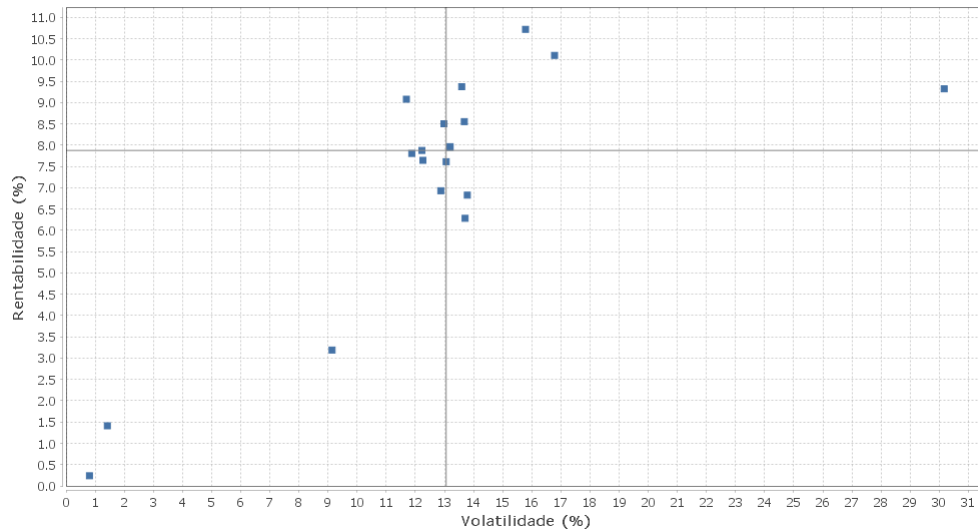
MOGI DAS CRUZES - No Mês



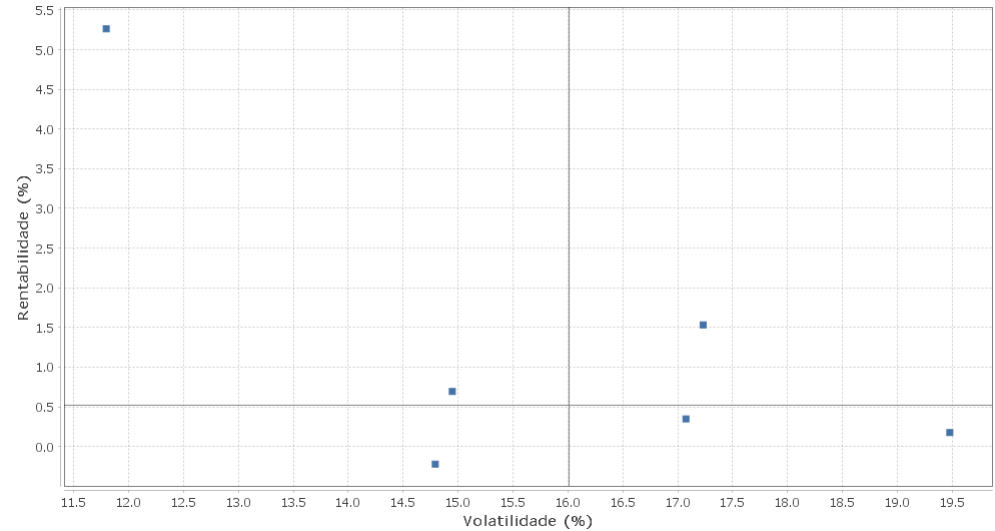
Renda Fixa - No Mês



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\$): 20.738.657,52

Value-At-Risk: 2,92%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,26	0,00	1,02	0,20	199.386,42	0,03
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,10	0,00	2,32	0,27	9.135.758,37	1,29
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,21	0,15	0,00	0,58	0,28	79.212,44	0,01
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,21	0,17	0,00	0,70	0,31	61.764,62	0,01
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,21	0,24	0,00	1,12	0,40	15.413,26	0,00
IT NOW S&P 500 TRN FUNDO DE ÍNDICE	Artigo 8º I, Alínea b	0,80	0,09	0,00	0,09	0,24	6.122.219,24	0,86
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,17	1,25	0,09	0,99	1,32	67.444.648,75	9,51
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,36	1,11	0,01	0,77	1,21	14.272.234,05	2,01
BRADERCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	Artigo 8º III	1,42	0,92	0,00	0,88	1,41	3.534.303,78	0,50
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,55	1,06	0,11	1,07	1,82	116.219.374,41	16,39
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,57	1,05	0,01	1,05	1,81	13.609.266,88	1,92
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,59	1,11	0,00	0,91	1,61	2.929.014,50	0,41
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,14	1,33	0,08	1,03	2,38	57.262.651,93	8,08
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,22	1,38	0,02	0,81	1,96	14.559.300,59	2,05
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,14	1,87	0,00	0,98	3,24	2.577.795,31	0,36
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	4,26	2,56	0,04	1,09	4,83	14.804.557,77	2,09
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,26	2,56	0,06	1,09	4,83	21.144.279,23	2,98
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	4,27	2,59	0,01	1,09	4,81	3.090.047,79	0,44
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,28	2,57	0,30	1,09	4,84	115.060.354,77	16,23
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	4,54	2,69	0,02	1,07	5,01	6.154.691,77	0,87
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	9,14	8,26	0,10	0,33	3,19	13.158.820,12	1,86
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	11,69	12,04	0,17	0,76	9,08	10.849.120,15	1,53
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	11,80	10,10	0,01	0,43	5,26	2.128.245,69	0,30
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	11,88	10,00	0,19	0,64	7,81	14.694.139,86	2,07
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,22	9,46	0,02	0,63	7,88	1.529.998,98	0,22
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	12,26	10,40	0,15	0,61	7,65	11.133.171,35	1,57
INDIE FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,87	10,03	0,03	0,53	6,93	2.290.771,52	0,32
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	12,98	10,58	0,27	0,64	8,50	19.815.586,64	2,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	13,06	10,31	0,06	0,57	7,61	4.708.990,14	0,66
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	Artigo 8º II, Alínea a	13,19	10,07	0,11	0,59	7,95	8.554.112,03	1,21
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	13,19	10,14	0,01	0,59	7,96	836.558,58	0,12
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	13,59	9,81	0,15	0,68	9,37	12.019.247,74	1,70
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	13,68	10,83	0,42	0,61	8,55	29.695.965,29	4,19
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	13,71	9,31	0,01	0,45	6,28	1.197.372,64	0,17
XP INVESTOR 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	13,79	10,79	0,26	0,48	6,83	19.205.828,23	2,71
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	14,79	11,31	0,03	-0,03	-0,22	5.936.309,56	0,84
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	14,95	12,70	0,03	0,04	0,69	6.596.358,90	0,93
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,79	10,09	0,03	0,67	10,72	2.369.442,87	0,33
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	16,78	11,09	0,02	0,59	10,11	1.256.694,78	0,18
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	17,07	11,15	0,01	0,01	0,35	1.881.485,91	0,27
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	17,23	12,05	0,04	0,08	1,53	9.701.466,40	1,37
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	19,48	12,29	0,03	0,00	0,18	23.635.551,78	3,33
IT NOW IBOVSPA FUNDO DE ÍNDICE	Artigo 8º I, Alínea b	30,17	0,67	0,00	0,30	9,32	37.611.586,07	5,30