



LDB
EMPRESAS

MOGI DAS CRUZES
JANEIRO 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 29.01.2021.

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

64,43%

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	0,58	0,03	0,03	61.784,02	0,01	8.572.331.669,58	0,00
BRAM	BRANDESCO	BRANDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	12,85	-0,89	-0,89	14.673.436,59	2,09	735.043.145,99	2,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,90	-0,87	-0,87	114.056.470,88	16,24	6.185.705.380,20	1,84
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,66	0,05	0,05	15.421,33	0,00	137.560.871,39	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,56	0,03	0,03	79.232,42	0,01	10.435.150.283,00	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,06	0,08	0,08	116.316.126,89	16,56	13.518.203.391,91	0,86
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	12,89	-0,88	-0,88	20.958.084,81	2,98	1.222.496.391,55	1,71
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,14	-0,77	-0,77	14.447.031,59	2,06	2.465.176.454,79	0,59
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,34	-0,66	-0,66	2.560.764,47	0,36	1.071.755.183,33	0,24
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	5,04	0,10	0,10	13.622.393,33	1,94	5.043.806.710,80	0,27
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,40	0,29	0,29	14.313.368,31	2,04	471.644.372,24	3,03
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,33	-0,55	-0,55	56.946.358,65	8,11	9.495.985.226,13	0,60
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	0,03	0,03	67.461.706,24	9,60	14.822.912.413,17	0,46
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,22	0,15	0,15	2.933.384,58	0,42	589.364.098,33	0,50
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			7,53	-0,36	-0,36	438.445.564,11	62,42		

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	0,18	0,18	4.818.833,71	0,69	1.719.845.014,52	0,28
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	14,18	-1,06	-1,06	6.089.632,38	0,87	259.753.585,98	2,34
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	12,85	-0,86	-0,86	3.063.508,48	0,44	1.371.288.426,53	0,22
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,67	0,13	0,13	199.653,47	0,03	3.621.561.522,63	0,01
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			3,50	-0,45	-0,45	14.171.628,04	2,02		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

7,20

-0,37

-0,37

452.617.192,15

64,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

27,74%

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	71,75	-3,32	-3,32	36.361.331,08	5,18	5.300.670.727,38	0,69
ITAU	ITAU	IT NOW S&P 500 TRN FUNDO DE ÍNDICE	8,36	4,61	4,61	6.404.508,51	0,91	1.569.152.950,49	0,41
Sub-total Artigo 8º I, Alínea b			71,12	-2,21	-2,21	42.765.839,59	6,09		

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	43,97	-3,06	-3,06	4.565.079,62	0,65	502.570.935,25	0,91
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	40,50	-3,92	-3,92	803.791,90	0,11	1.645.559.797,71	0,05
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	41,44	-3,95	-3,95	1.150.104,44	0,16	1.157.776.793,23	0,10
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	48,30	-2,32	-2,32	19.355.064,74	2,76	615.805.712,09	3,14
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	42,16	-3,25	-3,25	28.731.947,24	4,09	313.134.957,52	9,18
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	42,37	-3,14	-3,14	10.508.413,42	1,50	744.259.231,51	1,41
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	39,07	-3,33	-3,33	1.479.070,18	0,21	553.098.805,56	0,27
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	42,42	-3,13	-3,13	1.217.399,21	0,17	1.073.001.033,93	0,11
XP	INTRAG	XP INVESTOR 30 FIC FIA	49,00	-4,41	-4,41	18.358.780,31	2,61	554.517.737,17	3,31
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	42,54	-5,59	-5,59	2.237.076,98	0,32	1.137.598.937,97	0,20
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	40,22	-3,76	-3,76	11.567.007,21	1,65	968.458.637,18	1,19
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	45,52	-2,57	-2,57	10.846.654,24	1,54	1.019.809.762,10	1,06
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	40,46	-3,90	-3,90	8.220.858,07	1,17	252.810.248,65	3,25
INDIE CAPITAL	INTRAG	INDIE FIC FIA	49,52	-0,12	-0,12	2.288.049,94	0,33	1.200.110.828,77	0,19
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	38,81	-4,09	-4,09	14.093.203,18	2,01	226.416.499,77	6,22
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			43,76	-3,38	-3,38	135.422.500,68	19,28		

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	33,64	-0,16	-0,16	13.137.873,68	1,87	1.233.747.922,53	1,06
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	4,80	-0,07	-0,07	3.532.003,76	0,50	292.097.101,63	1,21
Sub-total Artigo 8º III			25,87	-0,14	-0,14	16.669.877,44	2,37		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			39,27	-2,85	-2,85	194.858.217,71	27,74		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 7,83%

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	29,91	3,98	3,98	11.002.790,12	1,57	189.714.982,18	5,80
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	31,56	-0,19	-0,19	2.731.316,04	0,39	415.152.499,67	0,66
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	30,10	4,30	4,30	26.194.925,38	3,73	1.477.834.874,26	1,77
Sub-total Artigo 9º A, II			27,78	3,92	3,92	39.929.031,54	5,68		

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	30,33	5,79	5,79	6.978.093,57	0,99	2.159.778.426,35	0,32
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	33,77	3,75	3,75	1.952.048,29	0,28	2.019.764.027,29	0,10
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	30,49	2,89	2,89	6.108.006,56	0,87	2.553.021.534,73	0,24
Sub-total Artigo 9º A, III			33,65	4,33	4,33	15.038.148,42	2,14		
Investimentos no Exterior			28,97	4,04	4,04	54.967.179,96	7,83		
Total			11,35	-0,75	-0,75	702.442.589,82	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	438.445.564,11	62,42				100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	14.171.628,04	2,02				40,00
	Total Renda Fixa	452.617.192,15	64,43				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea b	Fundos de Índices Referenciados	42.765.839,59	6,09				30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	135.422.500,68	19,28				20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	16.669.877,44	2,37				10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	194.858.217,71	27,74				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	39.929.031,54	5,68				10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	15.038.148,42	2,14				10,00
	Total Investimentos no Exterior	54.967.179,96	7,83				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

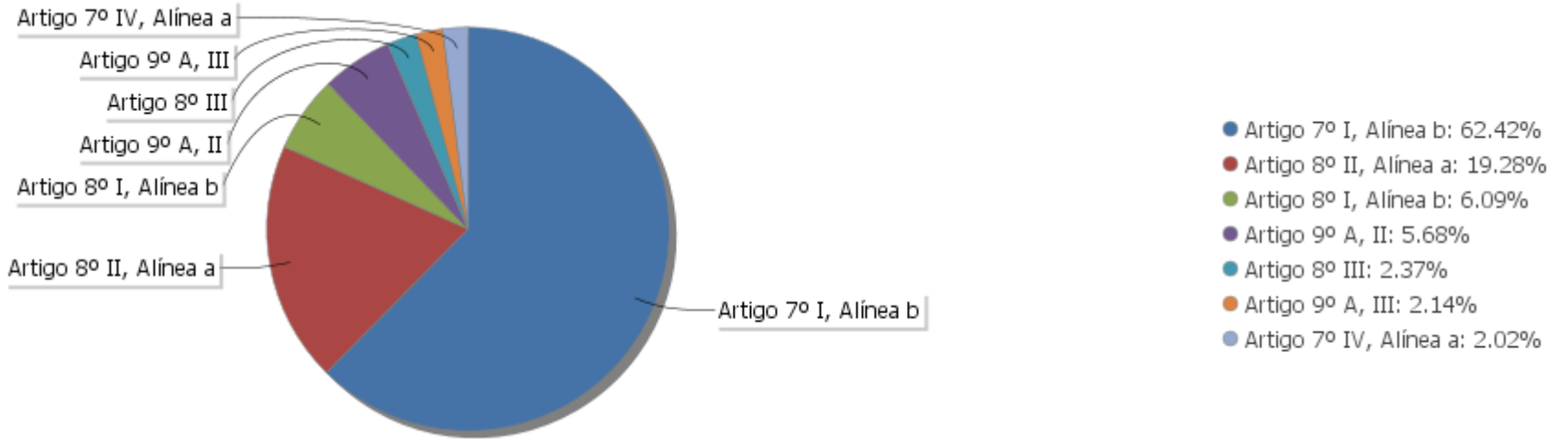
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,36 -242,36	-0,36 -242,36	3,80 818,58	2,37 252,16	6,12 242,16	-1.594.304,40	-1.594.304,40
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,45 -302,30	-0,45 -302,30	3,49 752,97	2,37 251,39	4,52 178,91	-81.256,31	-81.256,31
Artigo 8º I, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-2,21 1,11	-2,21 1,11	20,11 -2,37	10,22 -1,59	-0,28 -1,43	-967.965,72	-967.965,72
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,38 -0,06	-3,38 -0,06	18,05 -4,42	7,27 -4,54	-6,94 -8,09	-4.734.500,12	-4.734.500,12
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,14 3,18	-0,14 3,18	11,32 -11,15	10,50 -1,31	10,32 9,17	-23.246,46	-23.246,46
Artigo 9º A, II % do CDI	3,92 2.625,17	3,92 2.625,17	8,67 1.867,54	26,54 2.820,20	81,71 3.235,68	1.442.767,67	1.442.767,67
Artigo 9º A, III % do CDI	4,33 2.895,86	4,33 2.895,86	5,76 1.241,95	17,87 1.899,03	38,94 1.541,86	623.994,05	623.994,05
MOGI DAS CRUZES (Total)						-5.334.511,29	-5.334.511,29

Análise de Liquidez

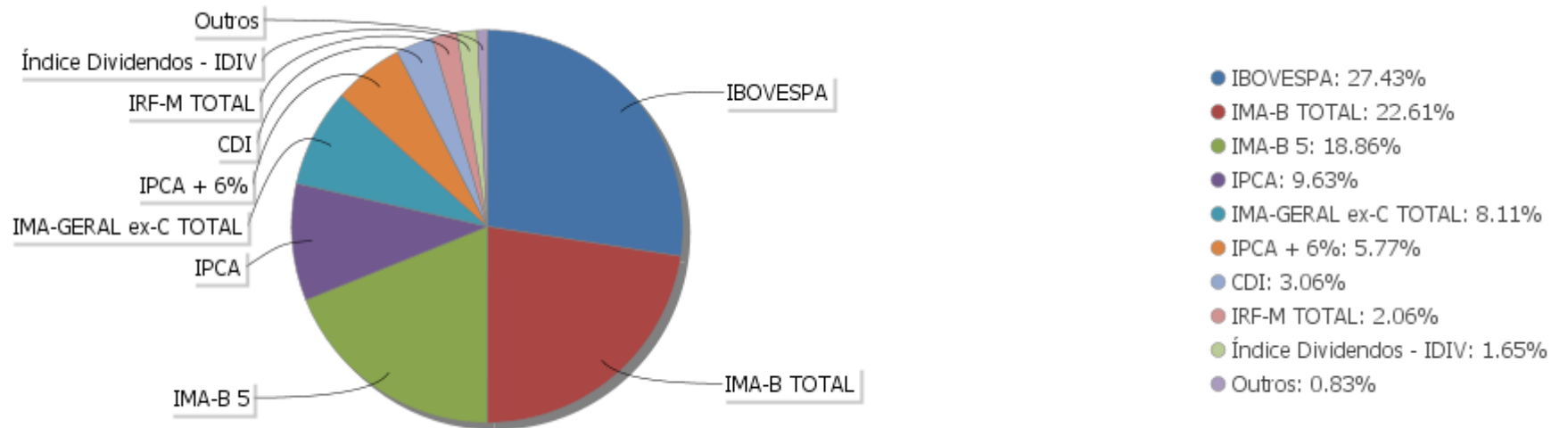
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	619.689.926,58	88,22	619.689.926,58	88,22
de 31 a 365 dias	65.505.910,35	9,33	685.195.836,93	97,54
acima de 365 dias	17.246.752,89	2,46	702.442.589,82	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

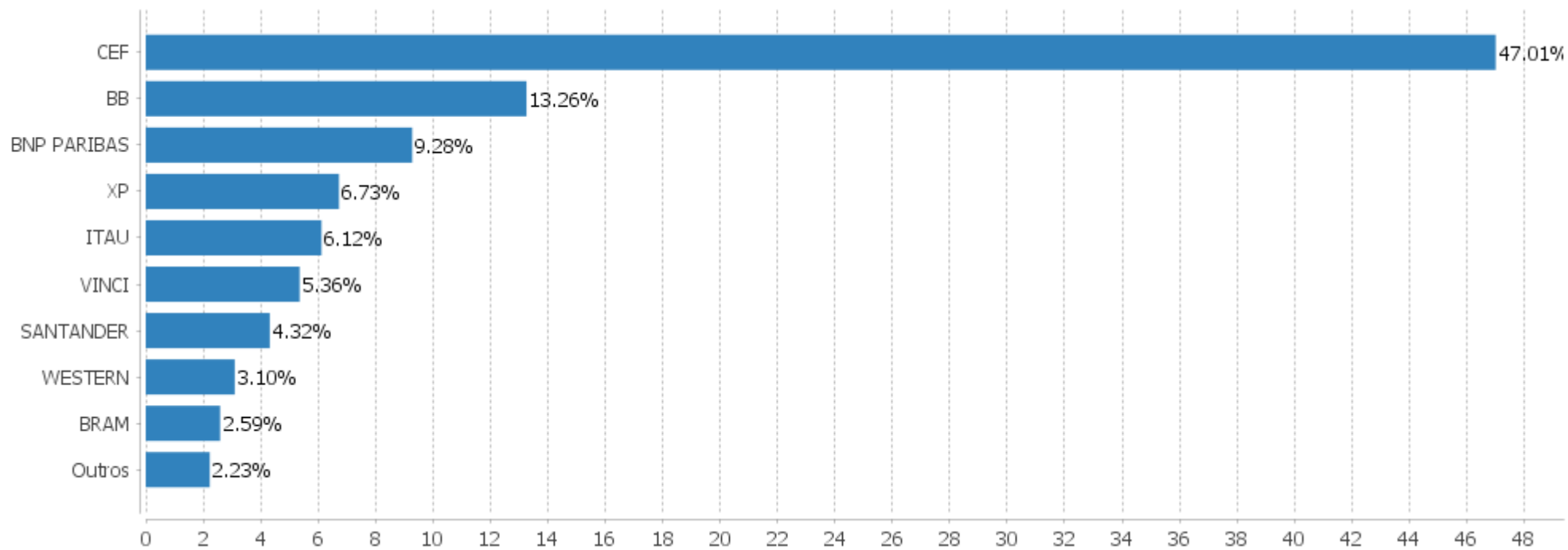


Alocação Por Estratégia



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	-0,75												-0,75
IPCA + 6%	0,71												0,71
p.p. indexador	-1,47												-1,47
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

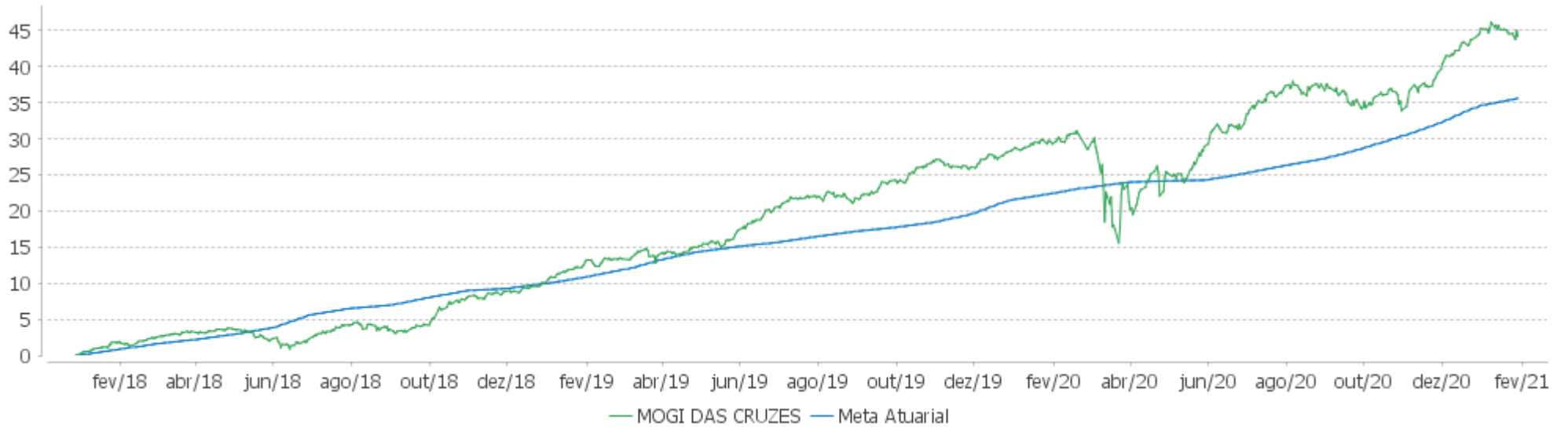
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

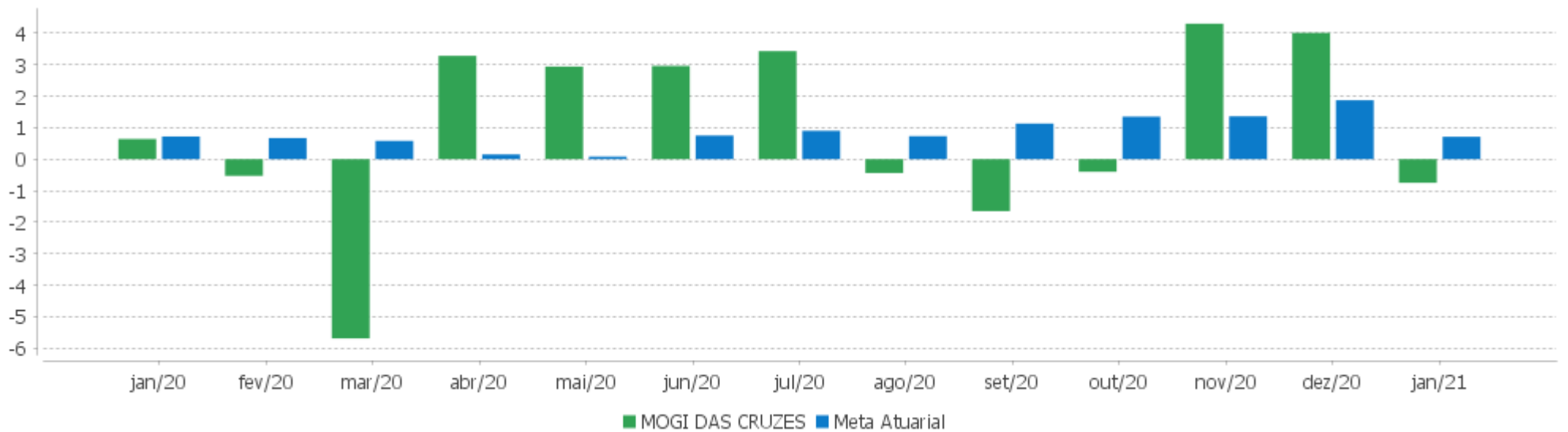
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	20	54,05	03 meses	7,67	3,96	3,71	5,10
Meses abaixo da Meta Atuarial	17	45,95	06 meses	5,00	7,30	-2,30	5,83
			12 meses	11,52	10,62	0,90	11,35
			24 meses	27,64	22,19	5,45	8,32
			36 meses	41,64	34,35	7,29	7,04
Maior rentabilidade da Carteira	4,30	2020-11	Desde 29/12/2017	44,16	35,43	8,73	6,95
Menor rentabilidade da Carteira	-5,69	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,87 -0,02	-0,87 -0,02	5,99 -0,05	2,66 -0,12	4,88 -0,35	23,46 -0,82	40,68 -1,14
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	-0,66 -0,77	-0,66 -0,77	4,04 0,76	2,59 -1,21	8,48 0,92	24,20 3,67	39,61 6,92
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,08 -0,02	0,08 -0,02	3,22 -0,07	3,64 -0,16	7,25 -0,30	19,86 -0,66	31,74 -0,94
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,03 -0,01	0,03 -0,01	0,54 -0,04	0,79 -0,23	3,07 -0,36	9,59 -0,68	16,98 -0,96
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,10 -0,01	0,10 -0,01	3,24 -0,04	3,66 -0,15	7,29 -0,27	19,97 -0,56	31,81 -0,87
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p.	0,15 -0,59	0,15 -0,59	3,08 -1,11	3,70 -4,27	6,62 -5,16	18,65 -4,97	40,83 5,18
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,77 0,03	-0,77 0,03	1,51 0,01	-0,25 -0,10	4,73 -0,18	16,38 -0,57	28,81 -0,80
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,89 -0,03	-0,89 -0,03	5,95 -0,09	2,61 -0,16	4,86 -0,36	23,44 -0,84	40,37 -1,46
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6% p.p.	0,29 -0,43	0,29 -0,43	2,69 -1,29	4,18 -3,18	7,48 -3,28	20,30 -2,05	42,62 8,09
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,55 -0,11	-0,55 -0,11	2,68 0,29	0,93 -0,03	4,00 0,14	15,84 0,48	27,67 0,72
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,05 0,01	0,05 0,01	0,67 0,09	0,79 -0,23	3,07 -0,36	9,63 -0,64	17,12 -0,83
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,03 -0,22	0,03 -0,22	2,18 -0,33	0,99 -3,31	5,82 1,27	20,75 11,80	32,60 19,54
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,03 -0,02	0,03 -0,02	0,53 -0,05	0,90 -0,12	3,22 -0,21	9,83 -0,44	17,30 -0,65
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,88 -0,03	-0,88 -0,03	5,96 -0,08	2,62 -0,16	4,67 -0,56	23,27 -1,01	40,32 -1,50
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,86 -0,01	-0,86 -0,01	5,93 -0,11	2,59 -0,19	4,73 -0,50	23,34 -0,95	40,50 -1,32
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,06 -0,21	-1,06 -0,21	5,95 -0,08	2,24 -0,54	4,49 -0,74	23,84 -0,45	41,00 -0,83
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,18	0,18	0,62	1,10	1,90	7,64	14,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	123,05	123,05	133,81	117,02	75,36	90,36	93,90
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,13 -0,12	0,13 -0,12	0,44 -2,07	0,16 -4,14	2,65 -1,91	12,60 3,66	22,91 9,86
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	-3,14 0,18	-3,14 0,18	19,35 -3,13	8,34 -3,47	-2,73 -3,88	31,72 13,58	63,12 27,61
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,90 -0,58	-3,90 -0,58	17,77 -4,71	4,34 -7,47	-13,47 -14,62		
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-3,76 1,32	-3,76 1,32	20,27 1,97	10,03 1,95	-2,32 2,19	25,54 4,27	47,60 3,65
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-3,06 0,26	-3,06 0,26	17,53 -4,95	8,32 -3,49	-8,34 -9,49	11,24 -6,91	29,43 -6,08
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,92 -0,60	-3,92 -0,60	17,82 -4,65	4,29 -7,52	-13,53 -14,68	10,48 -7,67	38,67 3,16
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,09 -0,77	-4,09 -0,77	13,64 -8,84	3,06 -8,75	-7,68 -8,83	22,65 4,50	47,39 11,87
XP INVESTOR 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,41 -1,09	-4,41 -1,09	12,13 -10,35	1,45 -10,36	-12,25 -13,40	22,95 4,80	50,02 14,50
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,59 -2,27	-5,59 -2,27	22,28 -0,20	14,80 2,99	1,52 0,37	22,76 4,61	50,70 15,19
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-3,95 -0,63	-3,95 -0,63	15,85 -6,62	1,98 -9,83	-11,45 -12,60	21,54 3,40	56,61 21,10
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-3,25 0,07	-3,25 0,07	20,20 -2,28	9,42 -2,39	0,04 -1,11	22,84 4,69	41,56 6,05
VINCI SELECTION EQUITIES FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,33 -0,01	-3,33 -0,01	15,71 -6,76	6,41 -5,41	5,21 4,06	28,34 10,19	56,01 20,49
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,12 3,20	-0,12 3,20	18,68 -3,79	12,59 0,78	5,10 3,95	52,87 34,72	
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-2,32 0,99	-2,32 0,99	22,30 -0,18	11,79 -0,02	-6,79 -7,94	36,41 18,26	46,74 11,23
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,13 0,19	-3,13 0,19	19,34 -3,13	9,66 -2,15	3,51 2,36	29,87 11,72	54,38 18,87
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	-2,57 0,75	-2,57 0,75	18,02 -4,46	5,76 -6,05	-4,46 -5,61		
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	-0,16 -106,48	-0,16 -106,48	14,05 3.026,34	13,28 1.410,89	11,59 458,78	37,59 444,52	37,18 241,86
BRADERCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	-0,07	-0,07	2,23	1,28	5,85	13,27	20,05

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-43,53	-43,53	480,20	135,66	231,47	156,90	130,41
IT NOW S&P 500 TRN FUNDO DE ÍNDICE Var. IBOVESPA p.p.	4,61 7,93	4,61 7,93	8,40 -14,07				
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE Var. IBOVESPA p.p.	-3,32 -0,01	-3,32 -0,01	22,48 0,01	11,81 0,00	1,15 0,00	50,77 32,62	
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IBOVESPA p.p.	3,98 7,30	3,98 7,30	8,52 -13,96	21,02 9,21	68,09 66,94	139,87 121,73	
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-0,19 -5,01	-0,19 -5,01	14,10 3,40	17,21 -5,38	39,36 -8,25		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6% p.p.	4,30 3,59	4,30 3,59	8,24 4,25	27,17 19,81	83,37 72,62		
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	5,79 9,11	5,79 9,11	9,11 -13,36	20,97 9,15	53,70 52,55	118,69 100,54	138,83 103,32
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	3,75 7,07	3,75 7,07	6,65 -15,82	18,86 7,05	40,11 38,96	102,40 84,25	
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	2,89 6,21	2,89 6,21	5,70 -16,78	18,48 6,67	59,07 57,92	128,83 110,68	150,87 115,36
MOGI DAS CRUZES Var. IPCA + 6% p.p.	-0,75 -1,47	-0,75 -1,47	7,67 3,69	5,00 -2,36	11,52 0,76	27,64 5,29	41,64 7,11
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,37
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
INPC + 6%	0,73	0,73	4,18	7,97	11,79	23,62	35,65
IPCA + 6%	0,71	0,71	3,99	7,36	10,76	22,35	34,53

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	0,04	0,04	0,58	1,02	3,43	10,27	17,95
IRF-M 1+	-1,39	-1,39	2,09	-0,60	5,77	20,12	35,07
IRF-M TOTAL	-0,80	-0,80	1,50	-0,15	4,92	16,95	29,61
IMA-B 5	0,11	0,11	3,28	3,80	7,55	20,52	32,68
IMA-B 5+	-1,69	-1,69	8,43	2,01	3,68	26,83	48,69
IMA-B TOTAL	-0,85	-0,85	6,04	2,78	5,22	24,29	41,83
IMA-C TOTAL	6,46	6,46	7,31	15,99	26,73	52,15	76,01
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,44	-0,44	2,38	0,96	3,87	15,36	26,95
IMA-GERAL TOTAL	-0,24	-0,24	2,52	1,39	4,50	16,33	28,20
IDKA 2	0,15	0,15	3,16	4,28	8,20	20,12	32,49
IDKA 20	-2,81	-2,81	11,88	1,09	0,71	29,02	58,93
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,37
Renda Variável							
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
IBRX 100	-3,03	-3,03	22,21	12,06	1,64	20,92	39,53
IBRX 50	-2,78	-2,78	23,61	13,27	2,67	17,81	33,39
SMALL CAP	-3,43	-3,43	21,10	10,52	-4,50	38,71	57,28
IFIX	0,32	0,32	4,07	5,35	-6,43	19,49	26,00
Índice Consumo - ICON			12,91	3,78	-3,99	37,57	37,84
Índice Dividendos - IDIV	-5,08	-5,08	18,30	8,08	-4,52	21,27	43,95
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,25	0,25	2,51	4,30	4,56	8,94	13,06
INPC	0,27	0,27	2,70	4,89	5,53	10,07	14,00
IGPM	2,58	2,58	6,95	18,36	25,71	35,53	44,66
SELIC	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,38
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

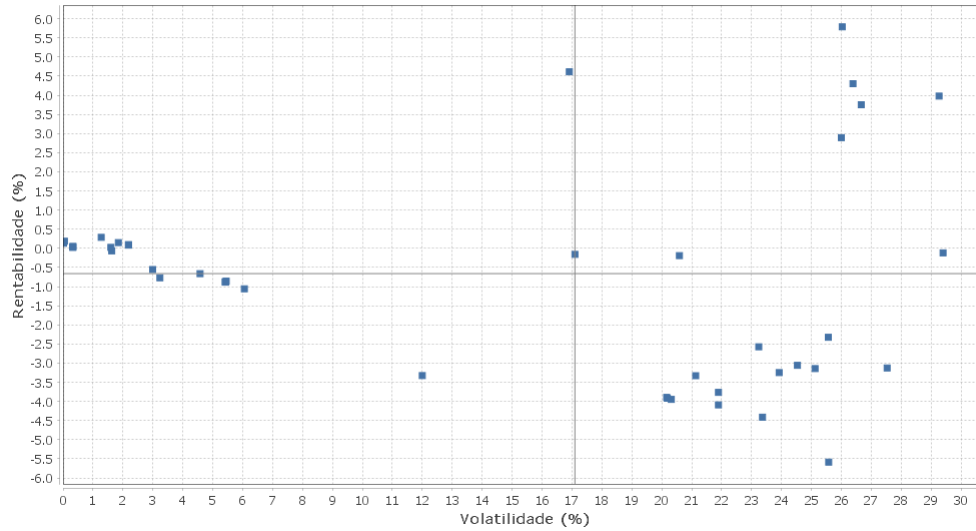
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
217	04/01/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	24.000,00	128,40577100	186,9074877000
215	05/01/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	785.000,00	0,00	4.199,47260800	186,9282344000
221	05/01/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	3.040.000,00	16.262,92576900	186,9282344000
220	08/01/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	785.000,00	4.198,63447700	186,9655490000
212	12/01/2021	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	906.000,00	0,00	978,31443530	926,0826246000
213	12/01/2021	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	604.000,00	0,00	4.276,18020818	141,2475552000
214	12/01/2021	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.511.000,00	0,00	7.508,19190072	201,2468541000
218	18/01/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	4.000,00	21,38224000	187,0711474000
222	18/01/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	1.109.395,80	5.930,34156000	187,0711474000
223	18/01/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	962.604,20	5.145,65830400	187,0711474000
219	22/01/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	71.000,00	379,37038500	187,1521946000
216	29/01/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	884.000,00	0,00	4.721,33436500	187,2352034000
Total						

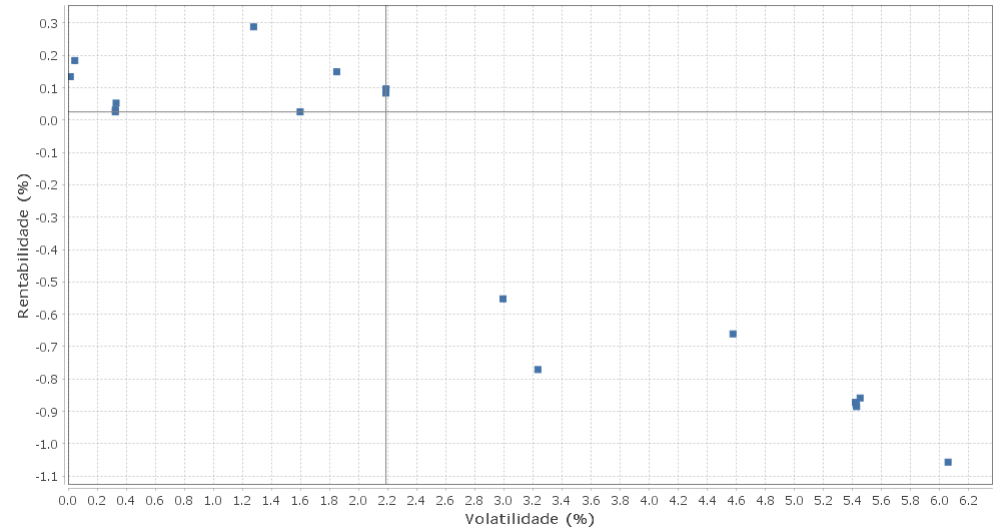
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

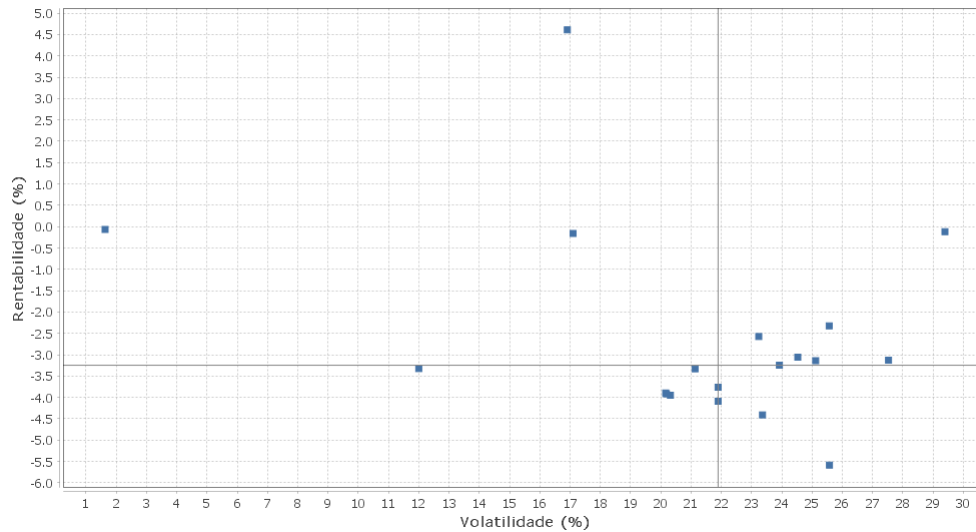
MOGI DAS CRUZES - No Mês



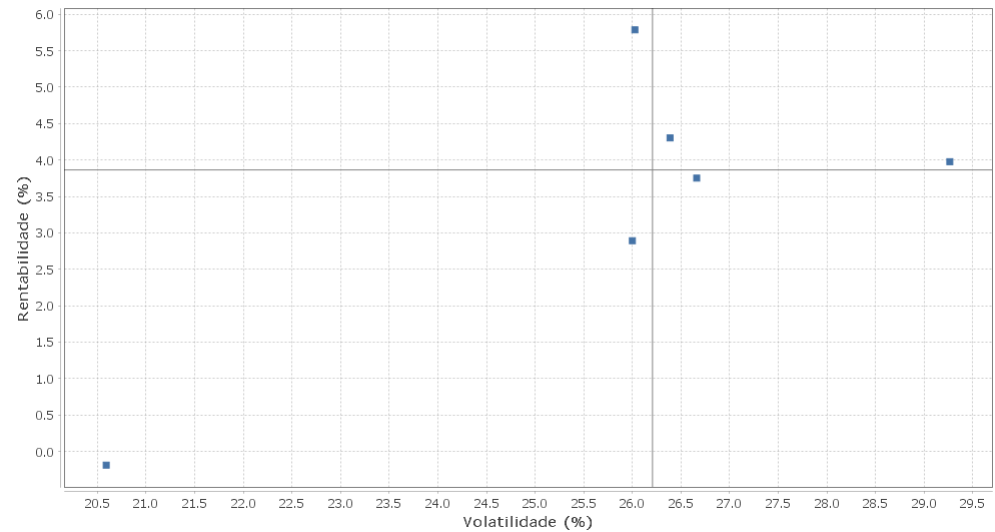
Renda Fixa - No Mês



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\$): 20.263.718,48

Value-At-Risk: 2,88%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,23	0,00	-1,01	0,13	199.653,47	0,03
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,10	0,00	0,74	0,18	4.818.833,71	0,69
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,19	0,00	-0,36	0,03	61.784,02	0,01
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,15	0,00	-0,38	0,03	79.232,42	0,01
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,24	0,00	-0,29	0,05	15.421,33	0,00
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,28	1,09	0,01	0,11	0,29	14.313.368,31	2,04
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,60	1,03	0,07	-0,08	0,03	67.461.706,24	9,60
BRADERCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	Artigo 8º III	1,63	0,87	0,00	-0,13	-0,07	3.532.003,76	0,50
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,85	1,09	0,00	-0,00	0,15	2.933.384,58	0,42
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	1,23	0,13	-0,03	0,08	116.316.126,89	16,56
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	1,22	0,01	-0,02	0,10	13.622.393,33	1,94
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,99	1,33	0,07	-0,23	-0,55	56.946.358,65	8,11
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,23	1,49	0,02	-0,28	-0,77	14.447.031,59	2,06
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,58	2,16	0,00	-0,18	-0,66	2.560.764,47	0,36
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,42	2,57	0,27	-0,19	-0,87	114.056.470,88	16,24
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,43	2,57	0,05	-0,19	-0,88	20.958.084,81	2,98
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	5,43	2,57	0,03	-0,19	-0,89	14.673.436,59	2,09
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	5,45	2,60	0,01	-0,18	-0,86	3.063.508,48	0,44
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	6,06	2,79	0,02	-0,20	-1,06	6.089.632,38	0,87
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	Artigo 8º I, Alínea b	12,00	0,67	0,00	-0,29	-3,32	36.361.331,08	5,18
IT NOW S&P 500 TRN FUNDO DE ÍNDICE	Artigo 8º I, Alínea b	16,91	0,29	-0,00	0,26	4,61	6.404.508,51	0,91
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	17,10	8,38	0,11	-0,02	-0,16	13.137.873,68	1,87
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,16	9,77	0,10	-0,20	-3,90	8.220.858,07	1,17
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,18	9,82	0,01	-0,20	-3,92	803.791,90	0,11
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	20,32	9,25	0,01	-0,20	-3,95	1.150.104,44	0,16
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	20,59	9,92	0,02	-0,02	-0,19	2.731.316,04	0,39
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,13	9,23	0,02	-0,16	-3,33	1.479.070,18	0,21
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,89	10,13	0,18	-0,19	-4,09	14.093.203,18	2,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,89	9,87	0,14	-0,18	-3,76	11.567.007,21	1,65
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	23,24	9,87	0,14	-0,12	-2,57	10.846.654,24	1,54
XP INVESTOR 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,36	10,33	0,24	-0,20	-4,41	18.358.780,31	2,61
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	23,92	11,48	0,43	-0,14	-3,25	28.731.947,24	4,09
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	24,53	11,42	0,07	-0,13	-3,06	4.565.079,62	0,65
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	25,12	9,96	0,14	-0,13	-3,14	10.508.413,42	1,50
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	25,56	11,42	0,28	-0,10	-2,32	19.355.064,74	2,76
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	25,58	11,21	0,03	-0,22	-5,59	2.237.076,98	0,32
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	26,00	11,33	0,04	0,11	2,89	6.108.006,56	0,87
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	26,03	11,89	0,04	0,22	5,79	6.978.093,57	0,99
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	26,39	13,23	0,06	0,16	4,30	26.194.925,38	3,73
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	26,66	11,45	0,01	0,14	3,75	1.952.048,29	0,28
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	27,53	11,12	0,02	-0,12	-3,13	1.217.399,21	0,17
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	29,26	11,49	0,06	0,13	3,98	11.002.790,12	1,57
INDIE FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	29,39	11,64	0,03	-0,01	-0,12	2.288.049,94	0,33