



LDB
EMPRESAS

MOGI DAS CRUZES
FEVEREIRO 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 26.02.2021.

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

63,26%

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	0,00	0,04	61.725,63	0,01	8.878.863.822,11	0,00
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	12,85	-1,54	-2,41	14.447.376,55	2,05	734.858.890,34	1,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,90	-1,54	-2,40	112.299.378,20	15,94	6.061.546.612,54	1,85
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,67	-0,02	0,03	15.417,65	0,00	142.516.628,98	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,56	0,02	0,04	79.246,73	0,01	9.935.744.303,82	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,09	-0,62	-0,54	66.041.387,36	9,38	13.590.487.322,92	0,49
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	12,89	-1,53	-2,40	20.637.053,20	2,93	1.190.218.692,49	1,73
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,16	-1,15	-1,92	5.399.304,84	0,77	2.086.612.425,47	0,26
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,37	-1,51	-2,16	51.637.468,35	7,33	1.154.939.152,90	4,47
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	5,06	-0,61	-0,52	13.538.678,66	1,92	5.161.165.829,74	0,26
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,40	-0,01	0,28	13.945.314,43	1,98	459.517.263,27	3,03
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,34	-0,91	-1,46	56.425.905,26	8,01	9.434.126.715,63	0,60
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,98	-0,51	-0,48	67.119.309,41	9,53	15.107.095.289,30	0,44
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,25	-0,45	-0,30	2.844.272,89	0,40	571.461.055,56	0,50
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			7,55	-1,07	-1,43	424.491.839,16	60,26		

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	0,11	0,29	11.151.378,41	1,58	1.692.516.634,26	0,66
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	14,18	-1,74	-2,78	5.983.408,66	0,85	248.127.381,74	2,41
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	12,85	-1,56	-2,40	3.015.848,19	0,43	1.338.328.556,40	0,23
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	16,98	0,00	0,00	781.000,00	0,11	505.633.773,09	0,15
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	1,67	0,06	0,19	199.772,87	0,03	3.571.923.057,61	0,01
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			3,56	-0,26	-0,71	21.131.408,13	3,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

7,22

-1,02

-1,39

445.623.247,29

63,26

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

26,93%

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 IBOVSPA FUNDO DE ÍNDICE	71,34	-4,38	-7,56	34.769.170,32	4,94	5.234.389.371,08	0,66
ITAU	ITAU	IT NOW S&P 500 TRN FUNDO DE ÍNDICE	10,02	4,74	9,57	6.707.874,43	0,95	1.812.330.564,66	0,37
Sub-total Artigo 8º I, Alínea b			70,63	-3,01	-5,16	41.477.044,75	5,89		

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	43,62	-4,29	-7,21	4.369.406,68	0,62	469.479.928,15	0,93
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	40,15	-3,81	-7,57	773.205,57	0,11	1.494.264.626,94	0,05
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	41,22	-2,57	-6,41	1.120.581,34	0,16	1.108.524.440,80	0,10
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	47,69	-1,23	-3,53	19.116.107,97	2,71	617.818.629,65	3,09
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	41,97	-4,48	-7,58	27.444.157,37	3,90	314.175.888,92	8,74
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	41,83	-4,39	-7,39	10.047.210,06	1,43	713.623.600,84	1,41
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	38,93	-3,90	-7,10	1.421.433,20	0,20	552.083.388,65	0,26
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	41,81	-3,36	-6,38	3.532.343,59	0,50	1.033.064.602,48	0,34
XP	INTRAG	XP INVESTOR 30 FIC FIA	48,52	-0,94	-5,31	18.185.915,05	2,58	537.111.449,79	3,39
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	42,30	-5,03	-10,33	2.124.597,39	0,30	1.081.575.624,12	0,20
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,87	-4,31	-7,91	11.068.142,65	1,57	927.907.033,94	1,19
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	45,10	-2,79	-5,29	10.544.314,00	1,50	988.656.272,19	1,07
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	40,12	-3,82	-7,56	211.692,72	0,03	234.065.927,15	0,09
INDIE CAPITAL	INTRAG	INDIE FIC FIA	49,10	-4,31	-4,43	7.661.671,46	1,09	1.115.140.506,42	0,69
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	38,70	-3,60	-7,54	13.585.499,48	1,93	225.541.259,62	6,02
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			43,36	-3,17	-6,44	131.206.278,53	18,63		

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	32,74	2,67	2,50	13.488.262,62	1,91	1.303.746.939,74	1,03
BRAM	BRADERCO	BRADERCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	4,82	-0,67	-0,74	3.508.314,92	0,50	297.510.452,07	1,18
Sub-total Artigo 8º III			25,17	1,96	1,82	16.996.577,54	2,41		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			38,81	-2,69	-5,46	189.679.900,82	26,93		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

9,81%

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	29,82	3,51	7,62	12.865.459,05	1,83	251.507.662,02	5,12
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	31,12	2,35	2,16	4.273.605,98	0,61	466.466.834,53	0,92
BRPP	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	33,83	-2,55	-2,55	7.625.042,59	1,08	340.927.280,12	2,24
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	30,01	4,42	8,91	28.830.393,61	4,09	1.706.818.937,80	1,69
Sub-total Artigo 9º A, II			27,63	3,62	7,69	53.594.501,23	7,61		

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	29,47	3,55	9,54	7.225.580,19	1,03	2.403.594.907,13	0,30
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	32,94	4,47	8,39	2.039.270,07	0,29	2.288.705.798,61	0,09
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	29,68	2,03	4,99	6.232.257,75	0,88	2.755.511.369,98	0,23
Sub-total Artigo 9º A, III			32,81	3,05	7,51	15.497.108,01	2,20		

Investimentos no Exterior			28,35	3,43	7,60	69.091.609,24	9,81		
Total			11,39	-1,12	-1,87	704.394.757,35	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	424.491.839,16	60,26	0,00	5,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	21.131.408,13	3,00	0,00	1,14	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	445.623.247,29	63,26				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea b	Fundos de Índices Referenciados	41.477.044,75	5,89	0,00	5,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	131.206.278,53	18,63	0,00	18,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	16.996.577,54	2,41	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	189.679.900,82	26,93				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	53.594.501,23	7,61	0,00	4,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	15.497.108,01	2,20	0,00	1,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	69.091.609,24	9,81				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

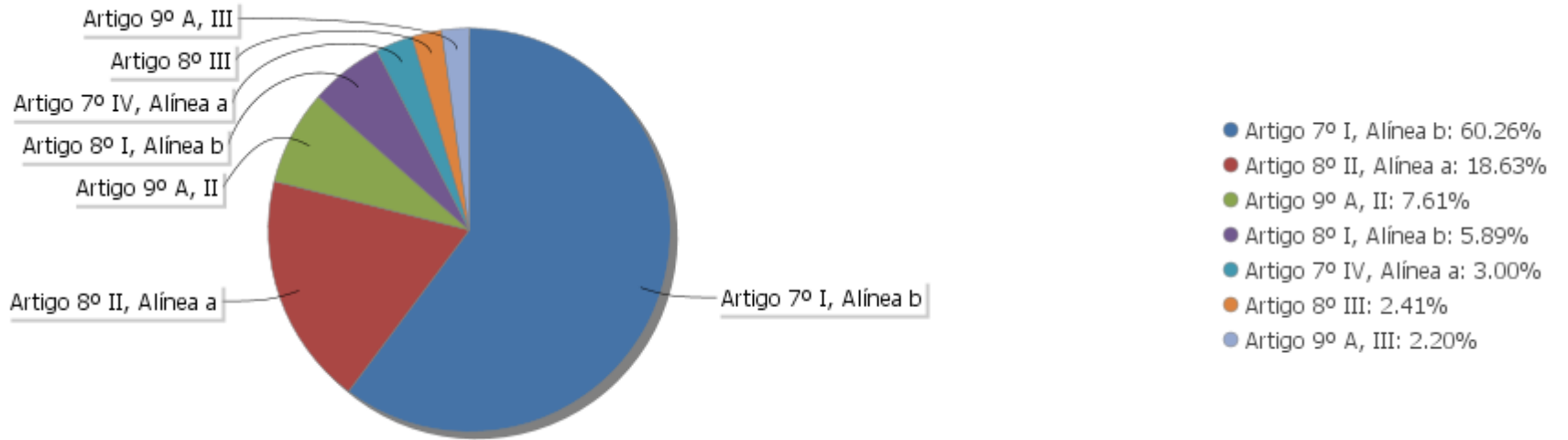
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-1,07 -798,03	-1,43 -503,84	1,34 298,77	1,99 217,51	4,39 185,98	-4.509.187,29	-6.103.491,69
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,26 -192,95	-0,71 -249,91	2,11 469,03	2,54 277,77	3,95 167,06	-140.219,91	-221.476,22
Artigo 8º I, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-3,01 1,36	-5,16 2,39	2,38 1,33	10,72 -0,01	5,59 -0,04	-1.288.794,84	-2.256.760,56
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,17 1,21	-6,44 1,11	1,22 0,18	7,07 -3,67	-3,32 -8,95	-4.216.222,15	-8.950.722,27
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	1,96 6,33	1,82 9,36	4,68 3,63	7,03 -3,71	19,37 13,74	326.700,10	303.453,64
Artigo 9º A, II % do CDI	3,62 2.693,88	7,69 2.705,88	8,59 1.912,87	13,95 1.523,51	90,25 3.819,92	1.332.469,69	2.775.237,36
Artigo 9º A, III % do CDI	3,05 2.268,59	7,51 2.643,39	7,26 1.616,57	4,71 514,85	51,09 2.162,36	458.959,59	1.082.953,64
MOGI DAS CRUZES (Total)						-8.036.294,81	-13.370.806,10

Análise de Liquidez

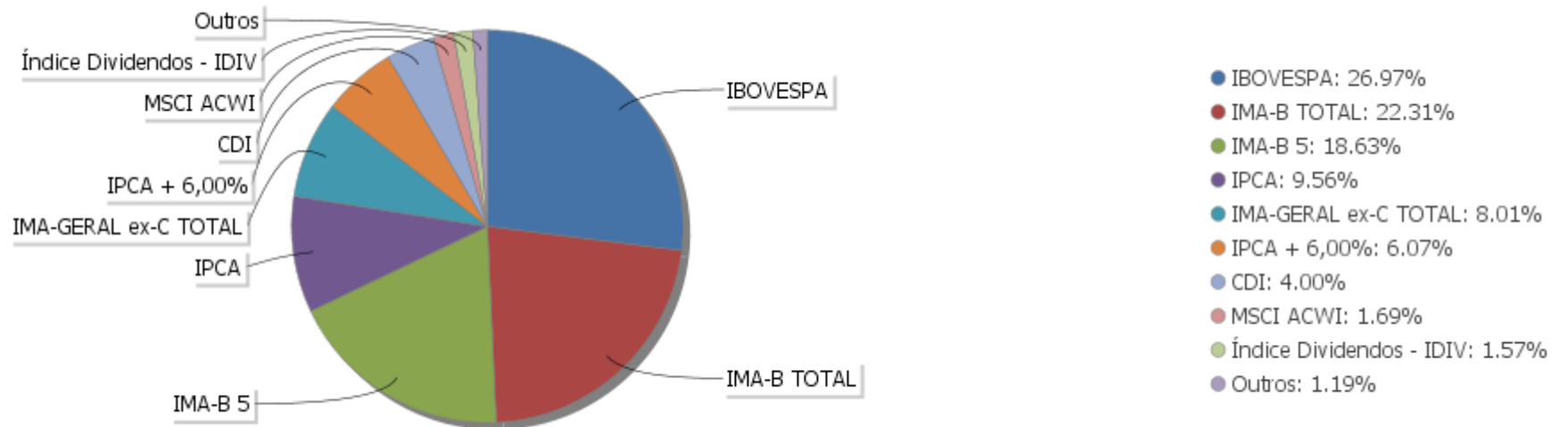
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	626.340.193,50	88,92	626.340.193,50	88,92
de 31 a 365 dias	61.264.976,53	8,70	687.605.170,03	97,62
acima de 365 dias	16.789.587,32	2,38	704.394.757,35	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

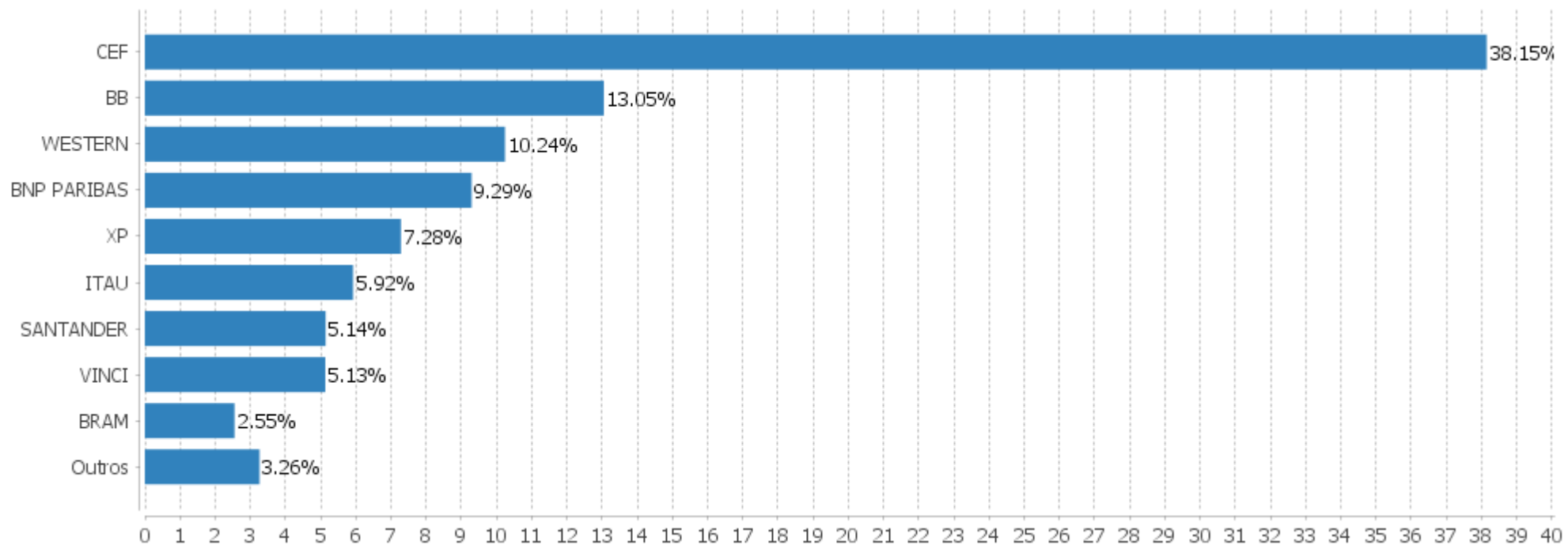


Alocação Por Estratégia



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	-1,12											-1,87
IPCA + 5,39%	0,67	0,85											1,52
p.p. indexador	-1,42	-1,97											-3,39
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 + 6,00%	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 + 6,00%	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

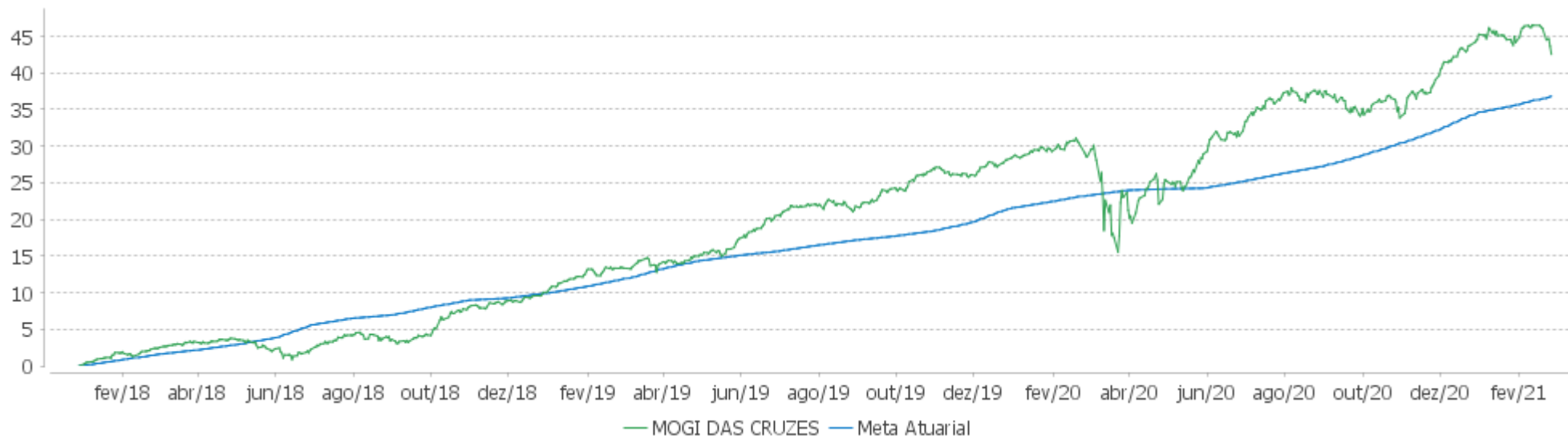
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

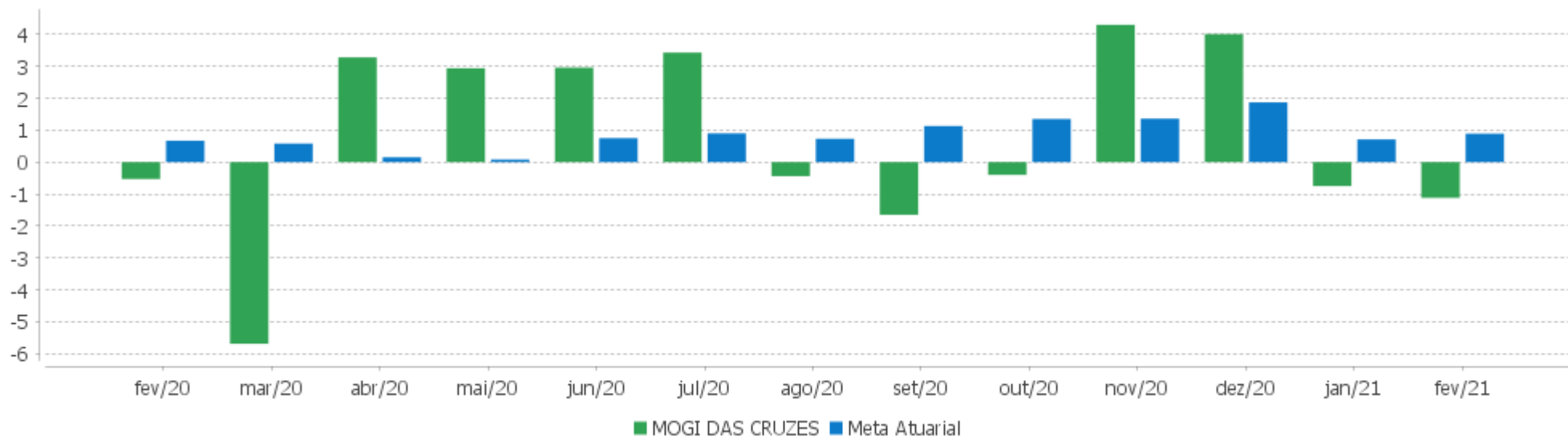
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	20	52,63	03 meses	2,07	3,41	-1,34	5,48
Meses abaixo da Meta Atuarial	18	47,37	06 meses	4,28	7,39	-3,11	5,97
			12 meses	10,85	10,78	0,07	11,39
			24 meses	25,70	22,08	3,63	8,42
			36 meses	39,22	34,43	4,79	7,11
Maior rentabilidade da Carteira	4,30	2020-11	Desde 29/12/2017	42,54	36,51	6,02	6,94
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
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	-1,51 -0,91	-2,16 -1,67	1,01 -0,32	1,35 -1,40	5,76 -0,47	21,87 2,72	36,22 5,04
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,54 -0,02	-2,40 -0,04	2,32 -0,06	2,96 -0,11	2,81 -0,35	20,93 -0,80	37,77 -1,14
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,62 -0,02	-0,54 -0,05	1,27 -0,06	2,60 -0,15	5,92 -0,31	18,50 -0,66	30,23 -0,95
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,00 -0,04	0,04 -0,05	0,35 -0,04	0,70 -0,23	2,71 -0,37	9,12 -0,68	16,38 -0,98
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-0,61 -0,02	-0,52 -0,03	1,28 -0,05	2,64 -0,10	5,94 -0,29	18,61 -0,55	30,33 -0,86
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-1,15 0,03	-1,92 0,06	0,01 0,06	-0,63 -0,05	2,87 -0,14	14,72 -0,51	25,86 -0,83
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6,00% p.p.	-0,45 -1,40	-0,30 -1,99	1,31 -2,39	2,80 -5,27	5,57 -6,62	17,55 -6,00	39,30 3,17
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,54 -0,02	-2,41 -0,06	2,30 -0,09	2,90 -0,17	2,81 -0,36	20,91 -0,82	37,47 -1,44
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,01 -0,90	0,28 -1,33	1,49 -2,01	3,39 -4,14	6,76 -4,24	19,69 -2,65	41,70 6,97
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,91 -0,09	-1,46 -0,20	0,88 0,05	0,90 0,09	2,59 0,03	14,34 0,43	25,55 0,55
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02 -0,06	0,03 -0,05	0,43 0,04	0,67 -0,26	2,68 -0,40	9,11 -0,69	16,47 -0,88
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,51 -0,98	-0,48 -1,20	0,83 -1,25	1,04 -3,50	4,64 -0,15	19,53 10,55	31,08 17,85
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,02 -0,02	0,04 -0,04	0,33 -0,06	0,82 -0,11	2,87 -0,21	9,36 -0,44	16,69 -0,66
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,53 -0,01	-2,40 -0,04	2,31 -0,07	2,93 -0,14	2,62 -0,54	20,75 -0,99	37,44 -1,48
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,46 -0,95	-4,15 -1,79	2,06 -0,33	1,71 -1,36	2,68 -0,49	24,20 2,46	43,72 4,80
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,56 -0,04	-2,40 -0,05	2,29 -0,09	2,83 -0,24	2,69 -0,48	20,79 -0,94	37,57 -1,35
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	-1,74	-2,78	2,09	2,45	2,26	21,16	37,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,23	-0,43	-0,30	-0,62	-0,91	-0,57	-1,18
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,06 -0,41	0,19 -0,53	0,40 -1,68	0,35 -4,19	2,45 -2,34	12,28 3,30	22,09 8,86
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,11 80,12	0,29 102,71	0,57 125,96	0,96 105,07	1,73 73,13	7,20 89,27	14,04 93,65
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	2,67 1.982,45	2,50 880,85	5,77 1.285,28	8,77 958,18	23,85 1.009,69	36,61 453,78	45,63 304,31
BRADESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL % do CDI	-0,67 -498,54	-0,74 -258,72	0,66 147,97	0,81 88,67	4,79 202,70	12,50 154,96	17,90 119,39
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	-4,39 -0,02	-7,39 0,16	1,02 -0,03	8,83 -1,91	-0,22 -5,85	28,90 13,78	53,90 24,98
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,82 0,56	-7,56 -0,02	-0,21 -1,26	5,06 -5,67	-10,50 -16,13		
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-4,31 0,89	-7,91 2,11	0,72 2,69	9,47 1,82	-0,18 3,35	19,66 2,32	40,76 3,47
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-4,29 0,09	-7,21 0,34	-0,15 -1,20	5,59 -5,14	-3,38 -9,01	8,49 -6,63	24,86 -4,06
XP INVESTOR 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,94 3,43	-5,31 2,24	1,16 0,11	0,19 -10,55	-7,65 -13,28	23,54 8,43	45,83 16,92
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,60 0,77	-7,54 0,00	-0,33 -1,38	5,09 -5,64	-5,37 -10,99	20,58 5,46	41,08 12,16
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,81 0,57	-7,57 -0,03	-0,21 -1,26	5,04 -5,69	-10,56 -16,19	8,40 -6,71	34,12 5,20
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,03 -0,65	-10,33 -2,79	-0,72 -1,77	13,05 2,32	5,91 0,28	20,39 5,27	42,48 13,57
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-2,57 1,81	-6,41 1,13	-0,53 -1,58	5,98 -4,76	-8,76 -14,39	20,18 5,06	49,29 20,38
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-4,48 -0,11	-7,58 -0,04	0,32 -0,73	8,18 -2,55	2,64 -2,99	18,37 3,25	36,90 7,98
VINCI SELECTION EQUITIES FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,90 0,48	-7,10 0,45	0,22 -0,83	4,91 -5,83	7,52 1,89	25,70 10,58	48,32 19,41
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,31 0,06	-4,43 3,12	2,20 1,15	7,22 -3,51	7,30 1,68	50,09 34,97	
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,36 1,01	-6,38 1,16	3,08 2,03	8,40 -2,34	10,55 4,92	27,02 11,90	47,27 18,36
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	-1,23	-3,53	4,67	12,60	0,16	37,54	45,77

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.	3,14	4,02	3,63	1,87	-5,47	22,42	16,86
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	-2,79	-5,29	1,95	6,49	1,82		
Var. IBOVESPA p.p.	1,59	2,26	0,90	-4,24	-3,81		
IT NOW S&P 500 TRN FUNDO DE ÍNDICE	4,74	9,57	9,83	11,51			
Var. IBOVESPA p.p.	9,11	17,11	8,78	0,77			
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	-4,38	-7,56	1,06	10,74	5,60	44,17	
Var. IBOVESPA p.p.	-0,01	-0,01	0,01	0,00	-0,03	29,05	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	3,55	9,54	10,30	8,76	68,74	114,04	150,85
Var. IBOVESPA p.p.	7,92	17,09	9,25	-1,97	63,12	98,92	121,93
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	4,47	8,39	8,76	7,04	54,45	100,15	
Var. IBOVESPA p.p.	8,84	15,93	7,71	-3,69	48,82	85,03	
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	2,03	4,99	4,75	3,98	65,57	121,93	163,41
Var. IBOVESPA p.p.	6,41	12,53	3,70	-6,75	59,94	106,81	134,50
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3,51	7,62	9,27	9,96	69,09	133,74	
Var. IBOVESPA p.p.	7,88	15,17	8,22	-0,78	63,46	118,62	
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	2,35	2,16	7,54	11,47	50,51		
Var. MSCI ACWI p.p.	-0,87	-6,05	-2,71	-2,10	-7,03		
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1,64	8,37	8,41				
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,59	0,16	-1,84				
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	4,42	8,91	9,10	15,21	97,35		
Var. IPCA + 6,00% p.p.	3,53	7,30	5,60	7,68	86,35		
MOGI DAS CRUZES	-1,12	-1,87	2,07	4,28	10,85	25,70	39,22
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-2,01	-3,48	-1,44	-3,25	-0,15	3,36	4,49
CDI	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	14,99
IBOVESPA	-4,37	-7,55	1,05	10,73	5,63	15,12	28,92
INPC + 6,00%	0,95	1,69	3,70	8,08	12,19	23,55	36,13
IPCA + 6,00%	0,89	1,61	3,51	7,53	11,00	22,34	34,73

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	0,08	0,39	0,94	3,08	9,80	17,36
IRF-M 1+	-2,01	-3,37	-0,43	-1,48	2,82	17,44	30,64
IRF-M TOTAL	-1,18	-1,97	-0,06	-0,58	3,01	15,23	26,69
IMA-B 5	-0,60	-0,49	1,33	2,75	6,23	19,15	31,19
IMA-B 5+	-2,33	-3,98	3,24	3,38	0,95	23,20	44,42
IMA-B TOTAL	-1,52	-2,36	2,38	3,07	3,16	21,74	38,91
IMA-C TOTAL	3,72	10,42	9,19	17,82	30,63	54,91	81,60
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,83	-1,26	0,83	0,82	2,55	13,91	25,00
IMA-GERAL TOTAL	-0,69	-0,93	1,07	1,29	3,31	14,97	26,40
IDKA 2	-0,48	-0,33	1,40	2,72	6,95	18,92	31,03
IDKA 20	-2,69	-5,42	5,32	4,90	-1,91	24,76	54,08
CDI	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	14,99
Renda Variável							
IBOVESPA	-4,37	-7,55	1,05	10,73	5,63	15,12	28,92
IBRX 100	-3,45	-6,38	2,19	11,97	6,92	18,84	34,16
IBRX 50	-3,80	-6,48	2,33	12,81	8,13	15,27	27,76
SMALL CAP	-1,84	-5,21	1,92	9,84	2,20	38,68	54,97
IFIX	0,25	0,57	2,78	3,75	-2,61	18,56	24,88
Índice Consumo - ICON	-5,29		-1,83	-0,23	1,03	36,15	35,39
Índice Dividendos - IDIV	-5,21	-10,02	-1,98	7,65	-3,53	17,34	37,29
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,47	0,72	2,08	4,54	4,79	8,99	13,23
INPC	0,53	0,80	2,27	5,07	5,91	10,06	14,40
IGPM	2,53	5,17	6,18	18,11	28,94	37,73	48,21
SELIC	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	15,00
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
13	03/02/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	50.000.000,00	15.430.160,47115600	3,2404070000
14	03/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	9.000.000,00	3.844.563,44460500	2,3409680000
15	03/02/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	769.000,00	0,00	4.106,16924900	187,2791776000
16	03/02/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	55.962.000,00	0,00	298.815,92132800	187,2791776000
17	03/02/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	85.000,00	453,86786300	187,2791776000
18	03/02/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	884.000,00	4.720,22576900	187,2791776000
19	04/02/2021	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	884.000,00	0,00	7.225,80176870	122,3393650000
20	04/02/2021	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	50.000.000,00	0,00	20.479.372,97075010	2,4414810000
21	04/02/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	50.000.000,00	266.974,08896800	187,2840926000
22	08/02/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	423.000,00	0,00	2.258,34589600	187,3052312000
23	08/02/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	3.038.000,00	0,00	16.219,51496300	187,3052312000
24	09/02/2021	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	5.539.000,00	0,00	44.340,68732500	124,9191281000
25	09/02/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	769.000,00	4.105,30484700	187,3186106000
26	17/02/2021	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,00	76.574,82	32.983,84719600	2,3215854580
27	17/02/2021	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	0,00	367.962,84	158.853,32298700	2,3163685410
28	17/02/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	16.000,00	85,38840600	187,3790694000
29	18/02/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	444.537,66	0,00	162.962,15831000	2,7278582010
30	18/02/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	2.078.000,00	11.089,43361100	187,3855846000
31	19/02/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	5.465.956,58	0,00	29.167,21971100	187,4006722000
32	22/02/2021	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	0,00	8.000.000,00	8.343.590,73519340	0,9588198000
33	23/02/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	41.000,00	218,76798000	187,4131675000
34	24/02/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	444.537,66	162.984,53477700	2,7274836880
35	24/02/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	444.527,21	0,00	2.371,81663200	187,4205637000
36	25/02/2021	OCCAM FIC FIA	2.400.000,00	0,00	718.826,10665000	3,3387769000
37	25/02/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	5.465.939,10	29.162,88404400	187,4279338000
38	25/02/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	444.544,69	2.371,81663200	187,4279338000
39	25/02/2021	INDIE FIC FIA	5.600.000,00	0,00	1.357.203,90016000	4,1261302000
40	26/02/2021	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.477.000,00	0,00	1.524,90824380	968,5828678000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

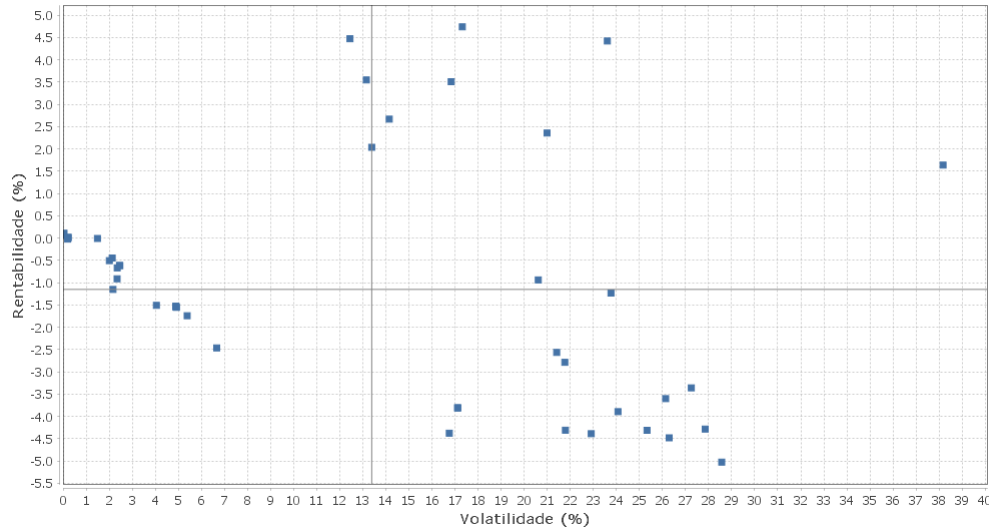
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
41	26/02/2021	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.477.000,00	0,00	12.388,28509540	119,2255416000
42	26/02/2021	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	781.000,00	0,00	216.484,19903720	3,6076536000
43	26/02/2021	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	1.478.000,00	0,00	10.170,93743332	145,3160055000
44	26/02/2021	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.478.000,00	0,00	6.889,91287145	214,5165008000

Total

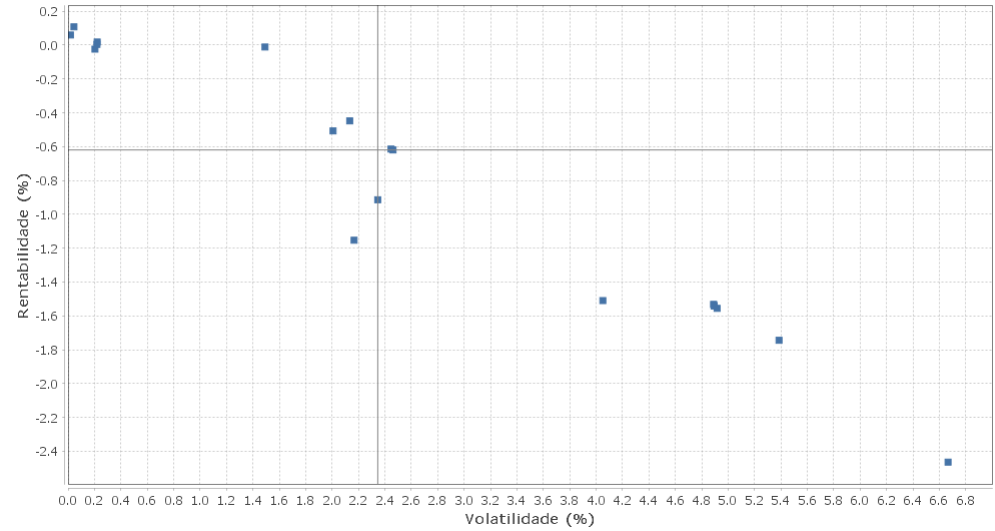
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

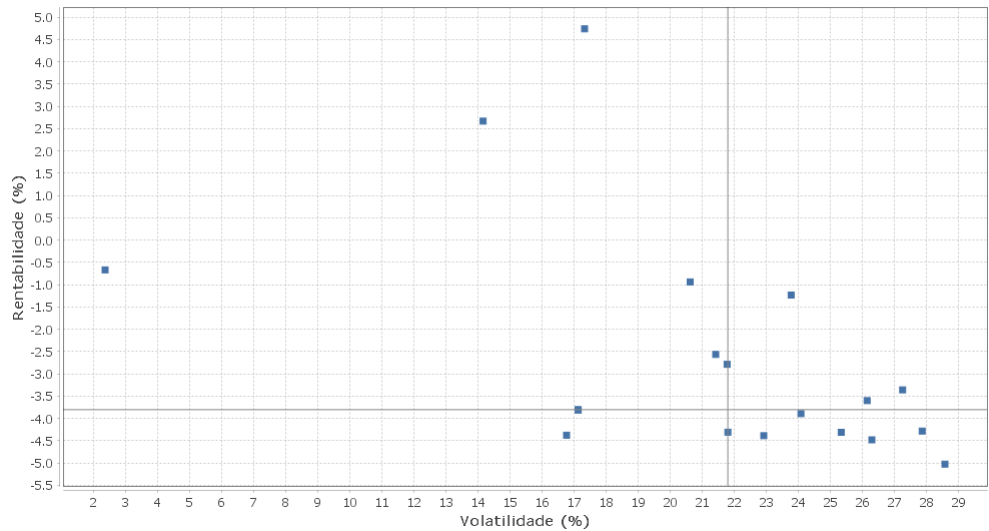
MOGI DAS CRUZES - No Mês



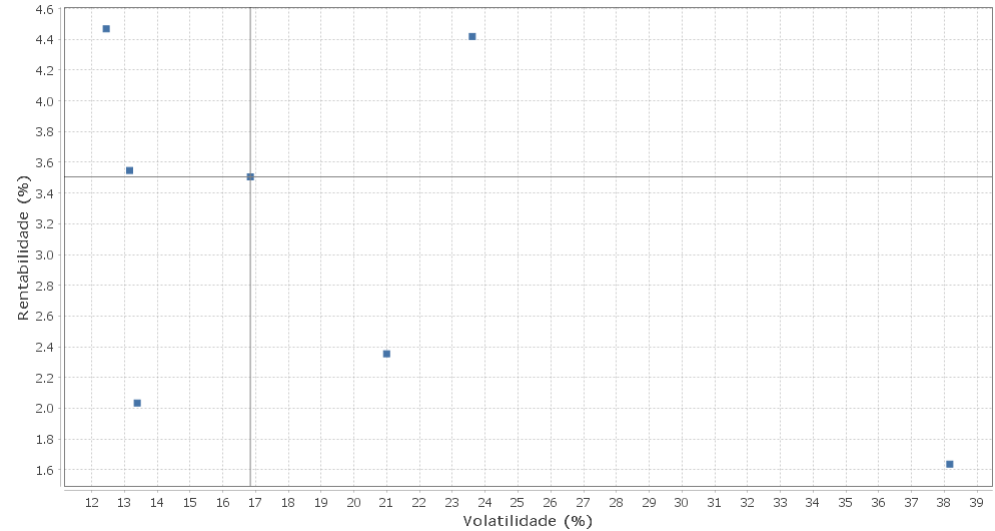
Renda Fixa - No Mês



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\$): 20.925.954,65

Value-At-Risk: 2,97%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,04	0,00	-4,19	0,06	199.772,87	0,03
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,05	0,00	-0,61	0,11	11.151.378,41	1,58
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,20	0,16	0,00	-0,78	-0,02	15.417,65	0,00
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,22	0,16	0,00	-0,59	0,00	61.725,63	0,01
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,22	0,15	0,00	-0,53	0,02	79.246,73	0,01
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,49	0,80	0,01	-0,10	-0,01	13.945.314,43	1,98
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,06	0,06	-0,32	-0,51	67.119.309,41	9,53
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,13	1,08	0,00	-0,27	-0,45	2.844.272,89	0,40
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,17	1,35	0,01	-0,59	-1,15	5.399.304,84	0,77
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,35	1,31	0,06	-0,45	-0,91	56.425.905,26	8,01
BRADESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	Artigo 8º III	2,35	1,25	0,00	-0,34	-0,67	3.508.314,92	0,50
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,45	1,22	0,01	-0,31	-0,61	13.538.678,66	1,92
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,46	1,23	0,07	-0,31	-0,62	66.041.387,36	9,38
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,05	2,17	0,09	-0,41	-1,51	51.637.468,35	7,33
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,89	2,28	0,04	-0,34	-1,53	20.637.053,20	2,93
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	4,89	2,28	0,03	-0,34	-1,54	14.447.376,55	2,05
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,89	2,29	0,21	-0,34	-1,54	112.299.378,20	15,94
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	4,92	2,30	0,01	-0,34	-1,56	3.015.848,19	0,43
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	5,39	2,48	0,01	-0,35	-1,74	5.983.408,66	0,85
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	6,67	3,36	0,00	-0,39	-2,46	781.000,00	0,11
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	12,44	11,43	0,01	0,35	4,47	2.039.270,07	0,29
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	13,16	11,52	0,04	0,26	3,55	7.225.580,19	1,03
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	13,39	10,30	0,04	0,14	2,03	6.232.257,75	0,88
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	14,15	8,13	0,11	0,18	2,67	13.488.262,62	1,91
IT NOW IBOVSPA FUNDO DE ÍNDICE	Artigo 8º I, Alínea b	16,75	0,47	0,00	-0,27	-4,38	34.769.170,32	4,94
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	16,84	11,33	0,08	0,20	3,51	12.865.459,05	1,83
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	17,12	9,58	0,01	-0,23	-3,81	773.205,57	0,11
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	Artigo 8º II, Alínea a	17,12	9,59	0,00	-0,23	-3,82	211.692,72	0,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
IT NOW S&P 500 TRN FUNDO DE ÍNDICE	Artigo 8º I, Alínea b	17,32	0,50	-0,00	0,27	4,74	6.707.874,43	0,95
XP INVESTOR 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,61	10,64	0,24	-0,05	-0,94	18.185.915,05	2,58
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	20,99	10,23	0,04	0,11	2,35	4.273.605,98	0,61
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	21,41	9,37	0,01	-0,13	-2,57	1.120.581,34	0,16
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	21,77	10,03	0,14	-0,13	-2,79	10.544.314,00	1,50
INDIE FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,79	11,66	0,11	-0,20	-4,31	7.661.671,46	1,09
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	22,91	9,87	0,13	-0,20	-4,39	10.047.210,06	1,43
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	23,61	13,01	0,19	0,18	4,42	28.830.393,61	4,09
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	23,77	10,67	0,26	-0,06	-1,23	19.116.107,97	2,71
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,07	9,32	0,02	-0,17	-3,90	1.421.433,20	0,20
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	25,33	11,12	0,15	-0,18	-4,31	11.068.142,65	1,57
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	26,14	10,35	0,17	-0,14	-3,60	13.585.499,48	1,93
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	26,29	11,52	0,40	-0,18	-4,48	27.444.157,37	3,90
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	27,25	13,21	0,06	-0,13	-3,36	3.532.343,59	0,50
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	27,86	11,50	0,07	-0,16	-4,29	4.369.406,68	0,62
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	28,57	12,24	0,03	-0,18	-5,03	2.124.597,39	0,30
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	38,17	16,13	0,05	0,04	1,64	7.625.042,59	1,08