



**LDB**  
EMPRESAS

**MOGI DAS CRUZES**  
MARÇO 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 31.03.2021.

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

62,22%

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	0,45	0,02	0,05	61.736,01	0,01	7.884.684.396,22	0,00
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	7,89	-0,50	-2,90	14.375.275,71	2,01	774.568.380,72	1,86
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,90	-0,47	-2,86	111.766.195,31	15,60	5.996.206.078,69	1,86
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,56	0,03	0,05	15.421,60	0,00	144.493.444,85	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,43	0,01	0,05	79.254,00	0,01	9.801.758.898,12	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,04	0,31	-0,23	66.247.089,69	9,25	13.551.415.614,90	0,49
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	7,90	-0,49	-2,87	20.536.882,19	2,87	1.193.793.207,38	1,72
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,14	-0,89	-2,79	5.351.392,33	0,75	1.953.428.365,60	0,27
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	5,97	-0,36	-2,51	51.453.298,61	7,18	1.185.329.734,14	4,34
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	3,01	0,32	-0,20	13.582.215,37	1,90	5.244.113.078,65	0,26
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	2,35	0,39	0,67	14.000.172,53	1,95	461.324.912,92	3,03
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	4,08	-0,42	-1,88	56.188.270,50	7,84	9.507.617.903,00	0,59
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,78	0,30	-0,18	67.321.371,64	9,40	15.491.489.347,05	0,43
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	2,58	0,29	-0,01	2.852.656,63	0,40	573.145.488,03	0,50
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>4,76</b>	<b>-0,16</b>	<b>-1,59</b>	<b>423.831.232,12</b>	<b>59,17</b>		

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	0,34	0,24	0,54	11.127.933,16	1,55	1.461.303.449,74	0,76
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	8,48	-0,81	-3,57	5.935.030,50	0,83	234.875.147,33	2,53
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	7,91	-0,50	-2,89	3.000.747,88	0,42	1.287.864.639,09	0,23
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	10,51	-1,07	-1,07	1.613.678,91	0,23	528.022.078,01	0,31
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	1,65	0,14	0,34	200.061,63	0,03	3.580.849.195,10	0,01
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>3,09</b>	<b>-0,11</b>	<b>-0,82</b>	<b>21.877.452,08</b>	<b>3,05</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

4,61

-0,15

-1,54

445.708.684,20

62,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

27,62%

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	27,39	6,01	-2,00	36.857.926,04	5,15	7.839.867.666,52	0,47
ITAU	ITAU	IT NOW S&P 500 TRN FUNDO DE ÍNDICE	11,48	5,55	15,65	7.080.429,56	0,99	2.364.499.887,05	0,30
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea b</b>			<b>25,48</b>	<b>5,93</b>	<b>0,47</b>	<b>43.938.355,60</b>	<b>6,13</b>		

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	26,06	1,48	-5,84	4.434.121,91	0,62	432.011.131,47	1,03
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	25,30	5,06	-2,89	812.368,38	0,11	1.500.771.290,94	0,05
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	23,18	8,97	1,99	1.221.144,58	0,17	1.164.556.497,85	0,10
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	28,76	3,21	-0,43	19.730.020,48	2,75	620.928.951,14	3,18
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	25,44	4,45	-3,47	18.388.148,55	2,57	308.858.985,72	5,95
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	25,46	5,08	-2,68	10.558.093,65	1,47	756.630.034,01	1,40
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	23,06	4,96	-2,48	1.491.981,91	0,21	587.455.576,04	0,25
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	25,55	3,94	-2,70	6.710.069,50	0,94	1.109.023.441,48	0,61
XP	INTRAG	XP INVESTOR 30 FIC FIA	26,28	1,60	-3,80	18.476.602,96	2,58	530.986.338,63	3,48
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	26,38	8,63	-2,59	2.307.963,19	0,32	1.177.292.184,55	0,20
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	24,71	5,62	-2,74	11.689.909,67	1,63	979.013.916,36	1,19
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	25,19	3,18	-2,28	10.879.600,54	1,52	1.025.557.184,19	1,06
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	25,24	5,07	-2,88	222.421,52	0,03	238.577.368,36	0,09
INDIE CAPITAL	INTRAG	INDIE FIC FIA	27,50	2,25	-2,28	14.905.105,21	2,08	1.183.629.596,46	1,26
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	24,93	7,17	-0,91	14.560.061,10	2,03	242.611.171,98	6,00
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>25,12</b>	<b>3,98</b>	<b>-2,71</b>	<b>136.387.613,15</b>	<b>19,04</b>		

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	20,90	4,03	6,63	14.031.304,89	1,96	1.455.516.681,87	0,96
BRAM	BRADERCO	BRADERCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	2,85	0,25	-0,48	3.517.257,63	0,49	313.205.014,86	1,12
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>16,14</b>	<b>3,25</b>	<b>5,12</b>	<b>17.548.562,52</b>	<b>2,45</b>		
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>			<b>19,23</b>	<b>4,34</b>	<b>-1,36</b>	<b>197.874.531,27</b>	<b>27,62</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

10,15%

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	25,95	1,74	9,50	14.060.586,51	1,96	280.751.899,79	5,01
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	22,18	-2,28	-0,17	5.156.557,83	0,72	443.487.803,45	1,16
BRPP	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	36,96	-3,91	-6,36	8.278.860,04	1,16	376.388.870,88	2,20
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	28,58	-2,14	6,58	29.151.326,83	4,07	1.676.325.591,46	1,74
<b>Sub-total Artigo 9º A, II</b>			<b>26,32</b>	<b>-1,41</b>	<b>6,17</b>	<b>56.647.331,21</b>	<b>7,91</b>		

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	24,18	3,43	13,29	7.473.256,56	1,04	2.719.540.696,03	0,27
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	24,60	3,03	11,67	2.101.071,89	0,29	2.654.448.171,68	0,08
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	23,96	4,33	9,53	6.502.258,19	0,91	3.092.130.666,10	0,21
<b>Sub-total Artigo 9º A, III</b>			<b>24,23</b>	<b>3,74</b>	<b>11,53</b>	<b>16.076.586,64</b>	<b>2,24</b>		

<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>24,21</b>	<b>-0,28</b>	<b>7,30</b>	<b>72.723.917,85</b>	<b>10,15</b>		
<b>Total</b>			<b>6,98</b>	<b>1,02</b>	<b>-0,86</b>	<b>716.307.133,32</b>	<b>100,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	423.831.232,12	59,17	0,00	5,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	21.877.452,08	3,05	0,00	1,14	40,00	40,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>445.708.684,20</b>	<b>62,22</b>				100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º I, Alínea b	Fundos de Índices Referenciados	43.938.355,60	6,13	0,00	5,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	136.387.613,15	19,04	0,00	18,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	17.548.562,52	2,45	0,00	2,00	10,00	10,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>197.874.531,27</b>	<b>27,62</b>				30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	56.647.331,21	7,91	0,00	4,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	16.076.586,64	2,24	0,00	1,00	10,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>72.723.917,85</b>	<b>10,15</b>				10,00



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades por Artigo**

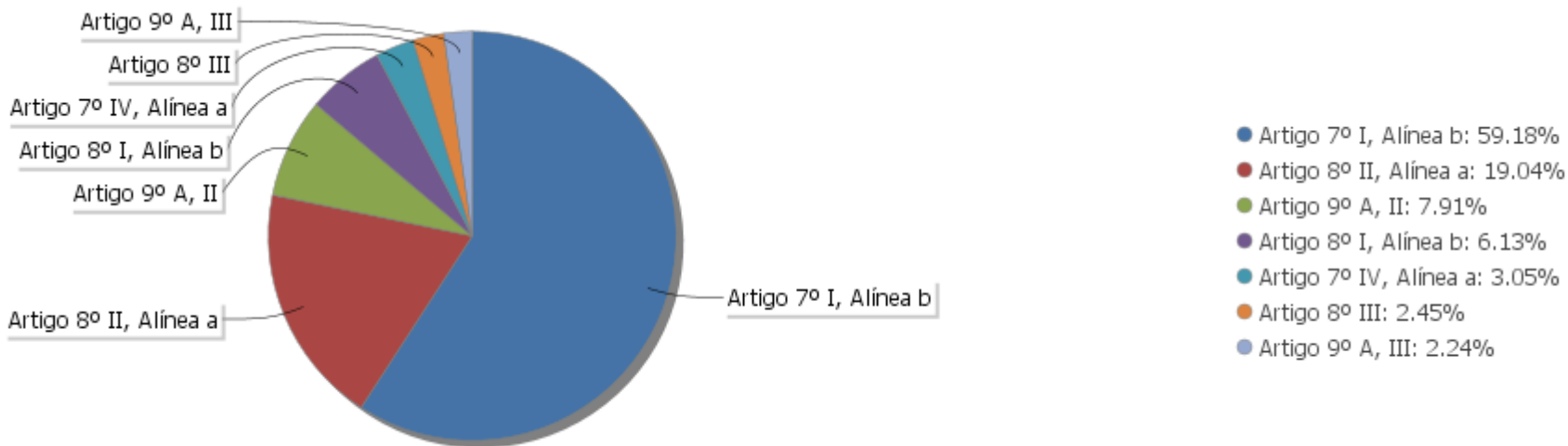
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,16 -77,39	-1,59 -326,30	-1,59 -326,30	2,61 271,96	7,29 327,91	-660.607,04	-6.764.098,73
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,11 -56,92	-0,82 -169,58	-0,82 -169,58	3,00 312,99	5,01 225,38	-43.956,05	-265.432,27
Artigo 8º I, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	5,93 -0,06	0,47 2,47	0,47 2,47	23,19 -0,10	59,57 -0,15	2.461.310,85	204.550,29
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	3,98 -2,01	-2,71 -0,71	-2,71 -0,71	17,05 -6,24	51,21 -8,51	5.181.334,62	-3.769.387,65
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	3,25 -2,75	5,12 7,13	5,12 7,13	14,97 -8,31	39,25 -20,48	551.984,98	855.438,62
Artigo 9º A, II % do CDI	-1,41 -701,61	6,17 1.270,14	6,17 1.270,14	9,73 1.014,21	77,64 3.493,34	-861.170,02	1.914.067,34
Artigo 9º A, III % do CDI	3,74 1.859,52	11,53 2.373,69	11,53 2.373,69	11,45 1.193,17	56,73 2.552,46	579.478,63	1.662.432,27
<b>MOGI DAS CRUZES (Total)</b>						<b>7.208.375,97</b>	<b>-6.162.430,13</b>

**Análise de Liquidez**

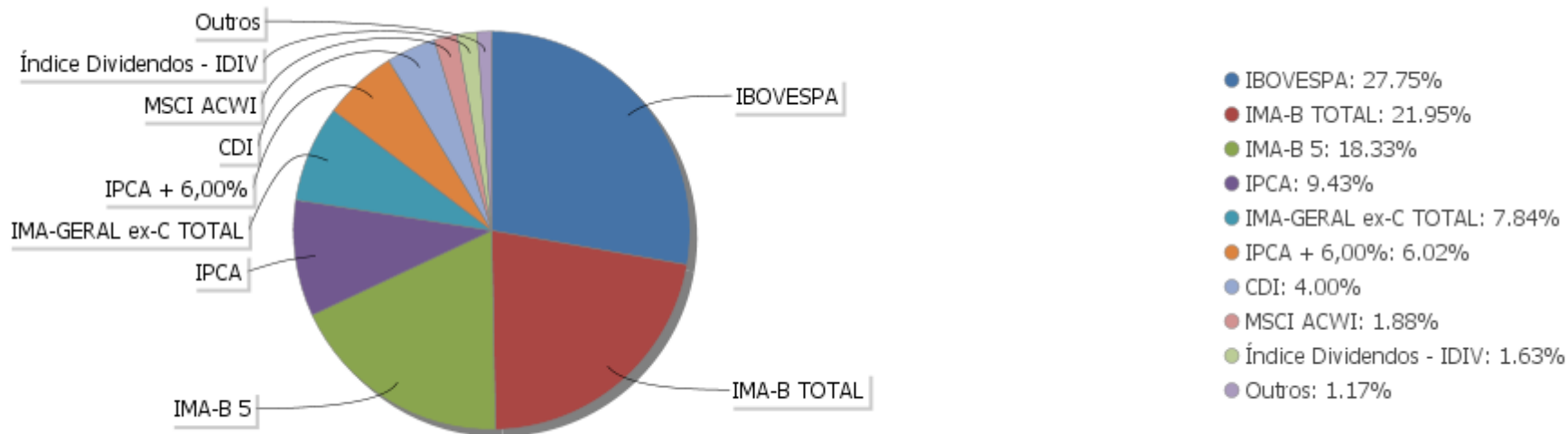
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	628.922.625,51	87,80	628.922.625,51	87,80
de 31 a 365 dias	70.531.678,65	9,85	699.454.304,16	97,65
acima de 365 dias	16.852.829,16	2,35	716.307.133,32	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

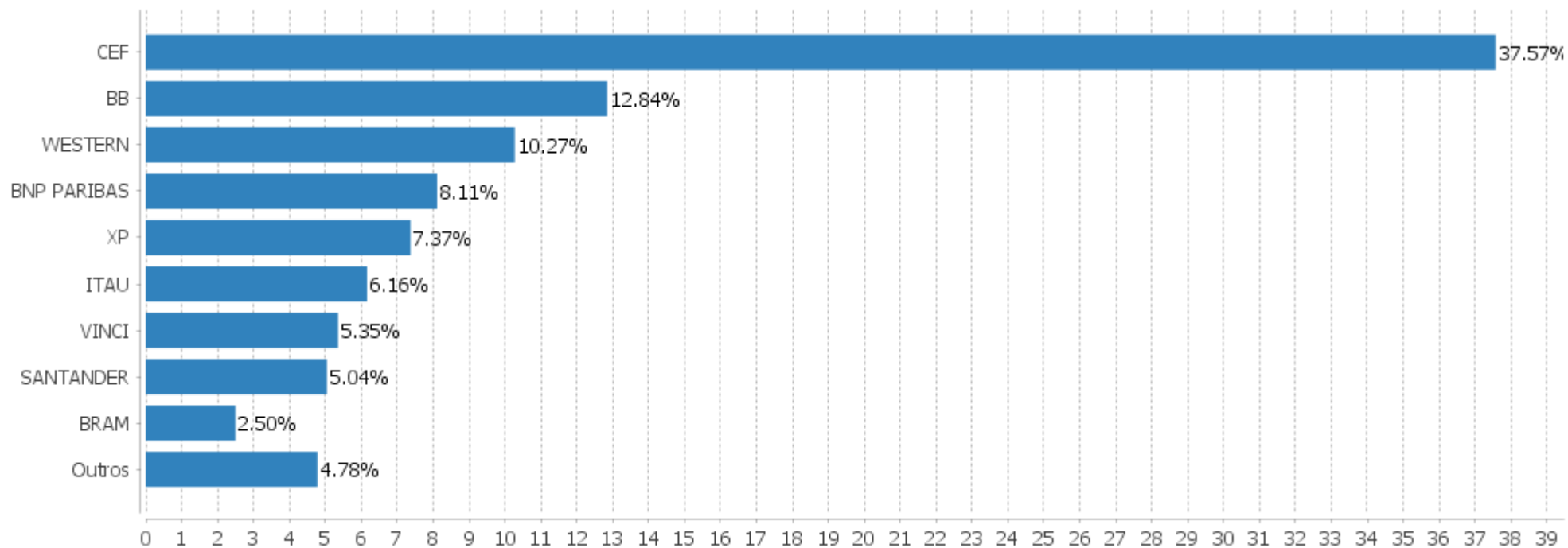


Alocação Por Estratégia



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	1,02										-0,86
IPCA + 5,39%	0,67	1,24	1,41										3,36
p.p. indexador	-1,42	-2,36	-0,39										-4,22
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

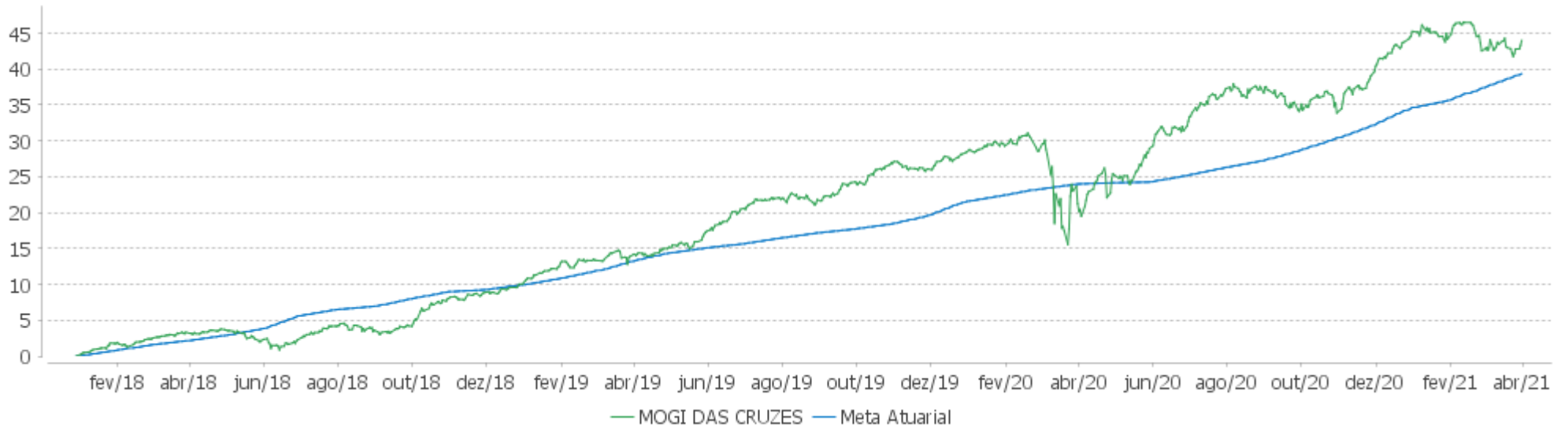
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

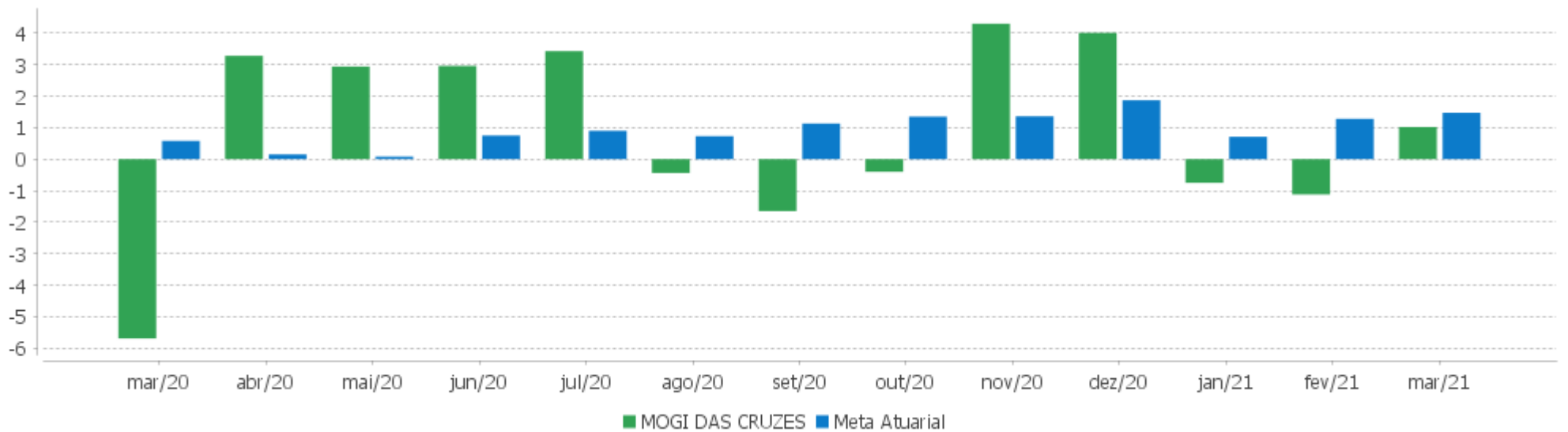
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	20	51,28	03 meses	-0,86	3,36	-4,22	6,27
Meses abaixo da Meta Atuarial	19	48,72	06 meses	7,12	8,12	-1,00	5,98
			12 meses	18,74	12,15	6,60	6,98
			24 meses	26,46	22,82	3,64	8,43
			36 meses	39,37	36,08	3,29	7,18
Maior rentabilidade da Carteira	4,30	2020-11	Desde 29/12/2017	43,99	38,98	5,01	6,93
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
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,50 -0,04	-2,89 -0,08	-2,89 -0,08	3,95 -0,22	10,00 -0,39	19,53 -0,94	35,63 -1,37
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,07 -0,60	-5,17 -2,37	-5,17 -2,37	2,87 -1,30	9,62 -0,76	22,18 1,71	40,30 3,31
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,81 -0,35	-3,57 -0,76	-3,57 -0,76	3,31 -0,86	9,53 -0,85	19,56 -0,92	35,36 -1,63
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,14 -0,79	0,34 -1,71	0,34 -1,71	0,72 -4,52	2,06 -4,04	12,01 2,41	21,02 6,40
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,24 121,75	0,54 110,62	0,54 110,62	1,16 121,27	2,05 92,28	6,96 89,47	13,72 93,84
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,47 -0,01	-2,86 -0,06	-2,86 -0,06	4,06 -0,11	10,15 -0,24	19,69 -0,79	35,87 -1,12
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	-0,36 -0,70	-2,51 -2,36	-2,51 -2,36	1,81 -1,41	7,91 -0,59	20,52 1,88	32,97 3,43
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,31 -0,03	-0,23 -0,08	-0,23 -0,08	3,08 -0,14	8,20 -0,30	17,97 -0,67	28,58 -0,95
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,02 -0,03	0,05 -0,07	0,05 -0,07	0,68 -0,15	2,12 -0,39	8,66 -0,68	15,66 -0,98
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,32 -0,02	-0,20 -0,05	-0,20 -0,05	3,13 -0,10	8,22 -0,28	18,09 -0,54	28,68 -0,85
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6,00% p.p.	0,29 -1,10	-0,01 -3,42	-0,01 -3,42	3,21 -5,22	7,72 -5,58	17,04 -7,10	38,67 1,01
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,89 -0,04	-2,79 0,01	-2,79 0,01	-0,91 -0,04	2,08 -0,17	13,08 -0,51	23,14 -0,84
BRANDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,50 -0,04	-2,90 -0,09	-2,90 -0,09	3,99 -0,18	10,00 -0,38	19,64 -0,83	35,53 -1,46
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,42 -0,04	-1,88 -0,24	-1,88 -0,24	1,24 0,09	4,35 0,17	13,27 0,41	23,79 0,44
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,39 -1,07	0,67 -2,83	0,67 -2,83	3,60 -4,71	8,98 -3,43	19,25 -3,90	41,23 4,78
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,03 -0,02	0,05 -0,07	0,05 -0,07	0,82 -0,01	2,11 -0,40	8,66 -0,67	15,77 -0,88
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,30	-0,18	-0,18	1,85	5,09	19,24	29,94

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.	-0,63	-2,24	-2,24	-3,39	-1,01	9,64	15,33
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,01 -0,04	0,05 -0,07	0,05 -0,07	0,70 -0,13	2,27 -0,23	8,88 -0,45	15,96 -0,68
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,49 -0,02	-2,87 -0,07	-2,87 -0,07	4,03 -0,14	10,01 -0,38	19,49 -0,98	35,53 -1,46
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	4,03 2.002,13	6,63 1.364,61	6,63 1.364,61	18,95 1.974,28	51,79 2.330,12	39,36 505,90	55,80 381,78
BRADERCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL % do CDI	0,25 126,76	-0,48 -99,26	-0,48 -99,26	1,45 150,63	4,73 212,68	12,37 158,98	17,17 117,49
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	5,08 -0,91	-2,68 -0,68	-2,68 -0,68	17,77 -5,51	52,19 -7,53	37,89 15,65	58,07 21,44
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,07 -0,93	-2,88 -0,87	-2,88 -0,87	16,67 -6,62	33,20 -26,53		
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	5,62 -1,95	-2,74 0,47	-2,74 0,47	21,61 0,20	45,22 5,87	27,27 -1,25	47,73 1,59
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	1,48 -4,52	-5,84 -3,83	-5,84 -3,83	11,94 -11,35	47,40 -12,33	10,36 -11,88	26,17 -10,46
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,17 1,18	-0,91 1,09	-0,91 1,09	18,07 -5,22	40,95 -18,78	29,36 7,12	51,89 15,27
XP INVESTOR 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,60 -4,40	-3,80 -1,79	-3,80 -1,79	8,86 -14,42	51,12 -8,61	27,31 5,07	43,30 6,67
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,06 -0,93	-2,89 -0,89	-2,89 -0,89	16,68 -6,61	33,22 -26,51	14,82 -7,42	35,48 -1,15
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,63 2,63	-2,59 -0,59	-2,59 -0,59	28,96 5,67	57,70 -2,03	29,30 7,07	56,62 20,00
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	4,45 -1,54	-3,47 -1,46	-3,47 -1,46	18,38 -4,91	52,70 -7,03	24,14 1,90	42,56 5,93
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	8,97 2,98	1,99 3,99	1,99 3,99	20,94 -2,35	45,27 -14,45	33,20 10,97	62,16 25,53
VINCI SELECTION EQUITIES FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,96 -1,03	-2,48 -0,48	-2,48 -0,48	15,40 -7,89	51,32 -8,41	32,80 10,56	55,29 18,66
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,25 -3,75	-2,28 -0,28	-2,28 -0,28	16,53 -6,76	67,28 7,55	54,68 32,44	
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,94 -2,06	-2,70 -0,70	-2,70 -0,70	19,50 -3,79	57,43 -2,30	32,44 10,20	50,37 13,74
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	3,21	-0,43	-0,43	21,68	70,60	42,03	52,56

## 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.	-2,79	1,57	1,57	-1,61	10,87	19,79	15,93
<b>FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR</b>	<b>3,18</b>	<b>-2,28</b>	<b>-2,28</b>	<b>16,12</b>	<b>54,35</b>		
Var. IBOVESPA p.p.	-2,82	-0,27	-0,27	-7,17	-5,38		
<b>IT NOW S&amp;P 500 TRN FUNDO DE ÍNDICE</b>	<b>5,55</b>	<b>15,65</b>	<b>15,65</b>	<b>17,70</b>			
Var. IBOVESPA p.p.	-0,44	17,65	17,65	-5,59			
<b>IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE</b>	<b>6,01</b>	<b>-2,00</b>	<b>-2,00</b>	<b>23,29</b>	<b>59,70</b>	<b>52,83</b>	
Var. IBOVESPA p.p.	0,01	-0,00	-0,00	-0,00	-0,02	30,59	
<b>FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I</b>	<b>3,43</b>	<b>13,29</b>	<b>13,29</b>	<b>14,78</b>	<b>64,18</b>	<b>108,61</b>	<b>166,72</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-2,57	15,30	15,30	-8,51	4,45	86,37	130,09
<b>SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB</b>	<b>3,03</b>	<b>11,67</b>	<b>11,67</b>	<b>13,16</b>	<b>59,12</b>	<b>93,70</b>	
Var. IBOVESPA p.p.	-2,97	13,67	13,67	-10,13	-0,60	71,46	
<b>WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I</b>	<b>4,33</b>	<b>9,53</b>	<b>9,53</b>	<b>10,01</b>	<b>68,68</b>	<b>116,58</b>	<b>180,95</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-1,66	11,54	11,54	-13,27	8,96	94,34	144,32
<b>ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>	<b>1,74</b>	<b>9,50</b>	<b>9,50</b>	<b>13,72</b>	<b>68,64</b>	<b>124,01</b>	
Var. IBOVESPA p.p.	-4,26	11,50	11,50	-9,57	8,91	101,77	
<b>AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE</b>	<b>-2,28</b>	<b>-0,17</b>	<b>-0,17</b>	<b>12,32</b>	<b>63,70</b>		
Var. MSCI ACWI p.p.	-7,83	-14,39	-14,39	-8,01	-3,11		
<b>GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE</b>	<b>-3,91</b>	<b>4,13</b>	<b>4,13</b>				
Var. MSCI ACWI p.p.	-9,46	-10,09	-10,09				
<b>MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>	<b>-2,14</b>	<b>6,58</b>	<b>6,58</b>	<b>9,46</b>	<b>79,75</b>		
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-3,61	3,07	3,07	1,15	67,34		
<b>MOGI DAS CRUZES</b>	<b>1,02</b>	<b>-0,86</b>	<b>-0,86</b>	<b>7,12</b>	<b>18,74</b>	<b>26,46</b>	<b>39,37</b>
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,44	-4,37	-4,37	-1,19	6,33	3,31	2,92
CDI	0,20	0,49	0,49	0,96	2,22	7,78	14,62
IBOVESPA	6,00	-2,00	-2,00	23,29	59,73	22,24	36,63
INPC + 6,00%	1,40	3,41	3,41	8,43	13,30	24,13	37,66
IPCA + 6,00%	1,47	3,50	3,50	8,31	12,41	23,15	36,45



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Indexadores**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
<b>Renda Fixa</b>							
IRF-M 1	0,04	0,13	0,13	0,83	2,51	9,33	16,64
IRF-M 1+	-1,45	-4,77	-4,77	-2,02	1,81	15,01	26,76
IRF-M TOTAL	-0,84	-2,80	-2,80	-0,87	2,25	13,59	23,98
IMA-B 5	0,34	-0,15	-0,15	3,23	8,50	18,63	29,54
IMA-B 5+	-1,17	-5,10	-5,10	4,90	12,01	21,24	42,19
IMA-B TOTAL	-0,46	-2,81	-2,81	4,17	10,39	20,48	36,99
IMA-C TOTAL	-0,72	9,62	9,62	13,61	34,42	51,98	77,98
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,38	-1,64	-1,64	1,15	4,18	12,86	23,35
IMA-GERAL TOTAL	-0,39	-1,32	-1,32	1,50	4,98	13,88	24,71
IDKA 2	0,29	-0,05	-0,05	3,00	8,57	18,47	29,35
IDKA 20	-1,89	-7,21	-7,21	7,55	15,19	22,04	53,40
CDI	0,20	0,49	0,49	0,96	2,22	7,78	14,62
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	6,00	-2,00	-2,00	23,29	59,73	22,24	36,63
IBRX 100	6,04	-0,72	-0,72	24,43	62,17	26,16	42,14
IBRX 50	6,08	-0,80	-0,80	25,46	64,73	22,50	35,45
SMALL CAP	4,56	-0,88	-0,88	21,46	64,58	44,87	61,92
IFIX	-1,38	-0,81	-0,81	1,86	14,14	14,65	20,75
Índice Consumo - ICON	2,32	-4,34	-4,34	6,29	50,94	40,41	39,42
Índice Dividendos - IDIV	7,57	-3,21	-3,21	21,41	39,35	28,51	46,14
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	0,93	2,05	2,05	5,25	6,10	9,60	14,62
INPC	0,86	1,96	1,96	5,36	6,94	10,48	15,64
IGPM	2,94	8,26	8,26	16,52	31,10	40,02	51,60
SELIC	0,20	0,49	0,49	0,96	2,22	7,78	14,62
<b>Meta Atuarial</b>							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

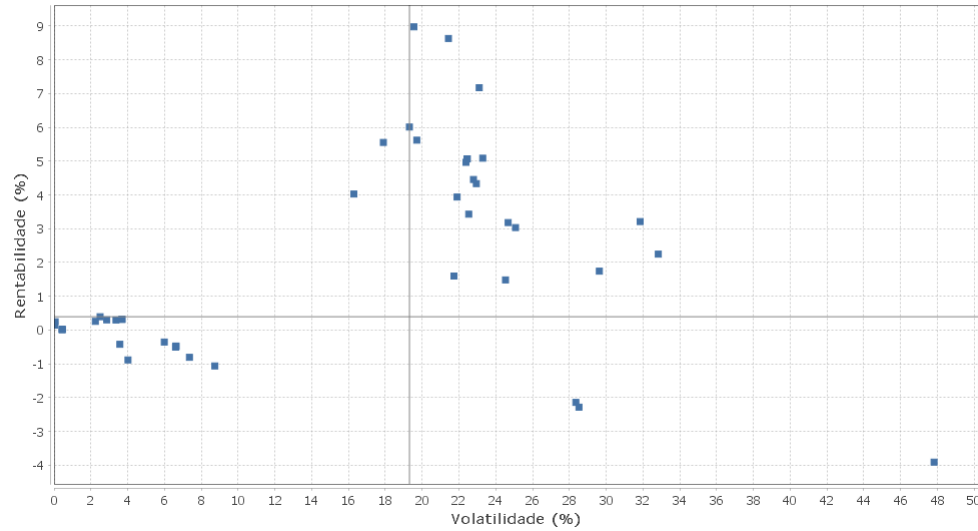
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
52	03/03/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	768.000,00	0,00	4.096,26916600	187,4876794000
54	03/03/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	18.000,00	96,00630900	187,4876794000
58	03/03/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	2.113.360,08	11.271,99444200	187,4876794000
59	03/03/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	961.827,04	5.130,08135200	187,4876794000
60	03/03/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	812,88	4,33566700	187,4876794000
51	08/03/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	430.000,00	0,00	2.292,51865600	187,5666307000
53	08/03/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	4.758.000,00	0,00	25.366,98549400	187,5666307000
45	09/03/2021	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	978.000,00	0,00	8.310,13754860	117,6875827000
47	09/03/2021	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	979.000,00	0,00	6.904,65774515	141,7883458000
49	09/03/2021	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	979.000,00	0,00	4.472,87812916	218,8747316000
57	09/03/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	768.000,00	4.094,34817400	187,5756451000
63	09/03/2021	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	978.000,00	0,00	985,43029900	992,4598431000
55	18/03/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	22.000,00	117,22246900	187,6773313000
61	18/03/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	2.084.000,00	11.104,16471500	187,6773313000
62	23/03/2021	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	0,00	10.000.000,00	27.523,63049780	363,3241627000
56	24/03/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	39.000,00	207,69441600	187,7758717000
46	26/03/2021	OCCAM FIC FIA	3.000.000,00	0,00	892.069,33412640	3,3629673000
48	26/03/2021	INDIE FIC FIA	7.000.000,00	0,00	1.715.303,61045000	4,0809102000
50	31/03/2021	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	841.000,00	0,00	235.625,96180080	3,5692162000
<b>Total</b>						

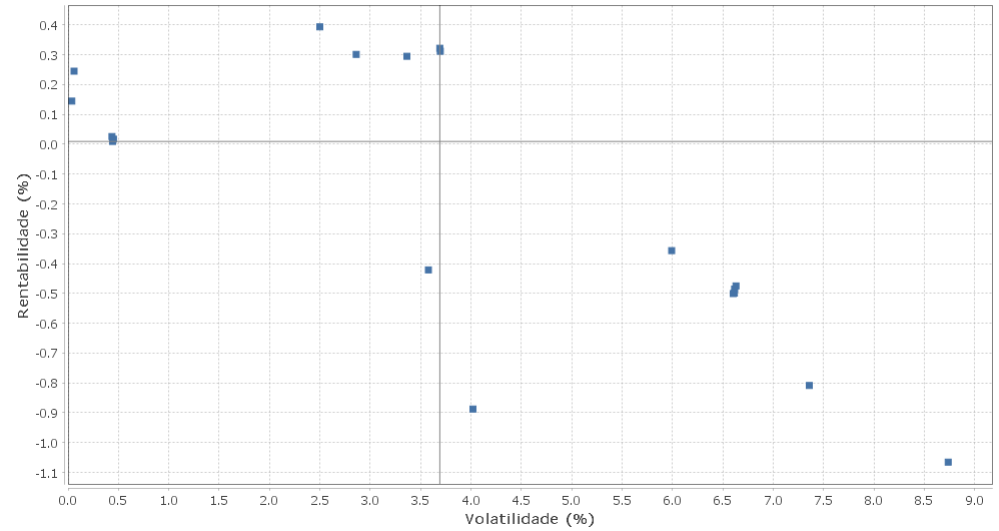
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

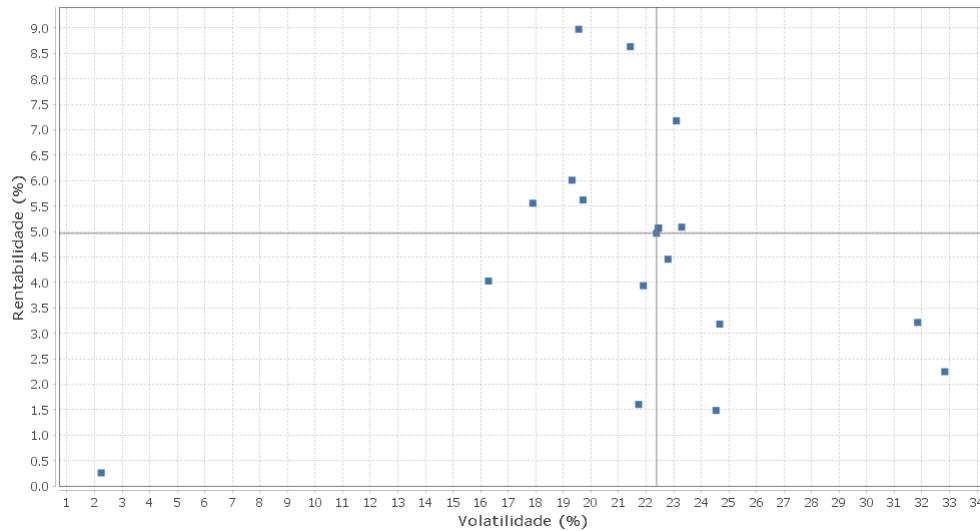
MOGI DAS CRUZES - No Mês



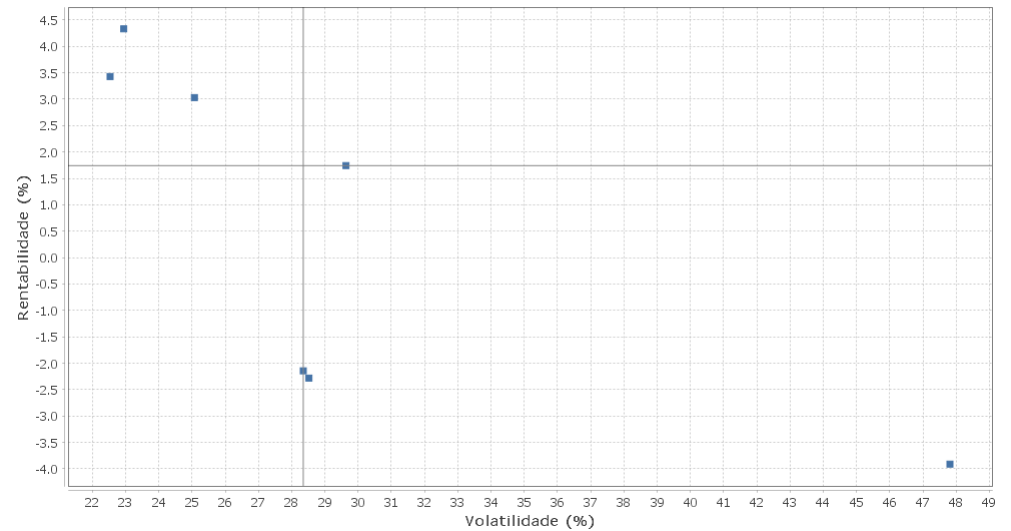
Renda Fixa - No Mês



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\$): 19.248.167,72

Value-At-Risk: 2,69%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,02	0,00	-1,52	0,14	200.061,63	0,03
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,03	0,00	0,73	0,24	11.127.933,16	1,55
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,44	0,15	0,00	-0,40	0,03	15.421,60	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,44	0,14	0,00	-0,43	0,01	79.254,00	0,01
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,45	0,15	0,00	-0,41	0,02	61.736,01	0,01
BRADESCO FIC DE FIM MACRO INSTITUCIONAL	Artigo 8º III	2,24	0,92	0,00	0,02	0,25	3.517.257,63	0,49
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,50	0,80	0,01	0,08	0,39	14.000.172,53	1,95
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,86	0,94	0,06	0,03	0,30	67.321.371,64	9,40
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,36	1,30	0,00	0,03	0,29	2.852.656,63	0,40
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,58	1,36	0,06	-0,17	-0,42	56.188.270,50	7,84
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,69	1,43	0,02	0,03	0,32	13.582.215,37	1,90
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,70	1,43	0,08	0,03	0,31	66.247.089,69	9,25
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,02	1,34	0,01	-0,27	-0,89	5.351.392,33	0,75
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,99	2,18	0,09	-0,09	-0,36	51.453.298,61	7,18
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	6,60	2,83	0,01	-0,11	-0,50	3.000.747,88	0,42
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	6,61	2,82	0,03	-0,11	-0,50	14.375.275,71	2,01
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,62	2,82	0,05	-0,10	-0,49	20.536.882,19	2,87
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,63	2,82	0,26	-0,10	-0,47	111.766.195,31	15,60
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	7,36	3,03	0,01	-0,14	-0,81	5.935.030,50	0,83
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	8,74	3,62	0,00	-0,14	-1,07	1.613.678,91	0,23
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	16,29	6,78	0,08	0,23	4,03	14.031.304,89	1,96
IT NOW S&P 500 TRN FUNDO DE ÍNDICE	Artigo 8º I, Alínea b	17,89	0,83	-0,00	0,30	5,55	7.080.429,56	0,99
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	Artigo 8º I, Alínea b	19,31	0,99	0,00	0,30	6,01	36.857.926,04	5,15
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	19,56	9,50	0,01	0,45	8,97	1.221.144,58	0,17
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	19,71	10,02	0,13	0,27	5,62	11.689.909,67	1,63
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,43	11,47	0,03	0,39	8,63	2.307.963,19	0,32
XP INVESTOR 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,73	10,21	0,22	0,06	1,60	18.476.602,96	2,58
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,90	10,55	0,08	0,17	3,94	6.710.069,50	0,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,38	9,19	0,02	0,21	4,96	1.491.981,91	0,21
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,44	9,22	0,01	0,22	5,06	812.368,38	0,11
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,45	9,19	0,00	0,22	5,07	222.421,52	0,03
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	22,53	10,08	0,02	0,14	3,43	7.473.256,56	1,04
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	22,79	10,76	0,24	0,19	4,45	18.388.148,55	2,57
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	22,94	9,96	0,02	0,18	4,33	6.502.258,19	0,91
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,10	8,34	0,14	0,30	7,17	14.560.061,10	2,03
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	23,29	9,33	0,12	0,21	5,08	10.558.093,65	1,47
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	24,53	10,08	0,06	0,05	1,48	4.434.121,91	0,62
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	24,67	9,88	0,13	0,12	3,18	10.879.600,54	1,52
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	25,07	11,75	0,01	0,11	3,03	2.101.071,89	0,29
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	28,35	12,73	0,06	-0,08	-2,14	29.151.326,83	4,07
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	28,52	11,09	0,05	-0,09	-2,28	5.156.557,83	0,72
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	29,63	11,60	0,07	0,05	1,74	14.060.586,51	1,96
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	31,84	10,81	0,25	0,09	3,21	19.730.020,48	2,75
INDIE FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	32,83	11,47	0,19	0,06	2,25	14.905.105,21	2,08
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	47,81	16,72	0,02	-0,09	-3,91	8.278.860,04	1,16