



LDB
EMPRESAS

COTIA
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

RENTA FIXA

72,17%

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	27.319.037,35	3,39	7.884.684.396,22	0,35
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	9,26	-0,85	-4,36	8.592.825,74	1,07	993.570.026,22	0,86
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	7,89	-0,48	-2,85	34.712.620,96	4,31	7.644.309.269,72	0,45
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,90	-0,47	-2,86	29.750.848,06	3,69	5.996.206.078,69	0,50
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,43	0,01	0,05	80.976.719,15	10,05	9.801.758.898,12	0,83
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,04	0,31	-0,23	134.770.180,45	16,73	13.551.415.614,90	0,99
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,63	0,37	-0,00	37.065.303,91	4,60	8.957.703.037,59	0,41
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,74	0,37	-0,02	58.767.744,95	7,30	10.861.361.928,62	0,54
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,78	0,30	-0,18	104.961.087,38	13,03	15.491.489.347,05	0,68
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,75	0,14	-0,52	516.916.367,95	64,17		

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
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	8,53	-0,74	-3,39	4.360.662,87	0,54	700.314.494,78	0,62
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,37	0,10	0,34	8.918.997,80	1,11	5.408.705.211,16	0,16
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,19	0,24	0,50	18.869.026,60	2,34	3.129.027.750,94	0,60
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,15	0,10	0,23	1.112.363,25	0,14	2.383.075.266,03	0,05
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,65	0,14	0,34	4.822.262,16	0,60	3.580.849.195,10	0,13
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	4,53	-0,34	-1,73	16.263.004,91	2,02	3.444.833.436,95	0,47
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,68	0,41	0,14	10.098.422,73	1,25	2.249.680.851,56	0,45
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,16	0,02	-0,47	64.444.740,32	8,00		

Renda Fixa

2,57

0,13

-0,51

581.361.108,27

72,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

20,24%

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA BRASIL IBX-50	26,96	5,92	-0,76	11.593.418,91	1,44	1.175.205.411,78	0,99
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	26,19	5,72	-0,63	21.487.725,33	2,67	1.206.597.607,28	1,78
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			26,49	5,79	-0,67	33.081.144,24	4,11		

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
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	24,62	5,87	-3,57	18.068.852,84	2,24	1.002.558.255,25	1,80
SAFRA	SAFRA	SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	26,37	6,54	-3,99	5.473.306,73	0,68	268.019.681,40	2,04
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	25,48	3,89	-2,44	5.175.899,26	0,64	981.481.248,05	0,53
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	25,46	5,08	-2,68	14.386.400,62	1,79	756.630.034,01	1,90
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	24,71	5,62	-2,74	14.940.822,60	1,85	979.013.916,36	1,53
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	26,05	-1,18	-6,76	7.900.704,66	0,98	2.066.276.030,96	0,38
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	26,61	2,12	1,10	3.706.539,73	0,46	3.385.715.282,16	0,11
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	26,38	1,18	1,18	1.011.796,40	0,13	1.177.292.184,55	0,09
BB	BB	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	26,80	1,25	1,25	1.073.916,45	0,13	819.326.312,79	0,13
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	25,19	3,18	-2,28	7.997.694,90	0,99	1.025.557.184,19	0,78
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	25,49	1,81	-3,02	8.905.634,11	1,11	363.910.250,21	2,45
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	24,79	0,70	0,20	5.478.519,13	0,68	273.676.829,28	2,00
SAFRA	SAFRA	SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	29,79	2,91	-0,61	3.278.175,17	0,41	109.938.144,88	2,98
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			24,79	3,87	-2,94	97.398.262,60	12,09		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO FI LP	1,80	0,45	0,05	12.940.207,52	1,61	404.944.680,68	3,20
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	20,61	4,07	6,58	4.965.201,51	0,62	1.037.182.533,83	0,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	2,29	-0,40	-1,02	3.027.402,95	0,38	108.074.058,26	2,80
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	20,92	4,05	6,80	6.416.260,88	0,80	1.178.826.435,94	0,54
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	21,01	4,16	6,79	5.179.095,72	0,64	2.216.604.138,65	0,23
Sub-total Artigo 8º III			4,17	2,13	2,91	32.528.168,58	4,04		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			22,26	3,91	-1,40	163.007.575,42	20,24		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,59%

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	36.584.172,78	4,54	2.719.540.696,03	1,35
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	24,60	3,03	11,67	24.584.666,42	3,05	2.654.448.171,68	0,93
Sub-total Artigo 9º A, III			23,92	3,27	12,63	61.168.839,20	7,59		
Investimentos no Exterior			23,92	3,27	12,63	61.168.839,20	7,59		
Total			4,38	1,09	0,21	805.537.522,89	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	516.916.367,95	64,17	58,00	58,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	64.444.740,32	8,00	5,00	5,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	581.361.108,27	72,17				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	33.081.144,24	4,11	0,00	4,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	97.398.262,60	12,09	11,00	18,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	32.528.168,58	4,04	5,00	5,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	163.007.575,42	20,24				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	61.168.839,20	7,59	7,00	7,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	61.168.839,20	7,59				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

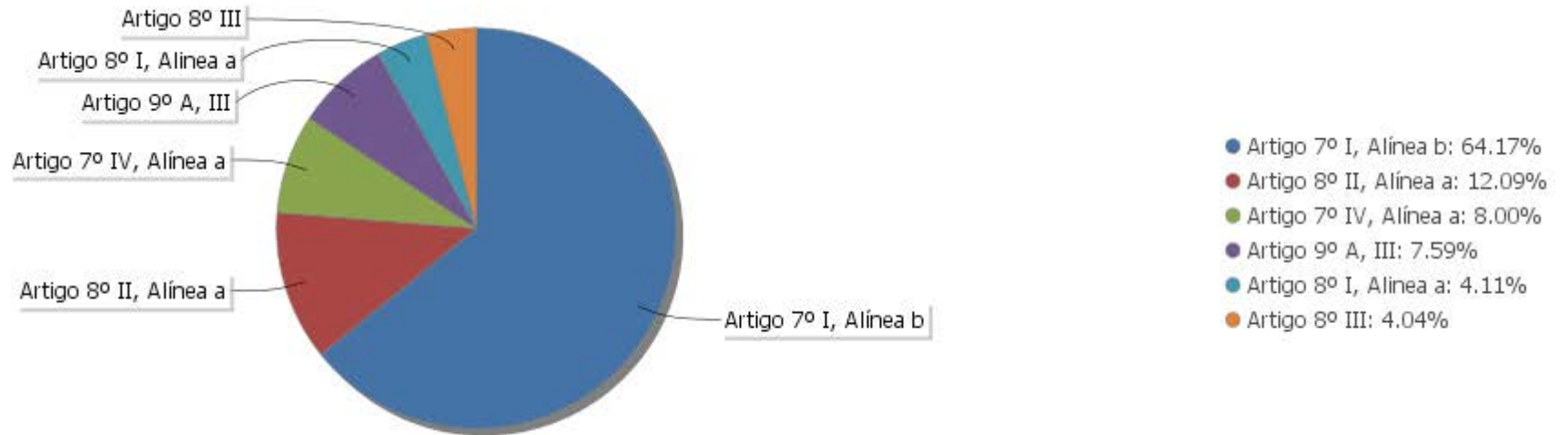
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,14 69,16	-0,52 -107,32	-0,52 -107,32	2,35 244,88	5,99 269,47	714.275,28	-2.744.373,71
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,02 11,87	-0,47 -96,95	-0,47 -96,95	1,35 140,87	2,45 110,14	13.318,94	-293.916,46
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	5,79 -0,20	-0,67 1,33	-0,67 1,33	23,83 0,54	61,48 1,75	1.811.318,42	-224.299,86
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	3,87 -2,13	-2,94 -0,94	-2,94 -0,94	17,35 -5,93	44,69 -15,04	3.549.176,83	-2.710.768,50
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,13 -3,87	2,91 4,91	2,91 4,91	5,15 -18,13	6,39 -53,33	657.409,52	846.835,49
Artigo 9º A, III % do CDI	3,27 1.626,16	12,63 2.600,28	12,63 2.600,28	14,34 1.494,24	62,92 2.830,98	1.917.270,16	6.801.815,40
COTIA (Total)						8.662.769,15	1.675.292,36

Análise de Liquidez

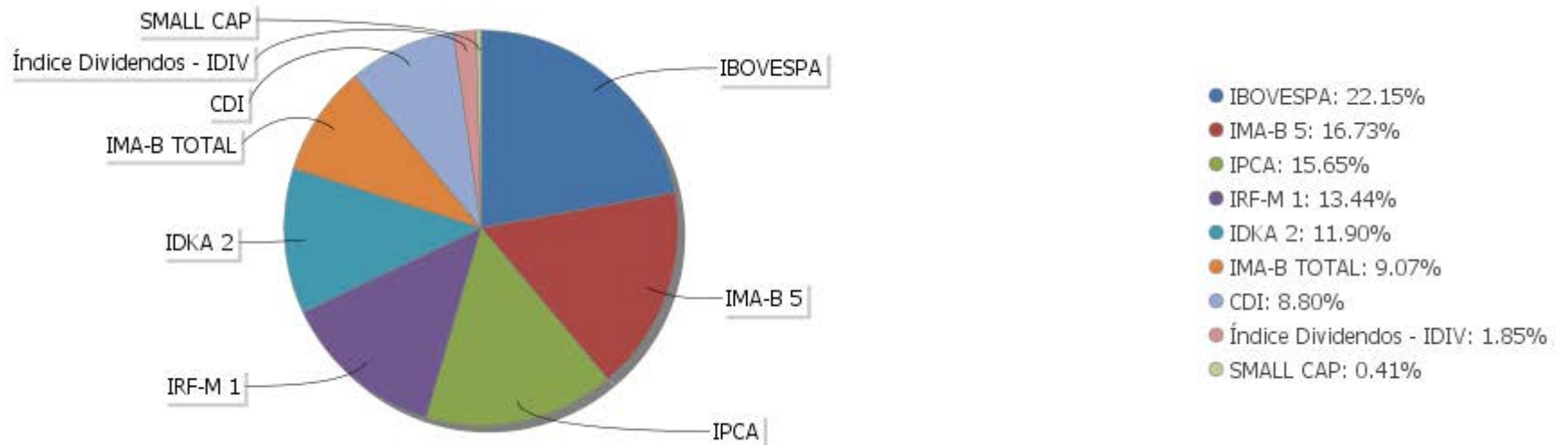
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	741.209.410,74	92,01	741.209.410,74	92,01
de 31 a 365 dias	64.328.112,15	7,99	805.537.522,89	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	805.537.522,89	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

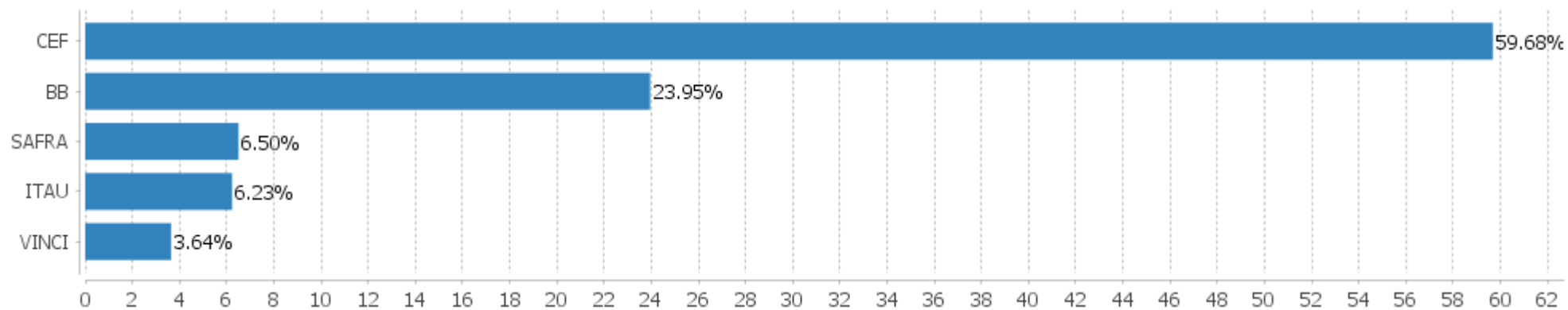


Alocação Por Estratégia



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	-0,21	-0,66	1,09										0,21
IPCA + 5,85%	0,70	1,27	1,46										3,47
p.p. indexador	-0,92	-1,93	-0,36										-3,26
2020	0,49	-0,32	-3,56	1,40	1,62	1,41	1,59	-0,08	-0,74	-0,16	2,49	2,57	6,75
IPCA + 5,85%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,85	10,61
p.p. indexador	-0,21	-0,98	-4,13	1,26	1,55	0,68	0,71	-0,80	-1,86	-1,50	1,14	0,72	-3,85
2019	1,23	0,48	0,57	0,84	0,95	1,23	0,79	0,30	1,39	1,36	-0,05	1,42	11,03
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	0,40	-0,41	-0,62	-0,22	0,31	0,78	0,07	-0,32	0,94	0,72	-1,02	-0,23	0,44
2018	0,86	0,51	0,95	0,49	-0,51	0,40	1,00	0,18	0,69	1,76	0,42	0,86	7,85
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	0,06	-0,23	0,37	-0,22	-1,40	-1,35	0,15	-0,27	-0,23	0,80	0,16	0,24	-2,07
2017	1,58	2,23	1,12	0,32	-0,10	0,50	2,52	1,12	1,18	0,19	-0,06	0,55	11,68
IPCA + 6,00%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	0,68	1,48	0,33	-0,23	-0,92	0,24	1,79	0,39	0,55	-0,72	-0,80	-0,35	2,64

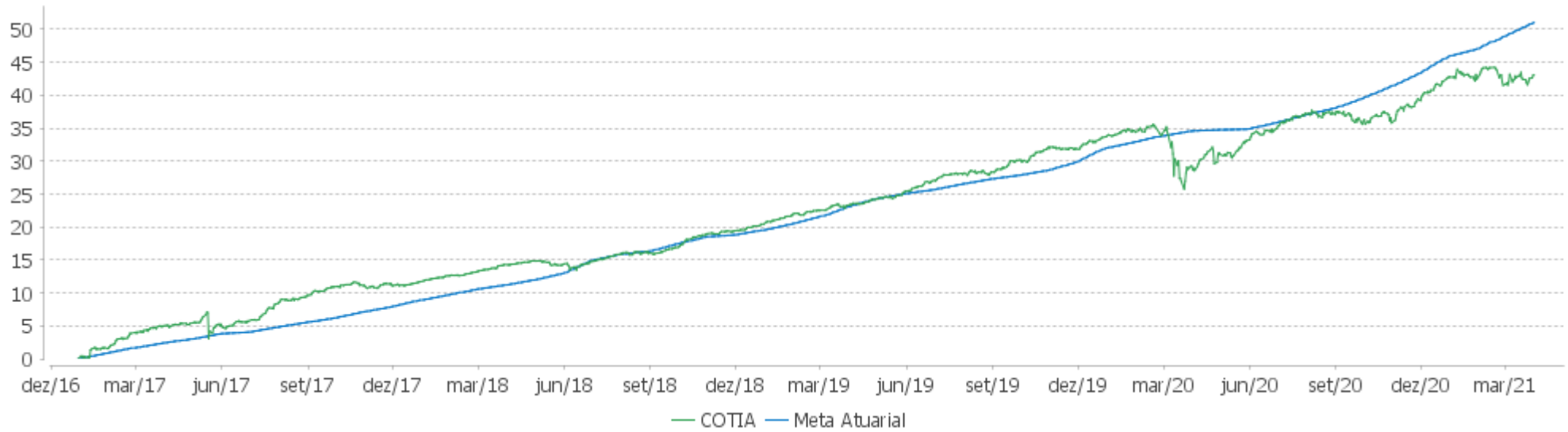
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

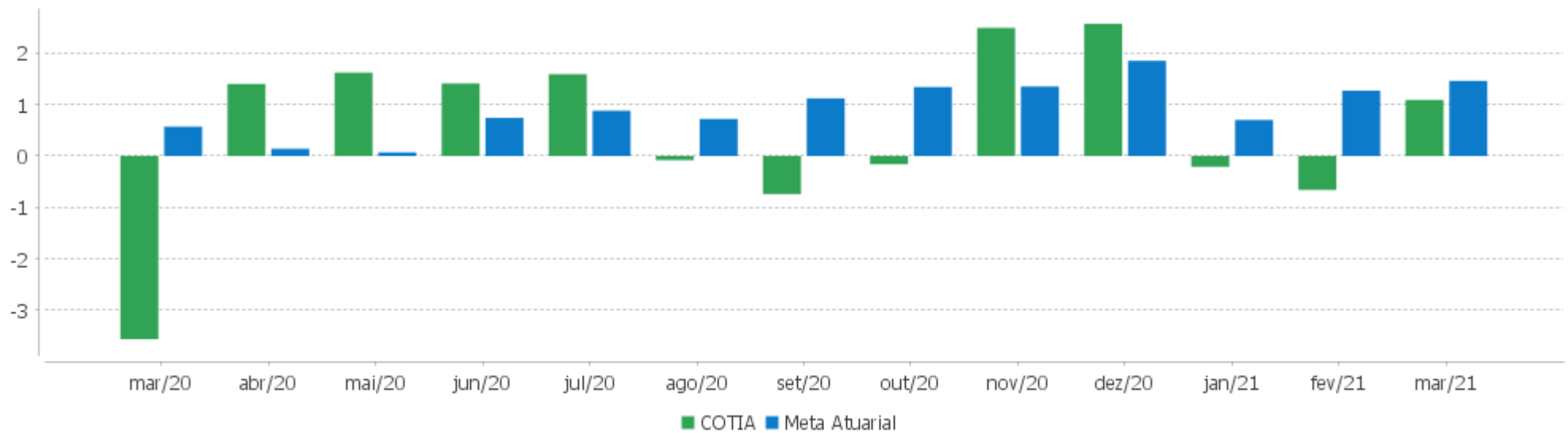
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	25	49,02	03 meses	0,21	3,47	-3,26	5,07
Meses abaixo da Meta Atuarial	26	50,98	06 meses	5,17	8,23	-3,06	4,46
			12 meses	10,73	12,26	-1,52	4,38
			24 meses	16,10	22,94	-6,83	4,84
			36 meses	25,18	36,21	-11,04	4,06
Maior rentabilidade da Carteira	2,57	2020-12	Desde 30/12/2016	43,07	51,70	-8,63	4,09
Menor rentabilidade da Carteira	-3,56	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.	-0,47 -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
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 IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,37 0,08	-0,00 0,04	-0,00 0,04	3,22 0,22	8,63 0,06	17,08 -1,39	27,21 -2,14
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
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,30 -0,63	-0,18 -2,24	-0,18 -2,24	1,85 -3,39	5,09 -1,01	19,24 9,64	29,94 15,33
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,37 0,08	-0,02 0,02	-0,02 0,02	3,02 0,02	8,45 -0,13	17,15 -1,31	27,36 -2,00
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,85 -0,39	-4,36 -1,56	-4,36 -1,56	2,79 -1,38	8,93 -1,46	19,50 -0,97	38,14 1,15
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,48 -0,02	-2,85 -0,05	-2,85 -0,05	4,08 -0,09	10,09 -0,30	19,91 -0,56	35,98 -1,01
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
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	-0,74 -369,78	-3,39 -697,59	-3,39 -697,59	3,49 363,35	9,66 434,57	22,62 290,73	38,90 266,10
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,24 119,51	0,50 103,23	0,50 103,23	1,07 111,93	2,31 103,88	7,23 92,95	13,91 95,15
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,10 51,92	0,23 47,53	0,23 47,53	0,45 46,79	1,12 50,22	5,47 70,33	10,96 75,01
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	-0,34 -1,27	-1,73 -3,78	-1,73 -3,78	1,86 -3,38	4,77 -1,33		
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	0,41 202,17	0,14 28,69	0,14 28,69	0,92 95,38	2,55 114,78		
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,10 49,18	0,34 69,73	0,34 69,73	0,98 102,09	1,96 88,11	7,05 90,55	13,66 93,48
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA 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
FIA BRASIL IBX-50	5,92	-0,76	-0,76	24,14	62,10	20,78	30,47

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.	-0,08	1,25	1,25	0,85	2,38	-1,46	-6,16
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	5,72	-0,63	-0,63	23,62	61,04	25,76	45,01
Var. IBOVESPA p.p.	-0,27	1,37	1,37	0,33	1,31	3,53	8,38
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	1,81	-3,02	-3,02	15,69	60,13		
Var. IBOVESPA p.p.	-4,19	-1,02	-1,02	-7,60	0,40		
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	5,08	-2,68	-2,68	17,77	52,19	37,89	58,07
Var. IBOVESPA p.p.	-0,91	-0,68	-0,68	-5,51	-7,53	15,65	21,44
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	8,73	-1,68	-1,68	25,98	76,37	44,87	
Var. IBOVESPA p.p.	2,73	0,32	0,32	2,70	16,64	22,63	
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	2,12	1,10	1,10	21,26	58,11	30,49	51,12
Var. IBOVESPA p.p.	-3,88	3,10	3,10	-2,03	-1,62	8,25	14,50
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	5,62	-2,74	-2,74	21,61	45,22	27,27	47,73
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,95	0,47	0,47	0,20	5,87	-1,25	1,59
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	8,63	-2,59	-2,59	28,96	57,70	29,30	56,62
Var. IBOVESPA p.p.	2,63	-0,59	-0,59	5,67	-2,03	7,07	20,00
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	-1,18	-6,76	-6,76	11,03	50,86	25,29	47,94
Var. IBOVESPA p.p.	-7,18	-4,76	-4,76	-12,26	-8,86	3,05	11,31
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	0,70	0,20	0,20	18,13	70,02		
Var. IBOVESPA p.p.	-5,30	2,20	2,20	-5,16	10,29		
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	6,54	-3,99	-3,99	18,35	43,56	23,22	28,61
Var. IBOVESPA p.p.	0,54	-1,99	-1,99	-4,93	-16,17	0,98	-8,02
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	3,89	-2,44	-2,44	18,66	56,32	25,45	41,04
Var. IBOVESPA p.p.	-2,10	-0,44	-0,44	-4,63	-3,41	3,21	4,41
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	2,91	-0,61	-0,61	17,15	61,04	41,84	
Var. SMALL CAP p.p.	-1,65	0,27	0,27	-4,32	-3,54	-3,03	
BB AÇÕES DIVIDENDOS	5,87	-3,57	-3,57	16,25	38,32	8,99	19,75
Var. IBOVESPA p.p.	-0,13	-1,57	-1,57	-7,04	-21,41	-13,25	-16,88
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	3,18	-2,28	-2,28	16,12	54,35		
Var. IBOVESPA p.p.	-2,82	-0,27	-0,27	-7,17	-5,38		
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	-0,40	-1,02	-1,02	0,92	2,55		
% do CDI	-198,29	-209,28	-209,28	96,13	114,73		
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	0,45	0,05	0,05	1,97	2,89	9,25	16,93
% do CDI	223,21	10,82	10,82	204,85	129,83	118,91	115,82
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4,05	6,80	6,80	18,84	51,15	38,08	
% do CDI	2.013,14	1.398,84	1.398,84	1.962,63	2.301,64	489,46	
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	4,07	6,58	6,58	18,69	51,16	39,63	55,47

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.	-1,93	8,58	8,58	-4,60	-8,57	17,39	18,84
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI % do CDI	4,16 2.068,46	6,79 1.396,50	6,79 1.396,50	18,92 1.971,17	52,87 2.378,63	40,59 521,63	56,61 387,30
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	3,43 -2,57	13,29 15,30	13,29 15,30	14,78 -8,51	64,18 4,45	108,61 86,37	166,72 130,09
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	3,03 -2,97	11,67 13,67	11,67 13,67	13,16 -10,13	59,12 -0,60	93,70 71,46	
COTIA Var. IPCA + 5,85% p.p.	1,09 -0,36	0,21 -3,26	0,21 -3,26	5,17 -3,06	10,73 -1,52	16,10 -6,70	25,18 -10,70
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
Renda Fixa							
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
Renda Variável							
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
Indicadores Econômicos							
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
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

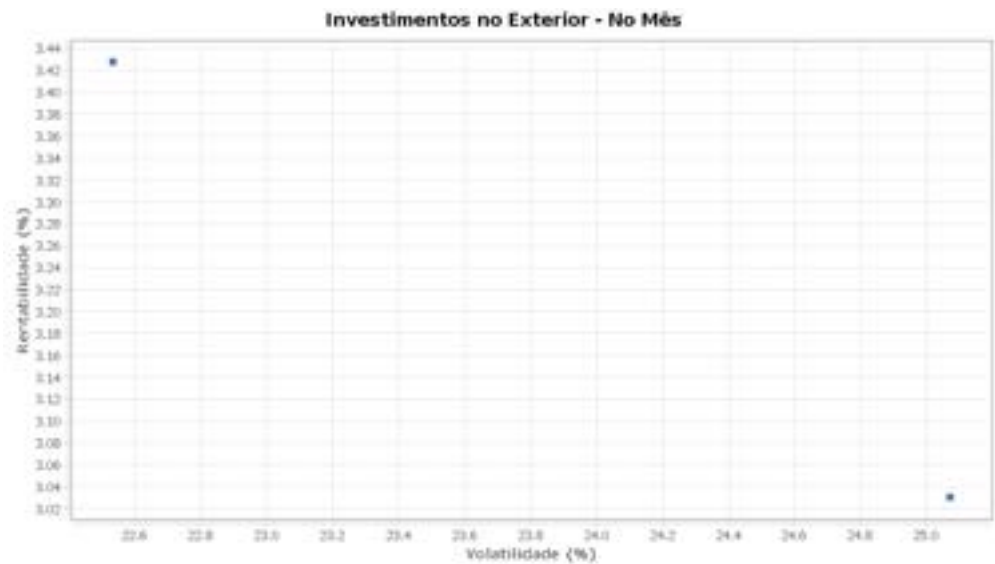
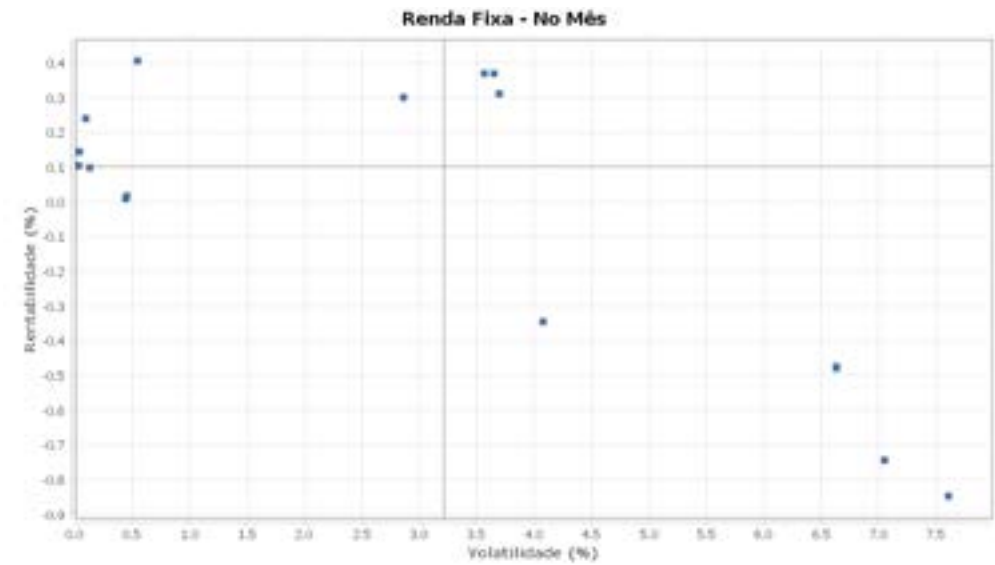
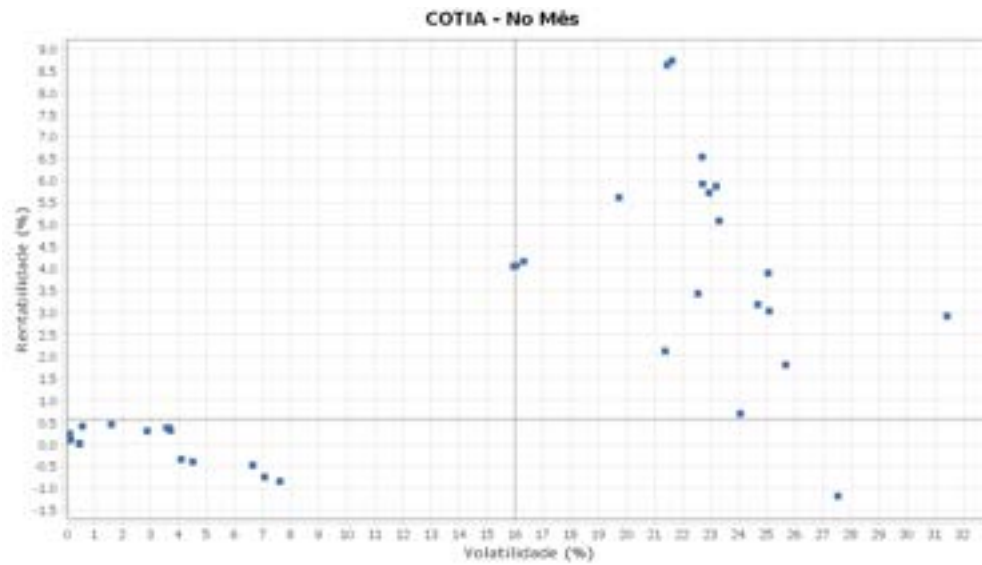
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
60	01/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	10.411,06	0,00	4.510,99108400	2,3079318500
67	01/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	17,85	8,43174800	2,1169986290
68	02/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.716,00	6.950,99823500	2,1171059900
57	04/03/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	117.704,45	43.170,48188100	2,7265030380
69	04/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.389,44	1.600,83076500	2,1173006380
65	05/03/2021	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	28.443,69	0,00	4.394,51324000	6,4725462060
66	05/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	22.627,37	0,00	10.686,68557800	2,1173421670
61	09/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	125.039,64	0,00	54.147,27654400	2,3092507690
70	09/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	13.083,00	6.178,51994500	2,1174974130
71	11/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.436,08	678,15381800	2,1176316660
62	15/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	168,16	0,00	72,79984200	2,3098951080
72	15/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.501,18	6.847,50464100	2,1177320440
63	17/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	784.005,67	0,00	339.344,13362000	2,3103557490
73	19/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	25.288,43	11.939,63122000	2,1180243790
58	25/03/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	2.095.466,35	769.173,18740000	2,7243101870
74	25/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	77.408,90	36.537,02757900	2,1186425150
77	25/03/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	775.000,00	0,00	554.506,96102900	1,3976380000
79	26/03/2021	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	262.000,00	0,00	13.261,73481309	19,7560880000
55	26/03/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	500.000,00	0,00	83.772,84757815	5,9685210000
59	26/03/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	222.666,27	81.734,78325200	2,7242535080
75	26/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	91.335,38	43.108,28989500	2,1187428270
80	29/03/2021	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	250.000,00	0,00	79.980,47196796	3,1257630000
53	29/03/2021	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	312.000,00	0,00	1.207,76337200	258,3287480000
54	29/03/2021	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	200.000,00	0,00	1.373,17662000	145,6476880000
56	29/03/2021	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	1.060.647,22	0,00	408.548,35498700	2,5961363130
64	29/03/2021	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	1.000.000,00	0,00	653.540,48082200	1,5301270990
76	29/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	17,85	8,42422000	2,1188904730
78	29/03/2021	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	773.504,14	0,00	642.905,05087100	1,2031390000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 18.518.731,66

Value-At-Risk: 2,30%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,01	0,00	-3,14	0,10	1.112.363,25	0,14
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,02	0,00	-1,52	0,14	4.822.262,16	0,60
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,09	0,03	0,00	0,42	0,24	18.869.026,60	2,34
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,13	0,04	0,00	-0,79	0,10	8.918.997,80	1,11
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,44	0,14	0,01	-0,43	0,01	80.976.719,15	10,05
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,45	0,15	0,00	-0,41	0,02	27.319.037,35	3,39
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,54	0,24	0,00	0,38	0,41	10.098.422,73	1,25
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	Artigo 8º III	1,58	0,75	0,01	0,16	0,45	12.940.207,52	1,61
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,86	0,94	0,08	0,03	0,30	104.961.087,38	13,03
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	3,56	1,38	0,04	0,05	0,37	37.065.303,91	4,60
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,65	1,45	0,07	0,05	0,37	58.767.744,95	7,30
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,70	1,43	0,15	0,03	0,31	134.770.180,45	16,73
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	4,08	1,56	0,02	-0,13	-0,34	16.263.004,91	2,02
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	Artigo 8º III	4,49	1,32	0,00	-0,13	-0,40	3.027.402,95	0,38
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,63	2,82	0,06	-0,10	-0,47	29.750.848,06	3,69
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,63	2,84	0,07	-0,10	-0,48	34.712.620,96	4,31
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	7,05	2,96	0,01	-0,13	-0,74	4.360.662,87	0,54
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	7,61	3,23	0,02	-0,14	-0,85	8.592.825,74	1,07
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	15,95	6,77	0,04	0,24	4,05	6.416.260,88	0,80
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	16,04	6,68	0,03	0,24	4,07	4.965.201,51	0,62
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	Artigo 8º III	16,31	6,78	0,03	0,24	4,16	5.179.095,72	0,64
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	19,71	10,02	0,16	0,27	5,62	14.940.822,60	1,85
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	21,36	8,95	0,04	0,09	2,12	3.706.539,73	0,46
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,43	11,47	0,01	0,39	8,63	1.011.796,40	0,13
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	21,60	11,68	0,01	0,39	8,73	1.073.916,45	0,13
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	22,53	10,08	0,13	0,14	3,43	36.584.172,78	4,54
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	22,68	10,09	0,06	0,28	6,54	5.473.306,73	0,68
FIA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	22,70	11,16	0,14	0,25	5,92	11.593.418,91	1,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	22,93	10,76	0,26	0,24	5,72	21.487.725,33	2,67
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	23,18	9,55	0,18	0,24	5,87	18.068.852,84	2,24
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	23,29	9,33	0,15	0,21	5,08	14.386.400,62	1,79
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,05	9,78	0,06	0,02	0,70	5.478.519,13	0,68
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	24,67	9,88	0,09	0,12	3,18	7.997.694,90	0,99
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	25,04	9,71	0,06	0,15	3,89	5.175.899,26	0,64
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	25,07	11,75	0,12	0,11	3,03	24.584.666,42	3,05
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	25,67	9,53	0,09	0,06	1,81	8.905.634,11	1,11
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	27,53	10,55	0,08	-0,05	-1,18	7.900.704,66	0,98
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	31,43	12,08	0,04	0,09	2,91	3.278.175,17	0,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de março de 2021, vale observar que:

- Os recursos alocados no Artigo 8º, Inciso III, representavam 4,04% dos recursos totais do Instituto, alocação está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos.