



LDB
EMPRESAS

COTIA
DEZEMBRO 2020



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 26.01.2021.

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

REND A FIXA 73,81%

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,57	0,31	3,47	34.445.128,39	4,33	8.522.749.810,66	0,40
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	14,68	5,53	7,24	8.984.789,58	1,13	1.130.429.213,40	0,79
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,74	4,84	6,14	35.675.468,26	4,49	8.693.778.987,76	0,41
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,80	4,84	6,06	30.627.714,61	3,85	6.193.173.925,17	0,49
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,55	0,28	3,63	80.934.254,50	10,18	16.753.976.831,37	0,48
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,02	1,82	7,75	135.077.079,31	16,99	20.761.505.098,56	0,65
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,20	1,53	7,92	37.066.627,45	4,66	8.476.640.994,51	0,44
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,13	1,65	8,03	58.782.359,82	7,39	10.655.087.063,09	0,55
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	1,32	6,66	105.153.289,33	13,22	14.722.139.597,34	0,71
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,17	1,74	5,96	526.746.711,25	66,24		

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	14,55	4,94	7,53	4.513.651,86	0,57	637.293.736,31	0,71
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,37	0,36	2,42	8.888.882,61	1,12	4.230.515.183,84	0,21
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,23	0,25	2,40	13.828.243,68	1,74	2.596.482.307,62	0,53
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	0,10	1,64	1.810.283,78	0,23	2.452.222.466,54	0,07
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,66	0,20	2,86	4.805.987,05	0,60	3.882.685.363,65	0,12
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	5,90	2,70	1,80	16.268.303,62	2,05	2.667.113.282,02	0,61
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,92	0,29	0,84	10.084.363,43	1,27	2.099.340.126,69	0,48
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,16	1,25	3,33	60.199.716,03	7,57		

Renda Fixa 3,82 1,69 5,70 586.946.427,28 73,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

19,41%

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	46,06	9,07	1,51	11.681.745,98	1,47	1.155.616.982,05	1,01
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	45,32	8,75	2,28	21.623.698,12	2,72	1.245.394.762,64	1,74
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			45,63	8,86	1,87	33.305.444,10	4,19		

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	39,21	7,67	-7,93	18.348.686,98	2,31	1.054.907.075,55	1,74
SAFRA	SAFRA	SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	40,77	8,02	-2,01	5.700.829,76	0,72	301.393.328,13	1,89
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	44,58	8,37	12,85	4.732.333,62	0,60	970.856.600,60	0,49
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	41,94	9,08	2,38	14.370.395,05	1,81	756.510.912,48	1,90
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,92	9,37	3,05	14.944.934,53	1,88	1.002.176.394,28	1,49
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	42,57	8,40	14,45	8.473.563,95	1,07	2.241.283.487,34	0,38
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	44,19	6,30	-4,87	3.666.245,27	0,46	3.595.641.284,57	0,10
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	45,15	7,65	10,01	5.926.439,07	0,75	1.038.280.774,77	0,57
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	44,13	7,35	10,30	9.183.028,77	1,15	337.153.236,99	2,72
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	46,58	6,73	17,09	4.762.294,73	0,60	214.749.020,69	2,22
SAFRA	SAFRA	SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	48,74	6,18	9,94	3.298.340,52	0,41	131.926.941,46	2,50
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			40,38	8,07	-2,00	93.407.092,25	11,75		

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	3,03	1,10	2,01	12.933.406,69	1,63	419.517.016,47	3,08
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	32,77	0,06	0,06	3.858.669,57	0,49	734.034.454,86	0,53
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	1,73	1,42	1,70	3.058.504,06	0,38	74.547.462,29	4,10
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	33,34	1,15	1,15	3.900.501,09	0,49	672.183.314,73	0,58

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	33,41	1,12	1,12	3.899.473,10	0,49	1.995.120.518,18	0,20
		Sub-total Artigo 8º III	3,03	1,49	2,56	27.650.554,51	3,48		
		Renda Variável e Investimentos Estruturados	37,87	7,45	-1,17	154.363.090,86	19,41		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,77%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	29,55	0,69	54,76	31.851.735,48	4,01	1.987.917.698,76	1,60
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	33,07	0,35	10,55	22.015.288,32	2,77	1.875.936.369,20	1,17
Sub-total Artigo 9º A, III			29,34	0,55	54,47	53.867.023,80	6,77		
Investimentos no Exterior			29,34	0,55	54,47	53.867.023,80	6,77		
Total			6,23	2,57	6,75	795.176.541,94	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	526.746.711,25	66,24	0,00	55,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	60.199.716,03	7,57	0,00	15,00	30,00	40,00
	Total Renda Fixa	586.946.427,28	73,81				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	33.305.444,10	4,19	0,00	7,00	15,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	93.407.092,25	11,75	0,00	10,00	15,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	27.650.554,51	3,48	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	154.363.090,86	19,41				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	53.867.023,80	6,77	0,00	3,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	53.867.023,80	6,77				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

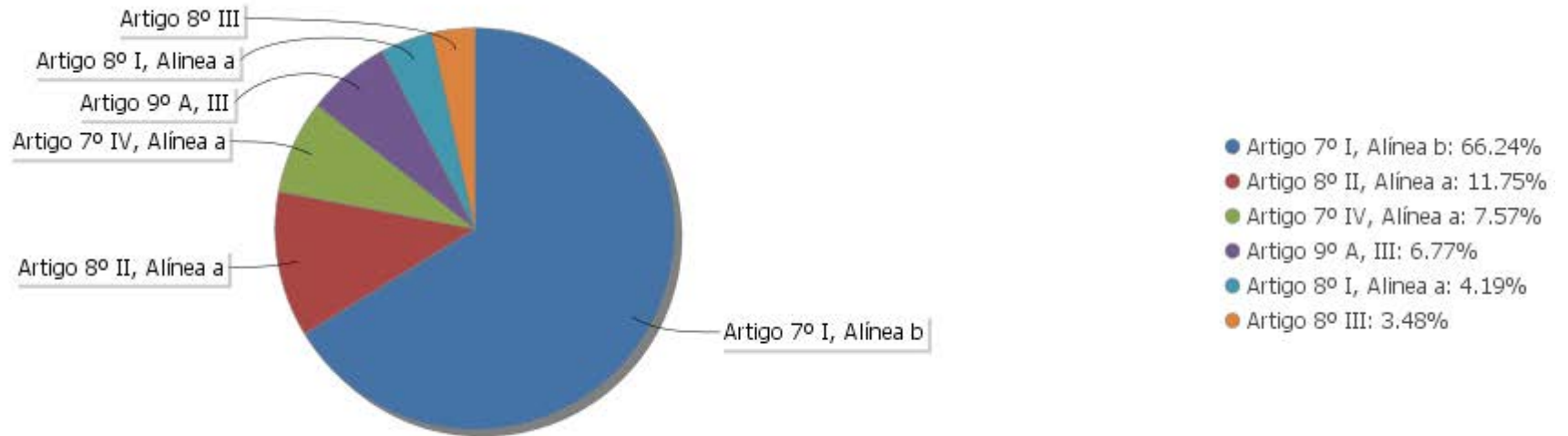
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,74 1.057,60	5,96 216,20	2,89 612,09	3,61 366,46	5,96 216,20	9.199.513,17	32.823.230,58
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,25 761,84	3,33 120,88	1,83 388,38	1,97 199,33	3,33 120,88	742.619,12	2.087.328,13
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,86 -0,43	1,87 -1,04	24,67 -1,14	24,12 -1,08	1,87 -1,04	2.685.177,51	2.240.530,54
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,07 -1,22	-2,00 -4,92	20,91 -4,90	20,32 -4,89	-2,00 -4,92	6.651.596,75	4.787.064,16
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	1,49 -7,81	2,56 -0,35	2,18 -23,63	1,62 -23,59	2,56 -0,35	264.573,07	341.361,61
Artigo 9º A, III % do CDI	0,55 335,41	54,47 1.975,26	1,52 321,47	16,27 1.650,34	54,47 1.975,26	295.497,11	7.623.196,23
COTIA (Total)						19.838.976,73	49.902.711,25

Análise de Liquidez

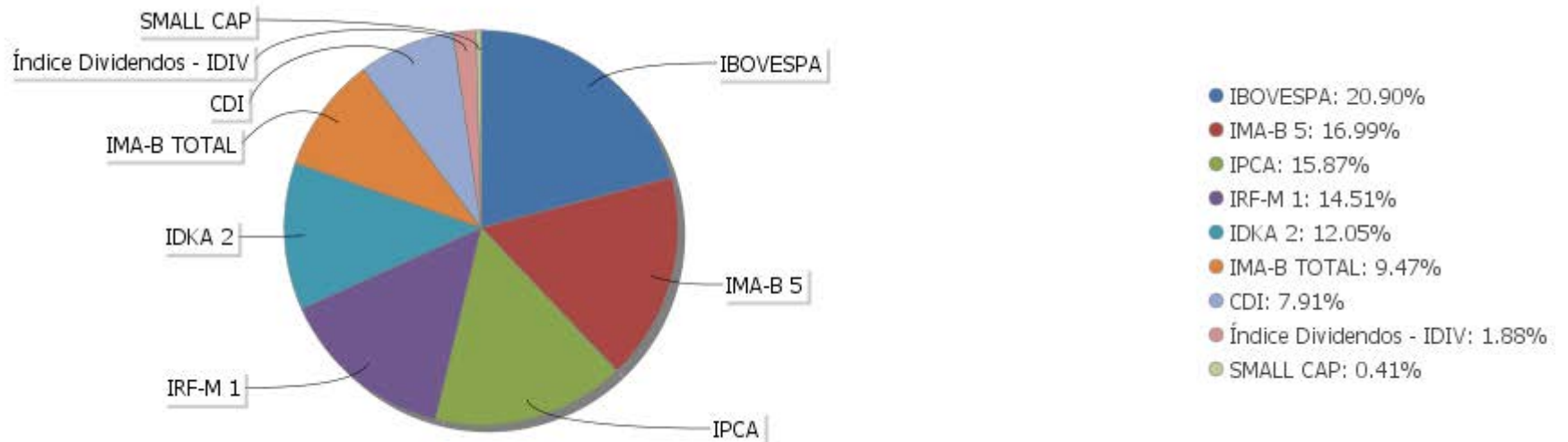
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	733.849.640,57	92,29	733.849.640,57	92,29
de 31 a 364 dias	61.326.901,37	7,71	795.176.541,94	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	795.176.541,94	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

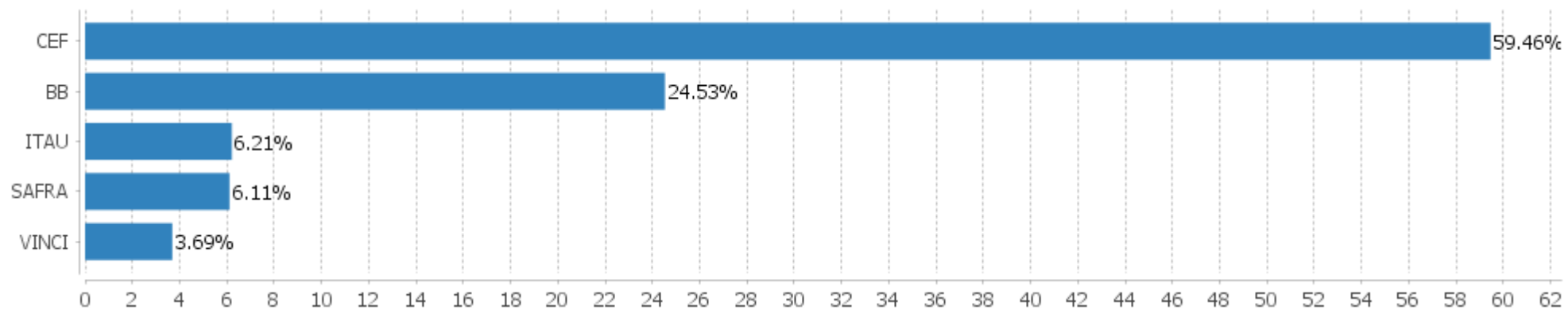


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2020	0,49	-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%	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%	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%	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

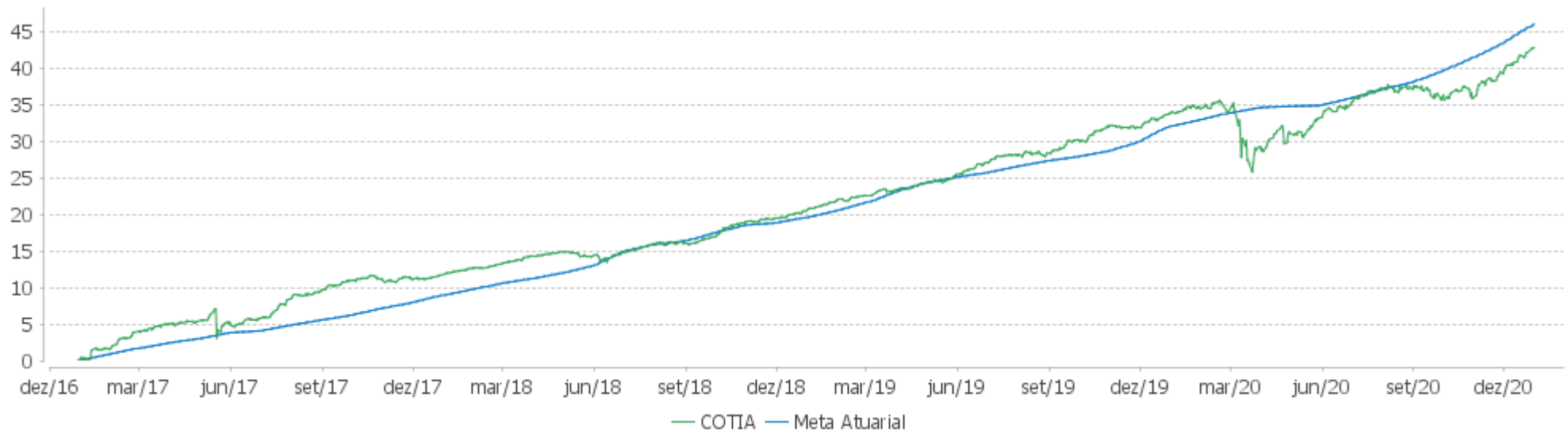
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

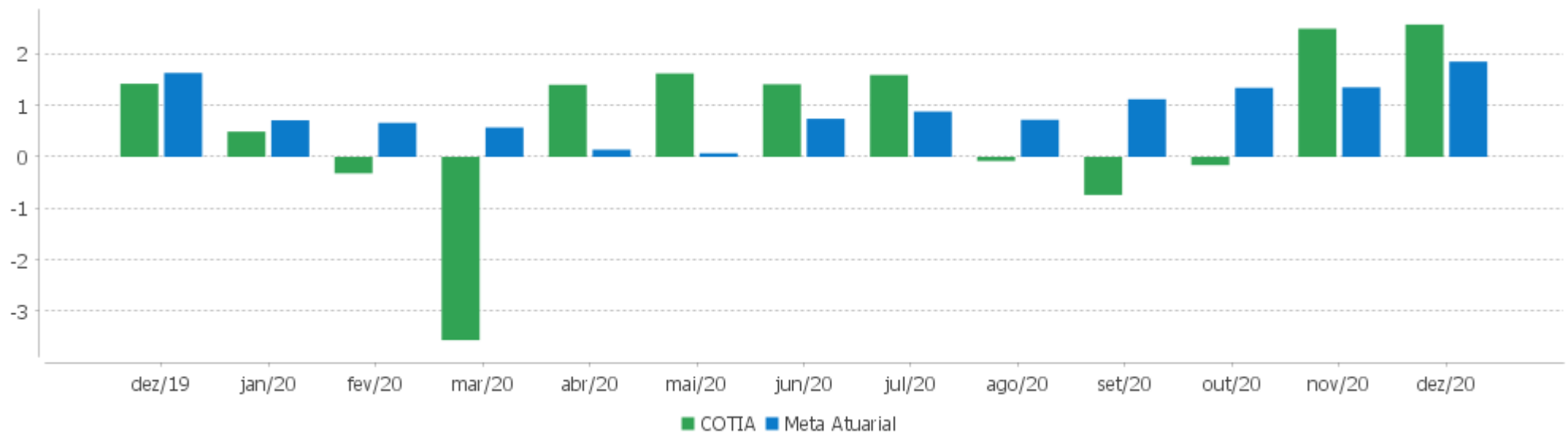
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	25	52,08	03 meses	4,95	4,61	0,34	3,72
Meses abaixo da Meta Atuarial	23	47,92	06 meses	5,74	7,47	-1,73	3,63
			12 meses	6,75	10,61	-3,85	6,23
			24 meses	18,53	22,32	-3,79	4,53
Maior rentabilidade da Carteira	2,57	2020-12	36 meses	27,83	34,45	-6,62	3,80
Menor rentabilidade da Carteira	-3,56	2020-03	Desde 30/12/2016	42,77	46,62	-3,85	4,03

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.	4,84 -0,01	6,06 -0,34	7,13 -0,04	8,09 -0,12	6,06 -0,34	30,02 -0,81	46,71 -1,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,82 -0,01	7,75 -0,29	3,32 -0,06	4,57 -0,15	7,75 -0,29	21,60 -0,65	33,35 -0,96
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,53 -0,21	7,92 -0,70	3,22 0,18	4,89 -0,21	7,92 -0,70	20,01 -1,46	31,07 -2,24
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,32 -0,03	6,66 2,15	2,04 -1,09	1,95 -2,47	6,66 2,15	24,19 15,17	33,90 20,80
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,31 0,00	3,47 -0,37	0,63 -0,08	0,99 -0,22	3,47 -0,37	10,19 -0,67	17,63 -0,96
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,65 -0,08	8,03 -0,59	3,05 0,00	4,76 -0,34	8,03 -0,59	20,12 -1,34	31,29 -2,02
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	5,53 0,68	7,24 0,84	7,48 0,31	7,97 -0,24	7,24 0,84	32,38 1,55	51,55 3,64
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,84 -0,02	6,14 -0,27	7,13 -0,04	8,03 -0,18	6,14 -0,27	30,17 -0,66	46,78 -1,13
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,28 -0,03	3,63 -0,21	0,64 -0,06	1,12 -0,09	3,63 -0,21	10,42 -0,44	17,94 -0,66
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	4,94 3.002,88	7,53 273,00	7,12 1.509,22	7,89 800,58	7,53 273,00	33,84 381,04	50,78 319,89
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,25 153,00	2,40 87,00	0,57 120,84	1,01 102,85	2,40 87,00	8,28 93,21	15,14 95,36
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,10 62,57	1,64 59,56	0,22 46,14	0,39 40,05	1,64 59,56	6,54 73,64	12,17 76,68
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	2,70 1,35	6,65 2,65	3,66 0,53	3,62 -0,79			
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,36 220,55	2,42 87,59	0,64 135,47	1,03 104,71	2,42 87,59	8,27 93,10	15,01 94,59
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	0,29 175,96	4,11 149,05	0,78 164,32	1,20 121,29	4,11 149,05		
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,20 -1,15	2,86 -1,66	0,38 -2,75	0,58 -3,83	2,86 -1,66	15,12 6,10	24,58 11,47
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	8,40	5,24	19,08	23,30	5,24	42,55	77,27

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.	-0,90	2,32	-6,72	-1,91	2,32	7,13	21,49
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	7,35 -1,95	7,18 4,27	19,29 -6,52	22,23 -2,98	7,18 4,27		
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	6,73 -2,57	13,80 10,89	17,90 -7,91	20,73 -4,48	13,80 10,89		
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	9,08 -0,22	2,38 -0,53	21,02 -4,79	21,77 -3,44	2,38 -0,53	54,11 18,69	78,18 22,40
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	8,02 -1,28	-2,01 -4,92	23,27 -2,53	19,81 -5,40	-2,01 -4,92	36,83 1,41	49,36 -6,42
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	6,30 -3,00	-4,87 -7,79	19,94 -5,87	22,34 -2,87	-4,87 -7,79	38,19 2,77	69,25 13,47
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA Var. SMALL CAP p.p.	6,18 -1,34	-3,98 -3,33	17,87 -4,68	19,12 -6,20	-3,98 -3,33	44,54 -12,62	
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	8,37 -0,93	2,14 -0,77	21,63 -4,18	22,49 -2,72	2,14 -0,77	37,94 2,52	60,14 4,37
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	9,37 0,43	3,05 4,05	25,03 -0,40	23,84 2,55	3,05 4,05	46,40 2,69	65,37 -1,26
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	7,67 -1,63	-7,93 -10,84	20,55 -5,26	18,48 -6,73	-7,93 -10,84	18,36 -17,06	38,53 -17,24
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	7,65 -1,65	1,18 -1,74	18,83 -6,98	18,56 -6,64	1,18 -1,74		
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI % do CDI	1,42 863,29	3,91 205,18	1,96 415,44	2,40 243,68			
BB PREV MULTIMERCADO FI LP % do CDI	1,10 668,88	2,01 73,00	1,91 405,52	1,07 108,79	2,01 73,00	11,22 126,36	18,95 119,39
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP % do CDI	3,14 1.910,46	11,19 405,81	11,27 2.390,50	19,33 1.960,20	11,19 405,81	46,52 523,75	
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	3,07 -6,23	12,58 9,67	11,36 -14,44	19,62 -5,59	12,58 9,67	48,60 13,18	44,75 -11,03
ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI % do CDI	3,06 1.858,33	12,93 468,85	11,36 2.409,28	20,06 2.033,92	12,93 468,85	49,53 557,69	45,37 285,83
FIA BRASIL IBX-50 Var. IBOVESPA p.p.	9,07 -0,23	1,51 -1,41	25,08 -0,72	24,45 -0,76	1,51 -1,41	31,39 -4,03	47,69 -8,09
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	8,75 -0,55	2,28 -0,64	24,40 -1,41	23,91 -1,29	2,28 -0,64	36,95 1,53	55,64 -0,14
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,69	54,76	1,31	16,49	54,76	108,09	129,28

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.	-8,60	51,85	-24,49	-8,72	51,85	72,67	73,50
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	0,35	44,45	1,33	16,88	44,45	98,40	
Var. IBOVESPA p.p.	-8,95	41,53	-24,48	-8,33	41,53	62,98	
COTIA	2,57	6,75	4,95	5,74	6,75	18,53	27,83
Var. IPCA + 5,85% p.p.	0,72	-3,85	0,34	-1,73	-3,85	-3,62	-6,24
CDI	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
INPC + 6%	1,98	11,75	4,85	8,23	11,75	23,79	35,66
IPCA + 6%	1,87	10,76	4,64	7,55	10,76	22,49	34,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

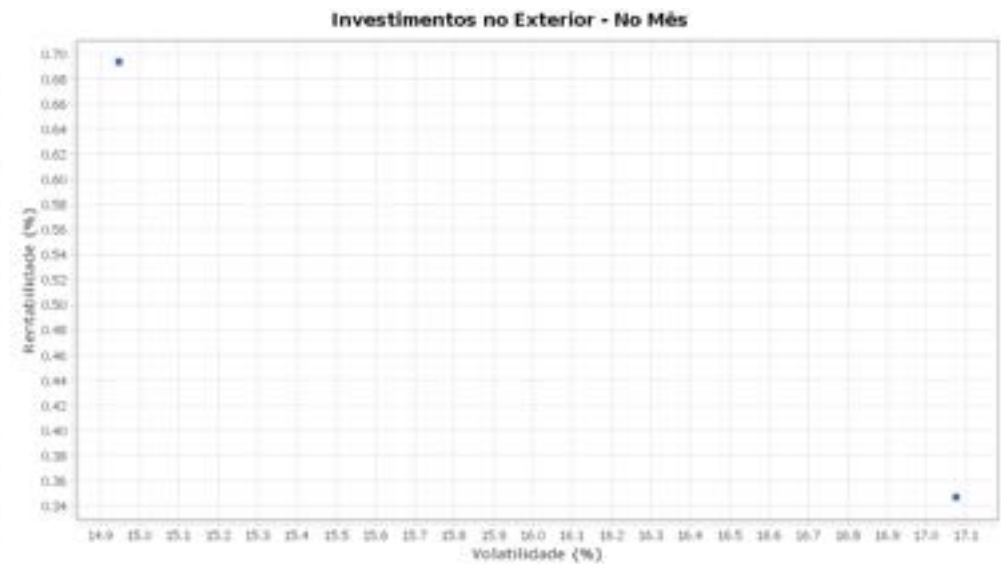
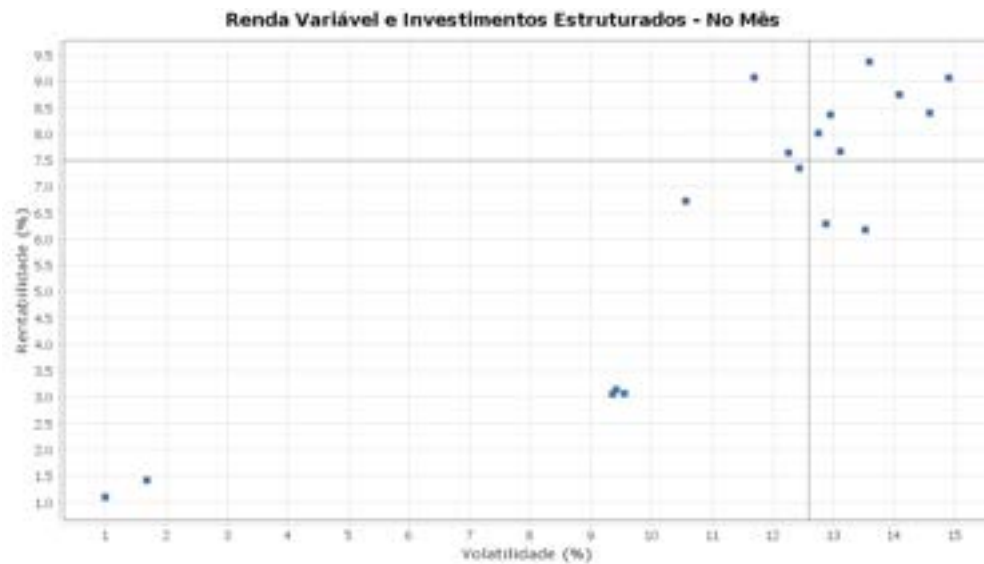
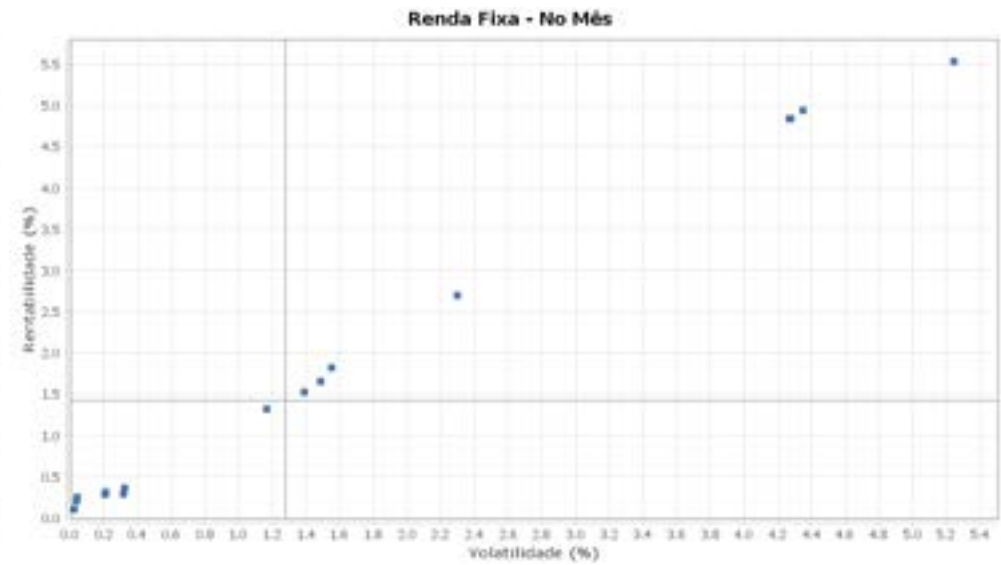
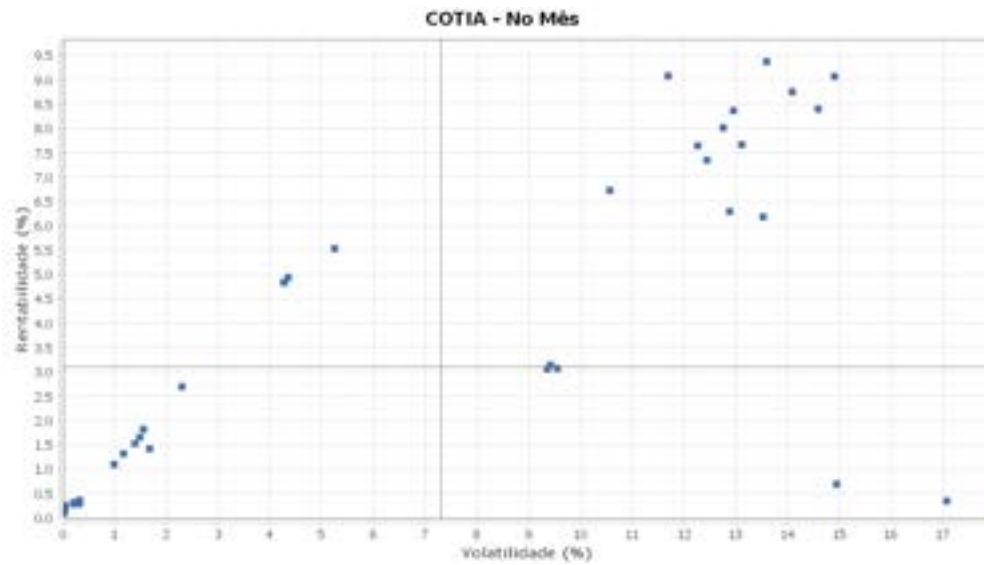
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
349	01/12/2020	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21.727,43	0,00	7.357,48881400	2,9531040480
367	01/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.500,00	3.550,81452600	2,1121914270
364	02/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.380,39	0,00	1.126,93754400	2,1122643510
368	03/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	17.818,50	8.435,35770700	2,1123585530
354	04/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	111.057,02	40.840,74589800	2,7192701200
359	04/12/2020	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	0,00	800.000,00	777.435,14623600	1,0290247410
369	04/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	190,00	89,94388100	2,1124282970
360	07/12/2020	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	54.609,22	0,00	8.589,78969500	6,3574571600
370	07/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.371,14	3.962,63165700	2,1125203460
371	08/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.680,00	3.161,87377200	2,1126713090
352	09/12/2020	BB PREV MULTIMERCADO FI LP	400.000,00	0,00	136.999,24620300	2,9197240940
372	09/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.009,91	1.424,63427300	2,1127597850
350	10/12/2020	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	400.000,00	0,00	131.606,68230700	3,0393593470
373	11/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.070,31	1.453,07875600	2,1129687480
351	14/12/2020	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	129.521,19	0,00	42.704,03812000	3,0329963090
374	14/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	15.433,79	7.304,08997300	2,1130339380
358	15/12/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	213.047,55	0,00	201.334,16428500	1,0581788280
365	15/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	518,82	0,00	245,52130100	2,1131364070
345	16/12/2020	BB AÇÕES DIVIDENDOS	500.000,00	0,00	27.119,95293700	18,4366101650
366	18/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.669,04	0,00	1.736,05829400	2,1134313360
375	21/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	76.087,92	36.000,19293900	2,1135420060
346	22/12/2020	BB AÇÕES DIVIDENDOS	49.882,74	0,00	2.740,82247700	18,1999164140
342	23/12/2020	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	3.856.271,00	0,00	210.416,61471644	18,3268370000
353	23/12/2020	BB PREV MULTIMERCADO FI LP	1.074.000,00	0,00	366.182,60230400	2,9329629350
361	23/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.568.813,00	4.428.996,32196200	2,6120620000
363	23/12/2020	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.856.271,00	0,00	2.927.787,58025000	1,3171280000
341	24/12/2020	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	536.600,00	0,00	167.200,78895341	3,2093150000
343	24/12/2020	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	536.600,00	0,00	3.673,17398400	146,0861920000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
347	24/12/2020	BB AÇÕES DIVIDENDOS	1.072.415,00	0,00	58.286,63686500	18,3989857310
339	28/12/2020	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	615.000,00	0,00	280.084,87254772	2,1957630000
340	28/12/2020	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	615.000,00	0,00	324.993,93608875	1,8923430000
348	28/12/2020	BB AÇÕES DIVIDENDOS	58.962,00	0,00	3.175,48762500	18,5678569600
362	28/12/2020	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	916.424,17	0,00	734.999,17791900	1,2468370000
376	28/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	89.456,62	42.317,61355300	2,1139334780
344	29/12/2020	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	3.856.271,00	0,00	15.906,39385300	242,4352770000
355	29/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	1.960.935,40	719.727,10728100	2,7245540430
377	29/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	16.259,38	7.691,00083500	2,1140785640
356	30/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	206.995,03	75.963,27904800	2,7249354240
378	30/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	75.288,93	35.611,57813300	2,1141699960
357	31/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	281.153,99	0,00	122.147,06742200	2,3017661900
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 19.425.293,60

Value-At-Risk: 2,44%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,06	0,00	-2,62	0,10	1.810.283,78	0,23
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,26	0,00	1,02	0,20	4.805.987,05	0,60
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,09	0,00	2,04	0,25	13.828.243,68	1,74
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,21	0,15	0,01	0,58	0,28	80.934.254,50	10,18
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,21	0,17	0,00	0,70	0,31	34.445.128,39	4,33
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,32	0,24	0,00	0,39	0,29	10.084.363,43	1,27
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,32	0,13	0,00	0,61	0,36	8.888.882,61	1,12
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	Artigo 8º III	0,99	0,88	0,01	0,95	1,10	12.933.406,69	1,63
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,17	1,25	0,11	0,99	1,32	105.153.289,33	13,22
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,39	0,94	0,03	0,98	1,53	37.066.627,45	4,66
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,49	1,10	0,05	1,00	1,65	58.782.359,82	7,39
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,55	1,06	0,11	1,07	1,82	135.077.079,31	16,99
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	Artigo 8º III	1,67	1,04	0,00	0,75	1,42	3.058.504,06	0,38
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	2,30	1,49	0,02	1,10	2,70	16.268.303,62	2,05
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,27	2,56	0,08	1,09	4,84	35.675.468,26	4,49
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,28	2,57	0,07	1,09	4,84	30.627.714,61	3,85
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	4,35	2,77	0,01	1,10	4,94	4.513.651,86	0,57
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	5,25	3,20	0,02	1,02	5,53	8.984.789,58	1,13
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	Artigo 8º III	9,36	8,24	0,03	0,31	3,06	3.899.473,10	0,49
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	9,42	8,35	0,03	0,32	3,14	3.900.501,09	0,49
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	9,55	8,13	0,03	0,30	3,07	3.858.669,57	0,49
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	10,56	9,45	0,05	0,62	6,73	4.762.294,73	0,60
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	11,69	12,04	0,19	0,76	9,08	14.370.395,05	1,81
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	12,26	10,40	0,07	0,61	7,65	5.926.439,07	0,75
ITAU INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	12,44	10,04	0,11	0,58	7,35	9.183.028,77	1,15
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	12,75	10,01	0,06	0,62	8,02	5.700.829,76	0,72
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	12,88	10,36	0,04	0,48	6,30	3.666.245,27	0,46
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	12,95	9,81	0,05	0,63	8,37	4.732.333,62	0,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	13,11	9,98	0,21	0,57	7,67	18.348.686,98	2,31
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	13,52	10,24	0,04	0,44	6,18	3.298.340,52	0,41
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	13,59	9,81	0,16	0,68	9,37	14.944.934,53	1,88
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	14,09	10,65	0,27	0,61	8,75	21.623.698,12	2,72
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	14,59	11,64	0,11	0,56	8,40	8.473.563,95	1,07
FIA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	14,90	11,04	0,15	0,60	9,07	11.681.745,98	1,47
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	14,95	12,70	0,19	0,04	0,69	31.851.735,48	4,01
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	17,07	11,15	0,12	0,01	0,35	22.015.288,32	2,77