



LDB
EMPRESAS

GUARULHOS
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 18.01.2021.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

62,19%

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-M	6,08	1,96	6,40	2.054.914,49	0,46	8.554.614.280,00	0,02
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,57	0,31	3,47	12.580.937,75	2,84	8.522.749.810,66	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,80	4,84	6,06	9.527.242,88	2,15	6.193.173.925,17	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,55	0,28	3,63	12.644.556,24	2,85	16.753.976.831,37	0,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,02	1,82	7,75	3.942.848,38	0,89	20.761.505.098,56	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,13	1,65	8,03	7.095.100,30	1,60	10.655.087.063,09	0,07
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,23	3,24	10,18	20.866.926,36	4,71	941.494.565,53	2,22
BB	BB	BB PREV RF IPCA	6,10	1,97	8,65	7.608.813,31	1,72	351.497.044,54	2,16
BB	BB	BB PREV RF VII	2,43	1,21	5,61	356.613,98	0,08	245.863.748,76	0,15
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	4,92	1,21	8,29	6.821.511,86	1,54	203.620.845,38	3,35
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,27	2,38	5,09	13.611.660,49	3,07	9.568.490.825,39	0,14
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	1,32	6,66	36.745.755,94	8,29	14.722.139.597,34	0,25
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	14,68	5,56	14,59	17.245.648,95	3,89	1.813.956.117,79	0,95
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,71	2,53	8,75	4.402.235,00	0,99	470.598.208,00	0,94
CEF	CEF	CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	13,90	5,52	9,33	7.735.703,84	1,75	383.439.882,64	2,02
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			5,92	2,40	6,97	163.240.469,77	36,83		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON INFLAÇÃO REFERENCIADO IMA-B FI RF LP	13,14	5,01	4,56	6.273.838,16	1,42	131.500.462,15	4,77
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			13,14	5,01	4,56	6.273.838,16	1,42		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	14,06	5,01	4,57	3.137.172,06	0,71	262.576.035,48	1,19
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,32	0,18	1,54	11.272.409,00	2,54	422.999.839,93	2,66
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	5,97	2,08	5,84	10.592.770,84	2,39	763.957.366,29	1,39
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	16,78	6,48	8,59	30.901.908,37	6,97	615.393.709,47	5,02
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,23	0,25	2,40	4.672.105,41	1,05	2.596.482.307,62	0,18
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	0,10	1,64	10.663.582,32	2,41	2.452.222.466,54	0,43
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,06	0,09	1,90	96.683,14	0,02	910.358.895,05	0,01
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,66	0,20	2,86	11.826.465,76	2,67	3.882.685.363,65	0,30
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	5,75	1,96	8,24	22.947.508,62	5,18	647.244.636,29	3,55
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			4,66	2,74	4,77	106.110.605,52	23,94		
Renda Fixa			5,28	2,58	5,97	275.624.913,45	62,19		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

28,92%

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
BRAM	BEM	BRANCO F I A SELECTION	44,35	7,90	-3,67	3.548.418,78	0,80	831.343.765,94	0,43
VINCI	BEM	VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	37,91	8,92	4,17	14.190.539,21	3,20	806.271.431,95	1,76
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	41,21	6,28	14,03	4.561.370,96	1,03	1.217.691.164,96	0,37
QUELUZ	BEM	QUELUZ VALOR FI EM ACOES	42,78	4,17	7,00	2.639.898,22	0,60	126.804.718,84	2,08
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	42,43	7,12	-7,00	13.279.352,36	3,00	315.811.586,46	4,20
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	38,86	7,88	9,26	17.670.532,31	3,99	567.847.062,72	3,11
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	42,06	4,26	4,26	3.105.965,92	0,70	1.060.739.165,08	0,29
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FIA	42,62	9,20	3,48	12.133.173,59	2,74	1.706.184.417,35	0,71
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	46,52	6,93	46,82	14.076.192,96	3,18	556.827.248,63	2,53
BB	BB	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	46,26	0,96	0,96	2.019.131,78	0,46	589.515.875,21	0,34
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			40,44	7,78	0,78	87.224.576,09	19,68		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	33,38	3,19	11,55	10.657.034,65	2,40	1.201.804.027,43	0,89
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	32,77	3,07	40,03	23.834.904,79	5,38	734.034.454,86	3,25
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO	2,29	1,08	1,98	5.059.978,91	1,14	134.791.131,54	3,75
Sub-total Artigo 8º III			19,27	2,89	31,82	39.551.918,35	8,92		

Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	CEF	RBBV11	14,61	2,48	13,29	1.424.550,00	0,32	126.230.937,11	1,13
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			14,61	2,48	13,29	1.424.550,00	0,32		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

38,03

6,28

0,57

128.201.044,44

28,92

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

8,89%

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 DIVERSIFIED DYNAMIC FIM - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	8,07	1,21	4,15	2.499.533,14	0,56	106.411.559,48	2,35
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	29,05	1,53	1,03	4.313.893,08	0,97	180.785.683,23	2,39
XP	BNP PARIBAS	ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	16,08	3,26	3,26	3.097.858,96	0,70	112.286.004,88	2,76
BB	BB	BB MULTIMERCADO SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	28,07	5,93	5,93	5.296.656,65	1,20	605.059.504,45	0,88
MONGERAL	BEM	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,49	7,31	7,31	2.146.292,88	0,48	8.539.933,63	25,13
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	29,49	0,18	6,44	7.158.045,98	1,62	1.275.079.811,13	0,56
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR	12,14	1,23	5,49	9.639.988,90	2,17	1.063.404.162,53	0,91
Sub-total Artigo 9º A, II			12,98	1,67	5,76	34.152.269,59	7,71		

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
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	33,07	4,83	4,83	5.241.529,15	1,18	1.875.936.369,20	0,28
Sub-total Artigo 9º A, III			33,07	4,83	4,83	5.241.529,15	1,18		
Investimentos no Exterior			13,00	1,82	5,91	39.393.798,74	8,89		
Total			9,60	3,63	6,94	443.219.756,63	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	163.240.469,77	36,83	20,00	50,00	90,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	6.273.838,16	1,42	0,00	0,00	15,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	106.110.605,52	23,94	5,00	20,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	275.624.913,45	62,19				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	87.224.576,09	19,68	0,00	20,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	39.551.918,35	8,92	0,00	2,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.424.550,00	0,32	0,00	1,00	3,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	128.201.044,44	28,92				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	34.152.269,59	7,71	0,00	3,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	5.241.529,15	1,18	0,00	1,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	39.393.798,74	8,89				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades por Artigo

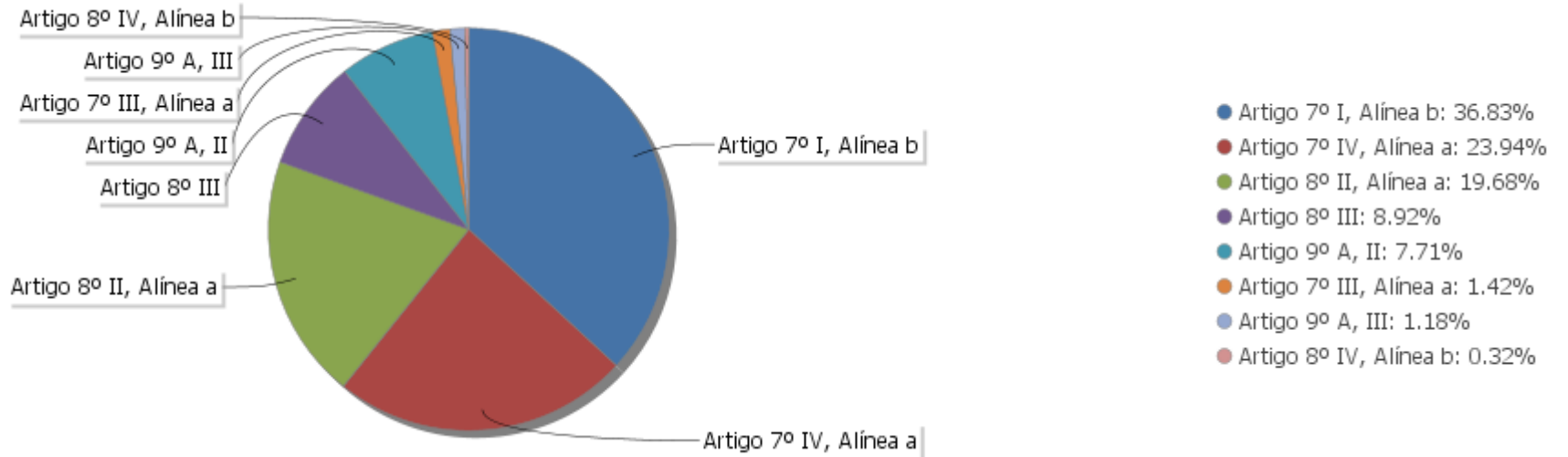
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	2,40 1.461,48	6,97 252,82	3,48 737,10	3,80 385,50	6,97 252,82	3.956.382,42	10.195.995,79
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	5,01 3.046,25	4,56 692,11	7,14 1.514,26			299.301,74	273.838,16
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	2,74 1.665,85	4,77 173,08	3,43 726,79	3,26 330,44	4,77 173,08	2.743.243,88	5.008.115,61
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	-4,67 -169,50	0,00 0,00	0,00 0,00	-4,67 -169,50	0,00	-162.937,74
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	7,78 -1,52	0,78 -2,14	20,09 -5,72	20,43 -4,78	0,78 -2,14	5.948.303,25	7.856.704,34
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,89 -6,40	31,82 28,91	10,12 -15,69	18,29 -6,92	31,82 28,91	895.869,47	3.207.344,37
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	2,48 -6,81	13,29 10,37	3,93 -21,88	5,21 -20,00	13,29 10,37	34.645,22	170.561,53
Artigo 9º A, II % do CDI	1,67 1.014,51	5,76 208,81	5,24 1.111,18	9,45 958,59	5,76 208,81	765.702,56	1.663.005,59
Artigo 9º A, III % do CDI	4,83 4.972,63	4,83 4.972,63				241.529,15	241.529,15
GUARULHOS - CONSOLIDADO (Total)						14.884.977,69	28.454.156,80

Análise de Liquidez

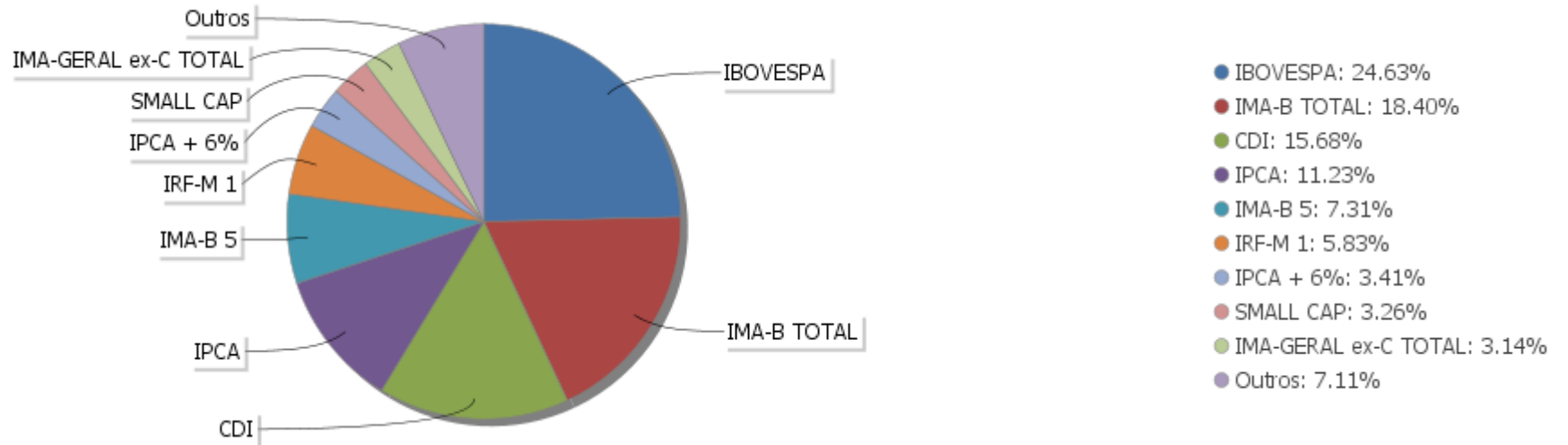
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	372.300.633,53	84,00	372.300.633,53	84,00
de 31 a 364 dias	43.994.245,11	9,93	416.294.878,64	93,93
acima de 365 dias	26.924.877,99	6,07	443.219.756,63	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

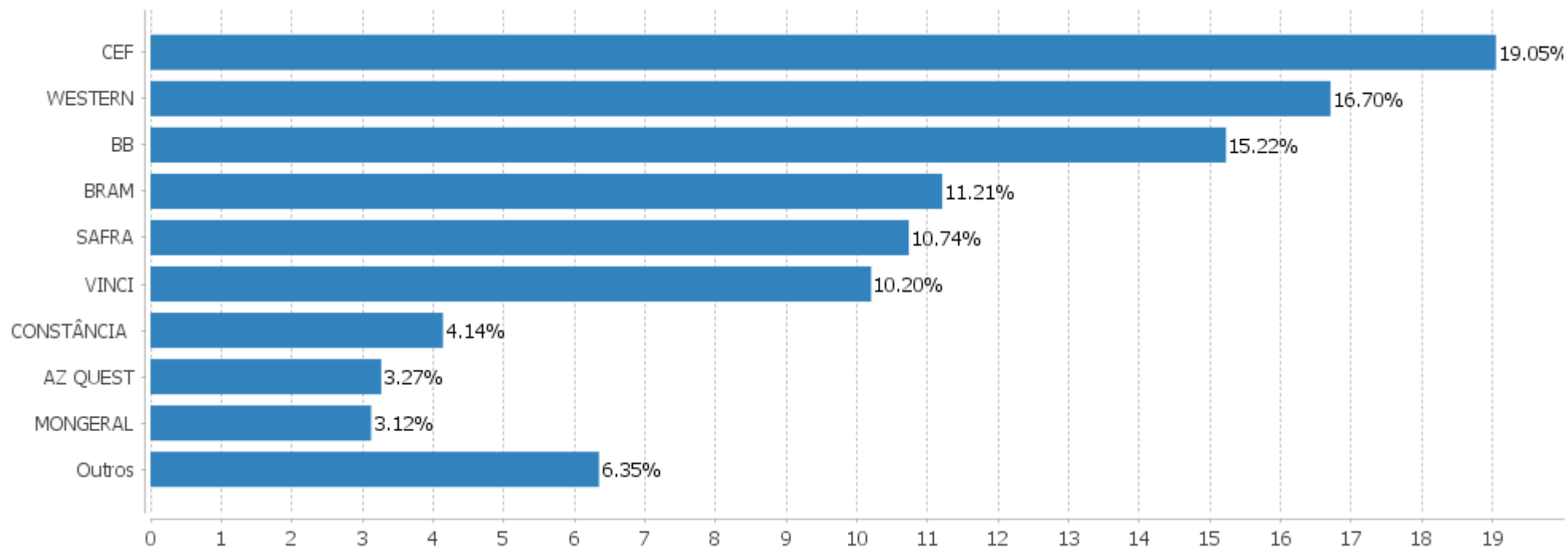


Alocação Por Estratégia



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	0,53	-0,88	-6,05	2,01	2,03	2,14	3,14	-1,11	-1,67	-0,41	3,82	3,63	6,94
INPC + 5,88%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,97	0,84	1,35	1,37	1,41	1,97	11,62
p.p. indexador	-0,16	-1,46	-6,73	1,78	1,83	1,36	2,17	-1,95	-3,02	-1,78	2,41	1,66	-4,69
2019	2,07	0,41	0,50	0,79	1,47	1,74	0,86	0,16	1,41	1,46	-0,04	2,38	14,00
INPC + 6%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,44	0,57	1,01	1,71	10,78
p.p. indexador	1,20	-0,59	-0,71	-0,30	0,81	1,29	0,23	-0,47	0,98	0,88	-1,05	0,67	3,22
2018	2,20	0,71	1,15	0,15	-1,66	0,02	1,59	-0,00	0,57	3,13	0,57	0,96	9,71
INPC + 6%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	0,74	0,91	0,21	0,60	9,59
p.p. indexador	1,46	0,11	0,59	-0,55	-2,57	-1,91	0,83	-0,53	-0,17	2,21	0,36	0,36	0,12

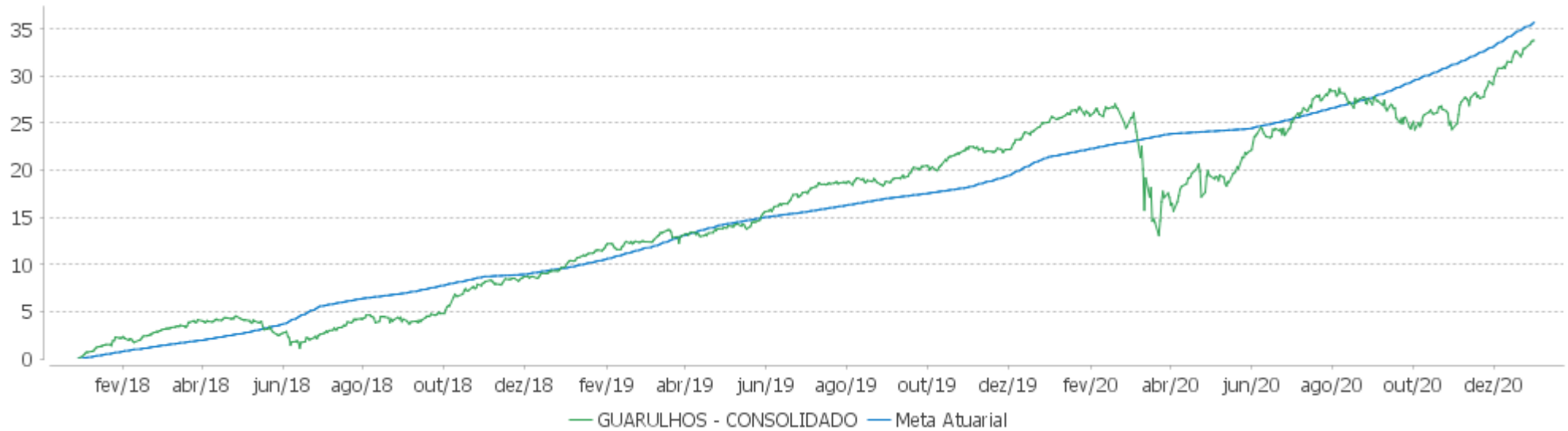
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

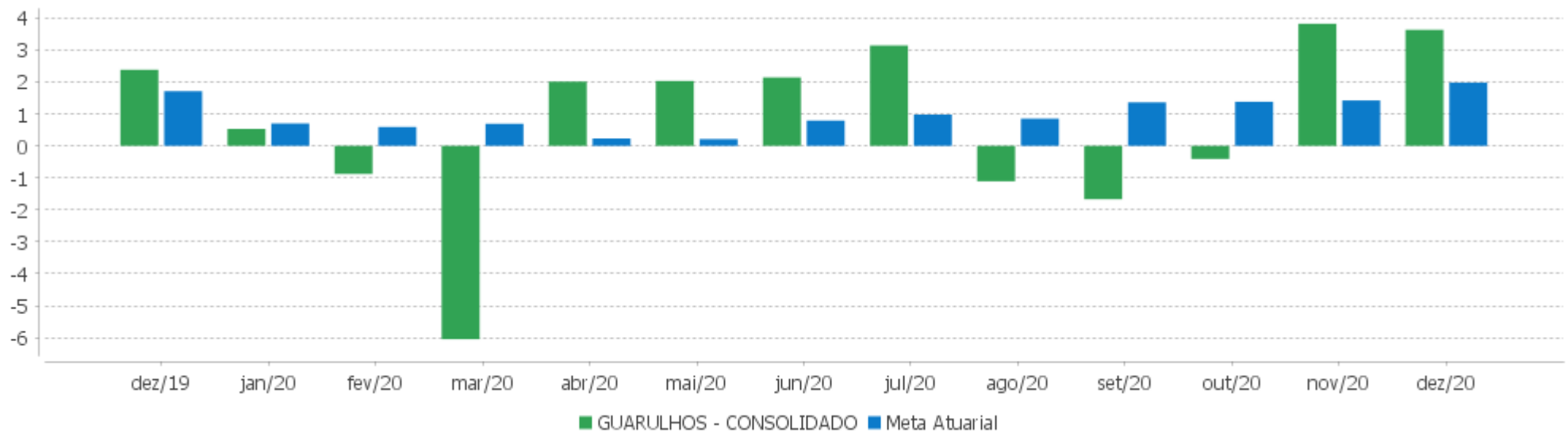
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	20	55,56	03 meses	7,14	4,82	2,32	5,39
Meses abaixo da Meta Atuarial	16	44,44	06 meses	7,45	8,16	-0,71	5,64
			12 meses	6,94	11,62	-4,69	9,60
			24 meses	21,90	23,65	-1,75	6,99
			36 meses	33,75	35,51	-1,76	5,96
Maior rentabilidade da Carteira	3,82	2020-11	Desde 29/12/2017	33,75	35,51	-1,76	5,96
Menor rentabilidade da Carteira	-6,05	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
BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO % do CDI	0,18 111,15	2,15 78,09	0,34 72,79	0,54 54,89	2,15 78,09	7,95 89,53	14,58 91,84
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	6,48 1,62	8,59 2,18	8,48 1,30	8,63 0,43	8,59 2,18	36,64 5,81	56,55 8,64
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	1,96 1.190,78	8,24 298,88	1,69 357,50	1,63 165,69	8,24 298,88	20,80 234,23	34,44 216,97
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	5,01 0,16	5,88 -0,52	7,13 -0,05	8,01 -0,19	5,88 -0,52	30,88 0,05	47,49 -0,42
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
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	2,08 0,05	5,84 0,50	3,03 0,17	3,77 0,37	5,84 0,50	19,49 0,65	31,49 0,73
ITAU 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
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,09 54,66	1,90 68,94	0,26 54,98	0,55 56,20	1,90 68,94	7,07 79,61	13,01 81,96
MONGERAL AEGON INFLAÇÃO REFERENCIADO IMA-B FI RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	5,01 0,16	6,40 -0,01	7,14 -0,03	7,88 -0,33	6,40 -0,01	30,82 -0,01	46,76 -1,15
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	3,24 1,41	10,18 2,15	4,43 1,05	5,13 0,41	10,18 2,15	27,76 5,51	42,78 8,47
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
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	1,21 -0,62	8,29 0,25	2,90 -0,48	4,76 0,04	8,29 0,25	23,53 1,28	36,58 2,27
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 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 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,53 -2,32	8,75 2,35	3,93 -3,24	4,70 -3,50	8,75 2,35	27,80 -3,03	42,85 -5,06
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	5,56	7,60	7,57	8,15	7,60	33,23	

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.	0,71	1,19	0,39	-0,06	1,19	2,41	
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,21 -3,65	5,61 -0,79	2,89 -4,28	3,91 -4,30	5,61 -0,79	16,66 -14,17	28,09 -19,82
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	2,38 0,26	5,09 0,24	3,17 0,34	3,28 0,19	5,09 0,24	18,83 0,74	30,59 0,94
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6% p.p.	1,97 0,10	8,65 -2,11	2,92 -1,72	4,45 -3,11	8,65 -2,11	25,73 3,24	39,91 5,27
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
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
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
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,96 0,01	6,40 -0,30	1,99 0,00	1,64 -0,11	6,40 -0,30	18,94 -0,59	31,47 -0,89
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	5,52 0,67	9,33 2,92	8,24 1,06	8,48 0,27	9,33 2,92	34,72 3,89	53,12 5,21
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	3,19 1.939,35	12,17 441,42	11,55 2.449,51	19,85 2.012,61	12,17 441,42	48,40 544,90	44,80 282,22
MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO % do CDI	1,08 658,80	2,66 96,56	2,14 454,58	2,35 238,51	2,66 96,56	8,83 99,44	
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
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	6,28 -3,01	-6,23 -9,14	18,58 -7,22	15,16 -10,05	-6,23 -9,14	41,49 6,07	73,82 18,04
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	7,90 -1,39	-3,67 -6,59	20,63 -5,17	27,64 2,43	-3,67 -6,59	22,88 -12,54	54,93 -0,85
VINCI MOSAICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	9,20 -0,10	3,48 0,56	21,18 -4,63	22,19 -3,01	3,48 0,56	54,75 19,33	77,64 21,86
VINCI SELECTION EQUITIES FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,88 -1,42	9,26 6,34	18,34 -7,47	19,95 -5,26	9,26 6,34	46,62 11,20	75,00 19,22
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA Var. SMALL CAP p.p.	6,93 -0,59	-4,03 -3,38	16,98 -5,57	21,32 -4,01	-4,03 -3,38		
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	10,42 1,13	14,03 11,11	28,14 2,33	31,99 6,79	14,03 11,11		
OCCAM FIC FIA	10,11	7,87	22,82	24,40	7,87	46,10	79,48

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.	0,81	4,95	-2,99	-0,80	4,95	10,68	23,71
VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	8,92	4,17	24,83	23,91	4,17	48,77	63,82
Var. IBOVESPA p.p.	-0,38	1,25	-0,98	-1,30	1,25	13,35	8,04
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	7,12	-7,00	20,98	15,84	-7,00	25,62	51,04
Var. IBOVESPA p.p.	-2,18	-9,92	-4,82	-9,37	-9,92	-9,80	-4,74
QUELUZ VALOR FI EM ACOES	4,17	-8,47	14,98	15,89	-8,47	24,45	43,45
Var. IBOVESPA p.p.	-5,13	-11,39	-10,83	-9,31	-11,39	-10,97	-12,33
RBBV11	2,48	13,29	3,93	5,21	13,29	41,23	72,80
Var. IFIX p.p.	0,29	23,53	1,23	2,93	23,53	19,18	43,89
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1,23	5,49	5,72	9,17	5,49	25,39	
Var. INPC + 6% p.p.	-0,75	-6,26	0,87	0,95	-6,26	1,60	
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1,53	75,99	3,86	18,56	75,99	141,02	
Var. IBOVESPA p.p.	-7,77	73,08	-21,95	-6,65	73,08	105,60	
ACCESS DIVERSIFIED DYNAMIC FIM - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1,21	-0,17	4,83	7,11	-0,17	21,87	
% do CDI	738,09	-6,21	1.024,22	720,97	-6,21	246,23	
BB MULTIMERCADO SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	0,24	55,99	4,05	20,15	55,99	102,81	115,50
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,64	8,58	-1,31	3,31	8,58	12,59	17,60
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	7,42	16,76	20,15				
Var. MSCI ACWI p.p.	5,53	13,85	14,79				
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	0,18	91,31	2,70	25,96	91,31		
Var. IPCA + 6% p.p.	-1,69	80,54	-1,94	18,41	80,54		
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2,31	6,40					
Var. MSCI ACWI p.p.	0,43	3,58					
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	
GUARULHOS - CONSOLIDADO	3,63	6,94	7,14	7,45	6,94	21,90	33,75
Var. INPC + 6% p.p.	1,65	-4,81	2,29	-0,77	-4,81	-1,89	-1,91
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
622	01/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	100.000,00	47.344,19367600	2,1121914270
644	01/12/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	80.343,02	0,00	23.415,00180000	3,4312626000
604	02/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	777,24	0,00	367,96530600	2,1122643510
646	02/12/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	16.200,02	4.720,89940000	3,4315537000
614	03/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	40.386,77	0,00	19.119,27780500	2,1123585530
623	03/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	20.377,57	9.646,83290700	2,1123585530
647	03/12/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	97,55	28,42530000	3,4317947000
635	03/12/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	725.485,28	211.401,13070000	3,4317947000
605	03/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	22.499,33	0,00	10.651,28359300	2,1123585530
621	04/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	60,00	0,00	28,40333000	2,1124282970
648	04/12/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	14.190,33	4.134,63580000	3,4320628000
636	04/12/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	862.773,63	251.386,31780000	3,4320628000
608	04/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.500.159,54	1.183.547,64682400	2,1124282970
592	04/12/2020	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	2.500.000,00	0,00	646.212,75769250	3,8686949000
616	07/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	4.941,56	0,00	2.339,17747000	2,1125203460
624	09/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	35.899,94	16.991,96484800	2,1127597850
637	09/12/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	1.033.100,41	300.931,89210000	3,4330041000
638	09/12/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	3.690.237,60	1.074.929,56380000	3,4330041000
609	09/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.500.000,00	3.549.859,31351400	2,1127597850
657	10/12/2020	ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	3.000.000,00	0,00	26.532,28636719	113,0697882000
655	10/12/2020	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.000.000,00	0,00	2.017.240,14114220	0,9914536000
625	10/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	68.592,93	32.464,54981500	2,1128563430
618	10/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	38.486,52	18.215,39837600	2,1128563430
649	10/12/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	304,41	88,66460000	3,4332733000
610	10/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	237.404,00	112.361,63820900	2,1128563430
603	10/12/2020	BB PREV RF IRF-M	0,00	9.817.771,44	1.610.002,46422300	6,0979853470
597	10/12/2020	OCCAM FIC FIA	2.500.000,00	0,00	744.518,97046240	3,3578728000
656	11/12/2020	BB MULTIMERCADO SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	5.000.000,00	0,00	1.196.438,09219500	4,1790712220

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
619	11/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	22.728,80	10.756,80841100	2,1129687480
631	11/12/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	6.772.578,91	0,00	1.972.478,79080000	3,4335370000
606	11/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	456.604,98	0,00	216.096,41904600	2,1129687480
594	11/12/2020	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	5.000.000,00	0,00	8.981,22264300	556,7170750000
640	14/12/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	5.523.119,15	1.608.466,64540000	3,4337791000
639	14/12/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	712.515,77	207.501,92620000	3,4337791000
650	14/12/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	121,90	35,50020000	3,4337791000
620	15/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.566.051,84	1.214.333,26854800	2,1131364070
626	15/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	53.786,46	25.453,37812600	2,1131364070
615	15/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	20.702,62	9.797,10535000	2,1131364070
651	15/12/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	13.629,08	3.968,80430000	3,4340519000
611	15/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	59.810,39	28.304,08382600	2,1131364070
632	16/12/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	5.200.000,00	0,00	1.514.068,24160000	3,4344555000
652	17/12/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	5.692,14	1.657,23590000	3,4347191000
627	18/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.840,88	1.344,20264900	2,1134313360
653	21/12/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	4.496,18	1.308,88860000	3,4351126000
633	22/12/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	54.973,96	0,00	16.002,02170000	3,4354384000
628	23/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	250.000,00	118.270,31902700	2,1138016880
641	23/12/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	23,49	6,83670000	3,4358612000
607	23/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	7.956.172,03	0,00	3.763.916,01689300	2,1138016880
600	23/12/2020	CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	500.000,00	0,00	275.542,36381180	1,8146030000
602	24/12/2020	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	2.000.000,00	0,00	755.207,04410200	2,6482803830
601	24/12/2020	BRADESCO F I A SELECTION	500.000,00	0,00	508,40693990	983,4641518000
629	28/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	135.858,73	64.268,21440400	2,1139334780
643	28/12/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	3.254.368,01	947.021,31600000	3,4364253000
654	28/12/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	5.813,78	1.691,81030000	3,4364253000
642	28/12/2020	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	1.250.877,05	364.005,30870000	3,4364253000
612	28/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.132.776,37	1.955.017,22878800	2,1139334780
598	28/12/2020	OCCAM FIC FIA	500.000,00	0,00	142.664,32997710	3,5047303000
593	28/12/2020	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	2.000.000,00	0,00	511.662,09671400	3,9088297000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

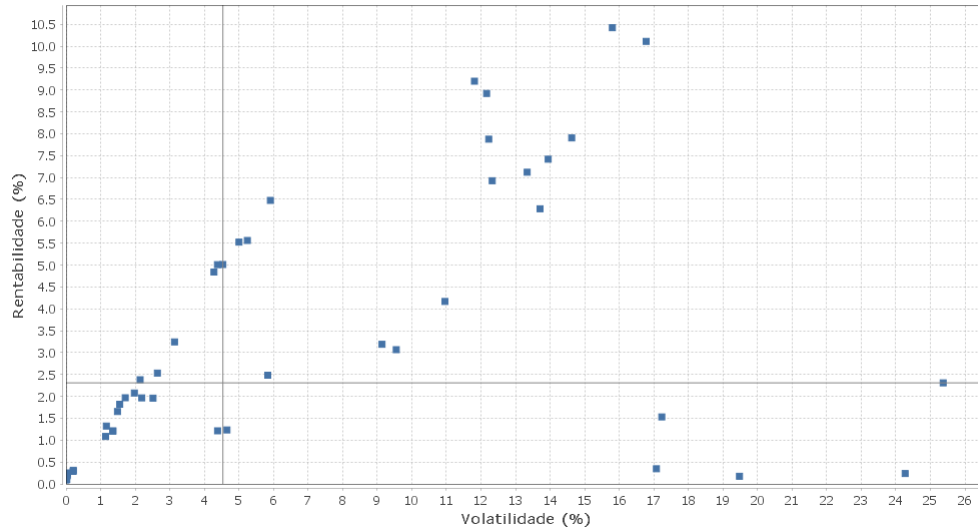
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
613	29/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.500.000,00	1.182.548,29435900	2,1140785640
599	29/12/2020	MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO	2.000.000,00	0,00	937.995,98003060	2,1322053000
595	29/12/2020	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	2.000.000,00	0,00	8.249,62449600	242,4352770000
617	30/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.600.000,00	0,00	1.229.797,03851500	2,1141699960
630	30/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	90.429,01	42.772,81872800	2,1141699960
634	30/12/2020	BRADERCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	9.130.000,00	0,00	2.656.410,96120000	3,4369682000
645	30/12/2020	BRADERCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	16.199,42	0,00	4.713,28770000	3,4369682000
596	30/12/2020	QUELUZ VALOR FI EM ACOES	500.000,00	0,00	159.879,29496940	3,1273593000

Total

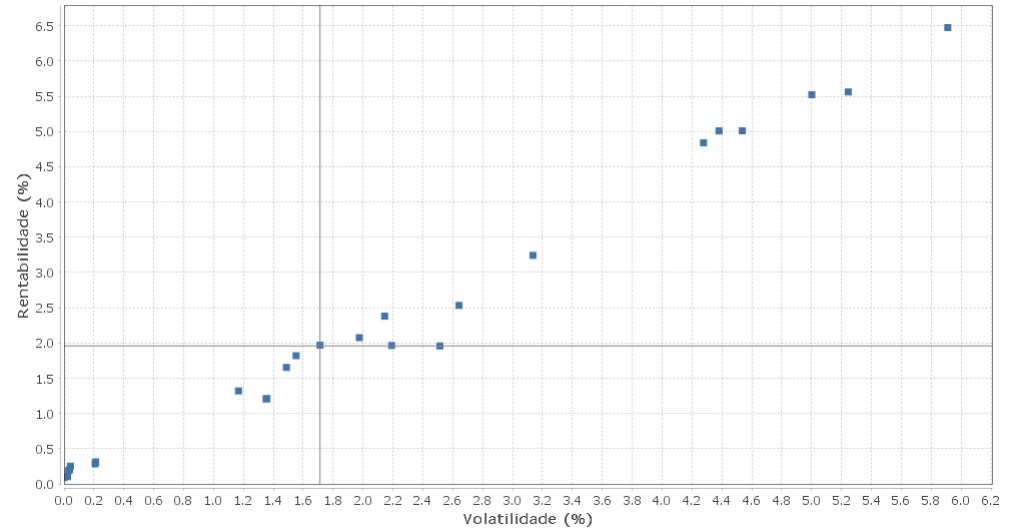
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

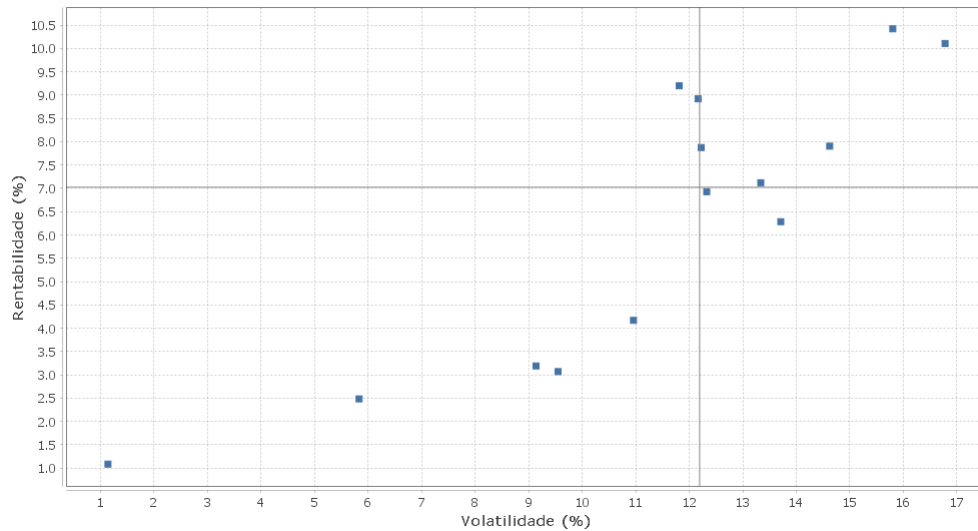
GUARULHOS - CONSOLIDADO - No Mês



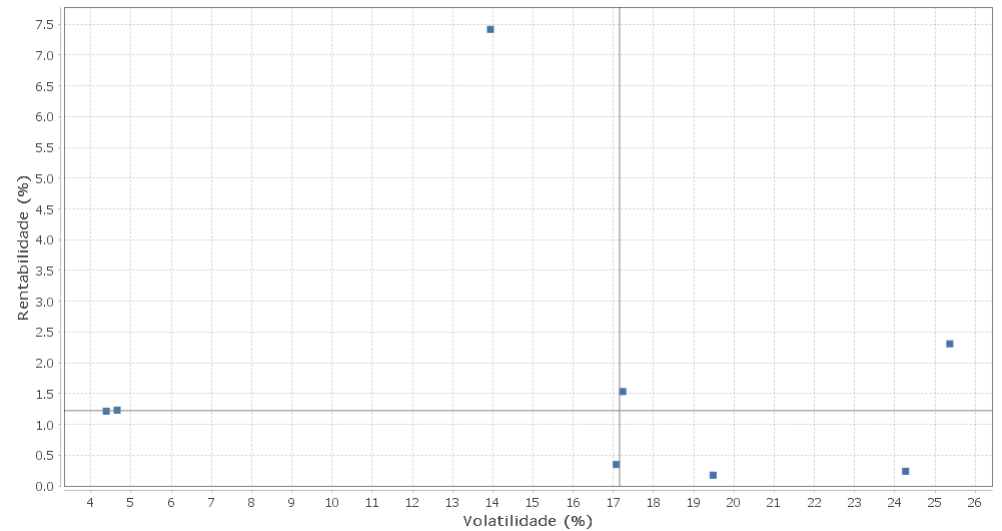
Renda Fixa - No Mês



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\$): 13.962.983,94

Value-At-Risk: 3,15%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	-87,26	0,09	96.683,14	0,02
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,06	0,00	-2,62	0,10	10.663.582,32	2,41
BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,14	0,00	0,65	0,18	11.272.409,00	2,54
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,26	0,00	1,02	0,20	11.826.465,76	2,67
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,09	0,00	2,04	0,25	4.672.105,41	1,05
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,21	0,15	0,00	0,58	0,28	12.644.556,24	2,85
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,21	0,17	0,00	0,70	0,31	12.580.937,75	2,84
MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	1,14	0,82	0,01	0,80	1,08	5.059.978,91	1,14
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,17	1,25	0,07	0,99	1,32	36.745.755,94	8,29
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,35	1,11	0,00	0,77	1,21	356.613,98	0,08
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	Artigo 7º I, Alínea b	1,36	1,11	0,01	0,77	1,21	6.821.511,86	1,54
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,49	1,10	0,01	1,00	1,65	7.095.100,30	1,60
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,55	1,06	0,01	1,07	1,82	3.942.848,38	0,89
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	1,71	1,45	0,01	1,05	1,97	7.608.813,31	1,72
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	1,97	1,10	0,02	0,97	2,08	10.592.770,84	2,39
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,14	1,33	0,03	1,03	2,38	13.611.660,49	3,07
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	1,39	0,00	0,82	1,96	2.054.914,49	0,46
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	2,51	1,40	0,04	0,71	1,96	22.947.508,62	5,18
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,64	1,71	0,01	0,90	2,53	4.402.235,00	0,99
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,14	1,87	0,06	0,98	3,24	20.866.926,36	4,71
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,28	2,57	0,04	1,09	4,84	9.527.242,88	2,15
MONGERAL AEGON INFLAÇÃO REFERENCIADO IMA-B FI RF LP	Artigo 7º III, Alínea a	4,38	2,67	0,03	1,11	5,01	6.273.838,16	1,42
ACCESS DIVERSIFIED DYNAMIC FIM - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	4,38	1,93	0,00	0,24	1,21	2.499.533,14	0,56
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	4,54	2,69	0,01	1,07	5,01	3.137.172,06	0,71
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	4,65	2,86	0,02	0,23	1,23	9.639.988,90	2,17
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,00	2,83	0,03	1,07	5,52	7.735.703,84	1,75
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,24	3,20	0,08	1,03	5,56	17.245.648,95	3,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RBBV11	Artigo 8º IV, Alínea b	5,83	1,42	0,00	0,40	2,48	1.424.550,00	0,32
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	5,91	3,40	0,16	1,07	6,48	30.901.908,37	6,97
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	9,14	8,26	0,15	0,33	3,19	10.657.034,65	2,40
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	9,55	8,13	0,32	0,30	3,07	23.834.904,79	5,38
QUELUZ VALOR FI EM ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	10,96	11,26	0,06	0,37	4,17	2.639.898,22	0,60
VINCI MOSAICO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	11,81	12,14	0,30	0,76	9,20	12.133.173,59	2,74
VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	12,16	9,72	0,28	0,72	8,92	14.190.539,21	3,20
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,22	9,46	0,35	0,63	7,88	17.670.532,31	3,99
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,33	11,25	0,32	0,55	6,93	14.076.192,96	3,18
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	Artigo 8º II, Alínea a	13,34	10,12	0,28	0,52	7,12	13.279.352,36	3,00
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	13,71	9,31	0,09	0,45	6,28	4.561.370,96	1,03
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	13,94	8,28	0,04	0,52	7,42	3.097.858,96	0,70
BRDESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	14,62	11,06	0,08	0,53	7,90	3.548.418,78	0,80
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	15,80	11,34	0,05	0,65	10,42	2.019.131,78	0,46
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	16,78	11,09	0,07	0,59	10,11	3.105.965,92	0,70
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	17,07	11,15	0,04	0,01	0,35	5.241.529,15	1,18
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	17,23	12,05	0,03	0,08	1,53	4.313.893,08	0,97
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	19,48	12,29	0,01	0,00	0,18	7.158.045,98	1,62
BB MULTIMERCADO SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	Artigo 9º A, II	24,27	11,39	-0,00	0,00	0,24	5.296.656,65	1,20
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	25,37	9,58	-0,01	0,08	2,31	2.146.292,88	0,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de dezembro de 2020, vale observar que:

- O Instituto está com 25,13% do patrimônio líquido do fundo MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR (Art. 9, Inciso II, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;