



**LDB**  
EMPRESAS

**GUARULHOS - CONSOLIDADO**  
FEVEREIRO 2021



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 26.02.2021.

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

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

Equipe LDB Empresas.

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Posição de Ativos e Enquadramento

## RENDA FIXA

63,69%

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	6,18	-0,85	-1,64	0,00	0,00	8.803.004.981,39	0,00
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,58	0,06	0,10	0,00	0,00	8.878.863.822,11	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,90	-1,54	-2,40	9.298.628,14	1,94	6.061.546.612,54	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,56	0,02	0,04	12.650.029,22	2,64	9.935.744.303,82	0,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,09	-0,62	-0,54	5.902.106,92	1,23	13.590.487.322,92	0,04
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,23	-0,53	-0,39	9.047.259,57	1,89	10.914.192.598,49	0,08
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,37	-1,51	-2,16	20.416.158,16	4,27	1.154.939.152,90	1,77
BB	BB	BB PREV RF IPCA	6,16	-0,58	-0,56	7.566.184,44	1,58	349.527.759,64	2,16
BB	BB	BB PREV RF VII	2,48	-0,01	0,27	348.157,01	0,07	240.033.347,68	0,15
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	4,93	-0,01	0,27	6.667.399,69	1,39	199.020.626,26	3,35
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,34	-0,91	-1,46	13.412.761,01	2,80	9.434.126.715,63	0,14
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,98	-0,51	-0,48	38.552.501,47	8,05	15.107.095.289,30	0,26
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	14,82	-1,86	-3,50	16.642.544,70	3,48	1.669.878.087,92	1,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,82	-1,43	-1,59	4.226.597,50	0,88	451.822.648,68	0,94
CEF	CEF	CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	14,04	-2,38	-3,78	7.276.429,90	1,52	360.674.797,15	2,02
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>6,02</b>	<b>-0,94</b>	<b>-1,34</b>	<b>152.006.757,73</b>	<b>31,76</b>		

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	13,26	-1,61	-2,55	8.560.030,77	1,79	130.170.183,51	6,58
XP	INTRAG	XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP	6,39	-1,31	-1,31	2.960.762,42	0,62	738.375.939,06	0,40
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>6,13</b>	<b>-1,40</b>	<b>-2,34</b>	<b>11.520.793,19</b>	<b>2,41</b>		

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	14,18	-1,74	-2,78	3.049.865,56	0,64	248.127.381,74	1,23
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,32	0,08	0,23	8.486.652,60	1,77	421.163.315,36	2,02
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	6,05	-0,74	-0,98	10.488.544,45	2,19	756.200.744,61	1,39
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	16,98	-2,46	-4,15	29.619.621,79	6,19	505.633.773,09	5,86
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,22	0,10	0,26	4.684.282,07	0,98	2.967.792.040,55	0,16
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,15	0,05	0,13	44.630.108,84	9,32	2.459.370.188,78	1,81
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,05	0,07	0,16	96.834,22	0,02	550.474.030,01	0,02
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,67	0,06	0,19	14.849.865,65	3,10	3.571.923.057,61	0,42
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	5,88	-1,24	-2,07	25.440.552,56	5,32	568.971.296,52	4,47
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>4,85</b>	<b>-1,09</b>	<b>-1,93</b>	<b>141.346.327,74</b>	<b>29,53</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>5,42</b>	<b>-1,01</b>	<b>-1,59</b>	<b>304.873.878,66</b>	<b>63,69</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

26,87%

## 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	44,14	-3,24	-5,64	3.348.170,43	0,70	748.567.197,38	0,45
VINCI	BEM	VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	37,91	-4,84	-9,03	12.909.578,64	2,70	724.851.025,32	1,78
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	41,22	-2,57	-6,41	4.268.835,79	0,89	1.108.524.440,80	0,39
QUELUZ	BEM	QUELUZ VALOR FI EM ACOES	42,03	-1,38	-5,91	2.483.833,02	0,52	119.189.541,93	2,08
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	42,22	-2,30	-6,10	12.469.368,93	2,61	298.458.860,67	4,18
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	38,93	-3,90	-7,10	16.416.665,40	3,43	552.083.388,65	2,97
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	41,81	-3,36	-6,38	2.907.659,69	0,61	1.033.064.602,48	0,28
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FIA	42,59	-3,17	-6,08	11.395.155,87	2,38	1.563.110.185,19	0,73
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	46,49	0,77	-1,16	13.913.515,80	2,91	550.853.305,14	2,53
BB	BB	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	46,07	-4,85	-9,57	2.750.234,20	0,57	701.089.974,79	0,39
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>40,39</b>	<b>-2,79</b>	<b>-6,08</b>	<b>82.863.017,77</b>	<b>17,31</b>		

## 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	32,74	2,67	2,50	12.879.909,63	2,69	1.303.746.939,74	0,99
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	32,13	2,59	2,41	26.367.868,61	5,51	825.903.419,31	3,19
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO	2,42	-0,45	-0,68	5.025.483,29	1,05	129.042.756,46	3,89
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>19,98</b>	<b>2,21</b>	<b>2,03</b>	<b>44.273.261,53</b>	<b>9,25</b>		

## 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	14,84	4,18	6,35	1.477.500,00	0,31	126.230.937,11	1,17
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>			<b>14,84</b>	<b>4,18</b>	<b>6,35</b>	<b>1.477.500,00</b>	<b>0,31</b>		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

37,69

-1,06

-3,37

128.613.779,30

26,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

9,44%

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	7,36	-1,32	-1,20	2.469.420,84	0,52	124.682.748,14	1,98
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	29,82	3,51	7,62	6.136.388,78	1,28	251.507.662,02	2,44
XP	BNP PARIBAS	ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	17,89	1,48	4,97	4.681.957,44	0,98	199.281.919,50	2,35
BB	BB	BB MULTIMERCADO SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	28,08	5,33	10,89	5.873.709,54	1,23	680.696.754,09	0,86
MONGERAL	BEM	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	22,05	1,87	14,33	3.442.840,90	0,72	17.533.158,04	19,64
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	30,01	4,42	8,91	7.795.913,61	1,63	1.706.818.937,80	0,46
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR	12,29	-3,31	-5,75	9.086.029,52	1,90	990.940.635,16	0,92
<b>Sub-total Artigo 9º A, II</b>			<b>13,59</b>	<b>1,53</b>	<b>4,17</b>	<b>39.486.260,63</b>	<b>8,25</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
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	32,94	4,47	8,39	5.681.091,44	1,19	2.288.705.798,61	0,25
<b>Sub-total Artigo 9º A, III</b>			<b>32,94</b>	<b>4,47</b>	<b>8,39</b>	<b>5.681.091,44</b>	<b>1,19</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>13,69</b>	<b>1,90</b>	<b>4,70</b>	<b>45.167.352,07</b>	<b>9,44</b>		
<b>Total</b>			<b>9,77</b>	<b>-0,81</b>	<b>-1,57</b>	<b>478.655.010,03</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	152.006.757,73	31,76	20,00	35,00	100,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	11.520.793,19	2,41	0,00	2,00	60,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	141.346.327,74	29,53	0,00	23,00	40,00	40,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>304.873.878,66</b>	<b>63,69</b>				100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	82.863.017,77	17,31	0,00	19,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	44.273.261,53	9,25	0,00	10,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.477.500,00	0,31	0,00	1,00	5,00	5,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>128.613.779,30</b>	<b>26,87</b>				30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	39.486.260,63	8,25	0,00	10,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	5.681.091,44	1,19	0,00	0,00	10,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>45.167.352,07</b>	<b>9,44</b>				10,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Rentabilidades por Artigo

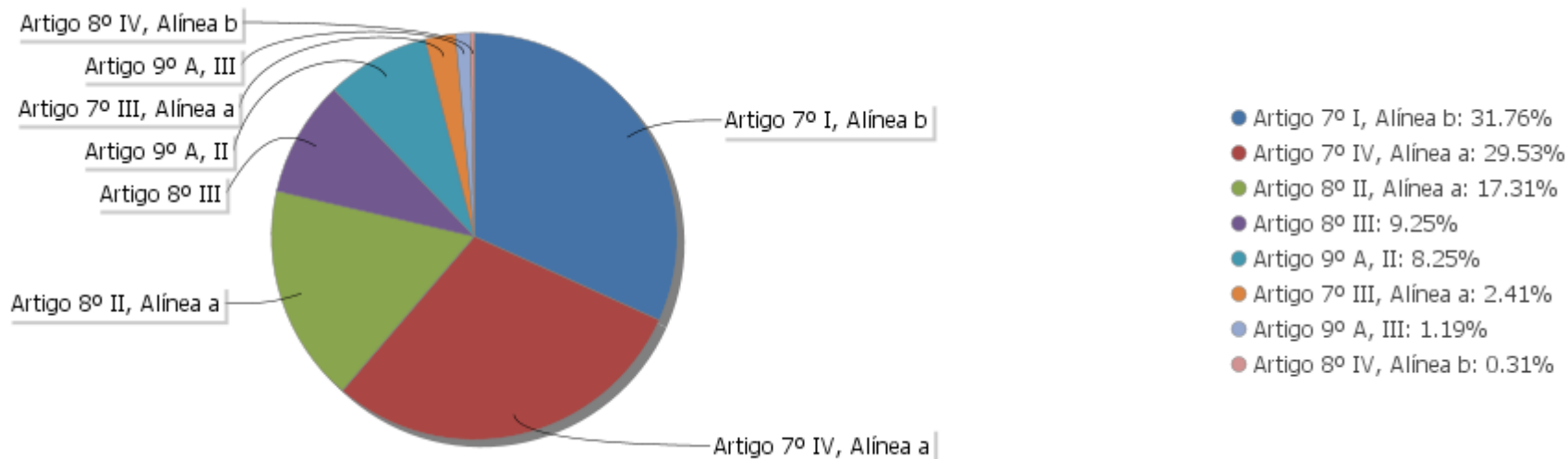
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,94 -699,23	-1,34 -473,21	1,03 228,47	1,38 150,61	4,28 181,05	-1.492.349,62	-2.158.558,60
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-1,40 -1.044,10	-2,34 -824,92	2,55 567,21	2,84 310,16		-193.233,79	-253.044,97
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-1,09 -809,72	-1,93 -678,43	0,76 168,86	0,55 59,93	2,21 93,70	-1.165.934,89	-1.908.861,69
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,79 1,58	-6,08 1,47	1,23 0,18	7,33 -3,40	1,05 -4,58	-2.410.883,95	-5.361.558,32
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,21 6,58	2,03 9,57	4,98 3,93	6,97 -3,77	35,10 29,47	791.749,79	721.343,18
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	4,18 8,55	6,35 13,89	8,99 7,94	13,73 3,00	15,25 9,62	59.551,02	89.066,21
Artigo 9º A, II % do CDI	1,53 1.139,26	4,17 1.468,51	5,91 1.316,25	9,24 1.009,59	13,56 573,77	445.584,95	1.333.991,04
Artigo 9º A, III % do CDI	4,47 3.321,32	8,39 2.950,55				242.986,40	439.562,29
<b>GUARULHOS - CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>-3.722.530,09</b>	<b>-7.098.060,86</b>

## Análise de Liquidez

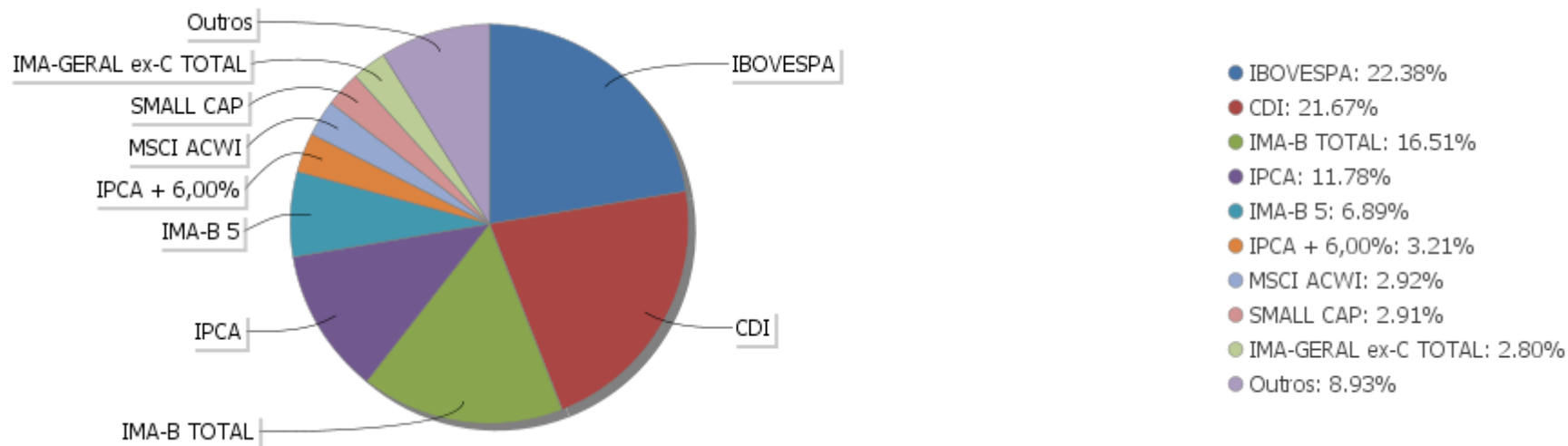
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	411.848.841,58	86,04	411.848.841,58	86,04
de 31 a 365 dias	40.721.399,91	8,51	452.570.241,49	94,55
acima de 365 dias	26.084.768,54	5,45	478.655.010,03	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

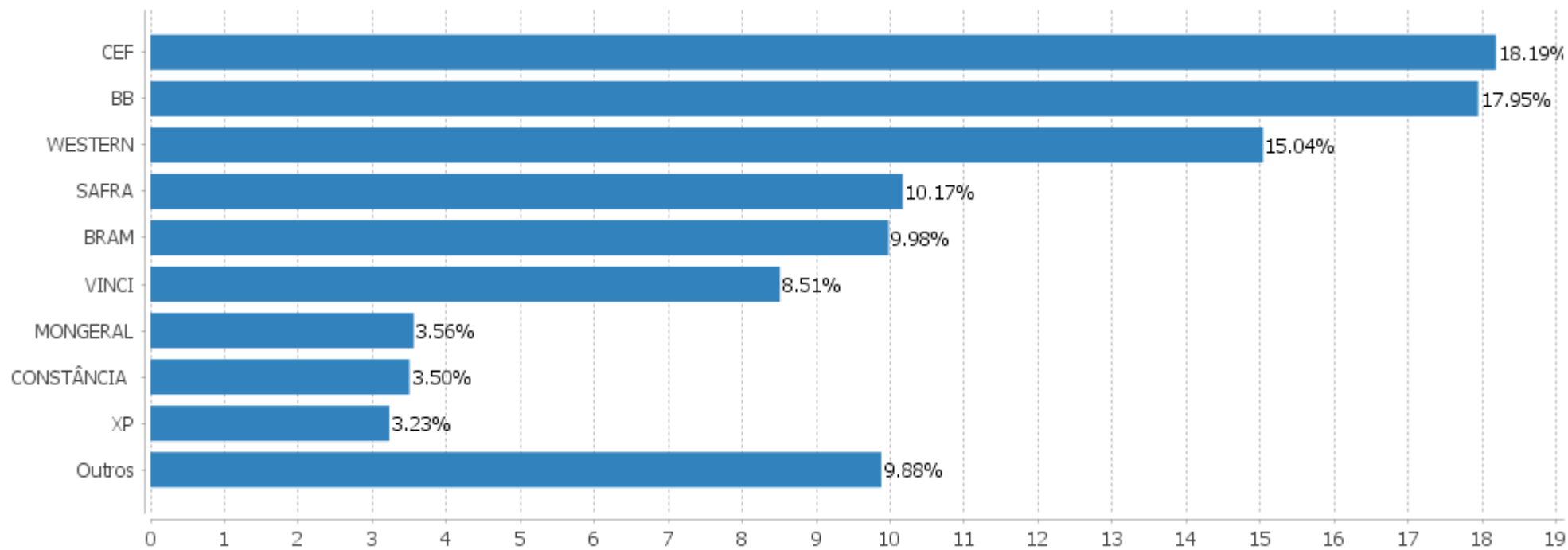


Alocação Por Estratégia



## 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	-0,76	-0,81											-1,57
INPC + 5,45%	0,69	1,20											1,90
p.p. indexador	-1,46	-2,01											-3,47
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 + 6,00%	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 + 6,00%	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

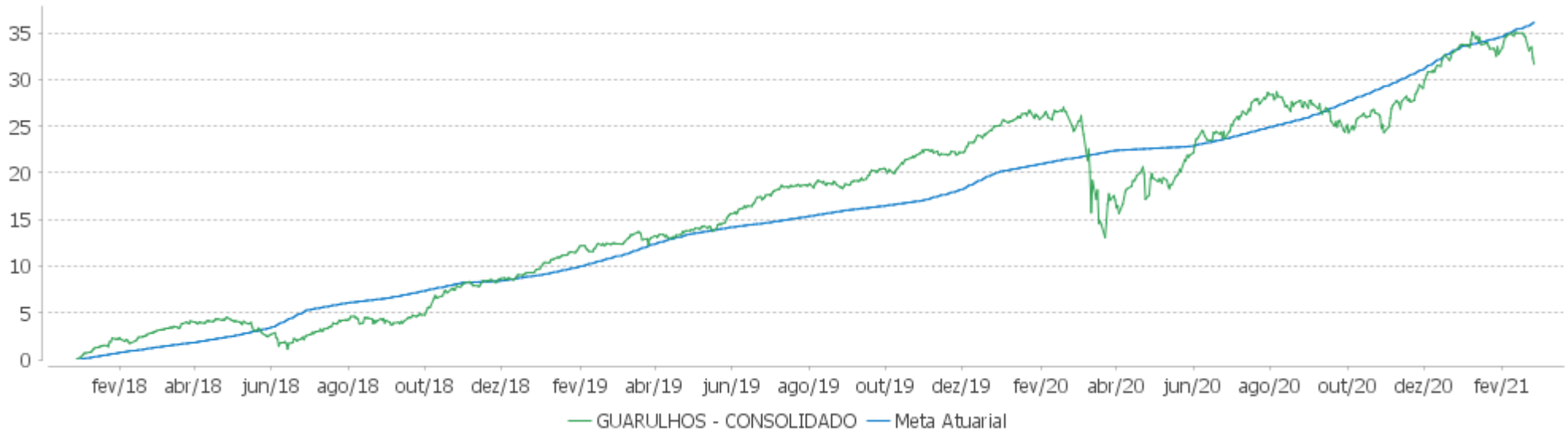
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

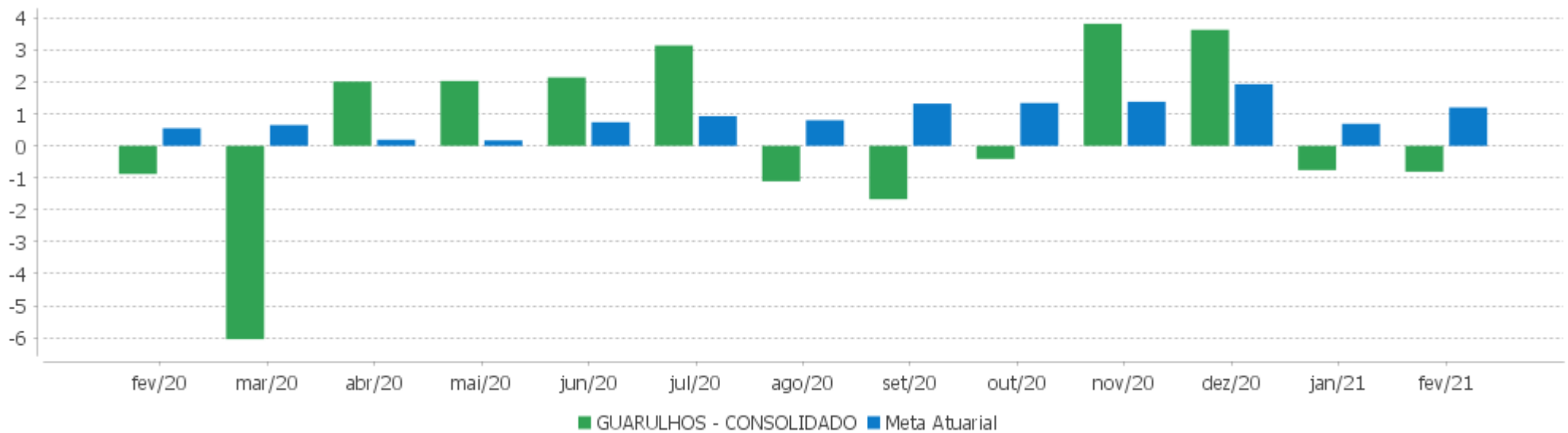
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	20	52,63	03 meses	2,00	3,91	-1,90	5,65
Meses abaixo da Meta Atuarial	18	47,37	06 meses	3,70	8,26	-4,56	6,05
			12 meses	5,64	12,32	-6,68	9,77
			24 meses	17,08	23,67	-6,59	7,21
			36 meses	27,91	36,26	-8,35	6,11
Maior rentabilidade da Carteira	3,82	2020-11	Desde 29/12/2017	31,65	38,09	-6,44	5,98
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
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	-1,51 -0,91	-2,16 -1,67	1,01 -0,32	1,35 -1,40	5,76 -0,47	21,87 2,72	36,22 5,04
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,54 -0,02	-2,40 -0,04	2,32 -0,06	2,96 -0,11	2,81 -0,35	20,93 -0,80	37,77 -1,14
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,62 -0,02	-0,54 -0,05	1,27 -0,06	2,60 -0,15	5,92 -0,31	18,50 -0,66	30,23 -0,95
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,01 0,58	0,27 0,76	1,49 0,16	3,38 0,64	7,12 0,89	20,93 1,77	33,84 2,65
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,00 -0,04	0,04 -0,05	0,35 -0,04	0,70 -0,23	2,71 -0,37	9,12 -0,68	16,38 -0,98
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,43 0,09	-1,59 0,76	0,90 -1,48	1,49 -1,58	5,44 2,27	22,36 0,62	35,77 -3,14
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,86 -0,34	-3,50 -1,14	1,87 -0,51	1,64 -1,43	2,80 -0,36	21,86 0,13	
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01 1,50	0,27 2,63	1,48 -0,90	3,37 0,30	5,26 2,09	14,83 -6,90	26,37 -12,54
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,91 -0,09	-1,46 -0,20	0,88 0,05	0,90 0,09	2,59 0,03	14,34 0,43	25,55 0,55
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,58 -1,87	-0,56 -2,56	1,40 -2,51	2,04 -5,91	6,51 -4,92	22,01 -0,80	35,39 0,14
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,51 -1,37	-0,48 -1,59	0,83 -1,65	1,04 -3,91	4,64 -0,55	19,53 10,12	31,08 17,41
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,53 -0,05	-0,39 -0,06	1,25 -0,14	2,68 -0,04	6,48 -0,47	17,50 -1,42	28,81 -2,22
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,02 -0,02	0,04 -0,04	0,33 -0,06	0,82 -0,11	2,87 -0,21	9,36 -0,44	16,69 -0,66
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-1,19 -0,01	-1,98 -0,01	-0,05 0,00	-0,68 -0,10	2,76 -0,25	14,70 -0,53	25,84 -0,85
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,38 -0,87	-3,78 -1,42	1,54 -0,85	2,15 -0,92	3,35 0,18	22,65 0,92	40,61 1,70
MONGERAL AEGON INFLAÇÃO REFERENCIADO IMA-B FI RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,61 -0,09	-2,55 -0,19	2,33 -0,05	2,63 -0,44	2,96 -0,20	21,25 -0,48	37,29 -1,62
XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP	-0,92	-0,94	1,65	3,18	6,03	19,01	

## 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.	-1,78	-2,05	-0,82	-1,77	0,83	9,60	
<b>BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO</b>	<b>0,08</b>	<b>0,23</b>	<b>0,41</b>	<b>0,46</b>	<b>1,76</b>	<b>7,14</b>	<b>13,70</b>
% do CDI	62,05	80,86	91,96	50,43	74,54	88,46	91,35
<b>WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF</b>	<b>-2,46</b>	<b>-4,15</b>	<b>2,06</b>	<b>1,71</b>	<b>2,68</b>	<b>24,20</b>	<b>43,72</b>
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,95	-1,79	-0,33	-1,36	-0,49	2,46	4,80
<b>BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI</b>	<b>0,10</b>	<b>0,26</b>	<b>0,51</b>	<b>0,86</b>	<b>2,03</b>	<b>7,47</b>	<b>14,25</b>
% do CDI	70,86	91,70	114,19	93,54	85,91	92,55	95,02
<b>BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF</b>	<b>-1,74</b>	<b>-2,78</b>	<b>2,09</b>	<b>2,45</b>	<b>2,26</b>	<b>21,16</b>	<b>37,74</b>
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,23	-0,43	-0,30	-0,62	-0,91	-0,57	-1,18
<b>BRADESCO FI RF IDKA PRE 2</b>	<b>-1,24</b>	<b>-2,07</b>	<b>-0,16</b>	<b>-0,97</b>	<b>3,89</b>	<b>16,51</b>	<b>28,87</b>
% do CDI	-921,69	-729,72	-34,82	-106,06	164,74	204,61	192,55
<b>BB PREV RF FLUXO FIC</b>	<b>0,05</b>	<b>0,13</b>	<b>0,23</b>	<b>0,34</b>	<b>1,26</b>	<b>5,77</b>	<b>11,34</b>
% do CDI	35,54	44,47	51,08	37,58	53,42	71,50	75,62
<b>BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL</b>	<b>-0,74</b>	<b>-0,98</b>	<b>1,07</b>	<b>1,50</b>	<b>3,72</b>	<b>15,50</b>	<b>26,89</b>
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,05	-0,05	0,00	0,20	0,41	0,54	0,48
<b>ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI</b>	<b>0,06</b>	<b>0,19</b>	<b>0,40</b>	<b>0,35</b>	<b>2,45</b>	<b>12,28</b>	<b>22,09</b>
Var. IPCA p.p.	-0,80	-0,92	-2,08	-4,60	-2,75	2,87	8,43
<b>FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF</b>	<b>0,07</b>	<b>0,16</b>	<b>0,25</b>	<b>0,50</b>	<b>1,52</b>	<b>6,29</b>	<b>12,16</b>
% do CDI	55,14	54,97	54,84	54,97	64,27	77,90	81,08
<b>MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO</b>	<b>-0,45</b>	<b>-0,68</b>	<b>0,39</b>	<b>0,76</b>	<b>2,11</b>	<b>6,65</b>	
% do CDI	-337,69	-239,86	87,79	82,89	89,43	82,42	
<b>WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO</b>	<b>2,67</b>	<b>2,50</b>	<b>5,77</b>	<b>8,77</b>	<b>23,85</b>	<b>36,61</b>	<b>45,63</b>
% do CDI	1.982,45	880,85	1.285,28	958,18	1.009,69	453,78	304,31
<b>SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO</b>	<b>2,59</b>	<b>2,41</b>	<b>5,56</b>	<b>8,58</b>	<b>24,11</b>	<b>36,82</b>	<b>45,31</b>
Var. IBOVESPA p.p.	6,97	9,96	4,51	-2,15	18,48	21,70	16,39
<b>CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES</b>	<b>-2,57</b>	<b>-6,41</b>	<b>-0,53</b>	<b>5,98</b>	<b>-8,76</b>	<b>20,18</b>	<b>49,29</b>
Var. IBOVESPA p.p.	1,81	1,13	-1,58	-4,76	-14,39	5,06	20,38
<b>BRADESCO F I A SELECTION</b>	<b>-3,24</b>	<b>-5,64</b>	<b>1,81</b>	<b>10,71</b>	<b>3,53</b>	<b>10,67</b>	<b>27,30</b>
Var. IBOVESPA p.p.	1,13	1,90	0,77	-0,02	-2,10	-4,45	-1,61
<b>VINCI MOSAICO FIA</b>	<b>-3,17</b>	<b>-6,08</b>	<b>2,56</b>	<b>10,60</b>	<b>0,99</b>	<b>31,29</b>	<b>54,79</b>
Var. IBOVESPA p.p.	1,20	1,46	1,51	-0,13	-4,64	16,17	25,88
<b>VINCI SELECTION EQUITIES FIA</b>	<b>-3,90</b>	<b>-7,10</b>	<b>0,22</b>	<b>4,91</b>	<b>7,52</b>	<b>25,70</b>	<b>48,32</b>
Var. IBOVESPA p.p.	0,48	0,45	-0,83	-5,83	1,89	10,58	19,41
<b>AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA</b>	<b>0,77</b>	<b>-1,16</b>	<b>5,69</b>	<b>8,74</b>	<b>-5,01</b>		
Var. SMALL CAP p.p.	2,61	4,05	3,77	-1,10	-7,21		
<b>BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI</b>	<b>-4,85</b>	<b>-9,57</b>	<b>-0,15</b>	<b>10,15</b>	<b>9,93</b>		

## 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.	-0,47	-2,03	-1,20	-0,59	4,30		
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,36 1,01	-6,38 1,16	3,08 2,03	8,40 -2,34	10,55 4,92	27,02 11,90	47,27 18,36
VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-4,84 -0,46	-9,03 -1,48	-0,91 -1,96	7,83 -2,90	-1,09 -6,72	20,31 5,19	39,05 10,13
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,30 2,08	-6,10 1,45	0,59 -0,46	6,62 -4,11	-4,45 -10,08	7,71 -7,41	25,67 -3,24
QUELUZ VALOR FI EM ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-1,38 2,99	-5,91 1,64	-1,99 -3,04	2,52 -8,22	-2,13 -7,76	7,60 -7,52	24,09 -4,82
RBBV11 Var. IFIX p.p.	4,18 3,93	6,35 5,78	8,99 6,21	13,47 9,72	15,25 17,86	33,84 15,28	64,74 39,85
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	4,47 8,84	8,39 15,93	8,76 7,71	7,04 -3,69	54,45 48,82	100,15 85,03	
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. INPC + 6,00% p.p.	-3,31 -4,55	-5,75 -7,73	-4,59 -8,59	-1,71 -10,09	2,48 -10,03	13,52 -10,39	
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IBOVESPA p.p.	3,51 7,88	7,62 15,17	9,27 8,22	9,96 -0,78	69,09 63,46	133,74 118,62	
ACCESS DIVERSIFIED DYNAMIC FIM - INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	-1,32 -981,71	-1,20 -423,86	-0,01 -1,23	2,65 289,06	0,52 21,92	13,97 173,20	19,65 131,06
BB MULTIMERCADO SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI ACWI p.p.	5,33 2,10	10,89 2,69	11,16 0,91	14,61 1,04	71,30 13,75	108,24 15,17	136,08 19,91
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	1,48 -1,75	4,97 -3,24	12,76 2,51	22,59 9,03			
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	4,42 3,14	8,91 6,91	9,10 5,19	15,21 7,27	97,35 85,92		
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	1,87 -1,36	14,33 6,12	16,97 6,72				
GUARULHOS - CONSOLIDADO Var. INPC + 5,45% p.p.	-0,81 -2,01	-1,57 -3,47	2,00 -1,87	3,70 -4,41	5,64 -6,29	17,08 -5,56	27,91 -6,51
CDI	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	14,99
IBOVESPA	-4,37	-7,55	1,05	10,73	5,63	15,12	28,92
INPC + 6,00%	1,24	1,98	4,00	8,39	12,51	23,91	36,52
IPCA + 6,00%	1,28	2,00	3,91	7,95	11,43	22,82	35,25

**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	0,08	0,39	0,94	3,08	9,80	17,36
IRF-M 1+	-2,01	-3,37	-0,43	-1,48	2,82	17,44	30,64
IRF-M TOTAL	-1,18	-1,97	-0,06	-0,58	3,01	15,23	26,69
IMA-B 5	-0,60	-0,49	1,33	2,75	6,23	19,15	31,19
IMA-B 5+	-2,33	-3,98	3,24	3,38	0,95	23,20	44,42
IMA-B TOTAL	-1,52	-2,36	2,38	3,07	3,16	21,74	38,91
IMA-C TOTAL	3,72	10,42	9,19	17,82	30,63	54,91	81,60
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,83	-1,26	0,83	0,82	2,55	13,91	25,00
IMA-GERAL TOTAL	-0,69	-0,93	1,07	1,29	3,31	14,97	26,40
IDKA 2	-0,48	-0,33	1,40	2,72	6,95	18,92	31,03
IDKA 20	-2,69	-5,42	5,32	4,90	-1,91	24,76	54,08
CDI	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	14,99
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	-4,37	-7,55	1,05	10,73	5,63	15,12	28,92
IBRX 100	-3,45	-6,38	2,19	11,97	6,92	18,84	34,16
IBRX 50	-3,80	-6,48	2,33	12,81	8,13	15,27	27,76
SMALL CAP	-1,84	-5,21	1,92	9,84	2,20	38,68	54,97
IFIX	0,25	0,57	2,78	3,75	-2,61	18,56	24,88
Índice Consumo - ICON	-5,29		-1,83	-0,23	1,03	36,15	35,39
Índice Dividendos - IDIV	-5,21	-10,02	-1,98	7,65	-3,53	17,34	37,29
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	0,86	1,11	2,48	4,95	5,20	9,41	13,66
INPC	0,82	1,09	2,57	5,37	6,22	10,38	14,73
IGPM	2,53	5,17	6,18	18,11	28,94	37,73	48,21
SELIC	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	15,00
<b>Meta Atuarial</b>							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
94	01/02/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	26.763,19	7.774,25860000	3,4425392000
95	02/02/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	2.796,00	812,14920000	3,4427172000
96	03/02/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	2.488,28	722,72130000	3,4429314000
107	03/02/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	704.946,33	204.751,77920000	3,4429314000
55	04/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	460,97	0,00	217,83306100	2,1161617830
97	05/02/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	25.293,75	7.345,74970000	3,4433177000
108	05/02/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	855.942,68	248.580,80330000	3,4433177000
59	05/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	109,66	51,81863900	2,1162269310
72	08/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	9.783,39	0,00	4.622,87879700	2,1162981830
98	08/02/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	8.099,84	2.352,19730000	3,4435206000
87	09/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.082,00	2.401,28193600	2,1163695620
99	09/02/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	398,40	115,68710000	3,4437702000
60	09/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.000.000,00	6.615.101,74374600	2,1163695650
92	09/02/2021	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	3.000.000,00	0,00	1.791.017,61680740	1,6750254000
39	09/02/2021	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	2.000.000,00	0,00	488.667,24462970	4,0927646000
109	10/02/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	1.988.465,93	577.398,63880000	3,4438355000
100	10/02/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	2.549,82	740,40120000	3,4438355000
47	10/02/2021	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.500.000,00	0,00	1.542,15496490	972,6648969000
37	10/02/2021	ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	1.500.000,00	0,00	11.668,46103872	128,5516569000
51	10/02/2021	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	1.000.000,00	0,00	382.360,60427900	2,6153321990
61	10/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.478.548,98	1.643.618,80916600	2,1163964300
42	10/02/2021	MONGERAL AEGON INFLAÇÃO REFERENCIADO IMA-B FI RF LP	2.500.000,00	0,00	874.985,04213070	2,8571917000
40	10/02/2021	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	2.000.000,00	0,00	7.879,47470300	253,8240270000
88	11/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	56.114,78	26.513,69559000	2,1164450580
81	11/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	21.826,66	10.312,88760200	2,1164450580
62	11/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	73.050,03	34.515,43886000	2,1164450580
41	11/02/2021	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.000.000,00	0,00	813.081,50572930	1,2298890000
89	12/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	100.000,00	47.247,67941900	2,1165060640

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
93	12/02/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	73.066,62	0,00	21.215,11960000	3,4440824000
63	12/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.000.000,00	4.252.291,14770000	2,1165060640
45	12/02/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.000.000,00	0,00	829.248,93679900	2,4118210000
44	12/02/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.000.000,00	0,00	616.669,75515400	3,2432270000
46	12/02/2021	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2.000.000,00	0,00	1.316.468,49427500	1,5192160000
38	12/02/2021	XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP	3.000.000,00	0,00	1.140.915,93415744	2,6294663000
110	17/02/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	4.505,95	1.308,28600000	3,4441627000
56	17/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	182.948,67	0,00	86.436,74689200	2,1165612610
52	17/02/2021	BB PREV RF VII	0,00	9.474,74	5.116,45775100	1,8518163270
53	17/02/2021	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	0,00	173.473,93	99.547,80594300	1,7426193210
43	18/02/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3.000.000,00	0,00	166.129,91935611	18,0581560000
79	19/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	40.386,77	0,00	19.080,30570600	2,1166731090
90	19/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	217.905,65	102.947,23784900	2,1166731090
75	19/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.250.000,00	0,00	590.549,38369300	2,1166731090
111	19/02/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	37.455,10	10.873,97240000	3,4444726000
57	19/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	22.498,91	0,00	10.629,37394700	2,1166731090
84	22/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1,35	0,00	0,63777800	2,1167234450
101	22/02/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	45,12	13,09870000	3,4446096000
80	23/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	4.174.581,01	0,00	1.972.136,75458200	2,1167806950
85	23/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	8.418.368,45	0,00	3.976.967,69905500	2,1167806950
71	23/02/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	4.174.581,01	1.530.424,02551600	2,7277283540
70	23/02/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	8.418.368,45	3.086.219,50389500	2,7277283540
102	23/02/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	9.375,80	2.721,75220000	3,4447689000
103	23/02/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	16.236,18	4.713,28770000	3,4447689000
104	24/02/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	616,72	179,03140000	3,4447574000
112	24/02/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	224,71	65,23240000	3,4447574000
69	24/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	30.244,38	0,00	14.287,81344200	2,1167955560
66	24/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	24.133,29	0,00	11.400,86010200	2,1167955560
50	24/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.129,16	0,00	533,42893500	2,1167955560
68	24/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.071.053,79	0,00	505.978,85419900	2,1167955560

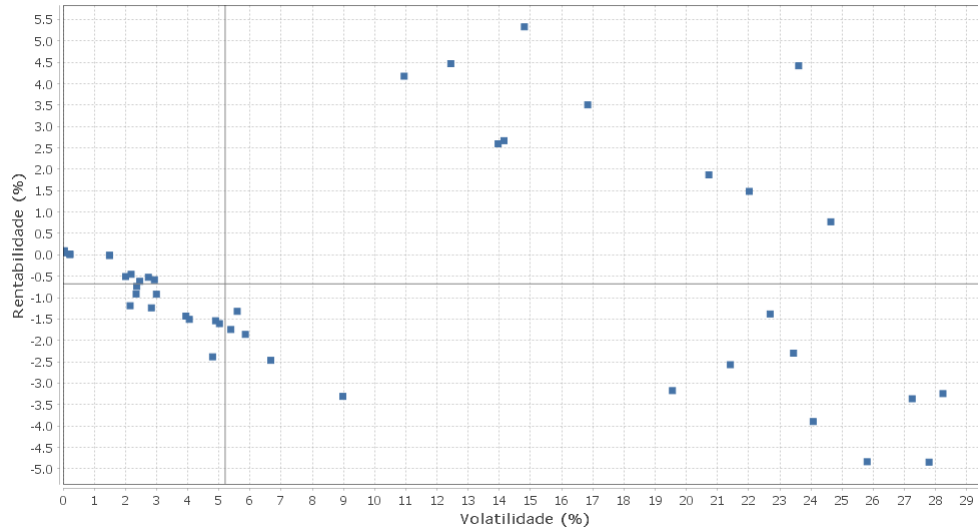
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
65	24/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	854.641,32	0,00	403.742,96779700	2,1167955560
49	24/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	39.986,90	0,00	18.890,29853900	2,1167955560
67	24/02/2021	BB PREV RF IRF-M	0,00	1.101.298,17	182.121,57710300	6,0470493805
64	24/02/2021	BB PREV RF IRF-M	0,00	878.774,61	145.322,88002800	6,0470492730
48	24/02/2021	BB PREV RF IRF-M	0,00	41.116,06	6.799,35945900	6,0470492730
91	25/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	104.623,12	49.424,01281000	2,1168479460
82	25/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	36.064,37	17.036,82594100	2,1168479460
58	25/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	18.588.806,87	0,00	8.781.361,41290800	2,1168479460
86	26/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	2.601.819,68	0,00	1.229.061,64386600	2,1169155290
83	26/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.989,06	1.884,37372400	2,1169155290
77	26/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	58.260,38	0,00	27.521,35321500	2,1169155290
74	26/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	50.249,25	0,00	23.737,01232300	2,1169155290
76	26/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.400.000,00	0,00	661.339,56731900	2,1169155290
73	26/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	30.000,00	0,00	14.171,56215600	2,1169155290
78	26/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.000,00	4.723,85405200	2,1169155290
105	26/02/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	2.650,00	769,19660000	3,4451530000
106	26/02/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	4.650.000,00	0,00	1.349.722,34900000	3,4451530000
<b>Total</b>						

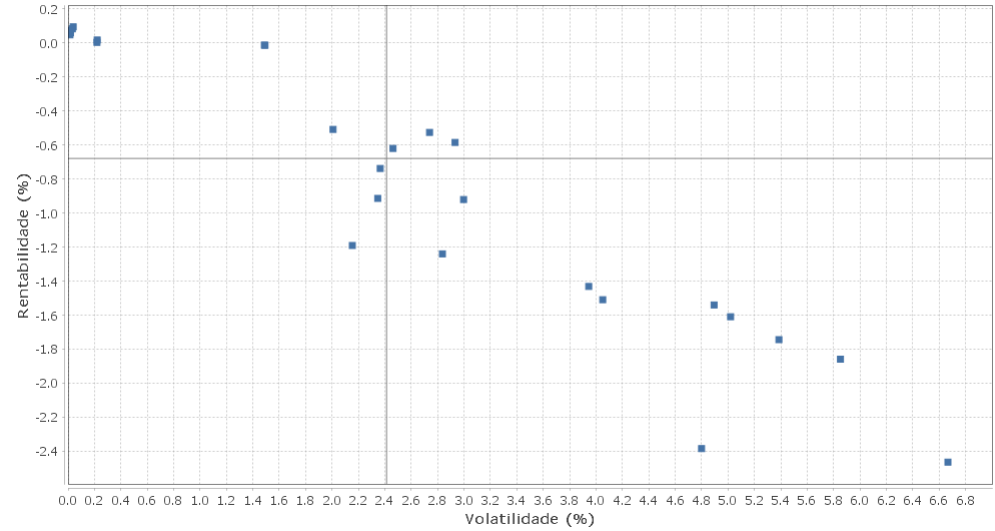
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

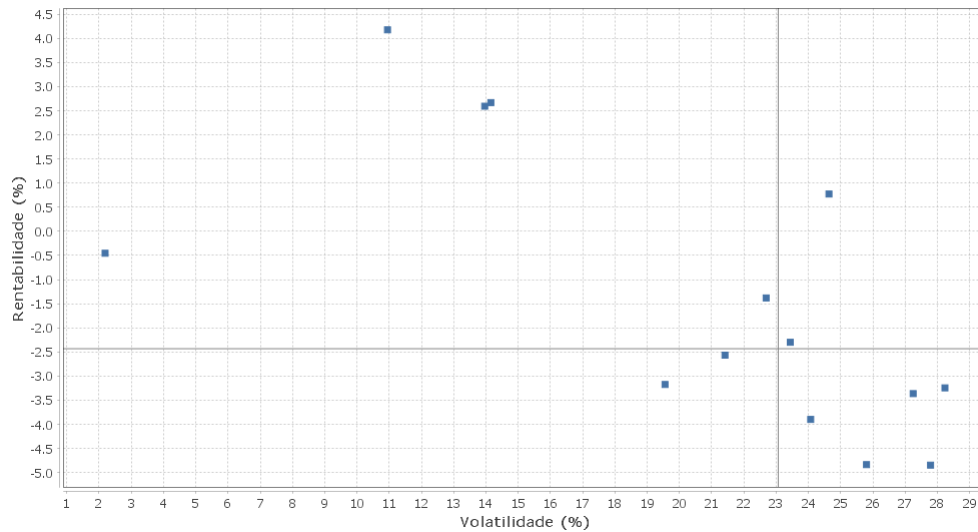
GUARULHOS - CONSOLIDADO - No Mês



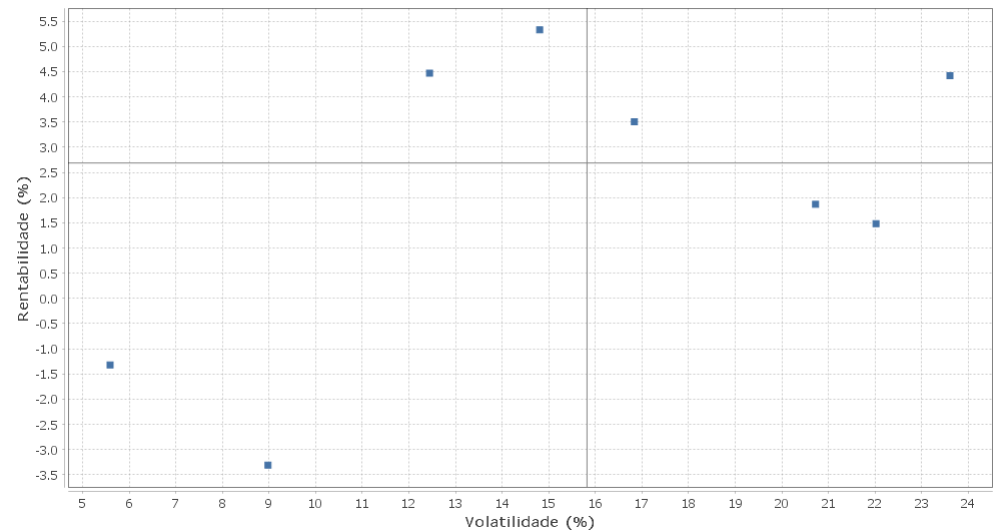
Renda Fixa - No Mês



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\$): 14.281.774,97

Value-At-Risk: 2,98%

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	-142,07	0,07	96.834,22	0,02
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,04	0,00	-6,17	0,05	44.630.108,84	9,32
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,04	0,00	-4,19	0,06	14.849.865,65	3,10
BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,04	0,00	-1,56	0,08	8.486.652,60	1,77
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,04	0,00	-1,00	0,10	4.684.282,07	0,98
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,22	NaN	0,00	-0,59	0,00	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,22	0,15	0,00	-0,53	0,02	12.650.029,22	2,64
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,49	0,80	0,00	-0,10	-0,01	348.157,01	0,07
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	Artigo 7º I, Alínea b	1,49	0,81	0,01	-0,10	-0,01	6.667.399,69	1,39
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,06	0,05	-0,32	-0,51	38.552.501,47	8,05
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,15	NaN	0,00	-0,62	-1,19	0,00	0,00
MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	2,19	0,92	0,01	-0,27	-0,45	5.025.483,29	1,05
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,35	1,31	0,02	-0,45	-0,91	13.412.761,01	2,80
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	2,36	1,16	0,01	-0,37	-0,74	10.488.544,45	2,19
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,46	1,23	0,01	-0,31	-0,62	5.902.106,92	1,23
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,74	1,16	0,01	-0,24	-0,53	9.047.259,57	1,89
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	2,84	1,54	0,04	-0,48	-1,24	25.440.552,56	5,32
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	2,93	1,31	0,01	-0,25	-0,58	7.566.184,44	1,58
XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP	Artigo 7º III, Alínea a	3,00	1,50	0,01	-0,35	-0,92	2.960.762,42	0,62
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,94	1,62	0,01	-0,40	-1,43	4.226.597,50	0,88
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,05	2,17	0,05	-0,41	-1,51	20.416.158,16	4,27
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,80	2,79	0,02	-0,52	-2,38	7.276.429,90	1,52
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,89	2,29	0,02	-0,34	-1,54	9.298.628,14	1,94
MONGERAL AEGON INFLAÇÃO REFERENCIADO IMA-B FI RF LP	Artigo 7º III, Alínea a	5,02	2,36	0,02	-0,35	-1,61	8.560.030,77	1,79
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	5,39	2,48	0,01	-0,35	-1,74	3.049.865,56	0,64
ACCESS DIVERSIFIED DYNAMIC FIM - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	5,59	2,16	0,00	-0,26	-1,32	2.469.420,84	0,52
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,85	3,02	0,06	-0,34	-1,86	16.642.544,70	3,48
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	6,67	3,36	0,11	-0,39	-2,46	29.619.621,79	6,19

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	8,98	3,25	0,02	-0,38	-3,31	9.086.029,52	1,90
RBBV11	Artigo 8º IV, Alínea b	10,95	4,24	-0,00	0,37	4,18	1.477.500,00	0,31
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	12,44	11,43	0,06	0,35	4,47	5.681.091,44	1,19
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	13,96	8,01	0,35	0,18	2,59	26.367.868,61	5,51
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	14,15	8,13	0,18	0,18	2,67	12.879.909,63	2,69
BB MULTIMERCADO SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	Artigo 9º A, II	14,80	10,24	0,02	0,35	5,33	5.873.709,54	1,23
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	16,84	11,33	0,06	0,20	3,51	6.136.388,78	1,28
VINCI MOSAICO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	19,55	9,88	0,22	-0,17	-3,17	11.395.155,87	2,38
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	20,72	10,60	-0,01	0,08	1,87	3.442.840,90	0,72
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	21,41	9,37	0,08	-0,13	-2,57	4.268.835,79	0,89
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	22,02	10,78	0,08	0,06	1,48	4.681.957,44	0,98
QUELUZ VALOR FI EM ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	22,69	11,39	0,05	-0,07	-1,38	2.483.833,02	0,52
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,44	10,65	0,25	-0,10	-2,30	12.469.368,93	2,61
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	23,61	13,01	0,06	0,18	4,42	7.795.913,61	1,63
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,07	9,32	0,30	-0,17	-3,90	16.416.665,40	3,43
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,64	12,46	0,32	0,03	0,77	13.913.515,80	2,91
VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	25,80	10,44	0,25	-0,19	-4,84	12.909.578,64	2,70
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	27,25	13,21	0,07	-0,13	-3,36	2.907.659,69	0,61
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	27,79	13,64	0,07	-0,18	-4,85	2.750.234,20	0,57
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	28,24	13,98	0,09	-0,12	-3,24	3.348.170,43	0,70