



LDB
EMPRESAS

GUARULHOS - CONSOLIDADO
MARÇO 2021



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.03.2021.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 61,02%

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
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,90	-0,47	-2,86	9.254.479,46	1,84	5.996.206.078,69	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,43	-0,00	0,04	0,00	0,00	9.801.758.898,12	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,04	0,31	-0,23	5.920.490,50	1,18	13.551.415.614,90	0,04
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,74	0,37	-0,02	9.080.690,22	1,81	10.861.361.928,62	0,08
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	5,97	-0,36	-2,51	20.343.342,07	4,05	1.185.329.734,14	1,72
BB	BB	BB PREV RF IPCA	3,77	0,38	-0,19	7.594.603,12	1,51	350.840.589,78	2,16
BB	BB	BB PREV RF VII	1,69	0,39	0,67	349.519,86	0,07	240.972.949,54	0,15
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	2,56	0,39	0,67	6.693.534,49	1,33	199.800.744,93	3,35
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	4,08	-0,42	-1,88	13.356.273,86	2,66	9.507.617.903,00	0,14
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,78	0,30	-0,18	63.640.341,74	12,67	15.491.489.347,05	0,41
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	9,26	-0,82	-4,28	16.506.781,07	3,29	1.525.094.042,58	1,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	5,25	0,07	-1,52	4.229.567,50	0,84	452.140.056,20	0,94
CEF	CEF	CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	9,22	-1,28	-5,01	7.183.500,00	1,43	293.423.532,64	2,45
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,03	-0,10	-1,44	164.153.123,89	32,67		

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	8,14	-0,52	-3,05	8.515.583,92	1,69	225.585.092,21	3,77
XP	INTRAG	XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP	4,11	-0,08	-1,38	12.872.192,27	2,56	746.927.906,22	1,72
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			6,10	-0,30	-2,63	21.387.776,19	4,26		

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	8,48	-0,81	-3,57	3.025.206,23	0,60	234.875.147,33	1,29
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,32	0,19	0,42	9.502.691,32	1,89	397.338.580,93	2,39
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	3,89	-0,63	-1,61	10.422.577,93	2,07	711.069.740,23	1,47
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	10,51	-1,07	-5,17	29.304.042,35	5,83	528.022.078,01	5,55
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,19	0,24	0,50	4.695.539,74	0,93	3.129.027.750,94	0,15
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,15	0,10	0,23	33.810.387,41	6,73	2.383.075.266,03	1,42
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,03	0,12	0,28	96.952,50	0,02	578.878.506,99	0,02
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,65	0,04	0,23	0,00	0,00	3.580.849.195,10	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	3,75	-0,90	-2,96	25.211.403,00	5,02	500.079.676,72	5,04
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			3,67	-0,74	-2,66	116.068.800,48	23,10		

Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado")

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	3,69	-0,41	-0,41	4.979.335,79	0,99	914.587.003,20	0,54
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			3,69	-0,41	-0,41	4.979.335,79	0,99		
Renda Fixa			3,85	-0,39	-1,97	306.589.036,35	61,02		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

29,65%

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	25,49	0,16	-5,50	3.353.376,72	0,67	736.778.248,58	0,46
VINCI	BEM	VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	22,93	5,60	-3,93	13.632.841,42	2,71	766.777.862,73	1,78
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	23,18	8,97	1,99	4.651.929,76	0,93	1.164.556.497,85	0,40
QUELUZ	BEM	QUELUZ VALOR FI EM ACOES	23,82	1,88	-4,14	2.530.562,69	0,50	130.728.935,85	1,94
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	24,04	7,57	1,01	13.413.719,75	2,67	326.101.868,13	4,11
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	23,06	4,96	-2,48	17.231.458,92	3,43	587.455.576,04	2,93
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	25,55	3,94	-2,70	8.670.214,31	1,73	1.109.023.441,48	0,78
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FIA	25,69	4,02	-2,31	11.853.023,80	2,36	1.628.597.392,82	0,73
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	26,10	0,77	-0,40	19.728.897,26	3,93	565.873.266,26	3,49
BB	BB	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	26,80	8,73	-1,68	2.990.227,71	0,60	819.326.312,79	0,36
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			23,48	4,45	-1,90	98.056.252,34	19,52		

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	20,90	4,03	6,63	17.037.997,97	3,39	1.455.516.681,87	1,17
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	20,61	4,07	6,58	27.439.897,83	5,46	1.037.182.533,83	2,65
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO	1,76	-0,80	-1,48	4.985.091,03	0,99	116.338.000,52	4,29
Sub-total Artigo 8º III			19,69	3,54	5,64	49.462.986,83	9,84		

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	12,94	-2,21	4,00	1.440.150,00	0,29	125.711.158,87	1,15
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			12,94	-2,21	4,00	1.440.150,00	0,29		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

21,23

4,11

0,61

148.959.389,17

29,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

9,33%

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	4,29	0,79	-0,42	2.488.934,28	0,50	124.006.138,31	2,01
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	25,95	1,74	9,50	6.243.246,21	1,24	280.751.899,79	2,22
XP	BNP PARIBAS	ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	18,14	-1,32	3,59	4.620.316,66	0,92	225.723.007,81	2,05
BB	BB	BB MULTIMERCADO SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	25,36	3,69	14,99	6.090.704,09	1,21	745.110.868,51	0,82
MONGERAL	BEM	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	23,49	-7,82	5,38	4.163.489,19	0,83	29.263.632,65	14,23
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	28,58	-2,14	6,58	7.628.801,29	1,52	1.676.325.591,46	0,46
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR	7,61	-3,16	-8,73	8.798.776,72	1,75	955.662.329,58	0,92
Sub-total Artigo 9º A, II			10,37	-1,13	3,00	40.034.268,44	7,97		

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	24,60	3,03	11,67	6.857.648,58	1,36	2.654.448.171,68	0,26
Sub-total Artigo 9º A, III			24,60	3,03	11,67	6.857.648,58	1,36		

Investimentos no Exterior			10,62	-0,59	4,09	46.891.917,02	9,33		
----------------------------------	--	--	--------------	--------------	-------------	----------------------	-------------	--	--

Total			6,56	0,95	-0,63	502.440.342,54	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	164.153.123,89	32,67	20,00	35,00	100,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	21.387.776,19	4,26	0,00	2,00	60,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	116.068.800,48	23,10	0,00	23,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	4.979.335,79	0,99	0,00	0,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	306.589.036,35	61,02				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	98.056.252,34	19,52	0,00	19,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	49.462.986,83	9,84	0,00	10,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.440.150,00	0,29	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	148.959.389,17	29,65				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	40.034.268,44	7,97	0,00	10,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	6.857.648,58	1,36	0,00	0,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	46.891.917,02	9,33				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

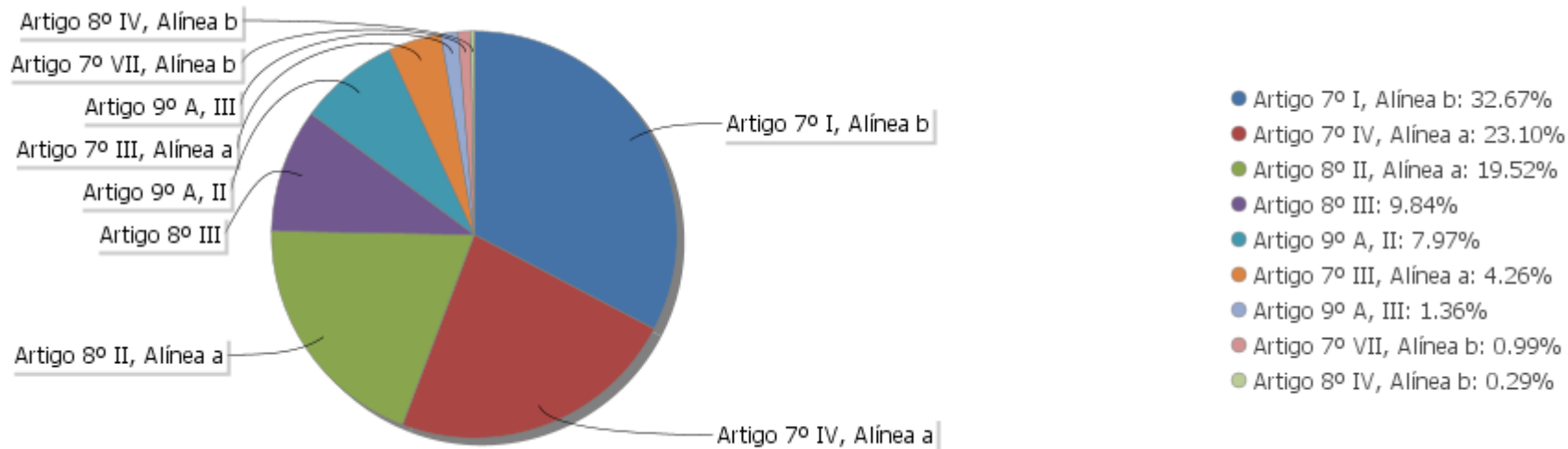
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,10 -50,18	-1,44 -297,30	-1,44 -297,30	1,98 206,47	5,86 263,84	-209.296,04	-2.367.854,64
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,30 -147,40	-2,63 -542,12	-2,63 -542,12	4,32 450,07		-133.017,00	-386.061,97
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,74 -369,94	-2,66 -547,01	-2,66 -547,01	0,68 70,74	2,69 121,14	-578.405,35	-2.487.267,04
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,41 -205,52	-0,41 -85,06	-0,41 -85,06	-0,41 -43,06	0,83 37,32	-20.664,21	-20.664,21
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	4,45 -1,54	-1,90 0,11	-1,90 0,11	17,81 -5,48	49,53 -10,19	4.193.234,57	-1.168.323,75
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	3,54 -2,46	5,64 7,64	5,64 7,64	16,33 -6,95	49,06 -10,67	1.689.725,30	2.411.068,48
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-2,21 -8,21	4,00 6,00	4,00 6,00	8,08 -15,21	21,18 -38,55	-32.530,86	56.535,35
Artigo 9º A, II % do CDI	-1,13 -561,90	3,00 616,77	3,00 616,77	8,39 874,61	25,52 1.148,17	-451.992,19	881.998,85
Artigo 9º A, III % do CDI	3,03 1.507,10	11,67 2.402,00	11,67 2.402,00			176.557,14	616.119,43
GUARULHOS - CONSOLIDADO (Total)						4.633.611,36	-2.464.449,50

Análise de Liquidez

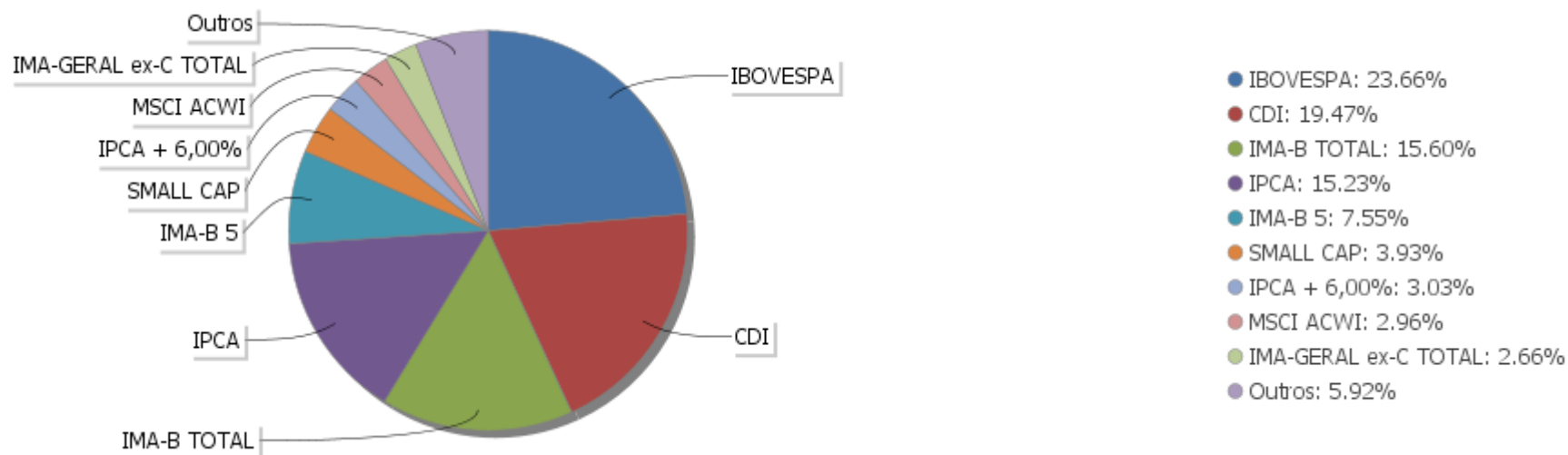
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	433.672.293,43	86,31	433.672.293,43	86,31
de 31 a 365 dias	42.717.324,14	8,50	476.389.617,57	94,82
acima de 365 dias	26.050.724,97	5,18	502.440.342,54	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

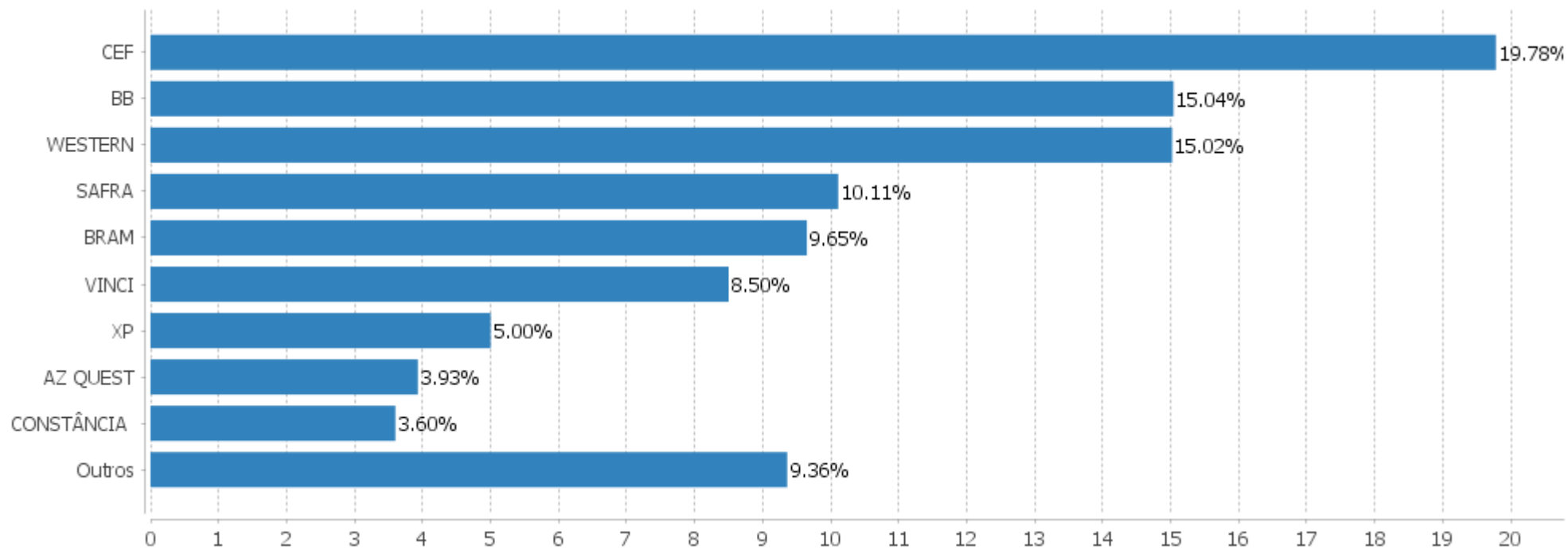


Alocação Por Estratégia



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	0,95										-0,63
INPC + 5,45%	0,69	1,20	1,35										3,28
p.p. indexador	-1,46	-2,01	-0,40										-3,91
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

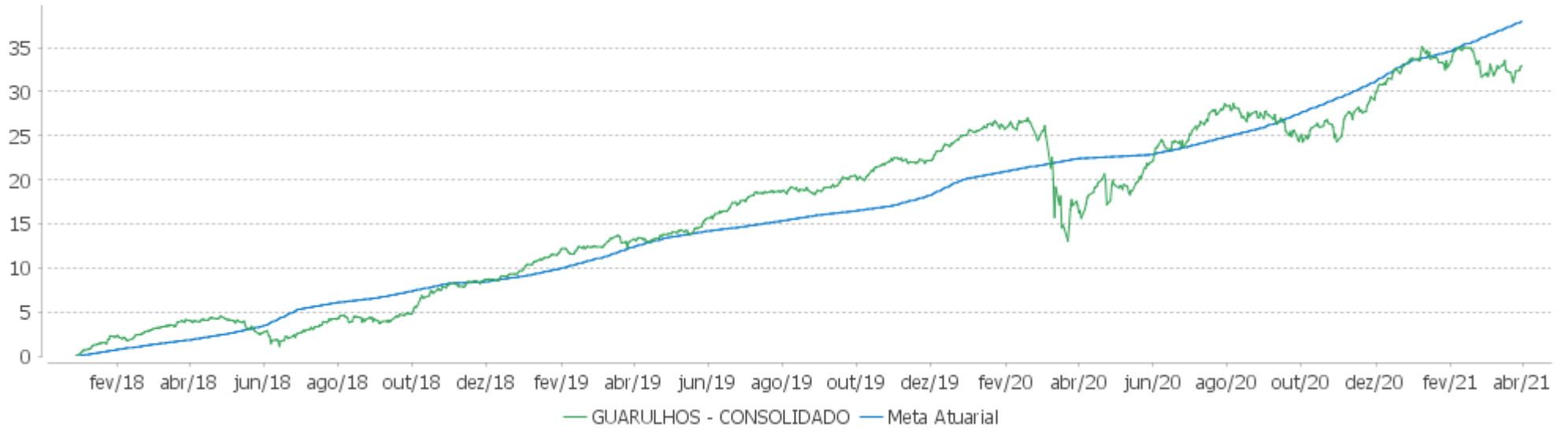
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

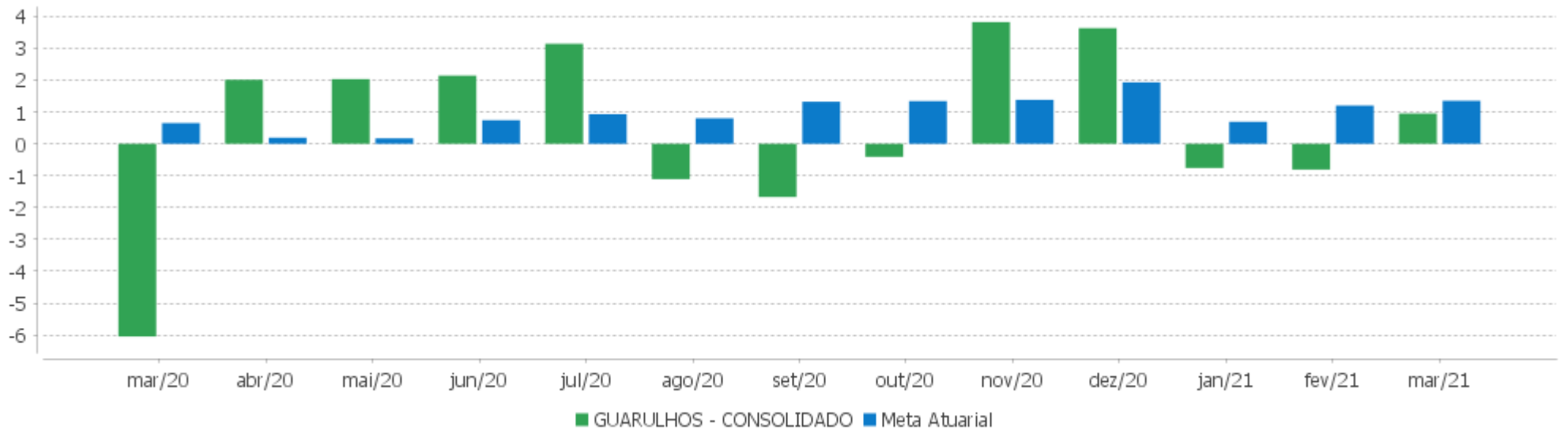
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	20	51,28	03 meses	-0,63	3,28	-3,91	6,39
Meses abaixo da Meta Atuarial	19	48,72	06 meses	6,46	8,26	-1,80	5,96
			12 meses	13,51	13,06	0,44	6,56
			24 meses	17,59	23,84	-6,24	7,27
			36 meses	27,65	37,33	-9,68	6,20
Maior rentabilidade da Carteira	3,82	2020-11	Desde 29/12/2017	32,90	39,95	-7,06	5,99
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	0,19 96,69	0,42 87,40	0,42 87,40	0,77 80,17	1,64 73,83	6,87 88,25	13,34 91,27
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,07 -0,60	-5,17 -2,37	-5,17 -2,37	2,87 -1,30	9,62 -0,76	22,18 1,71	40,30 3,31
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,24 119,51	0,50 103,23	0,50 103,23	1,07 111,93	2,31 103,88	7,23 92,95	13,91 95,15
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,81 -0,35	-3,57 -0,76	-3,57 -0,76	3,31 -0,86	9,53 -0,85	19,56 -0,92	35,36 -1,63
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	-0,90 -447,93	-2,96 -608,39	-2,96 -608,39	-1,32 -137,50	1,73 77,70	14,83 190,62	25,69 175,77
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,10 51,92	0,23 47,53	0,23 47,53	0,45 46,79	1,12 50,22	5,47 70,33	10,96 75,01
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,63 -0,24	-1,61 -0,28	-1,61 -0,28	1,38 -0,12	5,25 0,27	14,20 0,33	24,83 0,12
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,14 -0,79	0,34 -1,71	0,34 -1,71	0,72 -4,52	2,06 -4,04	12,01 2,41	21,02 6,40
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,12 60,75	0,28 57,34	0,28 57,34	0,54 56,12	1,37 61,83	5,99 76,94	11,78 80,57
MONGERAL AEGON INFLAÇÃO REFERENCIADO IMA-B FI RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,52 -0,06	-3,05 -0,25	-3,05 -0,25	3,87 -0,30	9,83 -0,55	19,92 -0,55	34,73 -2,26
XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP Var. IPCA p.p.	-0,08 -1,01	-1,02 -3,07	-1,02 -3,07	3,40 -1,84	9,36 3,26	18,04 8,44	
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CRED PRIV Var. IMA-B 5 p.p.	0,33 -0,01	0,15 0,30	0,15 0,30	4,04 0,81	11,03 2,53	17,34 -1,29	28,86 -0,68
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	-0,36 -0,70	-2,51 -2,36	-2,51 -2,36	1,81 -1,41	7,91 -0,59	20,52 1,88	32,97 3,43
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,47 -0,01	-2,86 -0,06	-2,86 -0,06	4,06 -0,11	10,15 -0,24	19,69 -0,79	35,87 -1,12
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,31 -0,03	-0,23 -0,08	-0,23 -0,08	3,08 -0,14	8,20 -0,30	17,97 -0,67	28,58 -0,95
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	0,39 0,05	0,67 0,82	0,67 0,82	3,59 0,36	9,44 0,94	20,45 1,82	31,66 2,13
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,07	-1,52	-1,52	2,35	8,43	21,33	32,96

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.	0,53	1,28	1,28	-1,82	-1,96	0,86	-4,03
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,82 -0,35	-4,28 -1,48	-4,28 -1,48	2,96 -1,21	9,28 -1,10	20,28 -0,20	
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,39 0,85	0,67 3,47	0,67 3,47	3,58 -0,59	7,11 -3,28	14,53 -5,95	25,28 -11,71
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,38 -1,09	-0,19 -3,69	-0,19 -3,69	2,73 -5,58	8,97 -3,45	21,25 -1,90	33,22 -3,23
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,42 -0,04	-1,88 -0,24	-1,88 -0,24	1,24 0,09	4,35 0,17	13,27 0,41	23,79 0,44
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,30 -0,63	-0,18 -2,24	-0,18 -2,24	1,85 -3,39	5,09 -1,01	19,24 9,64	29,94 15,33
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,37 0,08	-0,02 0,02	-0,02 0,02	3,02 0,02	8,45 -0,13	17,15 -1,31	27,36 -2,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,01 -0,04	0,05 -0,07	0,05 -0,07	0,70 -0,13	2,27 -0,23	8,88 -0,45	15,96 -0,68
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,28 -0,82	-5,01 -2,20	-5,01 -2,20	2,82 -1,35	9,49 -0,90	20,38 -0,10	37,82 0,83
MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO % do CDI	-0,80 -399,70	-1,48 -304,60	-1,48 -304,60	0,63 65,88	1,59 71,54	5,31 68,21	
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	4,03 2.002,13	6,63 1.364,61	6,63 1.364,61	18,95 1.974,28	51,79 2.330,12	39,36 505,90	55,80 381,78
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	4,07 -1,93	6,58 8,58	6,58 8,58	18,69 -4,60	51,16 -8,57	39,63 17,39	55,47 18,84
RBBV11 Var. IFIX p.p.	-2,21 -0,83	4,00 4,81	4,00 4,81	8,08 6,22	21,18 7,04	30,26 15,60	52,43 31,67
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	8,97 2,98	1,99 3,99	1,99 3,99	20,94 -2,35	45,27 -14,45	33,20 10,97	62,16 25,53
BRANCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	0,16 -5,84	-5,50 -3,49	-5,50 -3,49	14,00 -9,28	51,45 -8,28	10,58 -11,66	25,01 -11,62
VINCI MOSAICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,02 -1,98	-2,31 -0,31	-2,31 -0,31	18,38 -4,91	53,87 -5,86	38,93 16,69	57,04 20,41
VINCI SELECTION EQUITIES FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,96 -1,03	-2,48 -0,48	-2,48 -0,48	15,40 -7,89	51,32 -8,41	32,80 10,56	55,29 18,66
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA Var. SMALL CAP p.p.	0,77 -3,80	-0,40 0,48	-0,40 0,48	16,51 -4,95	54,57 -10,01		
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	8,73	-1,68	-1,68	25,98	76,37	44,87	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	2,73	0,32	0,32	2,70	16,64	22,63	
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,94 -2,06	-2,70 -0,70	-2,70 -0,70	19,50 -3,79	57,43 -2,30	32,44 10,20	50,37 13,74
VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	5,60 -0,39	-3,93 -1,93	-3,93 -1,93	19,92 -3,37	41,86 -17,86	27,66 5,42	45,70 9,07
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,57 1,58	1,01 3,01	1,01 3,01	22,21 -1,08	49,27 -10,46	16,12 -6,12	34,36 -2,27
QUELUZ VALOR FI EM ACOES Var. IBOVESPA p.p.	1,88 -4,12	-4,14 -2,14	-4,14 -2,14	10,22 -13,07	40,34 -19,39	10,63 -11,61	23,16 -13,46
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. INPC + 6,00% p.p.	-3,16 -4,56	-8,73 -12,14	-8,73 -12,14	-3,50 -11,93	10,95 -2,35	9,00 -15,13	
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IBOVESPA p.p.	1,74 -4,26	9,50 11,50	9,50 11,50	13,72 -9,57	68,64 8,91	124,01 101,77	
ACCESS DIVERSIFIED DYNAMIC FIM - INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	0,79 392,96	-0,42 -87,27	-0,42 -87,27	4,39 456,98	10,78 484,98	12,07 155,12	20,47 140,06
BB MULTIMERCADO SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI ACWI p.p.	3,69 -1,86	14,99 0,77	14,99 0,77	19,64 -0,69	70,86 4,06	104,27 10,70	150,76 22,43
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-1,32 -6,87	3,59 -10,63	3,59 -10,63	24,46 4,13			
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-2,14 -3,61	6,58 3,07	6,58 3,07	9,46 1,15	79,75 67,34		
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	-7,82 -13,37	5,38 -8,83	5,38 -8,83				
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	3,03 -2,97	11,67 13,67	11,67 13,67	13,16 -10,13	59,12 -0,60	93,70 71,46	
GUARULHOS - CONSOLIDADO Var. INPC + 5,45% p.p.	0,95 -0,40	-0,63 -3,91	-0,63 -3,91	6,46 -1,69	13,51 0,79	17,59 -5,26	27,65 -7,88
CDI	0,20	0,49	0,49	0,96	2,22	7,78	14,62
IBOVESPA	6,00	-2,00	-2,00	23,29	59,73	22,24	36,63
INPC + 6,00%	1,40	3,41	3,41	8,43	13,30	24,13	37,66
IPCA + 6,00%	1,47	3,50	3,50	8,31	12,41	23,15	36,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Indexadores

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
165	01/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.489,51	3.537,79634000	2,1169986290
159	01/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	13.560,84	6.405,69144200	2,1169986290
178	01/03/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	13.267,13	3.850,63950000	3,4454355000
179	02/03/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	5.080,68	1.474,45510000	3,4458017000
180	03/03/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	138,28	40,12620000	3,4461213000
141	04/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	26.788,96	12.652,41200000	2,1173006380
120	05/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.475,92	0,00	697,06258200	2,1173421670
142	05/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	60.800,44	28.715,45324500	2,1173421670
166	05/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	98.169,34	46.364,41928400	2,1173421670
160	05/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	397.989,08	187.966,35055200	2,1173421670
173	05/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	734.474,59	0,00	346.885,16643500	2,1173421670
181	05/03/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	57.818,30	16.774,98180000	3,4466986000
182	05/03/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	73.122,12	21.215,11960000	3,4466986000
193	08/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.649.864,69	4.839.063,90058600	2,6141140000
121	08/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	15.500.041,80	7.320.244,78292300	2,1174212420
134	08/03/2021	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	12.021.531,83	0,00	7.941.331,36432788	1,5137930000
131	08/03/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	14.855.662,20	822.204,66886277	18,0680830000
139	08/03/2021	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3.500.000,00	0,00	874.045,04024016	4,0043703000
143	08/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	18.187,66	8.589,53317300	2,1174212420
187	08/03/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	68.722,86	19.937,38200000	3,4469350000
186	08/03/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	264.568,67	76.754,76190000	3,4469350000
130	09/03/2021	AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	5.500.000,00	0,00	5.412.412,55140439	1,0161827000
122	09/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	2.778.056,01	0,00	1.311.952,49304400	2,1174974130
136	09/03/2021	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	278.066,46	0,00	183.723,88011380	1,5135020000
135	09/03/2021	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	628.332,86	0,00	415.151,65490366	1,5135020000
137	09/03/2021	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	12.077.595,74	0,00	7.979.900,74674497	1,5135020000
133	09/03/2021	OCCAM FIC FIA	5.500.000,00	0,00	1.658.106,56590604	3,3170365000
123	10/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	995.191,30	469.972,60768700	2,1175517120

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
140	10/03/2021	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	1.000.000,00	0,00	1.541,12728798	648,8756690000
144	10/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.991.764,00	940.597,57252300	2,1175517120
132	11/03/2021	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.000.000,00	0,00	882.877,86400061	1,1326595000
161	11/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	798,42	0,00	377,03440700	2,1176316660
124	12/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	79.324,05	37.457,99910500	2,1176798520
145	12/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.620.697,53	0,00	765.317,53771400	2,1176798520
154	12/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.544,42	1.673,72797000	2,1176798520
162	12/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.681.782,24	1.266.377,55818900	2,1176798520
158	12/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	31.330,63	14.794,79061503	2,1176798520
188	12/03/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	2.499.347,25	724.988,22670000	3,4474315000
125	15/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.000.010,45	2.361.021,29358900	2,1177320440
163	15/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10,45	4,93452400	2,1177320440
146	15/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.000.010,45	4.722.037,65265500	2,1177320440
189	15/03/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	826.035,86	239.591,32130000	3,4476869000
174	15/03/2021	XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP	10.000.000,00	0,00	3.823.146,73726540	2,6156464000
175	15/03/2021	ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	5.000.000,00	0,00	2.216.999,66075470	2,2553003000
147	16/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.000,00	4.721,88398400	2,1177987500
168	16/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	9.999,65	0,00	4.721,71871800	2,1177987500
169	17/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.378,08	4.900,30830700	2,1178422560
126	19/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	21.709,69	0,00	10.249,97172600	2,1180243790
155	19/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	39.621,21	0,00	18.706,68269500	2,1180243790
148	19/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	20.495,60	9.676,75358400	2,1180243790
190	19/03/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	31.074,75	9.010,78870000	3,4486163000
191	19/03/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	2.709,45	785,66290000	3,4486163000
170	22/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	66.883,81	0,00	31.575,14092600	2,1182426440
192	22/03/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	66.883,81	19.391,49650000	3,4491309000
176	23/03/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	110.059,45	0,00	31.905,05740000	3,4495926000
127	24/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	444.532,55	0,00	209.831,89598600	2,1185175300
149	24/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	127.217,49	60.050,24183100	2,1185175300
128	25/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	18.382.994,49	0,00	8.676.779,75866500	2,1186425150

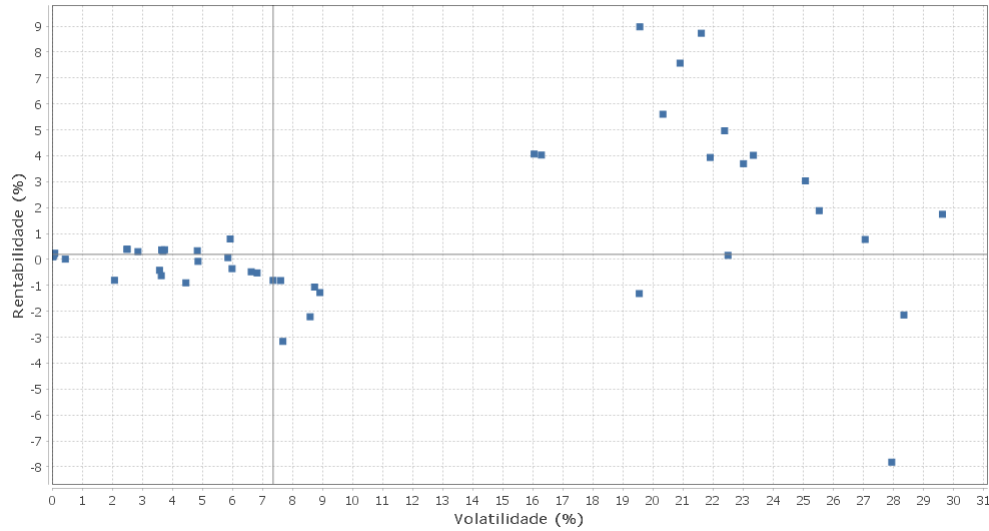
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
150	25/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.768,41	1.306,69047800	2,1186425150
164	26/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	2.500.000,00	0,00	1.179.944,99763700	2,1187428270
183	26/03/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	12.986,87	3.763,62040000	3,4506322000
129	29/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	171.468,75	80.923,83829400	2,1188904730
151	29/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	93.044,46	43.911,87802600	2,1188904730
156	29/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	26.106,27	12.320,72649900	2,1188904730
184	29/03/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,00	1.851,51	536,49710000	3,4511091000
152	30/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	100.000,00	47.192,13527100	2,1189971470
171	30/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	50.000,00	23.596,06763500	2,1189971470
177	30/03/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	88.002,46	0,00	25.496,76220000	3,4515151000
157	31/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.989,06	1.882,40824300	2,1191258670
153	31/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	72.305,79	0,00	34.120,57354600	2,1191258670
185	31/03/2021	BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	4.730.000,00	0,00	1.370.279,22870000	3,4518512000
Total						

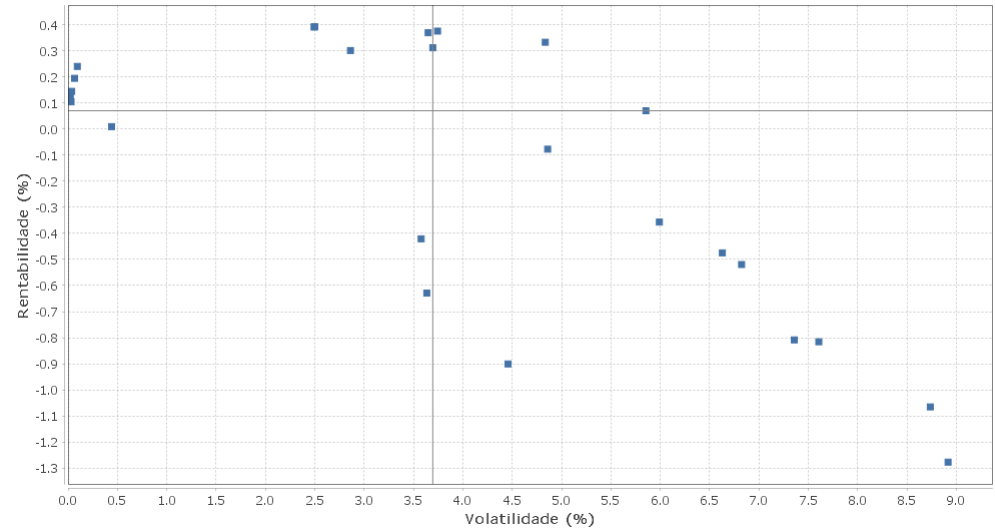
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

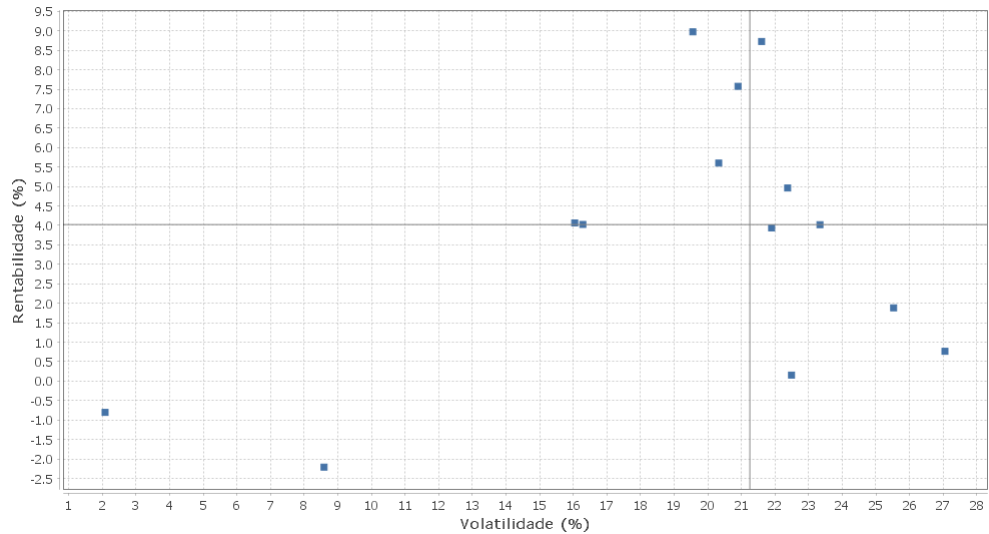
GUARULHOS - CONSOLIDADO - No Mês



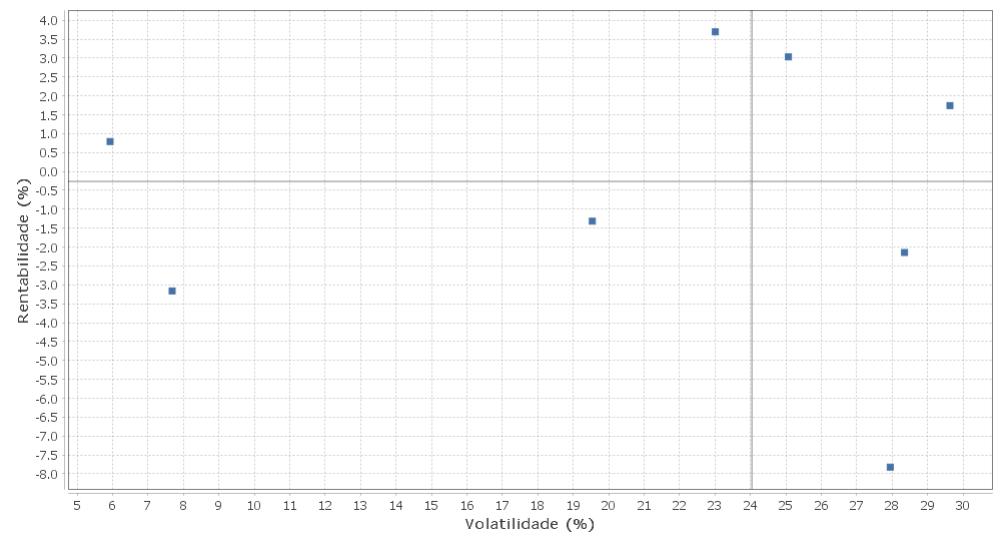
Renda Fixa - No Mês



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\$): 14.752.872,08

Value-At-Risk: 2,94%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	-0,00	-3,42	0,12	96.952,50	0,02
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,01	0,00	-3,14	0,10	33.810.387,41	6,73
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	NaN	0,00	-1,52	0,14	0,00	0,00
BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,02	-0,00	-0,10	0,19	9.502.691,32	1,89
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,09	0,03	0,00	0,42	0,24	4.695.539,74	0,93
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,44	NaN	0,00	-0,43	0,01	0,00	0,00
MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	2,08	0,85	0,01	-0,48	-0,80	4.985.091,03	0,99
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	2,49	0,79	0,00	0,08	0,39	349.519,86	0,07
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	Artigo 7º I, Alínea b	2,50	0,80	0,01	0,08	0,39	6.693.534,49	1,33
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,86	0,94	0,07	0,03	0,30	63.640.341,74	12,67
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,58	1,36	0,02	-0,17	-0,42	13.356.273,86	2,66
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	3,63	1,29	0,01	-0,23	-0,63	10.422.577,93	2,07
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,65	1,45	0,02	0,05	0,37	9.080.690,22	1,81
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,70	1,43	0,01	0,03	0,31	5.920.490,50	1,18
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	3,74	1,46	0,01	0,05	0,38	7.594.603,12	1,51
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	4,46	1,48	0,04	-0,25	-0,90	25.211.403,00	5,02
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	Artigo 7º VII, Alínea b	4,83	1,43	0,01	0,03	0,33	4.979.335,79	0,99
XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP	Artigo 7º III, Alínea a	4,86	1,57	0,02	-0,06	-0,08	12.872.192,27	2,56
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,85	2,01	0,01	-0,02	0,07	4.229.567,50	0,84
ACCESS DIVERSIFIED DYNAMIC FIM - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	5,93	2,39	0,00	0,10	0,79	2.488.934,28	0,50
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,99	2,18	0,05	-0,09	-0,36	20.343.342,07	4,05
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,63	2,82	0,03	-0,10	-0,47	9.254.479,46	1,84
MONGERAL AEGON INFLAÇÃO REFERENCIADO IMA-B FI RF LP	Artigo 7º III, Alínea a	6,82	2,91	0,03	-0,11	-0,52	8.515.583,92	1,69
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	7,36	3,03	0,01	-0,14	-0,81	3.025.206,23	0,60
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	7,61	3,23	0,06	-0,13	-0,82	16.506.781,07	3,29
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MM INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	7,68	3,28	0,02	-0,44	-3,16	8.798.776,72	1,75
RBBV11	Artigo 8º IV, Alínea b	8,59	4,15	-0,00	-0,28	-2,21	1.440.150,00	0,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	8,74	3,62	0,11	-0,14	-1,07	29.304.042,35	5,83
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	8,92	3,04	0,02	-0,17	-1,28	7.183.500,00	1,43
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	16,04	6,68	0,26	0,24	4,07	27.439.897,83	5,46
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	16,29	6,78	0,16	0,23	4,03	17.037.997,97	3,39
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	19,54	10,55	0,07	-0,08	-1,32	4.620.316,66	0,92
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	19,56	9,50	0,08	0,45	8,97	4.651.929,76	0,93
VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	20,33	9,60	0,23	0,27	5,60	13.632.841,42	2,71
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,90	10,43	0,25	0,35	7,57	13.413.719,75	2,67
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	21,60	11,68	0,06	0,39	8,73	2.990.227,71	0,60
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,90	10,55	0,17	0,17	3,94	8.670.214,31	1,73
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,38	9,19	0,29	0,21	4,96	17.231.458,92	3,43
BRDESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	22,49	11,01	0,06	-0,00	0,16	3.353.376,72	0,67
BB MULTIMERCADO SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	Artigo 9º A, II	23,01	10,29	0,00	0,15	3,69	6.090.704,09	1,21
VINCI MOSAICO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,34	9,58	0,20	0,16	4,02	11.853.023,80	2,36
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	25,07	11,75	0,05	0,11	3,03	6.857.648,58	1,36
QUELUZ VALOR FI EM ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	25,53	11,29	0,05	0,07	1,88	2.530.562,69	0,50
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	27,06	12,36	0,42	0,02	0,77	19.728.897,26	3,93
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	27,94	11,00	-0,02	-0,29	-7,82	4.163.489,19	0,83
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	28,35	12,73	0,01	-0,08	-2,14	7.628.801,29	1,52
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	29,63	11,60	0,04	0,05	1,74	6.243.246,21	1,24