



**LDB**  
EMPRESAS

**DIADEMA**  
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 68,82%

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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	5,11	-0,59	-0,51	2.151.302,99	0,82	1.352.679.953,96	0,16
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	12,89	-1,53	-2,40	20.471.882,39	7,78	1.190.218.692,49	1,72
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,37	-1,51	-2,16	27.105.021,04	10,30	1.154.939.152,90	2,35
BB	BB	BB PREV IPCA I	4,93	-0,01	0,28	16.696.237,48	6,34	506.870.926,97	3,29
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,34	-0,91	-1,46	25.857.770,93	9,82	9.434.126.715,63	0,27
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,98	-0,51	-0,48	36.299.716,93	13,79	15.107.095.289,30	0,24
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>7,34</b>	<b>-0,90</b>	<b>-1,24</b>	<b>128.581.931,76</b>	<b>48,85</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	13,45	-1,72	-2,73	21.779.157,79	8,27	1.966.997.449,89	1,11
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,22	0,10	0,26	17.071.060,48	6,49	2.967.792.040,55	0,58
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>8,45</b>	<b>-0,87</b>	<b>-1,38</b>	<b>38.850.218,27</b>	<b>14,76</b>		

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
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4,63	-1,07	-0,98	10.017.323,46	3,81	620.319.436,86	1,61
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	1,60	0,26	0,51	3.686.017,51	1,40	146.050.386,36	2,52
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>3,44</b>	<b>-0,72</b>	<b>-0,58</b>	<b>13.703.340,97</b>	<b>5,21</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>7,38</b>	<b>-0,88</b>	<b>-1,21</b>	<b>181.135.491,00</b>	<b>68,82</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

31,18%

## 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
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	40,15	-3,81	-7,57	13.107.272,53	4,98	1.494.264.626,94	0,88
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	46,15	0,81	-1,12	8.939.358,94	3,40	1.438.962.044,80	0,62
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	46,02	-2,53	-3,13	6.803.989,52	2,59	2.741.202.425,63	0,25
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	41,81	-3,36	-6,38	4.386.108,81	1,67	1.033.064.602,48	0,42
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	52,67	-4,30	-7,08	19.702.345,96	7,49	1.154.784.976,21	1,71
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>46,11</b>	<b>-3,04</b>	<b>-5,69</b>	<b>52.939.075,76</b>	<b>20,11</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	24.610.427,93	9,35	1.303.746.939,74	1,89
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>32,74</b>	<b>2,67</b>	<b>2,50</b>	<b>24.610.427,93</b>	<b>9,35</b>		

## Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
PÁTRIA	PÁTRIA	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	543,22	-0,90	-11,33	9.354,85	0,00	1.299.916,55	0,72
CEF	CEF	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	11,21	-0,38	-0,89	201.400,26	0,08	7.976.174,46	2,53
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b>			<b>254,06</b>	<b>-0,41</b>	<b>-1,41</b>	<b>210.755,11</b>	<b>0,08</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	RIO BRAVO	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	27,37	0,29	-1,87	3.004.838,44	1,14	62.200.155,62	4,83
BRPP	GERAÇÃO FUTURO	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	16,70	0,12	0,95	1.298.580,71	0,49	388.909.859,86	0,33
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>			<b>20,23</b>	<b>0,24</b>	<b>-1,03</b>	<b>4.303.419,15</b>	<b>1,64</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	36,50	-1,22	-3,12	82.063.677,95	31,18
Total	12,89	-0,99	-1,79	263.199.168,95	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	128.581.931,76	48,85	15,00	60,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	38.850.218,27	14,76	1,00	10,00	40,00	0,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	13.703.340,97	5,21	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>181.135.491,00</b>	<b>68,82</b>					100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	52.939.075,76	20,11	2,00	16,00	25,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	24.610.427,93	9,35	2,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	210.755,11	0,08	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	4.303.419,15	1,64	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>82.063.677,95</b>	<b>31,18</b>					35,00

**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	-0,90 -670,05	-1,24 -437,26	1,23 273,94	1,70 186,20	4,29 181,79	-1.171.913,43	-1.618.950,25
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,87 -648,95	-1,38 -484,85	1,22 271,52	1,42 154,68	2,54 107,70	-362.698,19	-553.308,17
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,72 -533,85	-0,58 -204,00	0,95 210,50	2,49 272,30	4,18 176,86	-99.129,44	-79.917,08
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,04 1,33	-5,69 1,85	1,50 0,45	4,32 -6,41	-10,15 -15,77	-1.660.964,23	-3.195.371,77
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,67 7,04	2,50 10,05	5,77 4,72	8,77 -1,96	23,85 18,23	639.313,01	601.094,51
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,41 3,97	-1,41 6,14	-1,73 -2,78	1,13 -9,60	-92,07 -97,69	-860,93	-3.013,67
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,24 4,61	-1,03 6,51	-0,06 -1,11	15,86 5,13	3,03 -2,60	10.420,69	-44.943,63
<b>DIADEMA (Total)</b>						<b>-2.645.832,52</b>	<b>-4.894.410,06</b>

**RESULTADO POR ATIVO**

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV IPCA I	17.135.540,86	0,00	-439.639,92	0,00	16.696.237,48	336,54	50.152,04
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	25.231.094,25	867.011,78	0,00	0,00	25.857.770,93	-240.335,10	-380.474,44
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	36.484.893,27	0,00	0,00	0,00	36.299.716,93	-185.176,34	-175.951,25
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2.164.157,66	0,00	0,00	0,00	2.151.302,99	-12.854,67	-11.058,67
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	20.790.344,59	0,00	0,00	0,00	20.471.882,39	-318.462,20	-503.166,39
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	27.520.442,70	0,00	0,00	0,00	27.105.021,04	-415.421,66	-598.451,54
					128.581.931,76	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	22.299.223,93	8.786.010,02	-14.033.554,03	0,00	17.071.060,48	19.380,56	57.382,93
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	22.161.236,54	0,00	0,00	0,00	21.779.157,79	-382.078,75	-610.691,10
					38.850.218,27	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	10.125.930,51	0,00	0,00	0,00	10.017.323,46	-108.607,05	-98.702,68
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	3.676.539,90	0,00	0,00	0,00	3.686.017,51	9.477,61	18.785,60
					13.703.340,97	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	8.867.588,50	0,00	0,00	0,00	8.939.358,94	71.770,44	-101.228,29
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	6.980.449,95	0,00	0,00	0,00	6.803.989,52	-176.460,43	-219.696,73
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	13.625.767,70	0,00	0,00	0,00	13.107.272,53	-518.495,17	-1.073.951,34
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	20.587.489,54	0,00	0,00	0,00	19.702.345,96	-885.143,58	-1.501.357,00
OCCAM FIC FIA	4.538.744,30	0,00	0,00	0,00	4.386.108,81	-152.635,49	-299.138,41
					52.939.075,76	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	23.971.114,92	0,00	0,00	0,00	24.610.427,93	639.313,01	601.094,51
					24.610.427,93	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	202.176,47	0,00	0,00	0,00	201.400,26	-776,21	-1.818,41
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	9.439,57	0,00	0,00	0,00	9.354,85	-84,72	-1.195,26



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					210.755,11	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	3.012.586,86	0,00	0,00	0,00	16.500,00	3.004.838,44	8.751,58	-57.294,25
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	1.305.449,52	0,00	0,00	0,00	8.537,92	1.298.580,71	1.669,11	12.350,62
						4.303.419,15	0,00	0,00

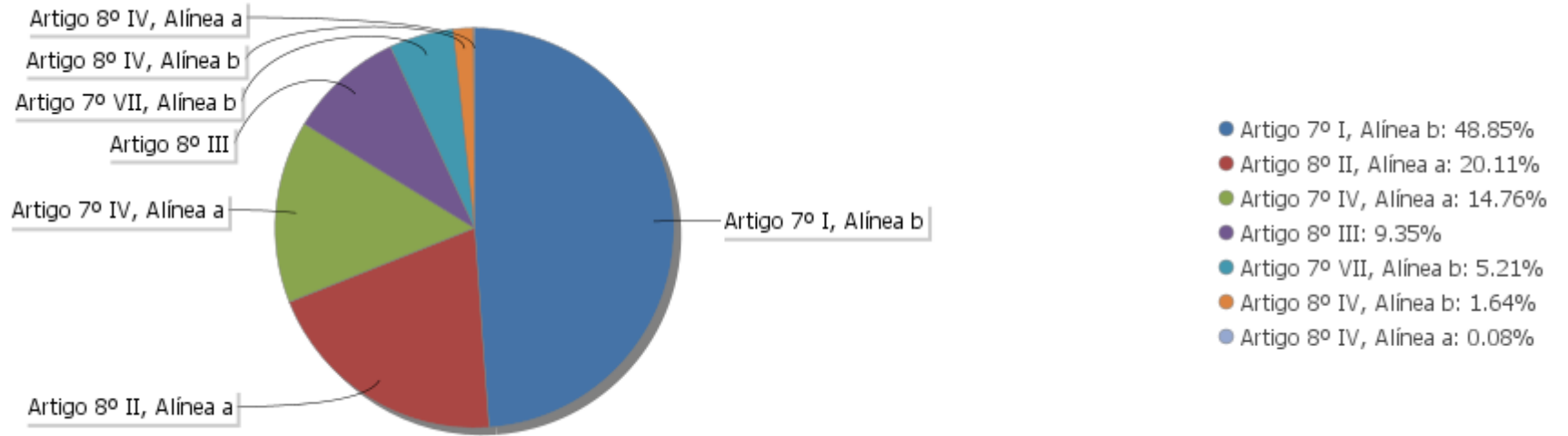
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

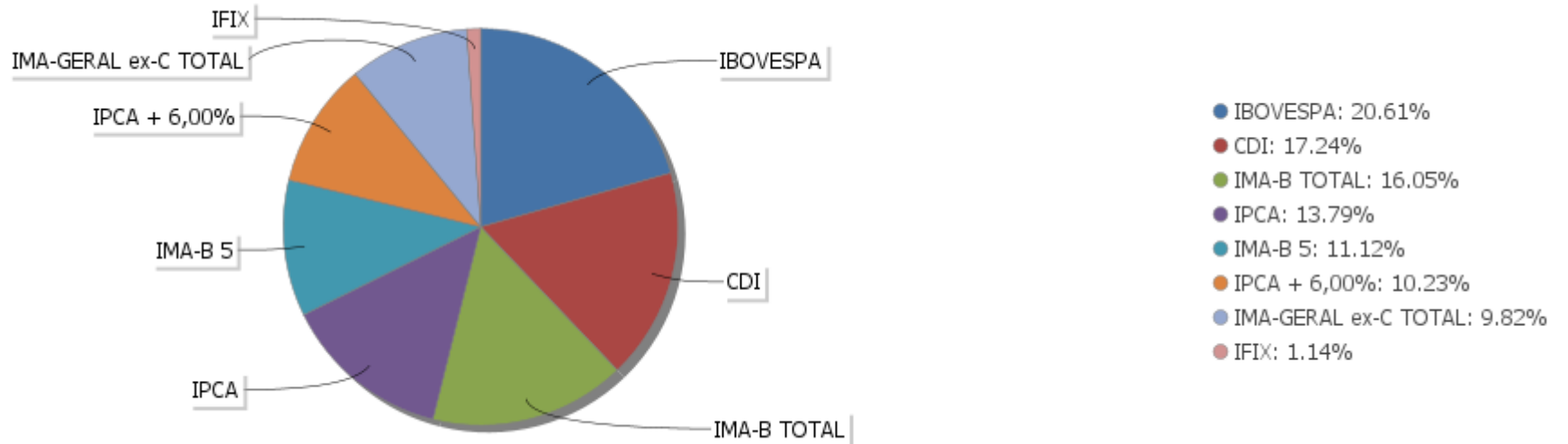
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	206.974.434,09	78,64	206.974.434,09	78,64
de 31 a 365 dias	26.506.335,48	10,07	233.480.769,57	88,71
acima de 365 dias	29.718.399,38	11,29	263.199.168,95	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

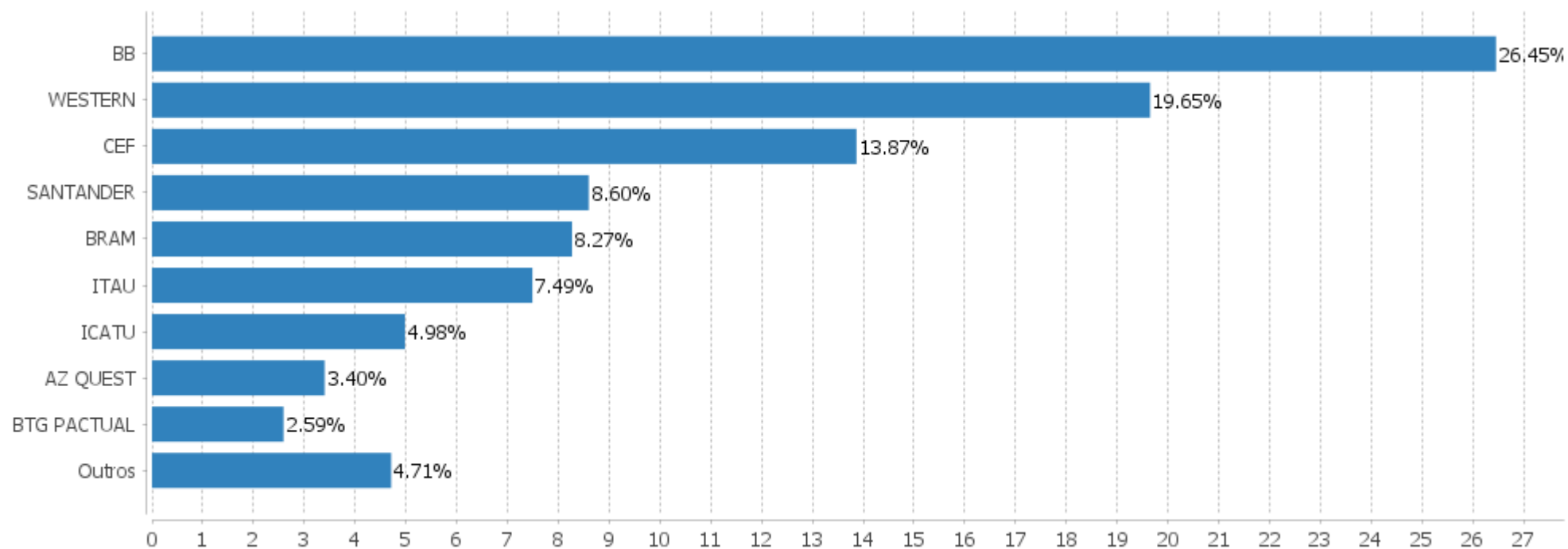


Alocação Por Estratégia



## 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	-0,82	-0,99											-1,79
IPCA + 5,44%	0,67	1,24											1,92
p.p. indexador	-1,49	-2,23											-3,72
2020	0,65	-1,49	-9,14	2,57	2,61	1,62	3,08	-0,83	-1,83	-0,62	3,93	3,52	3,39
IPCA + 5,88%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,64
p.p. indexador	-0,06	-2,15	-9,71	2,43	2,54	0,89	2,20	-1,55	-2,95	-1,96	2,58	1,66	-7,25
2019	1,96	0,42	0,53	1,12	1,29	2,25	1,43	0,12	1,52	1,92	-0,27	2,07	15,31
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	1,12	-0,47	-0,67	0,06	0,65	1,80	0,71	-0,50	1,07	1,28	-1,24	0,43	4,72

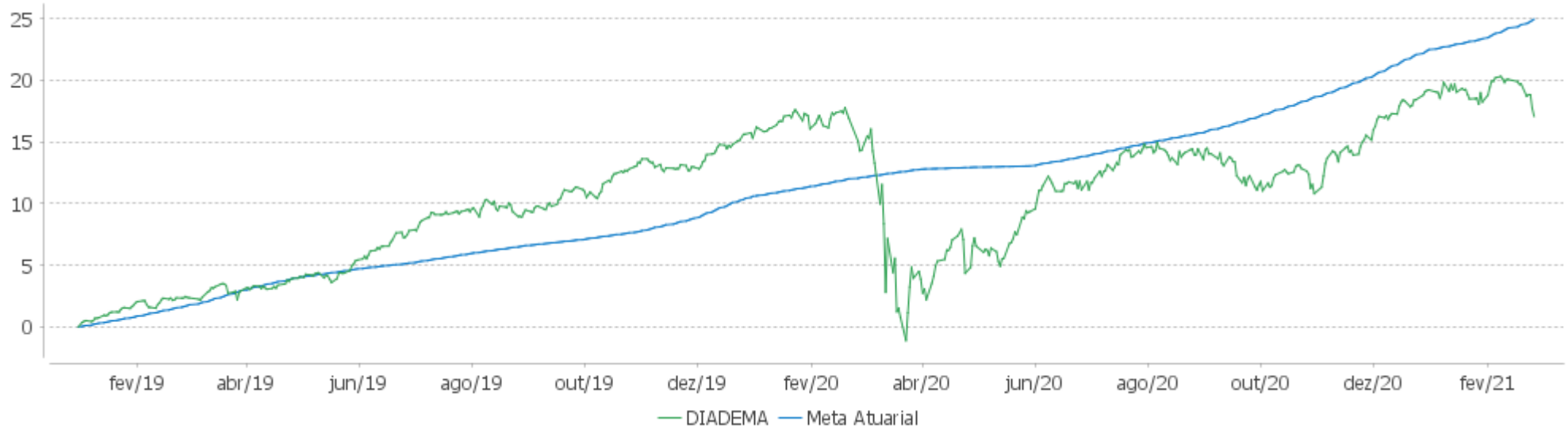
**Performance Sobre a Meta Atuarial**

**Relatório**

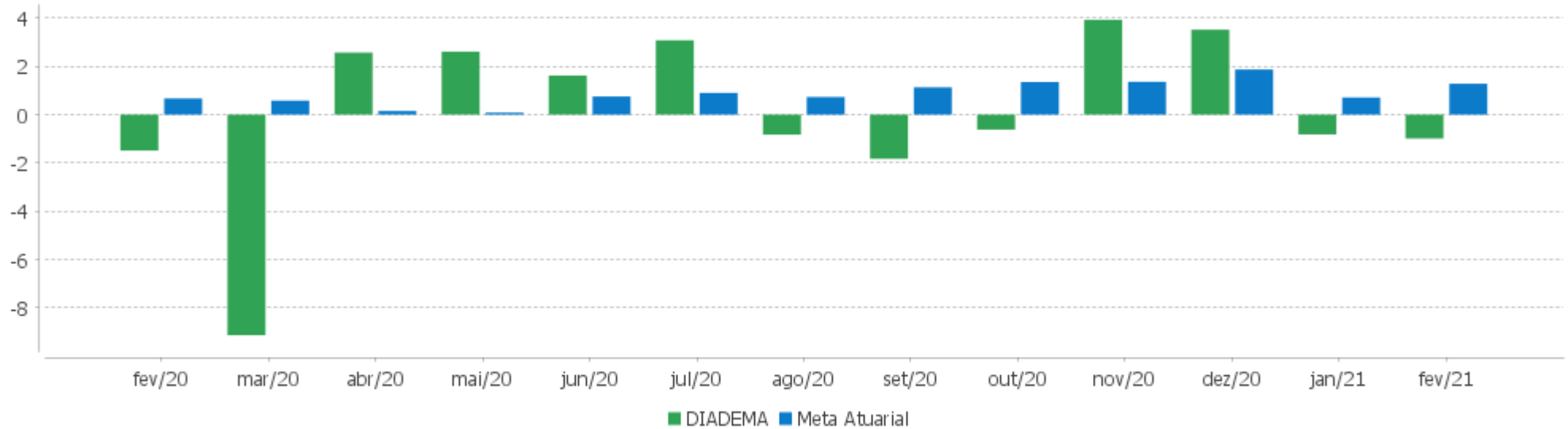
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	14	53,85	03 meses	1,66	3,82	-2,15	5,86
Meses abaixo - Meta Atuarial	12	46,15	06 meses	3,07	7,82	-4,75	6,46
			12 meses	2,40	11,24	-8,84	12,89
			24 meses	14,35	22,58	-8,23	9,56
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11	Desde 31/12/2018	17,08	24,71	-7,63	9,20
Menor rentabilidade da Carteira	-9,14	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
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-0,59 0,00	-0,51 -0,02	1,29 -0,04	2,64 -0,11	6,04 -0,19	18,67 -0,48	30,40 -0,78
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,01 -1,29	0,28 -1,72	1,50 -2,41	3,41 -4,54	7,19 -4,24	21,09 -1,73	34,01 -1,24
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
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
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,53 -0,01	-2,40 -0,04	2,31 -0,07	2,93 -0,14	2,62 -0,54	20,75 -0,99	37,44 -1,48
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,07 -2,35	-0,98 -2,98	0,89 -3,02	2,60 -5,35	5,69 -5,74	17,51 -5,31	30,57 -4,68
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO % do CDI	0,26 191,62	0,51 180,23	1,09 243,70	2,20 240,06	0,29 12,13	4,99 61,79	12,19 81,28
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,72 -0,21	-2,73 -0,37	2,08 -0,30	2,56 -0,51	2,65 -0,52	20,97 -0,76	37,93 -0,99
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,10 70,86	0,26 91,70	0,51 114,19	0,86 93,54	2,03 85,91	7,47 92,55	14,25 95,02
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,38 -1,66	-0,89 -2,90	-1,20 -5,11	2,16 -5,79	-7,08 -18,51	-69,96 -92,78	-70,36 -105,61
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP % do CDI	-0,90 -667,13	-11,33 -3.986,08	-12,00 -2.672,45	-17,32 -1.891,64	-99,63 -4.217,20	-99,78 -1.236,63	-99,77 -665,40
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,53 1,85	-3,13 4,42	1,94 0,89	5,65 -5,09	10,28 4,65	37,75 22,63	62,91 33,99
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-4,30 0,07	-7,08 0,47	0,32 -0,72	0,73 -10,01	-20,50 -26,13	-4,05 -19,17	17,50 -11,42
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,81 5,18	-1,12 6,43	5,73 4,68	8,73 -2,00	-4,31 -9,94	38,63 23,51	63,50 34,58
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,81 0,57	-7,57 -0,03	-0,21 -1,26	5,04 -5,69	-10,56 -16,19	8,40 -6,71	34,12 5,20
OCCAM FIC FIA	-3,36	-6,38	3,08	8,40	10,55	27,02	47,27



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

<b>Fundo</b> <b>Varição da Estratégia</b>	<b>No Mês</b>	<b>No Ano</b>	<b>3 meses</b>	<b>6 meses</b>	<b>12 meses</b>	<b>24 meses</b>	<b>36 meses</b>
Var. IBOVESPA p.p.	1,01	1,16	2,03	-2,34	4,92	11,90	18,36
<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>BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO</b>	<b>0,29</b>	<b>-1,87</b>	<b>-1,37</b>	<b>24,14</b>	<b>8,26</b>	<b>8,90</b>	<b>3,46</b>
Var. IFIX p.p.	0,04	-2,44	-4,15	20,38	10,87	-9,66	-21,42
<b>BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11</b>	<b>0,12</b>	<b>0,95</b>	<b>3,09</b>	<b>-1,80</b>	<b>-8,75</b>	<b>7,84</b>	<b>-3,32</b>
Var. IBOVESPA p.p.	4,50	8,49	2,05	-12,54	-14,38	-7,28	-32,23
<b>DIADEMA</b>	<b>-0,99</b>	<b>-1,79</b>	<b>1,66</b>	<b>3,07</b>	<b>2,40</b>	<b>14,35</b>	
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-2,27	-3,80	-2,25	-4,88	-9,03	-8,47	
<b>CDI</b>	<b>0,13</b>	<b>0,28</b>	<b>0,45</b>	<b>0,92</b>	<b>2,36</b>	<b>8,07</b>	<b>14,99</b>
<b>IBOVESPA</b>	<b>-4,37</b>	<b>-7,55</b>	<b>1,05</b>	<b>10,73</b>	<b>5,63</b>	<b>15,12</b>	<b>28,92</b>
<b>INPC + 6,00%</b>	<b>1,24</b>	<b>1,98</b>	<b>4,00</b>	<b>8,39</b>	<b>12,51</b>	<b>23,91</b>	<b>36,52</b>
<b>IPCA + 6,00%</b>	<b>1,28</b>	<b>2,00</b>	<b>3,91</b>	<b>7,95</b>	<b>11,43</b>	<b>22,82</b>	<b>35,25</b>

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Indexadores**

**Renda Fixa**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,04	0,08	0,39	0,94	3,08	9,80	17,36	28,91	47,25
IRF-M 1+	-2,01	-3,37	-0,43	-1,48	2,82	17,44	30,64	49,21	92,15
IRF-M TOTAL	-1,18	-1,97	-0,06	-0,58	3,01	15,23	26,69	43,25	76,67
IMA-B 5	-0,60	-0,49	1,33	2,75	6,23	19,15	31,19	46,55	66,19
IMA-B 5+	-2,33	-3,98	3,24	3,38	0,95	23,20	44,42	59,99	116,55
IMA-B TOTAL	-1,52	-2,36	2,38	3,07	3,16	21,74	38,91	53,99	95,10
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,83	-1,26	0,83	0,82	2,55	13,91	25,00	38,90	68,79
IMA-GERAL TOTAL	-0,69	-0,93	1,07	1,29	3,31	14,97	26,40	40,38	70,46
IDKA 2	-0,48	-0,33	1,40	2,72	6,95	18,92	31,03	47,34	65,63
IDKA 20	-2,69	-5,42	5,32	4,90	-1,91	24,76	54,08	66,90	183,79
CDI	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	14,99	25,28	42,67

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-4,37	-7,55	1,05	10,73	5,63	15,12	28,92	65,06	157,13
IBRX 100	-3,45	-6,38	2,19	11,97	6,92	18,84	34,16	71,82	163,52
IBRX 50	-3,80	-6,48	2,33	12,81	8,13	15,27	27,76	65,01	151,69
SMALL CAP	-1,84	-5,21	1,92	9,84	2,20	38,68	54,97	104,23	231,11
IFIX	0,25	0,57	2,78	3,75	-2,61	18,56	24,88	42,27	112,08
Índice Consumo - ICON	-5,29	-6,50	-1,83	-0,23	1,03	36,15	35,39	68,99	99,88
Índice Dividendos - IDIV	-5,21	-10,02	-1,98	7,65	-3,53	17,34	37,29	61,70	208,21

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,86	1,11	2,48	4,95	5,20	9,41	13,66	16,90	22,46
INPC	0,82	1,09	2,57	5,37	6,22	10,38	14,73	16,81	22,29
IGPM	2,53	5,17	6,18	18,11	28,94	37,73	48,21	47,59	55,52
SELIC	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	15,00	25,31	42,72

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,63	7,98	9,15	10,05	58,59	102,47	139,34	187,26	174,09
MSCI ACWI	3,23	8,21	10,25	13,57	57,54	93,07	116,17	163,31	145,71
MSCI World	3,47	7,88	9,50	12,25	56,56	93,39	119,42	164,33	144,92

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,14	1,71	3,44	6,96	9,35	18,26	27,78	36,61	48,83
IPCA + 5,00%	1,21	1,86	3,67	7,45	10,39	20,53	31,48	41,90	56,08
IPCA + 5,50%	1,25	1,93	3,79	7,70	10,91	21,67	33,36	44,60	59,81
IPCA + 5,89%	1,27	1,99	3,88	7,89	11,32	22,56	34,83	46,74	62,77
IPCA + 6,00%	1,28	2,00	3,91	7,95	11,43	22,82	35,25	47,34	63,62
INPC + 4,00%	1,10	1,69	3,53	7,39	10,41	19,31	28,98	36,50	48,63
INPC + 6,00%	1,24	1,98	4,00	8,39	12,51	23,91	36,52	47,23	63,39

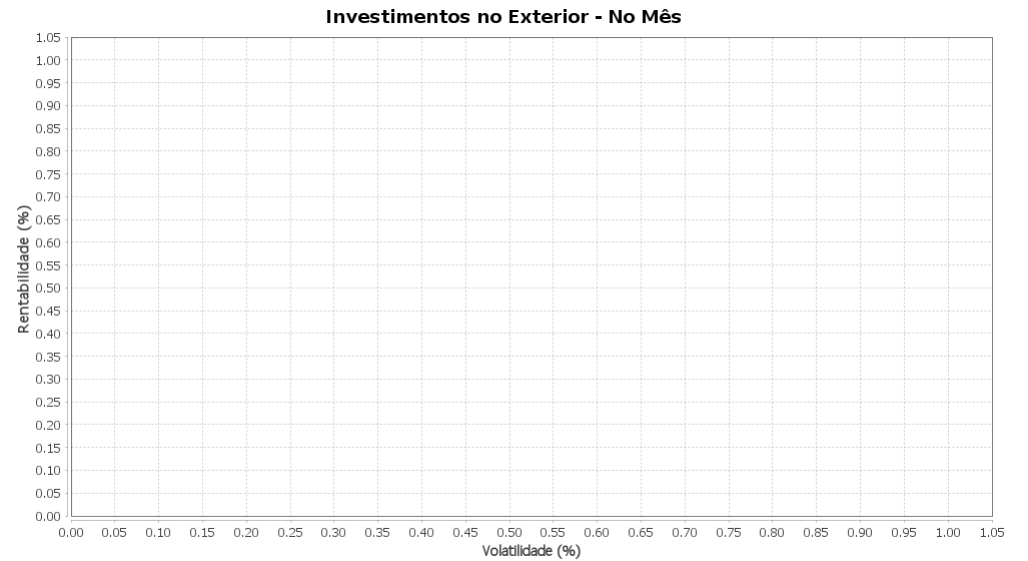
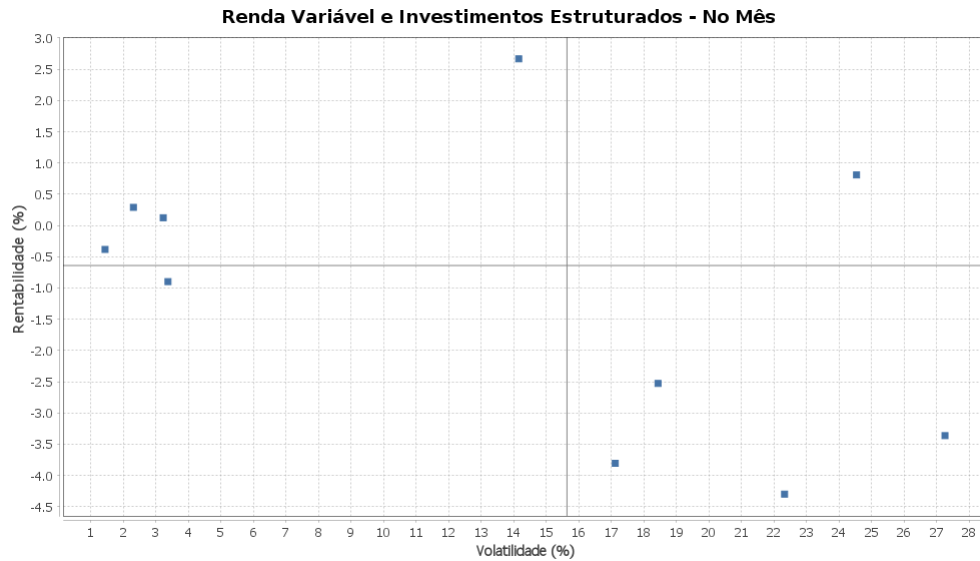
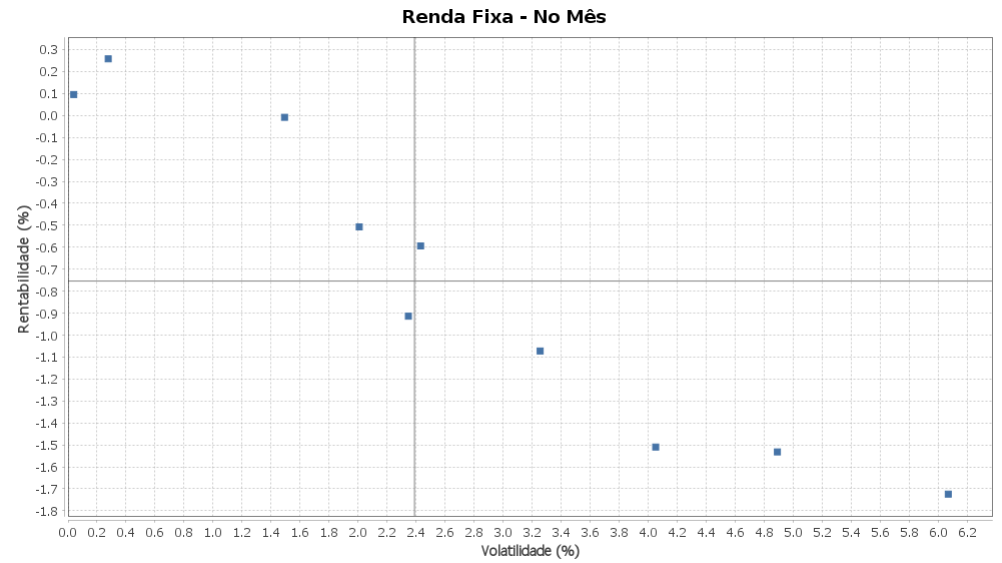
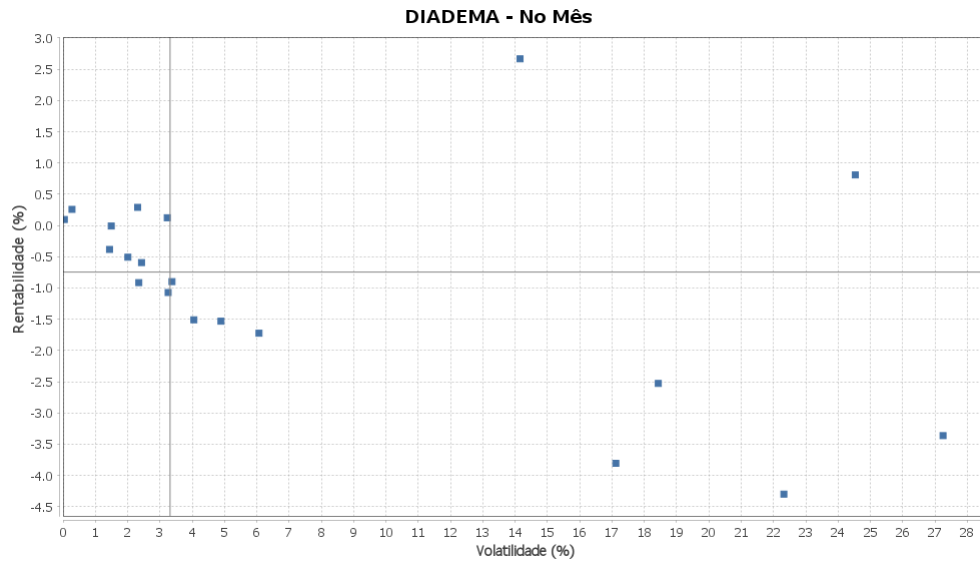
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
16	05/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	58.000,00	25.149,09923200	2,3062456220
17	05/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.146.000,00	496.911,51240300	2,3062456220
18	05/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	52.565,46	0,00	22.792,65464900	2,3062456220
19	08/02/2021	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	867.011,78	0,00	569.417,12362100	1,5226303250
20	08/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.537,92	0,00	3.701,81025500	2,3064175120
21	09/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	8.000,00	3.468,43396800	2,3065164490
22	09/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.081.801,07	469.019,44725700	2,3065164490
23	11/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	400,00	173,38896900	2,3069518370
24	12/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	56.000,00	24.273,13224500	2,3070776130
25	12/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	17.414,63	0,00	7.548,35030300	2,3070776130
26	12/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.428.190,09	2.786.291,21698300	2,3070776130
27	17/02/2021	BB PREV IPCA I	0,00	439.639,92	179.080,37570800	2,4549865850
28	17/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	15.000,00	0,00	6.501,54010000	2,3071456560
29	18/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	439.639,92	0,00	190.545,58573300	2,3072689840
30	19/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.500,00	1.083,48192100	2,3073758340
31	19/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.755.115,88	0,00	3.361.011,13902800	2,3073758340
32	22/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	2.166,94625900	2,3073945550
33	24/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	70.393,98	30.505,48571900	2,3075843030
34	25/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	120.200,00	52.087,90298700	2,3076375340
35	26/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	42.000,00	18.199,42546400	2,3077651590
36	26/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.015.068,89	2.173.127,91574200	2,3077651590
37	26/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	464.835,74	0,00	201.422,46198100	2,3077651590
38	26/02/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	32.900,47	0,00	14.256,42027300	2,3077651590
<b>Total</b>						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

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

Value-At-Risk (R\$): 8.250.004,82

Value-At-Risk: 3,13%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,04	0,00	-1,00	0,10	17.071.060,48	6,49
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,28	0,18	0,00	0,45	0,26	3.686.017,51	1,40
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	Artigo 8º IV, Alínea a	1,44	0,12	0,00	-0,36	-0,38	201.400,26	0,08
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	1,49	0,81	0,03	-0,10	-0,01	16.696.237,48	6,34
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,06	0,10	-0,32	-0,51	36.299.716,93	13,79
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	2,31	2,40	0,00	0,07	0,29	3.004.838,44	1,14
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,35	1,31	0,08	-0,45	-0,91	25.857.770,93	9,82
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,43	1,23	0,01	-0,30	-0,59	2.151.302,99	0,82
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	Artigo 8º IV, Alínea b	3,23	2,69	0,00	-0,00	0,12	1.298.580,71	0,49
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	3,25	1,27	0,03	-0,37	-1,07	10.017.323,46	3,81
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	Artigo 8º IV, Alínea a	3,37	0,86	0,00	-0,31	-0,90	9.354,85	0,00
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,05	2,17	0,14	-0,41	-1,51	27.105.021,04	10,30
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	Artigo 7º I, Alínea b	4,89	2,28	0,11	-0,34	-1,53	20.471.882,39	7,78
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	6,07	2,36	0,12	-0,31	-1,72	21.779.157,79	8,27
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	14,15	8,13	0,57	0,18	2,67	24.610.427,93	9,35
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	17,12	9,58	0,44	-0,23	-3,81	13.107.272,53	4,98
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	18,43	9,67	0,21	-0,14	-2,53	6.803.989,52	2,59
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	22,32	10,29	0,73	-0,20	-4,30	19.702.345,96	7,49
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,53	12,27	0,37	0,03	0,81	8.939.358,94	3,40
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	27,25	13,21	0,19	-0,13	-3,36	4.386.108,81	1,67