



**LDB**  
EMPRESAS

**SÃO VICENTE - 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 78,45%

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	7,89	-0,48	-2,85	4.213.949,63	2,17	7.644.309.269,72	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,90	-0,47	-2,86	29.261.477,12	15,05	5.996.206.078,69	0,49
ITAU	ITAU	ITAU RF IMAB5+ FIC DE FI	12,44	-1,19	-5,15	6.476.134,90	3,33	111.185.132,08	5,82
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,53	-1,20	-5,15	14.114.548,46	7,26	1.580.616.679,30	0,89
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,74	0,37	-0,02	29.227.754,01	15,03	10.861.361.928,62	0,27
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	4,08	-0,42	-1,88	13.197.824,61	6,79	9.507.617.903,00	0,14
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	9,22	-1,20	-4,93	1.801.025,00	0,93	66.301.603,97	2,72
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>7,35</b>	<b>-0,38</b>	<b>-2,49</b>	<b>98.292.713,73</b>	<b>50,55</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	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,23	0,22	0,55	766.679,84	0,39	3.143.103.114,21	0,02
ITAU	ITAU	ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	8,53	-0,74	-3,39	7.799.318,23	4,01	700.314.494,78	1,11
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,18	0,16	0,42	2.057.421,42	1,06	20.676.730.524,09	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	12,47	-1,15	-4,95	3.422.131,87	1,76	215.350.580,41	1,59
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	3,29	0,09	-0,72	15.869.185,41	8,16	1.065.355.221,87	1,49
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	1,65	0,14	0,34	23.272.176,10	11,97	3.580.849.195,10	0,65
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>3,70</b>	<b>-0,09</b>	<b>-1,00</b>	<b>53.186.912,87</b>	<b>27,35</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
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,43	0,16	0,27	1.066.376,57	0,55	653.314.937,12	0,16
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>0,43</b>	<b>0,16</b>	<b>0,27</b>	<b>1.066.376,57</b>	<b>0,55</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

5,96

-0,28

-1,98

152.546.003,17

78,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

21,55%

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	BRADESCO	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	25,06	6,56	-1,97	3.489.583,26	1,79	1.624.645.482,75	0,21
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	25,56	1,92	-3,15	968.912,80	0,50	745.741.603,95	0,13
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	28,76	3,21	-0,43	8.058.931,81	4,14	620.928.951,14	1,30
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	26,44	1,73	-1,46	7.445.989,90	3,83	2.831.568.584,73	0,26
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	25,44	4,45	-3,47	4.485.242,14	2,31	308.858.985,72	1,45
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	25,55	3,94	-2,70	522.040,76	0,27	1.109.023.441,48	0,05
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	25,24	5,07	-2,88	511.829,03	0,26	238.577.368,36	0,21
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVSPA - FIA	25,59	5,25	-3,64	512.609,77	0,26	432.528.507,65	0,12
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>25,40</b>	<b>3,47</b>	<b>-1,73</b>	<b>25.995.139,47</b>	<b>13,37</b>		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SAFRA	SAFRA	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	1,03	0,31	-0,03	2.444.847,41	1,26	731.139.739,87	0,33
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	20,61	4,07	6,58	13.460.279,34	6,92	1.037.182.533,83	1,30
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>16,38</b>	<b>3,47</b>	<b>5,51</b>	<b>15.905.126,75</b>	<b>8,18</b>		

<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>			<b>19,73</b>	<b>3,47</b>	<b>0,90</b>	<b>41.900.266,22</b>	<b>21,55</b>		
<b>Total</b>			<b>7,44</b>	<b>0,50</b>	<b>-1,38</b>	<b>194.446.269,39</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	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	98.292.713,73	50,55	0,00	55,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	53.186.912,87	27,35	0,00	10,00	40,00	0,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.066.376,57	0,55	0,00	0,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>152.546.003,17</b>	<b>78,45</b>					100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	25.995.139,47	13,37	0,00	20,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	15.905.126,75	8,18	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>41.900.266,22</b>	<b>21,55</b>					30,00

## 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	-0,38 -189,80	-2,49 -512,00	-2,49 -512,00	3,63 377,90	9,51 427,86	-385.636,69	-2.482.565,03
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,09 -45,11	-1,00 -205,52	-1,00 -205,52	1,99 207,69	5,72 257,16	-45.072,13	-483.776,83
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,16 79,78	0,27 55,93	0,27 55,93	0,87 90,50	1,11 49,87	1.708,13	2.890,22
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	3,47 -2,53	-1,73 0,28	-1,73 0,28	17,37 -5,92	58,97 -0,76	871.555,80	-456.634,38
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	3,47 -2,53	5,51 7,51	5,51 7,51	15,57 -7,72	39,76 -19,97	533.353,38	830.087,70
<b>SÃO VICENTE - CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>975.908,49</b>	<b>-2.589.998,32</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 RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	13.253.641,63	0,00	0,00	0,00	13.197.824,61	-55.817,02	-252.356,89
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.234.224,62	0,00	0,00	0,00	4.213.949,63	-20.274,99	-123.655,81
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	1.822.911,00	0,00	0,00	0,00	1.801.025,00	-21.886,00	-94.194,70
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	28.465.714,04	659.869,44	0,00	0,00	29.227.754,01	102.170,53	-15.774,38
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	14.285.267,93	0,00	0,00	0,00	14.114.548,46	-170.719,47	-766.874,85
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	29.668.342,15	0,00	-265.880,91	0,00	29.261.477,12	-140.984,12	-878.371,91
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	6.554.260,52	0,00	0,00	0,00	6.476.134,90	-78.125,62	-351.336,49
					98.292.713,73	0,00	0,00

## Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	765.008,98	0,00	0,00	0,00	766.679,84	1.670,86	4.172,97
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	15.854.702,48	0,00	0,00	0,00	15.869.185,41	14.482,93	-115.159,35



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	3.462.098,67	0,00	0,00	0,00	3.422.131,87	-39.966,80	-178.299,50
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	23.133.119,49	105.533,72	0,00	0,00	23.272.176,10	33.522,89	70.749,20
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	2.745.224,19	214.676,98	-906.126,57	0,00	2.057.421,42	3.646,82	8.390,24
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	7.857.747,06	0,00	0,00	0,00	7.799.318,23	-58.428,83	-273.630,39
					53.186.912,87	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	1.064.668,44	0,00	0,00	0,00	1.066.376,57	1.708,13	2.890,22
					1.066.376,57	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 ACOES FIC FIA	950.619,83	0,00	0,00	0,00	968.912,80	18.292,97	-31.479,64
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	4.293.956,12	0,00	0,00	0,00	4.485.242,14	191.286,02	-161.035,40
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	7.808.172,85	0,00	0,00	0,00	8.058.931,81	250.758,96	-34.950,36
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	3.274.718,38	0,00	0,00	0,00	3.489.583,26	214.864,88	-70.115,14
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	7.319.682,75	0,00	0,00	0,00	7.445.989,90	126.307,15	-110.041,01
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	487.140,26	0,00	0,00	0,00	511.829,03	24.688,77	-15.164,70
OCCAM FIC FIA	502.275,56	0,00	0,00	0,00	522.040,76	19.765,20	-14.490,66
SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA - FIA	487.017,92	0,00	0,00	0,00	512.609,77	25.591,85	-19.357,47
					25.995.139,47	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	2.437.363,79	0,00	0,00	0,00	2.444.847,41	7.483,62	-657,07
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	12.934.409,58	0,00	0,00	0,00	13.460.279,34	525.869,76	830.744,77
					15.905.126,75	0,00	0,00



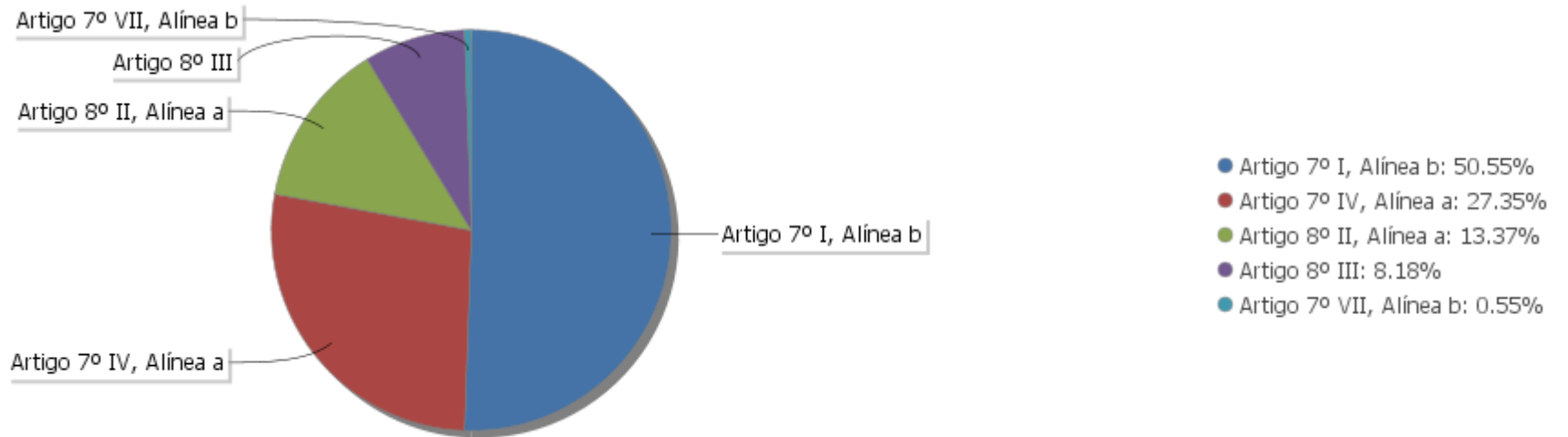
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

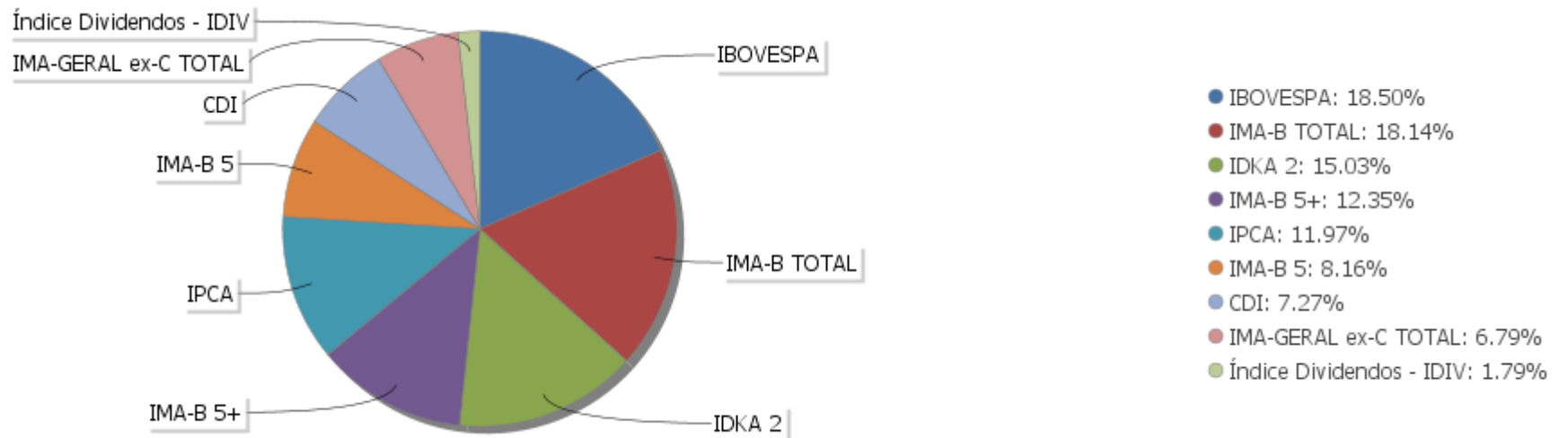
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	186.488.450,46	95,91	186.488.450,46	95,91
de 31 a 365 dias	7.957.818,93	4,09	194.446.269,39	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	194.446.269,39	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

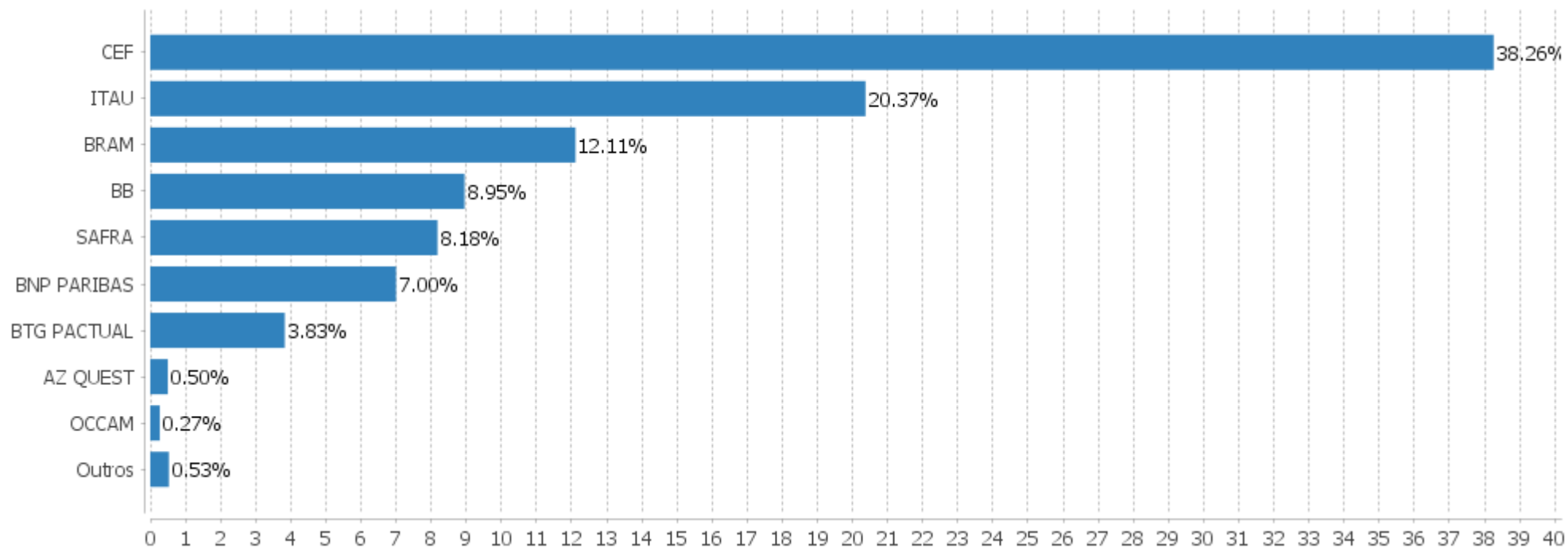


Alocação Por Estratégia



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	-0,80	-1,08	0,50										-1,38
INPC + 6,00%	0,73	1,24	1,40										3,41
p.p. indexador	-1,54	-2,32	-0,89										-4,79
2020	0,37	-1,02	-8,71	2,51	2,16	2,34	3,92	-0,89	-1,68	-0,23	3,36	3,94	5,49
INPC + 6,00%	0,70	0,59	0,69	0,23	0,21	0,79	0,98	0,85	1,36	1,38	1,42	1,98	11,75
p.p. indexador	-0,34	-1,61	-9,40	2,27	1,94	1,55	2,94	-1,74	-3,04	-1,62	1,94	1,96	-6,26
2019	3,68	0,35	0,43	1,28	2,33	2,92	1,33	-0,10	2,15	2,38	-1,05	2,74	19,95
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	2,81	-0,66	-0,78	0,19	1,67	2,47	0,69	-0,73	1,72	1,81	-2,06	1,03	9,17
2018	1,94	0,51	0,85	0,19	-2,24	-0,23	1,89	-0,53	0,08	5,08	0,90	1,26	9,96
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	1,20	-0,08	0,29	-0,51	-3,16	-2,15	1,13	-1,07	-0,66	4,16	0,69	0,66	0,37
2017	1,43	2,24	1,15	0,15	-0,53	0,43	2,86	1,21	1,36	0,03	-0,23	0,89	11,50
INPC + 6,00%	0,93	0,66	0,85	0,50	0,87	0,19	0,66	0,50	0,44	0,86	0,64	0,72	8,12
p.p. indexador	0,50	1,58	0,29	-0,34	-1,40	0,24	2,21	0,71	0,91	-0,83	-0,88	0,16	3,39

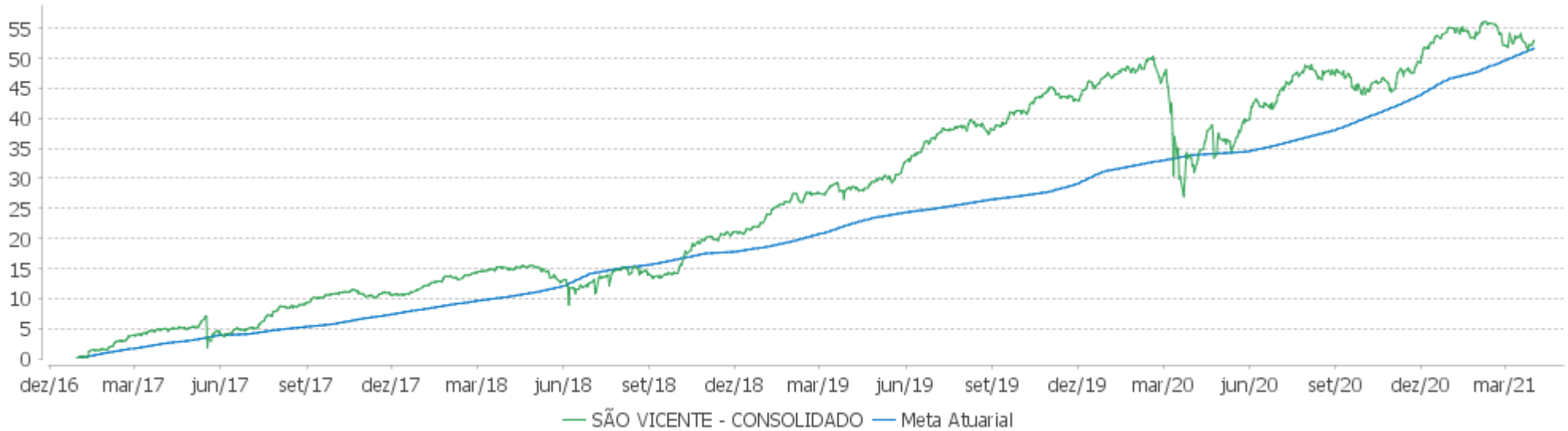
## Performance Sobre a Meta Atuarial

## Relatório

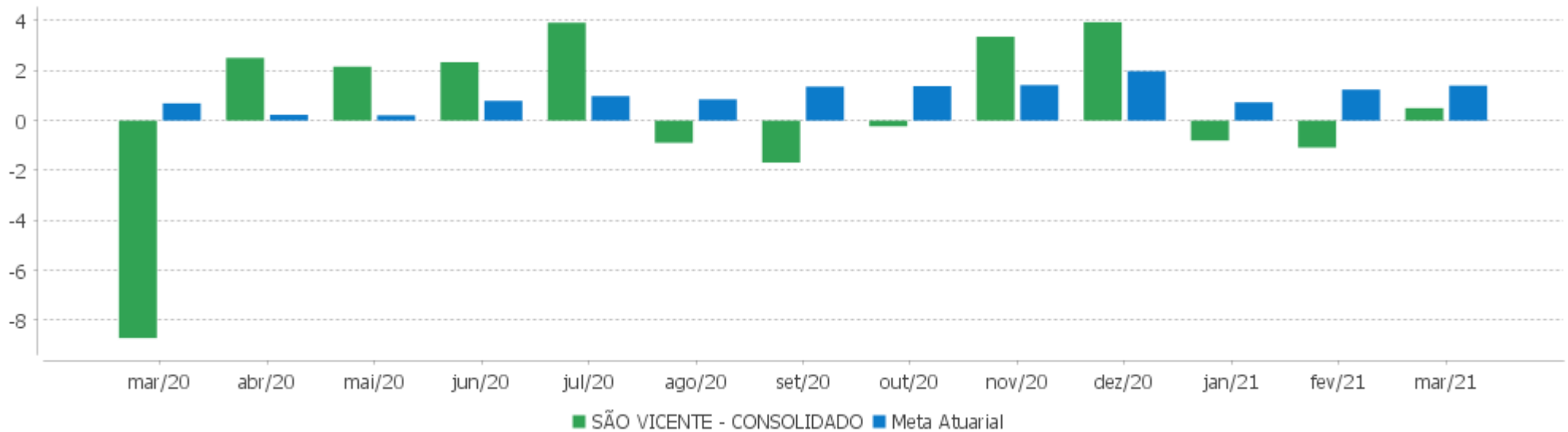
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	28	54,90	03 meses	-1,38	3,41	-4,79	5,92
Meses abaixo - Meta Atuarial	23	45,10	06 meses	5,70	8,43	-2,73	5,60
			12 meses	14,71	13,30	1,41	7,44
			24 meses	19,44	24,13	-4,70	9,61
Maior rentabilidade da Carteira	5,08	2018-10	36 meses	32,79	37,66	-4,87	8,81
Menor rentabilidade da Carteira	-8,71	2020-03	48 meses	45,86	48,02	-2,17	8,16
			Desde 30/12/2016	53,00	51,67	1,33	7,95

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
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	0,16 79,78	0,27 55,93	0,27 55,93	0,87 90,50	1,11 49,87	6,23 80,08	12,74 87,19
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 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,20 -0,74	-4,93 -2,13	-4,93 -2,13	2,90 -1,27	9,57 -0,82	20,44 -0,03	37,86 0,87
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
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
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,48 -0,02	-2,85 -0,05	-2,85 -0,05	4,08 -0,09	10,09 -0,30	19,91 -0,56	35,98 -1,01
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,20 -0,03	-5,15 -0,05	-5,15 -0,05	4,87 -0,03	11,75 -0,26	20,41 -0,83	40,66 -1,53
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,19 -0,02	-5,15 -0,05	-5,15 -0,05	4,73 -0,17	11,54 -0,47	20,26 -0,98	40,18 -2,01
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,09 -0,25	-0,72 -0,57	-0,72 -0,57	2,48 -0,74	7,71 -0,79	17,60 -1,04	27,97 -1,57
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,22 108,61	0,55 112,63	0,55 112,63	0,96 99,87	2,05 92,15	7,08 90,98	13,74 94,01
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	-0,74 -369,78	-3,39 -697,59	-3,39 -697,59	3,49 363,35	9,66 434,57	22,62 290,73	38,90 266,10
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	0,16 81,46	0,42 86,60	0,42 86,60	0,88 91,23	1,93 86,68	7,30 93,89	13,94 95,39
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,15 0,02	-4,95 0,15	-4,95 0,15	4,90 0,01	11,74 -0,27	20,00 -1,24	40,31 -1,88
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
BRADESCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	6,56 -1,00	-1,97 1,24	-1,97 1,24	23,31 1,90	43,07 3,73	6,84 -21,67	20,38 -25,76
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,73 -4,27	-1,46 0,55	-1,46 0,55	10,75 -12,53	64,29 4,56	42,15 19,91	62,62 25,99
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	4,45	-3,47	-3,47	18,38	52,70	24,14	42,56

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.	-1,54	-1,46	-1,46	-4,91	-7,03	1,90	5,93
AZ QUEST ACOES FIC FIA	1,92	-3,15	-3,15	13,11	51,47	15,09	28,48
Var. IBOVESPA p.p.	-4,07	-1,14	-1,14	-10,18	-8,26	-7,15	-8,15
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	5,07	-2,88	-2,88	16,67	33,20		
Var. IBOVESPA p.p.	-0,93	-0,87	-0,87	-6,62	-26,53		
SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA - FIA	5,25	-3,64	-3,64	20,70	57,34	26,35	41,73
Var. IBOVESPA p.p.	-0,74	-1,64	-1,64	-2,59	-2,39	4,11	5,10
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	3,21	-0,43	-0,43	21,68	70,60	42,03	52,56
Var. IBOVESPA p.p.	-2,79	1,57	1,57	-1,61	10,87	19,79	15,93
OCCAM FIC FIA	3,94	-2,70	-2,70	19,50	57,43	32,44	50,37
Var. IBOVESPA p.p.	-2,06	-0,70	-0,70	-3,79	-2,30	10,20	13,74
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,31	-0,03	-0,03	1,47	2,42	8,17	13,82
% do CDI	152,69	-5,53	-5,53	153,66	108,82	105,03	94,57
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	4,07	6,58	6,58	18,69	51,16	39,63	55,47
Var. IBOVESPA p.p.	-1,93	8,58	8,58	-4,60	-8,57	17,39	18,84
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO	0,50	-1,38	-1,38	5,70	14,71	19,44	32,79
Var. INPC + 6,00% p.p.	-0,89	-4,79	-4,79	-2,73	1,41	-4,70	-4,87
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**
**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	0,13	0,13	0,83	2,51	9,33	16,64	27,53	45,49
IRF-M 1+	-1,45	-4,77	-4,77	-2,02	1,81	15,01	26,76	44,69	79,99
IRF-M TOTAL	-0,84	-2,80	-2,80	-0,87	2,25	13,59	23,98	39,93	69,38
IMA-B 5	0,34	-0,15	-0,15	3,23	8,50	18,63	29,54	45,04	65,50
IMA-B 5+	-1,17	-5,10	-5,10	4,90	12,01	21,24	42,19	56,75	97,62
IMA-B TOTAL	-0,46	-2,81	-2,81	4,17	10,39	20,48	36,99	51,70	84,40
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,38	-1,64	-1,64	1,15	4,18	12,86	23,35	36,70	62,69
IMA-GERAL TOTAL	-0,39	-1,32	-1,32	1,50	4,98	13,88	24,71	38,15	64,18
IDKA 2	0,29	-0,05	-0,05	3,00	8,57	18,47	29,35	45,40	65,85
IDKA 20	-1,89	-7,21	-7,21	7,55	15,19	22,04	53,40	63,82	131,50
CDI	0,20	0,49	0,49	0,96	2,22	7,78	14,62	24,23	41,32

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,00	-2,00	-2,00	23,29	59,73	22,24	36,63	79,48	133,01
IBRX 100	6,04	-0,72	-0,72	24,43	62,17	26,16	42,14	86,58	142,11
IBRX 50	6,08	-0,80	-0,80	25,46	64,73	22,50	35,45	78,91	129,35
SMALL CAP	4,56	-0,88	-0,88	21,46	64,58	44,87	61,92	116,69	210,83
IFIX	-1,38	-0,81	-0,81	1,86	14,14	14,65	20,75	40,04	91,60
Índice Consumo - ICON	2,32	-4,34	-4,34	6,29	50,94	40,41	39,42	72,50	90,80
Índice Dividendos - IDIV	7,57	-3,21	-3,21	21,41	39,35	28,51	46,14	77,21	174,91

**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	0,93	2,05	2,05	5,25	6,10	9,60	14,62	17,69	23,07
INPC	0,86	1,96	1,96	5,36	6,94	10,48	15,64	17,44	22,80
IGPM	2,94	8,26	8,26	16,52	31,10	40,02	51,60	51,90	59,27
SELIC	0,20	0,49	0,49	0,96	2,22	7,78	14,62	24,25	41,36

**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	7,39	15,96	15,96	19,32	68,46	104,94	157,87	202,36	208,78
MSCI ACWI	5,55	14,22	14,22	20,33	66,81	93,57	128,33	169,72	170,64
MSCI World	6,22	14,59	14,59	19,97	66,32	95,04	133,33	172,75	173,11

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,29	3,03	3,03	7,30	10,31	18,55	28,89	37,53	49,60
IPCA + 5,00%	1,38	3,26	3,26	7,81	11,36	20,84	32,63	42,86	56,89
IPCA + 5,50%	1,42	3,38	3,38	8,06	11,89	21,99	34,53	45,58	60,64
IPCA + 5,89%	1,46	3,48	3,48	8,25	12,30	22,90	36,03	47,73	63,62
IPCA + 6,00%	1,47	3,50	3,50	8,31	12,41	23,15	36,45	48,34	64,47
INPC + 4,00%	1,22	2,93	2,93	7,42	11,18	19,49	30,03	37,24	49,27
INPC + 6,00%	1,40	3,41	3,41	8,43	13,30	24,13	37,66	48,02	64,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
45	02/03/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	10.623,89	217,06716423	48,9428700000
46	05/03/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	11.184,10	228,46026471	48,9542460000
33	05/03/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	659.869,44	0,00	274.081,55788800	2,4075660000
42	09/03/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	50.000,00	0,00	1.021,22163925	48,9609680000
39	09/03/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	60.790,26	0,00	3.364,45584656	18,0683780000
47	10/03/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	66.287,36	1.353,80483222	48,9637490000
34	10/03/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	22.275,14	6.141,70297500	3,6268670000
48	11/03/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	701.060,00	14.317,04893081	48,9667950000
49	12/03/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	20.249,00	413,50316866	48,9693950000
40	12/03/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	8.104,94	0,00	448,50362754	18,0710690000
50	15/03/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	7.505,00	153,25311229	48,9712730000
51	18/03/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	600,00	12,25033861	48,9782380000
52	19/03/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	87.492,22	1.786,18658086	48,9826880000
35	19/03/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	11.579,85	3.220,76901600	3,5953680000
36	19/03/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	39.518,95	10.991,62858600	3,5953680000
41	23/03/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	36.638,52	0,00	2.026,50794958	18,0796330000
53	24/03/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	1.125,00	22,95952947	48,9992620000
43	29/03/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	50.057,98	0,00	1.021,35589140	49,0113000000
44	30/03/2021	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	114.619,00	0,00	2.338,48539089	49,0142040000
38	30/03/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	8.048,88	2.248,46009500	3,5797300000
37	30/03/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	184.458,09	51.528,49273900	3,5797300000

**Total**



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 5.283.214,41

Value-At-Risk: 2,72%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,02	0,00	-1,03	0,16	2.057.421,42	1,06
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,02	0,00	-1,52	0,14	23.272.176,10	11,97
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,04	-0,00	0,27	0,22	766.679,84	0,39
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	Artigo 7º VII, Alínea b	0,31	0,13	0,00	-0,13	0,16	1.066.376,57	0,55
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	0,90	0,50	0,00	0,12	0,31	2.444.847,41	1,26
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,58	1,36	0,08	-0,17	-0,42	13.197.824,61	6,79
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,65	1,45	0,16	0,05	0,37	29.227.754,01	15,03
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	4,15	1,46	0,09	-0,03	0,09	15.869.185,41	8,16
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,63	2,82	0,35	-0,10	-0,47	29.261.477,12	15,05
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,63	2,84	0,05	-0,10	-0,48	4.213.949,63	2,17
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	7,05	2,96	0,10	-0,13	-0,74	7.799.318,23	4,01
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	8,89	3,03	0,02	-0,16	-1,20	1.801.025,00	0,93
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	9,52	4,73	0,07	-0,14	-1,15	3.422.131,87	1,76
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	Artigo 7º I, Alínea b	9,68	4,75	0,13	-0,14	-1,19	6.476.134,90	3,33
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	9,71	4,78	0,28	-0,14	-1,20	14.114.548,46	7,26
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	16,04	6,68	0,24	0,24	4,07	13.460.279,34	6,92
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,90	10,55	0,02	0,17	3,94	522.040,76	0,27
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	22,40	12,02	0,17	0,28	6,56	3.489.583,26	1,79
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,45	9,19	0,02	0,22	5,07	511.829,03	0,26
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	22,79	10,76	0,20	0,19	4,45	4.485.242,14	2,31
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,85	11,60	0,02	0,22	5,25	512.609,77	0,26
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,44	9,32	0,04	0,07	1,92	968.912,80	0,50
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	28,37	10,10	0,29	0,05	1,73	7.445.989,90	3,83
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	31,84	10,81	0,38	0,09	3,21	8.058.931,81	4,14