



LDB
EMPRESAS

CUBATÃO
DEZEMBRO 2020



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.12.2020.

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

82,24%

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
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOUREO IPCA GERAL FI RF	12,26	4,87	6,18	21.199.113,37	2,47	274.033.039,87	7,74
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,69	4,83	6,11	29.658.796,54	3,46	407.903.215,85	7,27
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,57	0,31	3,47	137.970.067,44	16,09	8.522.749.810,66	1,62
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	14,68	5,53	7,24	61.906.962,40	7,22	1.130.429.213,40	5,48
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,74	4,84	6,14	31.464.224,14	3,67	8.693.778.987,76	0,36
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	12,74	4,83	6,05	32.837.730,45	3,83	770.268.981,55	4,26
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,80	4,84	6,06	63.949.983,16	7,46	6.193.173.925,17	1,03
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,66	0,38	3,21	17.001,23	0,00	76.440.230,07	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,55	0,28	3,63	44.236.856,73	5,16	16.753.976.831,37	0,26
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,57	0,33	3,48	1.028.185,12	0,12	842.553.482,20	0,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,52	2,11	4,82	16.055.833,24	1,87	1.195.459.257,45	1,34
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			7,60	2,87	4,89	440.324.753,82	51,35		

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
CEF	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	12,72	4,85	6,05	34.224.530,33	3,99	2.989.829.287,39	1,14
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,72	4,85	6,05	34.224.530,33	3,99		

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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,37	0,27	2,10	47.274.800,89	5,51	1.591.072.731,33	2,97
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,26	0,22	2,13	13.218.204,20	1,54	3.168.557.239,02	0,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	5,07	1,76	7,51	17.899.387,18	2,09	471.053.682,40	3,80
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	5,97	2,08	5,84	68.965.468,60	8,04	763.957.366,29	9,03
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	13,31	4,94	6,30	34.215.337,93	3,99	2.099.544.961,17	1,63
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	12,75	4,81	5,91	40.853.938,67	4,76	1.391.144.513,85	2,94
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			6,28	2,47	5,06	222.427.137,47	25,94		

Artigo 7º VII, Alínea a (Cota Sênior de FIDC)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRPP	BRPP	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	143,78	0,00	-83,89	0,00	0,00	0,00	0,00
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			143,78	0,00	-100,00	0,00	0,00		

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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	0,49	0,31	2,06	8.223.691,21	0,96	5.400.889.837,28	0,15
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			0,49	0,31	2,06	8.223.691,21	0,96		
Renda Fixa			7,31	2,80	4,97	705.200.112,83	82,24		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

17,76%

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
GERAÇÃO FUTURO	BRB	GERAÇÃO FI EM AÇÕES	42,88	8,45	1,04	22.513.658,02	2,63	387.702.300,26	5,81
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	40,19	7,96	-9,45	10.074.631,18	1,17	1.793.128.513,73	0,56
4UM	BEM	4UM SMALL CAPS FIA	34,63	6,18	-3,53	14.718.290,98	1,72	379.488.263,66	3,88
4UM	BEM	4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	36,70	7,26	-5,60	19.923.731,66	2,32	278.668.241,41	7,15
ITAU	ITAU	ITAU INDEX IBOVESPA 1	45,21	9,27	2,21	5.686.570,15	0,66	57.179.892,58	9,95
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	42,06	10,11	7,87	39.617.637,24	4,62	1.060.739.165,08	3,73
ARX	BEM	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	16,38	8,24	18,20	28.054.348,37	3,27	93.516.976,58	30,00
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	46,58	3,99	3,99	4.679.620,05	0,55	214.749.020,69	2,18
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			39,45	8,46	0,43	145.268.487,65	16,94		

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 S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	32,77	1,88	1,88	4.694.652,47	0,55	734.034.454,86	0,64
Sub-total Artigo 8º III			32,77	1,88	1,88	4.694.652,47	0,55		

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
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	33,58	3,31	-12,63	2.323.000,00	0,27	0,00	
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			33,58	3,31	-12,63	2.323.000,00	0,27		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			39,03	8,32	0,13	152.286.140,12	17,76		
--	--	--	--------------	-------------	-------------	-----------------------	--------------	--	--

Total			10,84	3,68	4,09	857.486.252,95	100,00		
--------------	--	--	--------------	-------------	-------------	-----------------------	---------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	440.324.753,82	51,35	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	34.224.530,33	3,99	0,00	5,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	222.427.137,47	25,94	0,00	23,85	40,00	0,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	0,00	0,00	0,00	0,05	5,00	0,00	5,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	8.223.691,21	0,96	0,00	1,10	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	705.200.112,83	82,24					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	145.268.487,65	16,94	0,00	20,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	4.694.652,47	0,55	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	2.323.000,00	0,27	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	152.286.140,12	17,76					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	2,87 1.743,66	4,89 177,27	4,12 873,82	4,80 487,18	4,89 177,27	12.421.613,32	21.021.487,13
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	4,85 2.951,47	6,05 219,39	7,10 1.506,28	8,06 816,90	6,05 219,39	1.584.278,40	1.952.598,91
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	2,47 1.500,25	5,06 183,64	3,68 780,78	4,48 453,97	5,06 183,64	5.355.706,80	10.616.166,60
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	0,00 0,00	-100,00 -3.626,06	0,00 0,00	0,00 0,00	-100,00 -3.626,06	0,00	-5.276,99
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,31 188,62	2,06 74,72	0,76 161,30	1,68 169,86	2,06 74,72	25.429,51	166.038,00
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,46 -0,84	0,43 -2,48	21,01 -4,80	19,24 -5,97	0,43 -2,48	10.713.651,73	1.118.466,98
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	1,88 -1,50	1,88 -1,50				86.647,34	86.647,34
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	3,31 -5,98	-12,63 -15,55	2,92 -22,88	3,76 -21,45	-12,63 -15,55	74.500,00	-343.600,00
CUBATÃO (Total)						30.261.827,10	34.612.527,97

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	30.012.852,85	0,00	0,00	0,00	31.464.224,14	1.451.371,29	1.820.248,14
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	138.956.650,71	15.703.242,40	-17.117.620,00	0,00	137.970.067,44	427.794,33	3.683.784,59
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	1.024.852,02	0,00	0,00	0,00	1.028.185,12	3.333,10	34.567,53
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	31.326.146,47	0,00	0,00	0,00	32.837.730,45	1.511.583,98	1.872.945,52
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	20.214.284,41	0,00	0,00	0,00	21.199.113,37	984.828,96	1.233.159,60
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.724.554,87	0,00	0,00	0,00	16.055.833,24	331.278,37	738.237,91
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	60.997.433,14	0,00	0,00	0,00	63.949.983,16	2.952.550,02	3.655.003,93
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	44.045.652,58	275.290,00	-209.810,00	0,00	44.236.856,73	125.724,15	1.548.303,44
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	28.292.069,42	0,00	0,00	0,00	29.658.796,54	1.366.727,12	1.707.263,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	58.661.620,67	0,00	0,00	0,00	61.906.962,40	3.245.341,73	4.181.163,64
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.103.926,09	0,00	-19.108.005,13	0,00	17.001,23	21.080,27	546.809,59
					440.324.753,82	0,00	0,00

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	32.640.251,93	0,00	0,00	0,00	34.224.530,33	1.584.278,40	1.952.598,91
					34.224.530,33	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B	38.980.184,84	0,00	0,00	0,00	40.853.938,67	1.873.753,83	2.281.428,95
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	13.189.720,37	0,00	0,00	0,00	13.218.204,20	28.483,83	275.482,12
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	67.562.654,38	0,00	0,00	0,00	68.965.468,60	1.402.814,22	3.805.479,70
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	32.603.495,32	0,00	0,00	0,00	34.215.337,93	1.611.842,61	2.028.198,14
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	17.589.298,71	0,00	0,00	0,00	17.899.387,18	310.088,47	1.250.611,26
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	47.158.177,05	0,00	-12.100,00	0,00	47.274.800,89	128.723,84	974.966,43
					222.427.137,47	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	-5.276,99
					0,00	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	8.198.261,70	0,00	0,00	0,00	8.223.691,21	25.429,51	166.038,00
					8.223.691,21	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	18.574.954,48	0,00	0,00	0,00	19.923.731,66	1.348.777,18	-1.181.278,51
4UM SMALL CAPS FIA	13.861.282,90	0,00	0,00	0,00	14.718.290,98	857.008,08	-538.325,94
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	25.917.846,43	0,00	0,00	0,00	28.054.348,37	2.136.501,94	4.319.124,75
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	20.759.264,37	0,00	0,00	0,00	22.513.658,02	1.754.393,65	232.197,13
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	9.331.408,22	0,00	0,00	0,00	10.074.631,18	743.222,96	-1.050.962,44
ITAU INDEX IBOVESPA 1	5.204.295,13	0,00	0,00	0,00	5.686.570,15	482.275,02	123.119,84
OCCAM FIC FIA	26.405.784,39	10.000.000,00	0,00	0,00	39.617.637,24	3.211.852,85	2.662.705,53
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	0,00	4.500.000,00	0,00	0,00	4.679.620,05	179.620,05	179.620,05
					145.268.487,65	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	0,00	4.608.005,13	0,00	0,00	4.694.652,47	86.647,34	86.647,34
					4.694.652,47	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\$)
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	2.248.500,00	0,00	0,00	0,00	0,00	2.323.000,00	74.500,00	-343.600,00
						2.323.000,00	0,00	0,00

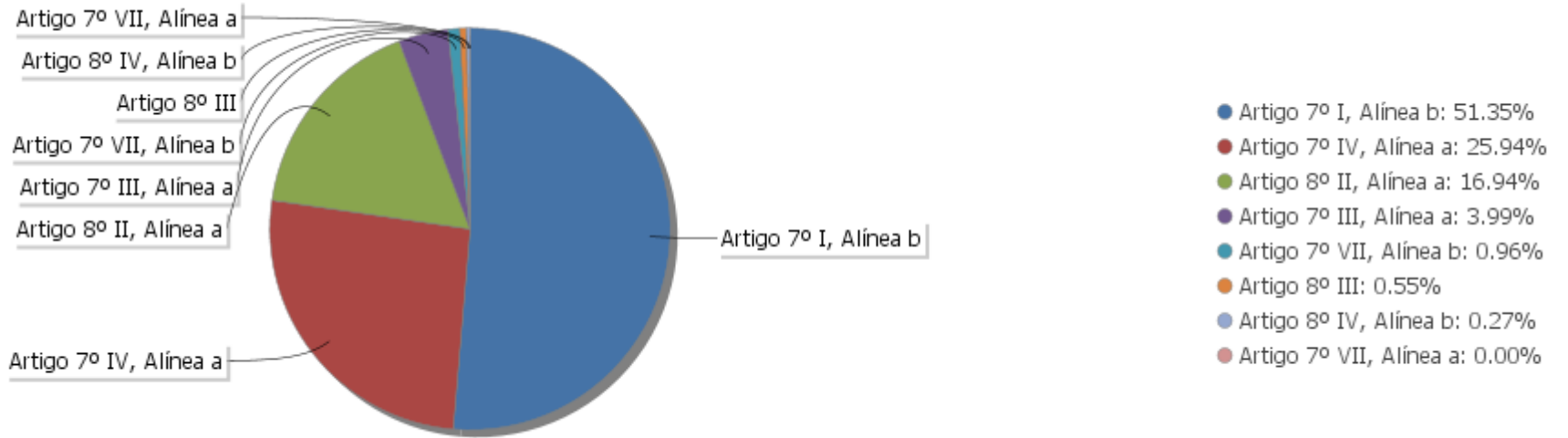
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

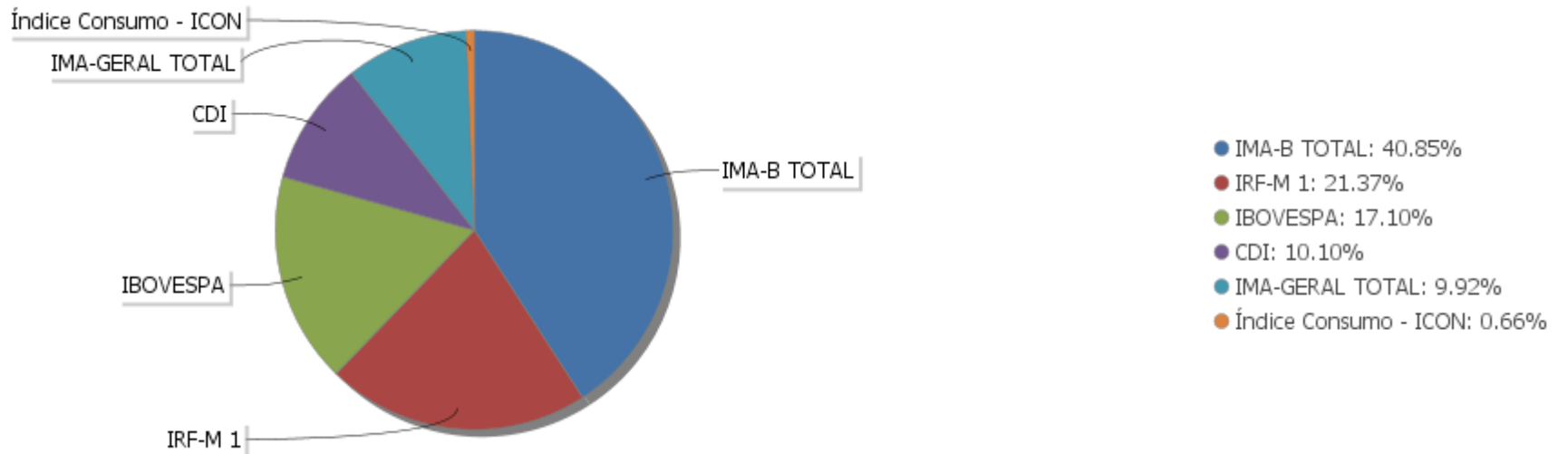
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	852.806.632,90	99,45	852.806.632,90	99,45
de 31 a 365 dias	4.679.620,05	0,55	857.486.252,95	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	857.486.252,95	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

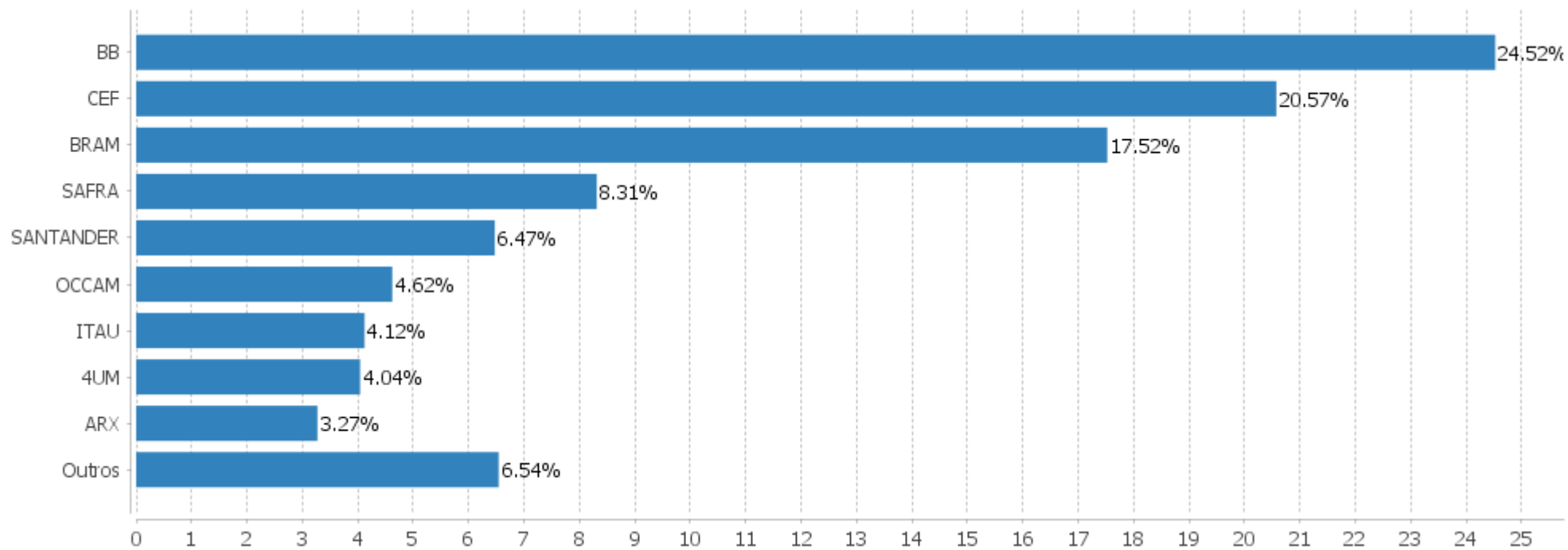


Alocação Por Estratégia



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
2020	0,23	-0,94	-7,44	1,84	1,81	2,26	3,20	-1,32	-1,40	-0,05	2,65	3,68	4,09
INPC + 5,86%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,96	0,84	1,35	1,37	1,41	1,97	11,60
p.p. indexador	-0,46	-1,52	-8,12	1,61	1,61	1,48	2,24	-2,16	-2,75	-1,42	1,25	1,71	-7,52
2019	3,58	0,24	0,31	1,07	2,11	2,57	1,17	0,27	1,76	2,17	-0,86	2,58	18,27
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	2,70	-0,76	-0,90	-0,02	1,45	2,12	0,54	-0,36	1,33	1,60	-1,86	0,87	7,49

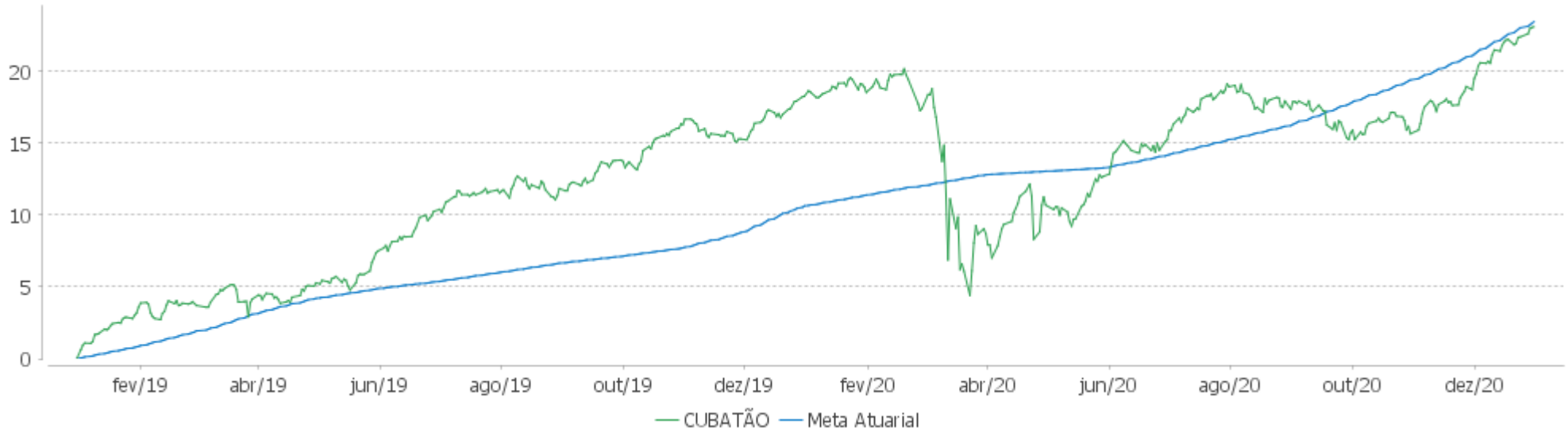
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

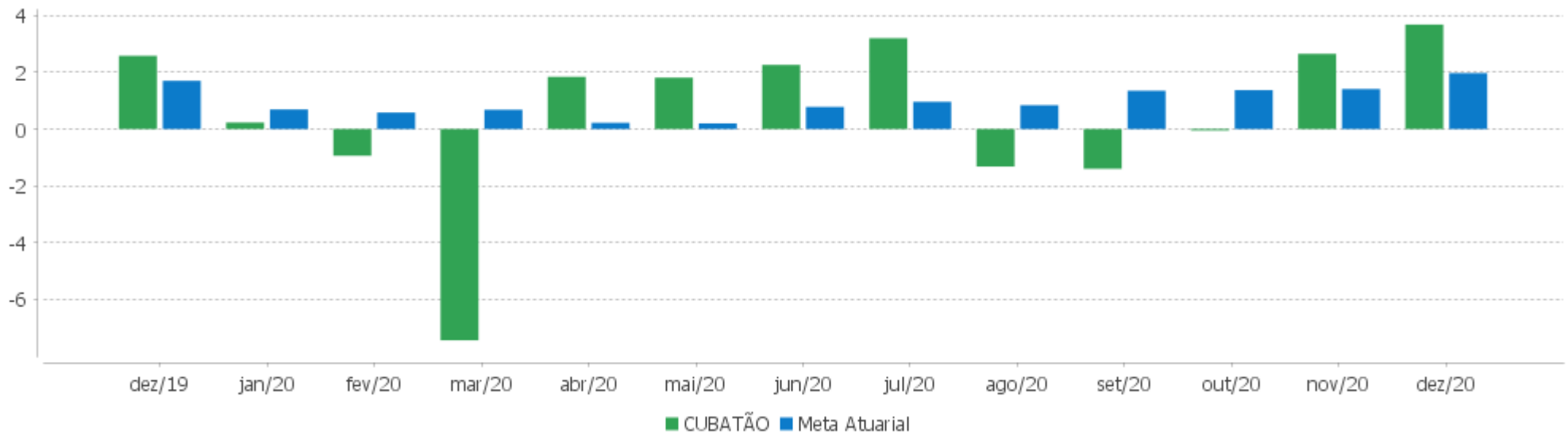
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	13	54,17	03 meses	6,38	4,82	1,56	4,25
Meses abaixo - Meta Atuarial	11	45,83	06 meses	6,82	8,15	-1,33	4,93
			12 meses	4,09	11,60	-7,52	10,84
			24 meses	23,10	23,63	-0,53	8,15
			Desde 31/12/2018	23,10	23,63	-0,53	8,15
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	3,68	2020-12					
Menor rentabilidade da Carteira	-7,44	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
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	0,31 188,62	2,06 74,72	0,76 161,30	1,68 169,86	2,06 74,72	7,90 88,96	14,76 92,96
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2 % do CDI	0,00 0,00	-83,89 -3.042,08	0,00 0,00	0,00 0,00	-83,89 -3.042,08	-97,52 -1.097,89	-99,12 -624,40
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP % do CDI	1,76 1.072,01	7,51 272,38	3,18 673,81	4,42 448,48	7,51 272,38	20,11 226,43	29,24 184,21
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,94 0,09	6,30 -0,10	7,16 -0,02	8,14 -0,07	6,30 -0,10	30,60 -0,23	47,40 -0,51
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,22 131,32	2,13 77,18	0,41 86,73	0,96 97,61	2,13 77,18	8,09 91,03	14,93 94,04
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,81 -0,05	5,91 -0,49	7,04 -0,14	8,01 -0,19	5,91 -0,49	29,81 -1,01	46,46 -1,45
BRADERCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	2,08 0,05	5,84 0,50	3,03 0,17	3,77 0,37	5,84 0,50	19,49 0,65	31,49 0,73
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,27 166,02	2,10 76,05	0,62 132,12	1,18 119,99	2,10 76,05	8,03 90,42	14,89 93,81
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,83 -0,02	6,11 -0,30	7,08 -0,09	8,03 -0,17	6,11 -0,30	30,06 -0,77	46,26 -1,65
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,84 -0,01	6,06 -0,34	7,13 -0,04	8,09 -0,12	6,06 -0,34	30,02 -0,81	46,71 -1,20
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,33 0,02	3,48 -0,36	0,67 -0,03	1,01 -0,20	3,48 -0,36	10,18 -0,68	17,59 -1,01
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,31 0,00	3,47 -0,37	0,63 -0,08	0,99 -0,22	3,47 -0,37	10,19 -0,67	17,63 -0,96
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	5,53 0,68	7,24 0,84	7,48 0,31	7,97 -0,24	7,24 0,84	32,38 1,55	51,55 3,64
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,84 -0,02	6,14 -0,27	7,13 -0,04	8,03 -0,18	6,14 -0,27	30,17 -0,66	46,78 -1,13
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,28 -0,03	3,63 -0,21	0,64 -0,06	1,12 -0,09	3,63 -0,21	10,42 -0,44	17,94 -0,66
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,87 0,02	6,18 -0,23	7,07 -0,10	7,88 -0,32	6,18 -0,23	29,99 -0,83	46,53 -1,38
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,11	4,82	2,85	3,16	4,82	17,74	29,09

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,08	-0,52	-0,02	-0,25	-0,52	-1,10	-1,68
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	4,83	6,05	7,09	8,04	6,05	29,95	46,40
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,36	-0,08	-0,17	-0,36	-0,88	-1,51
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,38	3,21	0,71	0,87	3,21	9,68	16,91
Var. IRF-M 1 p.p.	0,07	-0,63	0,01	-0,34	-0,63	-1,18	-1,68
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	4,85	6,05	7,10	8,06	6,05	29,87	46,68
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,00	-0,36	-0,07	-0,15	-0,36	-0,95	-1,23
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	3,07	12,58	11,36	19,62	12,58	48,60	44,75
Var. IBOVESPA p.p.	-6,23	9,67	-14,44	-5,59	9,67	13,18	-11,03
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	8,45	1,04	22,65	24,44	1,04	33,32	50,78
Var. IBOVESPA p.p.	-0,85	-1,87	-3,16	-0,77	-1,87	-2,10	-5,00
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	8,24	18,20					
Var. IBOVESPA p.p.	-1,05	-3,41					
4UM SMALL CAPS FIA	6,18	-3,53	17,34	11,91	-3,53	56,70	73,46
Var. IBOVESPA p.p.	-3,11	-6,44	-8,46	-13,29	-6,44	21,28	17,68
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	6,73	13,80	17,90	20,73	13,80		
Var. IBOVESPA p.p.	-2,57	10,89	-7,91	-4,48	10,89		
ITAU INDEX IBOVESPA 1	9,27	2,21	25,62	24,79	2,21	32,51	15,61
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	4,27	1,40	14,51	11,65	1,40	-24,00	-25,91
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	7,96	-9,45	20,15	13,27	-9,45	29,14	57,09
Var. IBOVESPA p.p.	-1,33	-12,36	-5,66	-11,93	-12,36	-6,28	1,31
OCCAM FIC FIA	10,11	7,87	22,82	24,40	7,87	46,10	79,48
Var. IBOVESPA p.p.	0,81	4,95	-2,99	-0,80	4,95	10,68	23,71
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	7,26	-5,60	21,31	16,33	-5,60	35,93	47,14
Var. IBOVESPA p.p.	-2,04	-8,51	-4,50	-8,88	-8,51	0,51	-8,64
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	3,31	-12,63	2,92	3,76	-12,63	16,87	27,96
Var. IBOVESPA p.p.	-5,98	-15,55	-22,88	-21,45	-15,55	-18,55	-27,81
CUBATÃO	3,68	4,09	6,38	6,82	4,09	23,10	
Var. INPC + 5,86% p.p.	1,71	-7,52	1,56	-1,33	-7,52	-0,36	
CDI	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
INPC + 6,00%	1,98	11,75	4,85	8,23	11,75	23,79	35,66
IPCA + 6,00%	1,87	10,76	4,64	7,55	10,76	22,49	34,64

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	0,31	3,84	0,70	1,21	3,84	10,86	18,59	31,78	51,17
IRF-M 1+	3,05	8,45	2,90	2,29	8,45	23,90	39,09	62,28	110,38
IRF-M TOTAL	1,95	6,69	1,99	1,75	6,69	19,53	32,36	52,47	88,11
IMA-B 5	1,83	8,04	3,38	4,72	8,04	22,25	34,31	51,20	74,61
IMA-B 5+	7,51	5,50	10,53	11,36	5,50	37,54	58,72	78,96	134,51
IMA-B TOTAL	4,85	6,41	7,18	8,21	6,41	30,83	47,91	66,83	108,23
IMA-GERAL ex-C TOTAL	2,12	4,85	2,83	3,09	4,85	18,09	29,65	46,36	77,22
IMA-GERAL TOTAL	2,02	5,34	2,86	3,40	5,34	18,84	30,77	47,53	78,50
IDKA 2	1,73	8,62	3,05	5,10	8,62	21,46	33,31	51,45	74,50
IDKA 20	11,36	2,20	15,90	16,58	2,20	47,44	77,53	99,14	205,07
CDI	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87	27,37	45,21

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78	97,61	174,56
IBRX 100	9,15	3,50	25,34	25,28	3,50	38,06	59,35	103,24	177,83
IBRX 50	9,42	3,62	26,47	26,00	3,62	33,83	53,28	94,38	165,96
SMALL CAP	7,52	-0,65	22,54	25,33	-0,65	57,16	69,94	153,81	234,41
IFIX	2,19	-10,24	2,69	2,28	-10,24	22,05	28,91	53,93	103,70
Índice Consumo - ICON	5,00	0,81	11,11	13,14	0,81	56,51	41,53	88,43	113,36
Índice Dividendos - IDIV	8,94	-1,00	25,44	21,29	-1,00	43,71	66,63	108,79	235,09

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	1,35	4,52	3,13	4,42	4,52	9,02	13,10	16,43	23,76
INPC	1,46	5,45	3,34	5,07	5,45	10,17	13,96	16,31	23,97
IGPM	0,96	23,14	7,64	17,96	23,14	32,13	42,09	41,35	51,49
SELIC	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,88	27,40	45,26

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	1,09	49,89	2,90	14,97	49,89	100,95	120,70	167,51	144,56
MSCI ACWI	1,88	47,41	5,35	16,84	47,41	90,22	97,90	144,28	115,36
MSCI World	1,50	47,05	4,69	15,94	47,05	91,50	100,90	144,93	115,30

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,70	8,68	4,15	6,52	8,68	17,91	27,18	36,11	50,43
IPCA + 5,00%	1,78	9,72	4,40	7,03	9,72	20,19	30,88	41,39	57,76
IPCA + 5,50%	1,82	10,24	4,52	7,29	10,24	21,34	32,75	44,09	61,54
IPCA + 5,89%	1,86	10,65	4,62	7,49	10,65	22,24	34,23	46,22	64,53
IPCA + 6,00%	1,87	10,76	4,64	7,55	10,76	22,49	34,64	46,83	65,38
INPC + 4,00%	1,81	9,65	4,35	7,18	9,65	19,16	28,15	35,96	50,68
INPC + 6,00%	1,98	11,75	4,85	8,23	11,75	23,79	35,66	46,67	65,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
264	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.610.645,36	372.945,88516200	25,7695439000
287	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.012,61	310,93355600	25,7695439000
284	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.082,38	313,64105300	25,7695439000
281	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.663,69	452,61551100	25,7695439000
278	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.931,32	463,00105600	25,7695439000
275	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.219,95	435,39587500	25,7695439000
272	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	30.793,06	1.194,94043200	25,7695439000
269	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.464,23	444,87516900	25,7695439000
266	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.674,75	491,85005500	25,7695439000
286	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.020,60	311,24344500	25,7695439000
283	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.772,21	418,02120200	25,7695439000
280	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.888,06	422,51690200	25,7695439000
277	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.964,73	464,29753000	25,7695439000
274	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.269,73	437,32777600	25,7695439000
271	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	56.269,06	2.183,54923300	25,7695439000
268	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.623,68	489,86837500	25,7695439000
265	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	38.721,11	1.502,59225300	25,7695439000
288	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.997,92	349,16883100	25,7695439000
285	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.036,98	311,87929500	25,7695439000
282	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.615,09	450,72961500	25,7695439000
279	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.877,92	460,92887400	25,7695439000
276	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.537,81	1.068,61864900	25,7695439000
273	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.369,56	441,20173400	25,7695439000
270	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.253,11	359,07165800	25,7695439000
267	02/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	34.295,08	1.330,83779900	25,7695439000
261	03/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	2.330.000,00	856.820,80462600	2,7193550710
252	03/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.100,00	2.338,77766000	2,6082000000
226	03/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	311.000,00	114.365,35203400	2,7193550710

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
238	03/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.955.000,00	0,00	718.920,46053400	2,7193550710
262	04/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	2.260.000,00	831.105,37029000	2,7192701200
247	04/12/2020	OCCAM FIC FIA	10.000.000,00	0,00	3.011.333,81731490	3,3207876000
227	04/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	119.000,00	43.761,74294900	2,7192701200
236	04/12/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	12.100,00	64,88793000	186,4753599000
255	07/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.200.000,00	0,00	441.266,50745000	2,7194450060
249	07/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	120.000,00	0,00	46.008,03607000	2,6082400000
228	07/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	6.500,00	0,00	2.390,19358200	2,7194450060
231	07/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	45.000,00	0,00	17.253,01352600	2,6082400000
239	07/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	120.000,00	0,00	44.126,65074500	2,7194450060
290	09/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.098.810,72	314.126,47126000	25,7820065000
289	09/12/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.009.194,41	39.143,36223600	25,7820065000
246	11/12/2020	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	4.500.000,00	0,00	31.670,77171400	142,0868440000
245	11/12/2020	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	4.608.005,13	0,00	19.352,52288300	238,1087550000
256	15/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	60.000,00	0,00	22.046,20917400	2,7215563240
250	15/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	45.000,00	0,00	17.240,35545700	2,6101550000
240	15/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	508.000,00	0,00	186.657,90434600	2,7215563240
234	15/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.000,00	0,00	3.831,19010100	2,6101550000
248	21/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	10.572,40	0,00	3.883,07064400	2,7226906150
241	21/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	245.000,00	0,00	89.984,51702500	2,7226906150
257	22/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	180.000,00	0,00	66.093,82861400	2,7234010160
242	22/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	118.000,00	0,00	43.328,17653600	2,7234010160
258	23/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	150.000,00	0,00	55.068,34340400	2,7238880040
263	28/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	11.957.210,00	4.389.559,82372900	2,7240111720
253	28/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	58.850,00	22.528,88498300	2,6122020000
229	28/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	210.320,00	0,00	77.209,66865400	2,7240111720
237	28/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	140.410,00	51.545,30988800	2,7240111720
254	29/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	111.810,00	42.797,00396900	2,6125660000
232	29/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.840,00	1.087,05382500	2,6125660000
233	29/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	30.210,00	11.563,34416400	2,6125660000

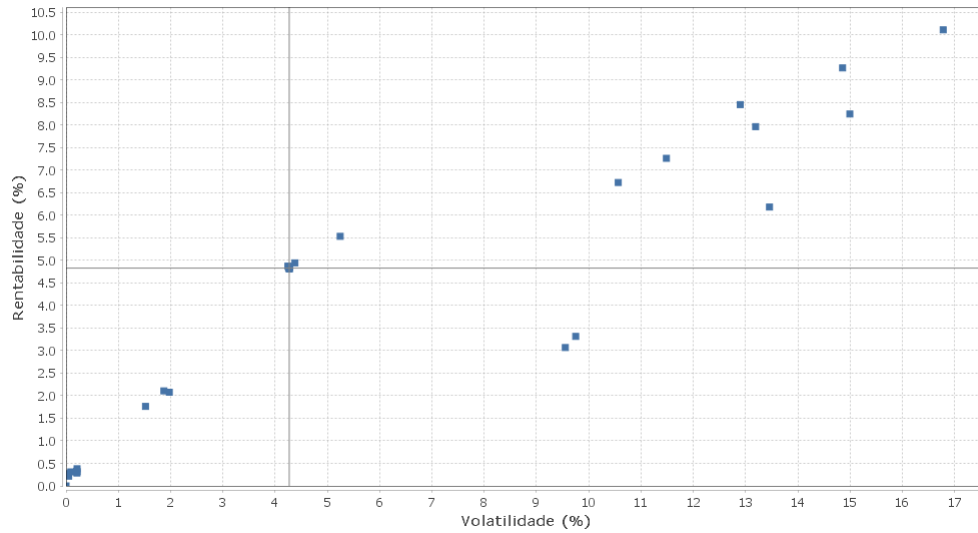
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
259	30/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	3.437.900,00	0,00	1.261.644,57686600	2,7249354240
251	30/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	45.420,00	0,00	17.383,37694400	2,6128410000
230	30/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	3.810,00	0,00	1.398,19827100	2,7249354240
243	30/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.010.180,00	0,00	737.698,21563300	2,7249354240
235	30/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.870,00	0,00	3.777,49736700	2,6128410000
260	31/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	3.452.030,00	0,00	1.266.741,18276600	2,7251265270
244	31/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.035.930,00	0,00	747.095,58614100	2,7251265270
Total						

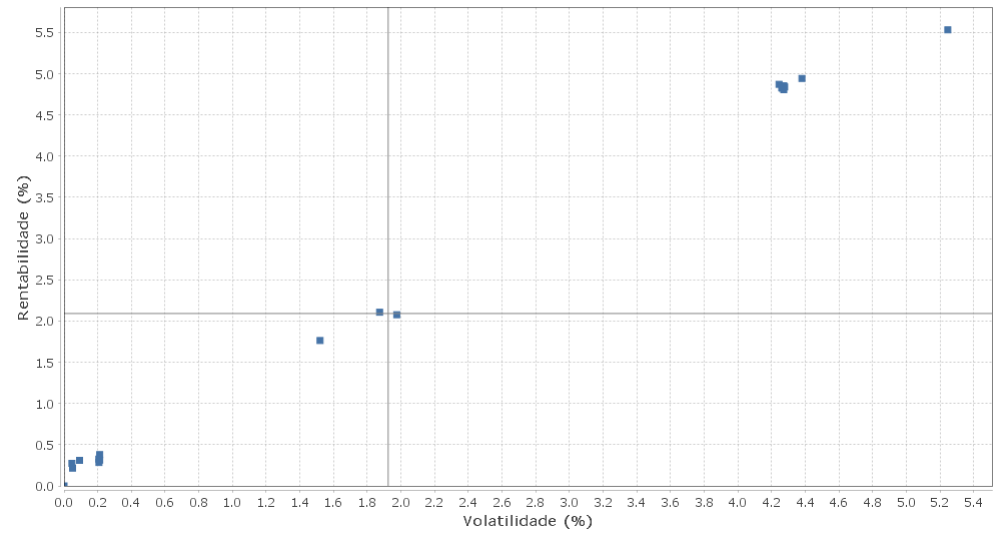
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

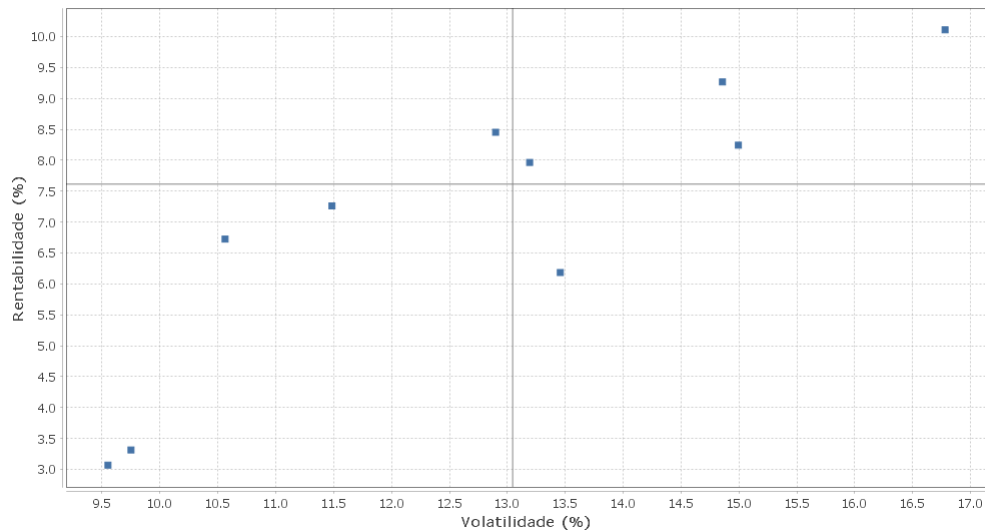
CUBATÃO - No Mês



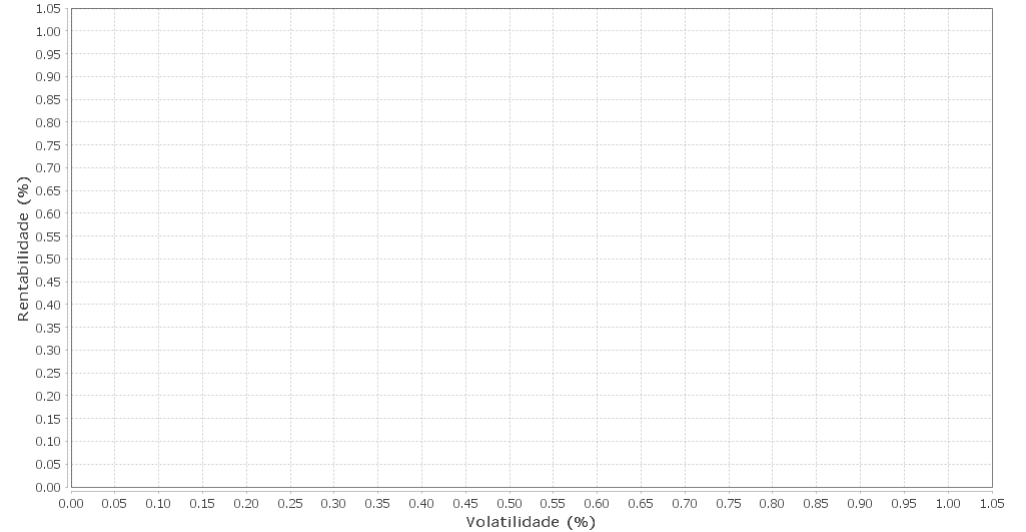
Renda Fixa - No Mês



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\$): 21.749.718,54

Value-At-Risk: 2,54%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	Artigo 7º VII, Alínea a	0,00	NaN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,10	0,00	2,32	0,27	47.274.800,89	5,51
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,04	-0,00	1,02	0,22	13.218.204,20	1,54
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,09	0,09	0,00	1,58	0,31	8.223.691,21	0,96
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,21	0,18	0,00	0,78	0,33	1.028.185,12	0,12
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,21	0,15	0,01	0,58	0,28	44.236.856,73	5,16
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,21	0,17	0,02	0,70	0,31	137.970.067,44	16,09
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,21	0,24	0,00	1,02	0,38	17.001,23	0,00
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	Artigo 7º IV, Alínea a	1,52	1,02	0,02	1,05	1,76	17.899.387,18	2,09
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,87	1,07	0,02	1,04	2,11	16.055.833,24	1,87
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	1,97	1,10	0,08	0,97	2,08	68.965.468,60	8,04
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,24	2,55	0,05	1,11	4,87	21.199.113,37	2,47
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	4,26	2,56	0,08	1,10	4,83	29.658.796,54	3,46
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TÍTULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	4,26	2,56	0,08	1,09	4,83	32.837.730,45	3,83
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,27	2,56	0,08	1,09	4,84	31.464.224,14	3,67
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	4,27	2,59	0,11	1,09	4,81	40.853.938,67	4,76
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	4,27	2,56	0,09	1,10	4,85	34.224.530,33	3,99
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,28	2,57	0,16	1,09	4,84	63.949.983,16	7,46
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	4,38	2,64	0,09	1,09	4,94	34.215.337,93	3,99
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	5,25	3,20	0,19	1,02	5,53	61.906.962,40	7,22
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	9,55	8,13	0,02	0,30	3,07	4.694.652,47	0,55
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	Artigo 8º IV, Alínea b	9,75	5,70	0,00	0,32	3,31	2.323.000,00	0,27
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	10,56	9,45	0,05	0,62	6,73	4.679.620,05	0,55
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	11,49	8,28	0,17	0,62	7,26	19.923.731,66	2,32
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	12,90	9,84	0,23	0,64	8,45	22.513.658,02	2,63
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	13,19	10,14	0,11	0,59	7,96	10.074.631,18	1,17
4UM SMALL CAPS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	13,46	10,50	0,13	0,45	6,18	14.718.290,98	1,72
ITAU INDEX IBOVESPA 1	Artigo 8º II, Alínea a	14,86	10,89	0,07	0,61	9,27	5.686.570,15	0,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	14,99	8,83	0,23	0,54	8,24	28.054.348,37	3,27
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	16,78	11,09	0,46	0,59	10,11	39.617.637,24	4,62

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Fundo de Previdência está com 30% do patrimônio líquido do fundo ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA (Art. 8, Inciso II, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;