



CUBATÃO
JANEIRO 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 29.01.2021.

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 **82,45%**

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
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOUREO IPCA GERAL FI RF	12,36	-0,88	-0,88	21.011.825,79	2,50	266.953.517,36	7,87
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,79	-0,88	-0,88	29.398.862,10	3,49	403.585.829,79	7,28
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,58	0,03	0,03	130.700.277,78	15,52	8.572.331.669,58	1,52
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	14,81	-1,69	-1,69	60.858.044,78	7,23	1.078.898.480,28	5,64
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,85	-0,86	-0,86	31.192.450,85	3,70	8.335.200.025,45	0,37
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	12,85	-0,89	-0,89	32.546.892,88	3,87	735.043.145,99	4,43
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,90	-0,87	-0,87	63.392.029,39	7,53	6.185.705.380,20	1,02
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,66	0,03	0,03	17.006,89	0,00	75.867.937,61	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,56	0,03	0,03	44.289.956,97	5,26	10.435.150.283,00	0,42
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,58	0,03	0,03	1.028.480,42	0,12	856.175.117,14	0,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,58	-0,46	-0,46	15.982.463,71	1,90	1.190.995.528,69	1,34
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			7,66	-0,59	-0,59	430.418.291,56	51,12		

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	12,82	-0,88	-0,88	33.922.696,28	4,03	2.989.640.382,47	1,13
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,82	-0,88	-0,88	33.922.696,28	4,03		

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	0,18	0,18	47.309.232,68	5,62	1.719.845.014,52	2,75
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,26	0,16	0,16	13.238.719,44	1,57	3.219.925.406,69	0,41

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	5,11	0,06	0,06	17.909.335,15	2,13	491.535.637,63	3,64
BRAM	BRADERCO	BRADERCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	6,04	-0,25	-0,25	68.794.386,17	8,17	763.158.290,49	9,01
BRAM	BRADERCO	BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	13,42	-1,02	-1,02	33.865.980,99	4,02	2.084.064.922,01	1,62
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	12,85	-0,86	-0,86	40.503.058,89	4,81	1.371.288.426,53	2,95
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			6,34	-0,34	-0,34	221.620.713,32	26,32		

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	136,67	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			136,67	0,00	0,00	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	0,20	0,20	8.239.971,02	0,98	5.250.399.096,20	0,16
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			0,49	0,20	0,20	8.239.971,02	0,98		
Renda Fixa			7,37	-0,52	-0,52	694.201.672,18	82,45		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

17,55%

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
GERAÇÃO FUTURO	BRB	GERAÇÃO FI EM AÇÕES	43,24	-3,47	-3,47	21.733.044,74	2,58	373.545.537,60	5,82
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	40,50	-3,92	-3,92	9.680.023,77	1,15	1.645.559.797,71	0,59
4UM	BEM	4UM SMALL CAPS FIA	34,70	-2,72	-2,72	14.318.379,07	1,70	369.177.660,17	3,88
4UM	BEM	4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	36,90	-2,85	-2,85	19.356.221,78	2,30	263.921.942,50	7,33
ITAU	ITAU	ITAU INDEX IBOVESPA 1	45,51	-3,38	-3,38	5.494.626,53	0,65	54.784.733,71	10,03
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	42,42	-3,13	-3,13	38.378.833,96	4,56	1.073.001.033,93	3,58
ARX	BEM	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	18,62	-3,10	-3,10	27.185.681,91	3,23	90.621.349,20	30,00
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	46,79	-0,42	-0,42	4.660.061,96	0,55	224.177.673,75	2,08
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			39,71	-3,07	-3,07	140.806.873,72	16,72		

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	33,03	-0,18	-0,18	4.686.403,21	0,56	760.076.567,11	0,62
Sub-total Artigo 8º III			33,03	-0,18	-0,18	4.686.403,21	0,56		

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	31,29	-0,55	-0,55	2.300.000,00	0,27	1.742.146.468,85	0,13
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			31,29	-0,55	-0,55	2.300.000,00	0,27		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			39,25	-2,94	-2,94	147.793.276,93	17,55		
Total			10,91	-0,95	-0,95	841.994.949,11	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	430.418.291,56	51,12	0,00	40,50	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	33.922.696,28	4,03	0,00	4,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	221.620.713,32	26,32	0,00	15,00	40,00	0,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	0,00	0,00	0,00	0,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	8.239.971,02	0,98	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	694.201.672,18	82,45					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	140.806.873,72	16,72	0,00	20,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	4.686.403,21	0,56	0,00	9,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	2.300.000,00	0,27	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	147.793.276,93	17,55					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	-0,59 -396,14	-0,59 -396,14	3,41 734,62	1,56 165,82	3,93 155,50	-2.639.720,38	-2.639.720,38
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,88 -589,95	-0,88 -589,95	5,95 1.282,51	2,59 275,53	4,87 193,03	-301.834,05	-301.834,05
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,34 -226,68	-0,34 -226,68	3,19 687,77	1,91 203,12	4,29 169,69	-753.924,15	-753.924,15
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,20 132,42	0,20 132,42	0,73 157,70	1,46 155,64	1,88 74,31	16.279,81	16.279,81
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,07 0,25	-3,07 0,25	18,59 -3,89	7,40 -4,41	-2,46 -3,61	-4.461.613,93	-4.461.613,93
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,18 3,14	-0,18 3,14				-8.249,26	-8.249,26
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-0,55 2,77	-0,55 2,77	5,92 -16,56	9,02 -2,79	-6,27 -7,42	-12.400,00	-12.400,00
CUBATÃO (Total)						-8.161.461,96	-8.161.461,96

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	31.464.224,14	0,00	0,00	0,00	31.192.450,85	-271.773,29	-271.773,29
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	137.970.067,44	1.140.571,96	-8.449.273,84	0,00	130.700.277,78	38.912,22	38.912,22
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	1.028.185,12	0,00	0,00	0,00	1.028.480,42	295,30	295,30
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	32.837.730,45	0,00	0,00	0,00	32.546.892,88	-290.837,57	-290.837,57
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	21.199.113,37	0,00	0,00	0,00	21.011.825,79	-187.287,58	-187.287,58
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.055.833,24	0,00	0,00	0,00	15.982.463,71	-73.369,53	-73.369,53
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	63.949.983,16	0,00	0,00	0,00	63.392.029,39	-557.953,77	-557.953,77
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	44.236.856,73	215.000,00	-173.040,00	0,00	44.289.956,97	11.140,24	11.140,24
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	29.658.796,54	0,00	0,00	0,00	29.398.862,10	-259.934,44	-259.934,44
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	61.906.962,40	0,00	0,00	0,00	60.858.044,78	-1.048.917,62	-1.048.917,62

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.001,23	0,00	0,00	0,00	17.006,89	5,66	5,66
					430.418.291,56	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	34.224.530,33	0,00	0,00	0,00	33.922.696,28	-301.834,05	-301.834,05
					33.922.696,28	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	40.853.938,67	0,00	0,00	0,00	40.503.058,89	-350.879,78	-350.879,78
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	13.218.204,20	0,00	0,00	0,00	13.238.719,44	20.515,24	20.515,24
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	68.965.468,60	0,00	0,00	0,00	68.794.386,17	-171.082,43	-171.082,43
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	34.215.337,93	0,00	0,00	0,00	33.865.980,99	-349.356,94	-349.356,94
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	17.899.387,18	0,00	0,00	0,00	17.909.335,15	9.947,97	9.947,97
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	47.274.800,89	0,00	-52.500,00	0,00	47.309.232,68	86.931,79	86.931,79
					221.620.713,32	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	0,00
					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	8.223.691,21	0,00	0,00	0,00	8.239.971,02	16.279,81	16.279,81
					8.239.971,02	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	19.923.731,66	0,00	0,00	0,00	19.356.221,78	-567.509,88	-567.509,88
4UM SMALL CAPS FIA	14.718.290,98	0,00	0,00	0,00	14.318.379,07	-399.911,91	-399.911,91
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	28.054.348,37	0,00	0,00	0,00	27.185.681,91	-868.666,46	-868.666,46
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	22.513.658,02	0,00	0,00	0,00	21.733.044,74	-780.613,28	-780.613,28
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	10.074.631,18	0,00	0,00	0,00	9.680.023,77	-394.607,41	-394.607,41
ITAU INDEX IBOVESPA 1	5.686.570,15	0,00	0,00	0,00	5.494.626,53	-191.943,62	-191.943,62
OCCAM FIC FIA	39.617.637,24	0,00	0,00	0,00	38.378.833,96	-1.238.803,28	-1.238.803,28
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	4.679.620,05	0,00	0,00	0,00	4.660.061,96	-19.558,09	-19.558,09
					140.806.873,72	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	4.694.652,47	0,00	0,00	0,00	4.686.403,21	-8.249,26	-8.249,26
					4.686.403,21	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	2.323.000,00	0,00	0,00	0,00	10.600,00	2.300.000,00	-12.400,00	-12.400,00
						2.300.000,00	0,00	0,00

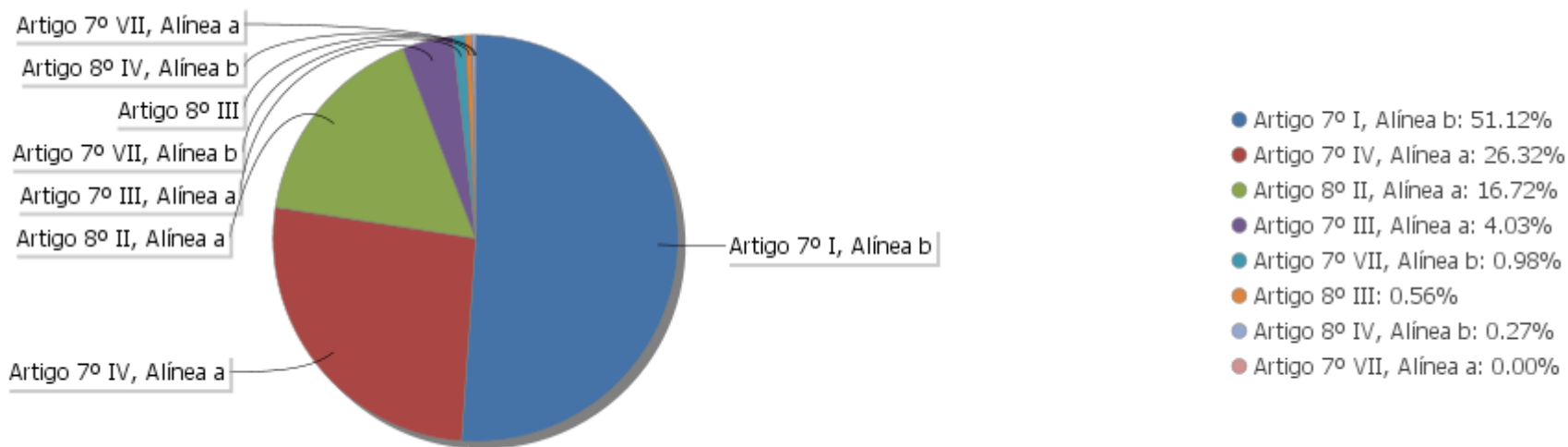
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

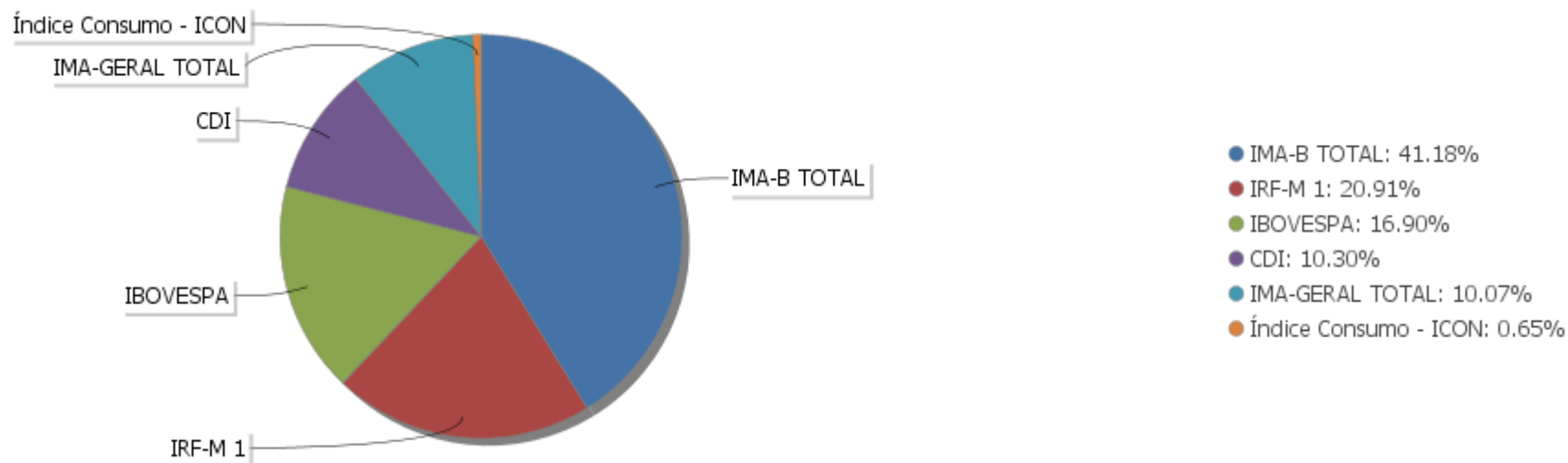
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	837.334.887,15	99,45	837.334.887,15	99,45
de 31 a 365 dias	4.660.061,96	0,55	841.994.949,11	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	841.994.949,11	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

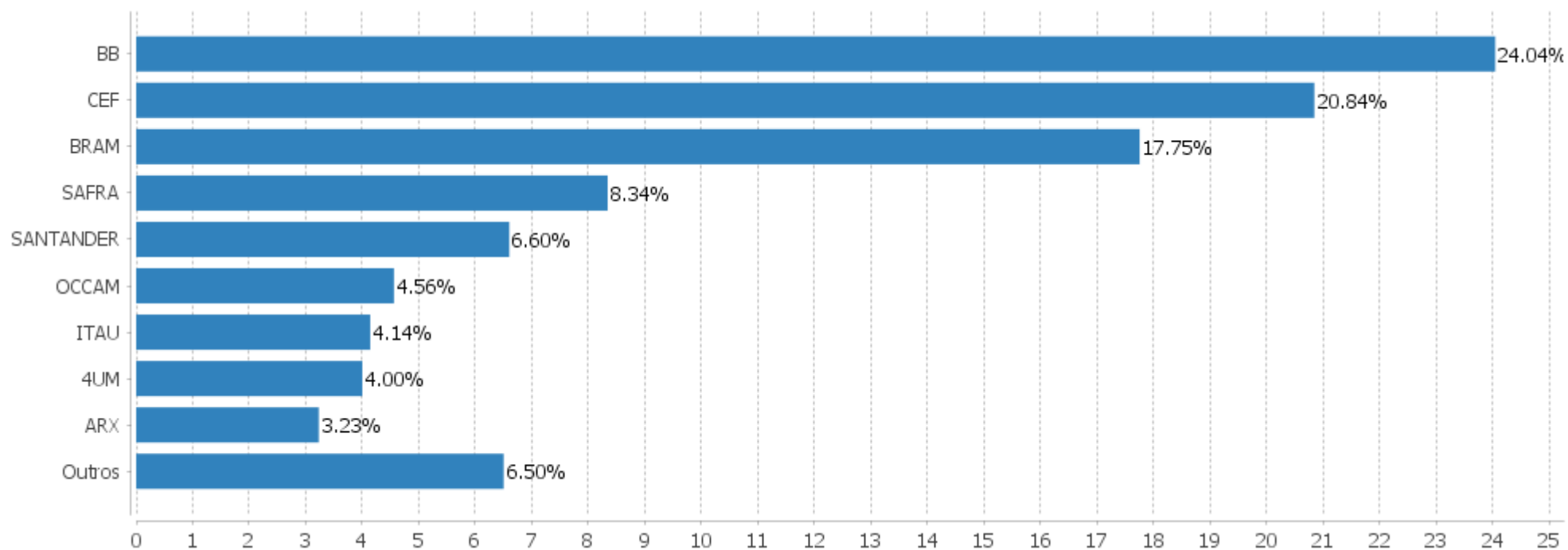


Alocação Por Estratégia



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	-0,95												-0,95
INPC + 5,86%	0,72												0,72
p.p. indexador	-1,67												-1,67
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

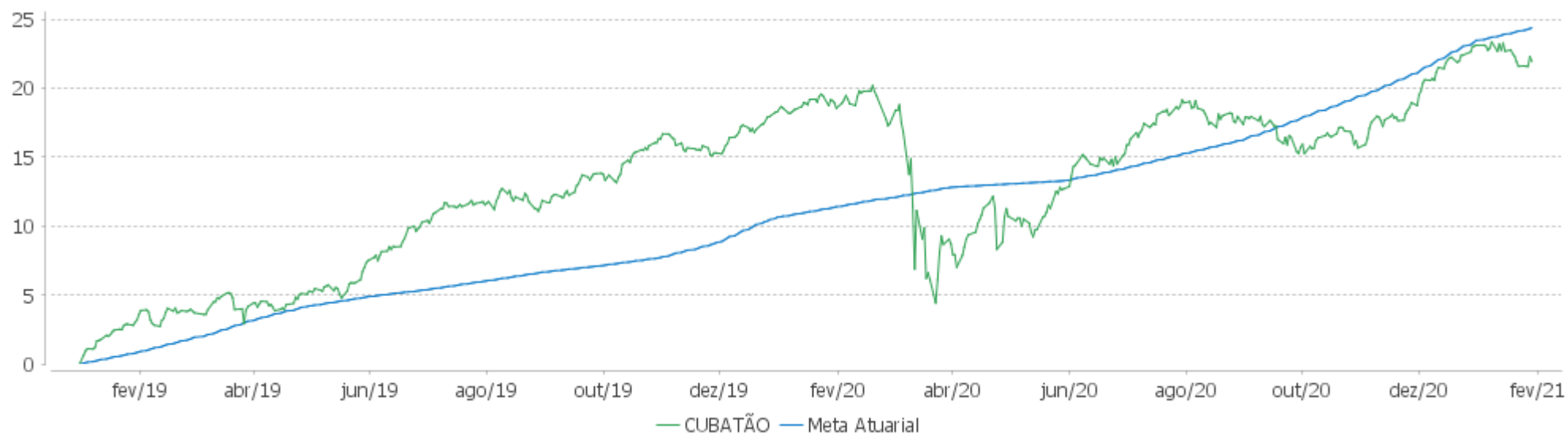
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

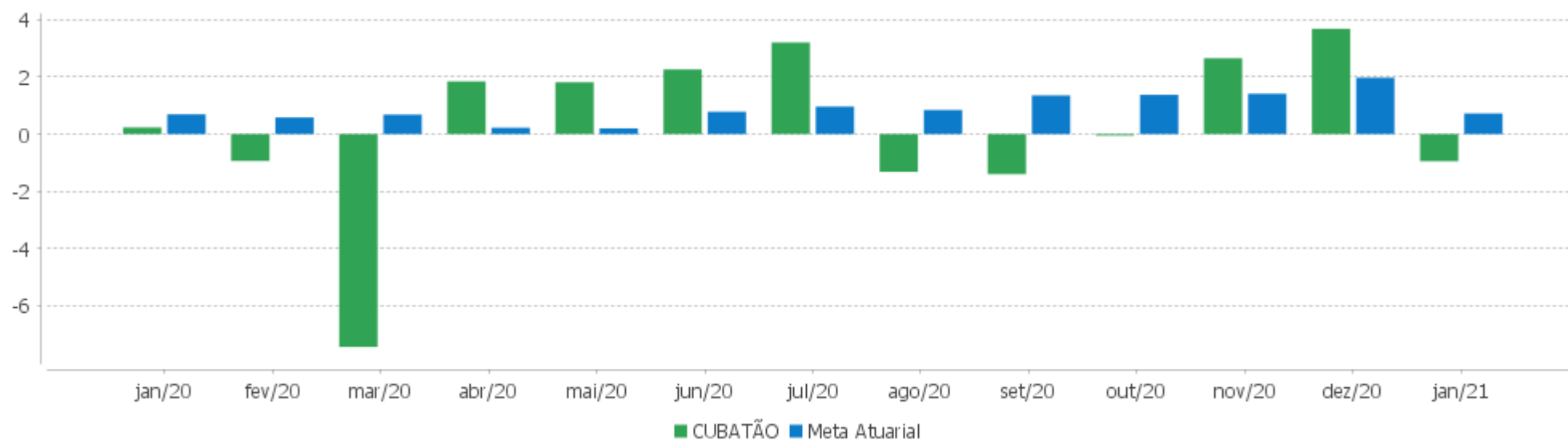
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	13	52,00	03 meses	5,42	4,15	1,27	4,44
Meses abaixo - Meta Atuarial	12	48,00	06 meses	2,52	7,90	-5,38	5,05
			12 meses	2,86	11,64	-8,78	10,91
			24 meses	17,72	23,45	-5,73	8,19
Maior rentabilidade da Carteira	3,68	2020-12	Desde 31/12/2018	21,93	24,52	-2,59	8,05
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	0,20 132,42	0,20 132,42	0,73 157,70	1,46 155,64	1,88 74,31	7,52 88,91	14,31 93,07
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2 % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-74,30 -2.942,13	-97,31 -1.150,84	-99,08 -644,47
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,87 -0,02	-0,87 -0,02	5,99 -0,05	2,66 -0,12	4,88 -0,35	23,46 -0,82	40,68 -1,14
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,88 -0,02	-0,88 -0,02	5,95 -0,09	2,61 -0,17	4,93 -0,30	23,58 -0,71	40,27 -1,56
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,03 -0,01	0,03 -0,01	0,55 -0,03	0,82 -0,19	3,08 -0,35	9,60 -0,67	16,95 -1,00
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,03 -0,01	0,03 -0,01	0,54 -0,04	0,79 -0,23	3,07 -0,36	9,59 -0,68	16,98 -0,96
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,86 -0,01	-0,86 -0,01	6,00 -0,04	2,62 -0,16	4,95 -0,27	23,66 -0,63	40,75 -1,07
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,69 -0,84	-1,69 -0,84	5,96 -0,08	1,30 -1,48	5,09 -0,14	23,95 -0,34	44,19 2,36
BTG PACTUAL TESOUREIRO IPCA GERAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,88 -0,03	-0,88 -0,03	5,95 -0,09	2,67 -0,11	4,98 -0,25	23,49 -0,80	40,49 -1,33
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,03 -0,02	0,03 -0,02	0,53 -0,05	0,90 -0,12	3,22 -0,21	9,83 -0,44	17,30 -0,65
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,46 -0,21	-0,46 -0,21	2,35 -0,18	1,02 -0,37	3,84 -0,66	15,02 -1,30	26,37 -1,82
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,89 -0,03	-0,89 -0,03	5,95 -0,09	2,61 -0,16	4,86 -0,36	23,44 -0,84	40,37 -1,46
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,03 -0,01	0,03 -0,01	0,61 0,03	0,67 -0,35	2,83 -0,60	9,12 -1,15	16,31 -1,63
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP % do CDI	0,06 37,18	0,06 37,18	3,07 661,14	3,45 366,39	7,00 277,08	19,17 226,72	28,23 183,64
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,02 -0,17	-1,02 -0,17	5,96 -0,08	2,45 -0,33	4,93 -0,30	23,73 -0,55	41,11 -0,71
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,16 103,82	0,16 103,82	0,41 88,62	0,85 90,53	1,91 75,63	7,68 90,81	14,45 93,99
BB PREV RF IMA-B	-0,86	-0,86	5,93	2,59	4,73	23,34	40,50

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.	-0,01	-0,01	-0,11	-0,19	-0,50	-0,95	-1,32
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	-0,25	-0,25	2,69	1,62	4,98	16,92	28,83
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,00	-0,00	0,17	0,23	0,48	0,59	0,64
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,18 123,05	0,18 123,05	0,62 133,81	1,10 117,02	1,90 75,36	7,64 90,36	14,44 93,90
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	-0,88	-0,88	5,95	2,59	4,87	23,40	40,74
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,03	-0,09	-0,18	-0,35	-0,89	-1,09
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	-0,55	-0,55	5,92	9,02	-6,27	12,96	22,65
Var. IBOVESPA p.p.	2,77	2,77	-16,56	-2,79	-7,42	-5,19	-12,86
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-0,18	-0,18	13,78	13,09	11,97	37,87	37,07
Var. IBOVESPA p.p.	3,14	3,14	-8,70	1,28	10,82	19,73	1,56
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	-3,47	-3,47	19,26	9,97	-1,23	16,76	32,72
Var. IBOVESPA p.p.	-0,15	-0,15	-3,22	-1,84	-2,37	-1,38	-2,80
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	-3,10	-3,10					
Var. IBOVESPA p.p.	0,22	0,22					
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	-0,42	-0,42	18,06	11,57	10,66		
Var. IBOVESPA p.p.	2,90	2,90	-4,41	-0,24	9,51		
4UM SMALL CAPS FIA	-2,72	-2,72	14,42	3,12	-6,79	40,80	63,56
Var. IBOVESPA p.p.	0,60	0,60	-8,06	-8,69	-7,94	22,66	28,05
ITAU INDEX IBOVESPA 1	-3,38	-3,38	22,29	11,44	0,47	15,76	10,10
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-2,09	-2,09	9,39	7,66	4,46	-21,81	-27,73
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	-3,92	-3,92	17,82	4,29	-13,53	10,48	38,67
Var. IBOVESPA p.p.	-0,60	-0,60	-4,65	-7,52	-14,68	-7,67	3,16
OCCAM FIC FIA	-3,13	-3,13	19,34	9,66	3,51	29,87	54,38
Var. IBOVESPA p.p.	0,19	0,19	-3,13	-2,15	2,36	11,72	18,87
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	-2,85	-2,85	17,46	7,43	-7,21	17,69	32,67
Var. IBOVESPA p.p.	0,47	0,47	-5,01	-4,38	-8,36	-0,46	-2,85
CUBATÃO	-0,95	-0,95	5,42	2,52	2,86	17,72	
Var. INPC + 5,86% p.p.	-1,67	-1,67	1,27	-5,38	-8,78	-5,58	
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,37
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
INPC + 6,00%	0,73	0,73	4,18	7,97	11,79	23,62	35,65
IPCA + 6,00%	0,71	0,71	3,99	7,36	10,76	22,35	34,53

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	0,04	0,58	1,02	3,43	10,27	17,95	30,16	48,79
IRF-M 1+	-1,39	-1,39	2,09	-0,60	5,77	20,12	35,07	55,88	99,88
IRF-M TOTAL	-0,80	-0,80	1,50	-0,15	4,92	16,95	29,61	47,87	81,53
IMA-B 5	0,11	0,11	3,28	3,80	7,55	20,52	32,68	49,63	69,75
IMA-B 5+	-1,69	-1,69	8,43	2,01	3,68	26,83	48,69	72,09	127,80
IMA-B TOTAL	-0,85	-0,85	6,04	2,78	5,22	24,29	41,83	62,38	102,58
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,44	-0,44	2,38	0,96	3,87	15,36	26,95	43,19	72,95
IMA-GERAL TOTAL	-0,24	-0,24	2,52	1,39	4,50	16,33	28,20	44,56	74,55
IDKA 2	0,15	0,15	3,16	4,28	8,20	20,12	32,49	50,04	68,42
IDKA 20	-2,81	-2,81	11,88	1,09	0,71	29,02	58,93	87,07	199,14
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,37	26,20	43,91

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51	77,93	184,79
IBRX 100	-3,03	-3,03	22,21	12,06	1,64	20,92	39,53	83,84	187,39
IBRX 50	-2,78	-2,78	23,61	13,27	2,67	17,81	33,39	76,40	176,44
SMALL CAP	-3,43	-3,43	21,10	10,52	-4,50	38,71	57,28	119,97	253,04
IFIX	0,32	0,32	4,07	5,35	-6,43	19,49	26,00	48,83	117,65
Índice Consumo - ICON	-1,28	-1,28	12,91	3,78	-3,99	37,57	37,84	80,08	121,08
Índice Dividendos - IDIV	-5,08	-5,08	18,30	8,08	-4,52	21,27	43,95	82,51	251,58

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	0,25	0,25	2,51	4,30	4,56	8,94	13,06	16,28	22,51
INPC	0,27	0,27	2,70	4,89	5,53	10,07	14,00	16,14	22,45
IGPM	2,58	2,58	6,95	18,36	25,71	35,53	44,66	44,07	53,65
SELIC	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,38	26,22	43,96

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	4,20	4,20	7,76	19,50	47,69	105,96	127,76	185,42	159,29
MSCI ACWI	4,82	4,82	10,70	22,59	47,61	96,26	105,52	159,93	132,20
MSCI World	4,26	4,26	10,13	21,53	45,74	96,75	108,24	160,05	130,78

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,56	0,56	3,50	6,35	8,69	17,79	27,09	35,89	48,91
IPCA + 5,00%	0,64	0,64	3,75	6,86	9,72	20,06	30,78	41,15	56,18
IPCA + 5,50%	0,68	0,68	3,87	7,11	10,24	21,20	32,64	43,84	59,91
IPCA + 5,89%	0,71	0,71	3,96	7,30	10,64	22,10	34,11	45,97	62,87
IPCA + 6,00%	0,71	0,71	3,99	7,36	10,76	22,35	34,53	46,57	63,72
INPC + 4,00%	0,58	0,58	3,70	6,95	9,70	19,02	28,16	35,72	48,84
INPC + 6,00%	0,73	0,73	4,18	7,97	11,79	23,62	35,65	46,38	63,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

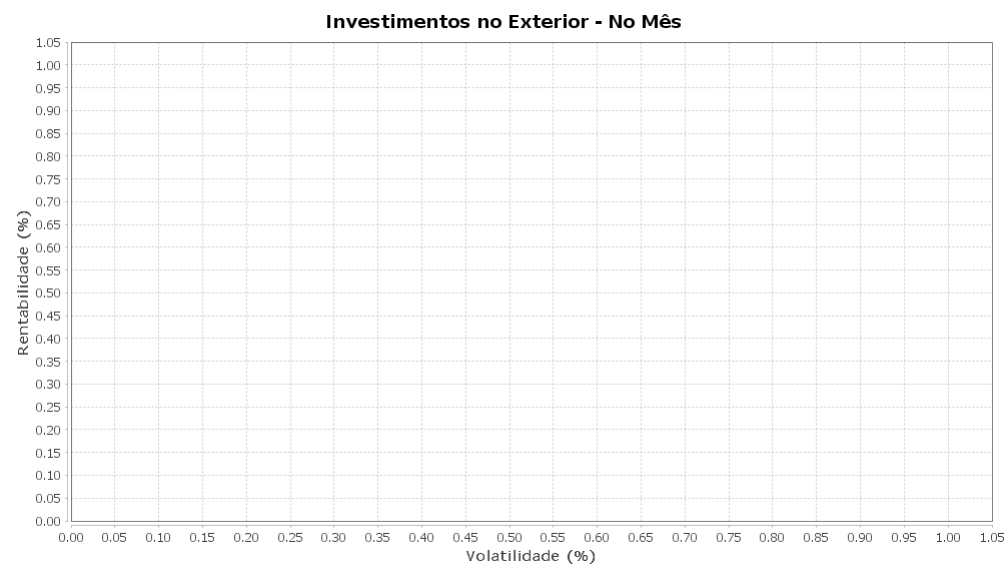
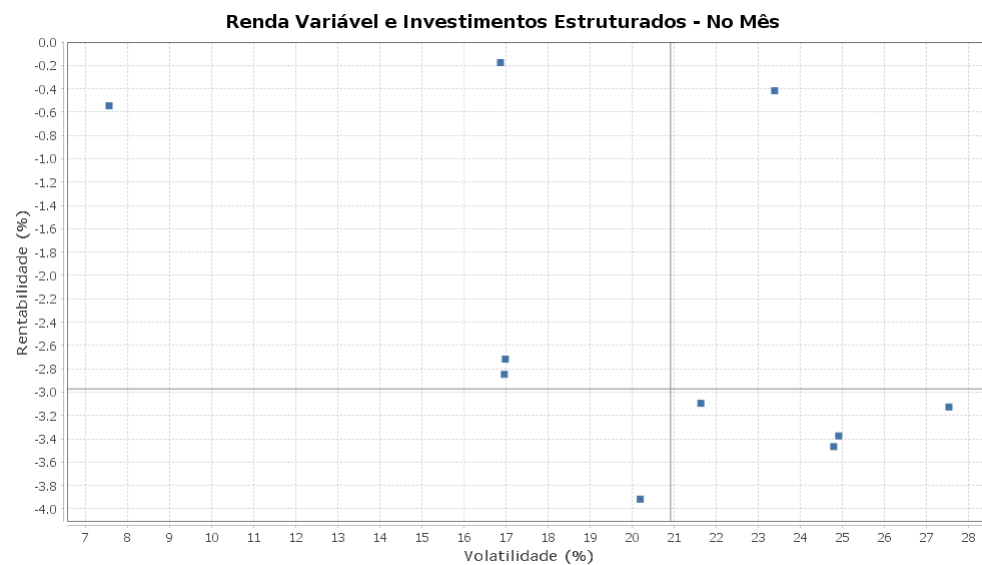
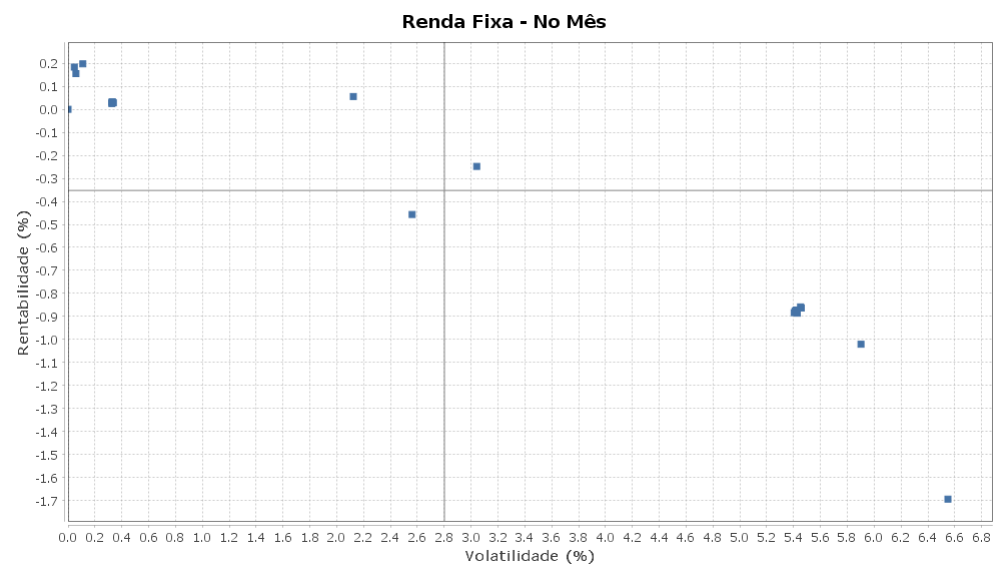
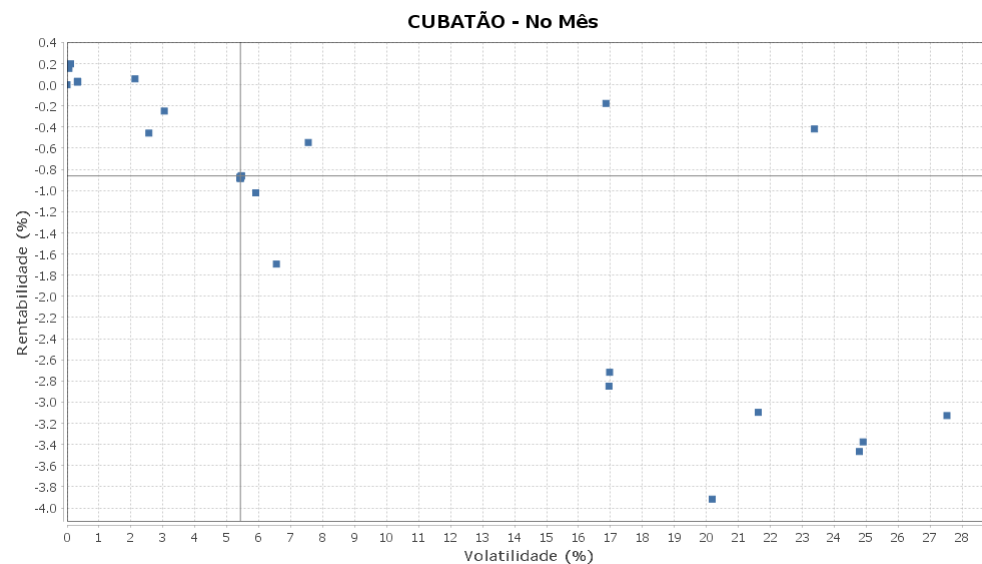
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	15/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	72.600,00	26.654,70598300	2,7237216590
2	15/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	1.930.000,00	708.589,29128200	2,7237216590
3	15/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	520.000,00	0,00	190.915,24946400	2,7237216590
4	15/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.900,00	727,56486719	2,6114510000
5	15/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.110,00	1.573,83768640	2,6114510000
6	15/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	130.720,00	50.056,46286298	2,6114510000
7	15/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	980,00	375,27029992	2,6114510000
8	15/01/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	22.500,00	120,28448159	187,0565488000
9	18/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	215.000,00	0,00	82.305,62951365	2,6122150000
10	19/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	10.571,96	0,00	3.879,56911400	2,7250345820
11	19/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	250.000,00	0,00	91.741,95500100	2,7250345820
12	21/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	830,00	304,65360300	2,7244056570
13	21/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	50.000,00	18.352,62669900	2,7244056570
14	21/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	23.100,00	8.478,91353500	2,7244056570
15	22/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	3.927,00	1.441,26662400	2,7246866980
16	22/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	953.243,00	349.854,16881100	2,7246866980
17	27/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	5.300.000,00	1.945.292,34017900	2,7245262270
18	27/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	10.000,00	3.670,36290600	2,7245262270
19	27/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	35.330,00	13.524,69261279	2,6122590000
20	27/01/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	20.961,47	111,97408192	187,1993022000
21	27/01/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	9.038,53	48,28292570	187,1993022000
22	28/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	360.000,00	0,00	132.090,82572600	2,7253974530
23	28/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	8.573,84	3.145,90445900	2,7253974530
24	28/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	60.000,00	22.015,13762100	2,7253974530
25	28/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	37.000,00	13.576,00153300	2,7253974530

Total

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 20.949.580,25

Value-At-Risk: 2,49%

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	0,74	0,18	47.309.232,68	5,62
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,04	-0,00	0,10	0,16	13.238.719,44	1,57
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,11	0,06	0,00	0,44	0,20	8.239.971,02	0,98
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,19	0,02	-0,36	0,03	130.700.277,78	15,52
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,15	0,00	-0,38	0,03	44.289.956,97	5,26
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,24	0,00	-0,35	0,03	17.006,89	0,00
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,34	0,19	0,00	-0,36	0,03	1.028.480,42	0,12
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	Artigo 7º IV, Alínea a	2,12	1,22	0,02	-0,04	0,06	17.909.335,15	2,13
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,56	1,08	0,02	-0,24	-0,46	15.982.463,71	1,90
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	3,04	1,21	0,08	-0,13	-0,25	68.794.386,17	8,17
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,40	2,56	0,05	-0,19	-0,88	21.011.825,79	2,50
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	5,41	2,56	0,07	-0,19	-0,88	29.398.862,10	3,49
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	5,41	2,56	0,08	-0,19	-0,88	33.922.696,28	4,03
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,42	2,57	0,16	-0,19	-0,87	63.392.029,39	7,53
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	5,43	2,57	0,08	-0,19	-0,89	32.546.892,88	3,87
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	5,45	2,60	0,10	-0,18	-0,86	40.503.058,89	4,81
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,46	2,56	0,08	-0,19	-0,86	31.192.450,85	3,70
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	5,90	2,68	0,09	-0,20	-1,02	33.865.980,99	4,02
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	6,55	3,18	0,19	-0,28	-1,69	60.858.044,78	7,23
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	Artigo 8º IV, Alínea b	7,55	5,53	0,00	-0,09	-0,55	2.300.000,00	0,27
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	16,86	8,34	0,03	-0,02	-0,18	4.686.403,21	0,56
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	16,95	8,10	0,16	-0,18	-2,85	19.356.221,78	2,30
4UM SMALL CAPS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	16,97	9,24	0,11	-0,17	-2,72	14.318.379,07	1,70
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,18	9,82	0,10	-0,20	-3,92	9.680.023,77	1,15
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,62	8,63	0,22	-0,15	-3,10	27.185.681,91	3,23
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,38	9,84	0,05	-0,02	-0,42	4.660.061,96	0,55
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	24,78	11,54	0,26	-0,15	-3,47	21.733.044,74	2,58

Carteira: CUBATÃO

Data Extrato: 29/01/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INDEX IBOVESPA 1	Artigo 8º II, Alínea a	24,90	11,76	0,07	-0,14	-3,38	5.494.626,53	0,65
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	27,53	11,12	0,44	-0,12	-3,13	38.378.833,96	4,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de janeiro de 2021, 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;