



LDB
EMPRESAS

CUBATÃO
ABRIL 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 30.04.2021.

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	81,83%
------------	--------

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 TESOIRO IPCA GERAL FI RF	5,90	0,62	-2,26	20.719.550,57	2,44	293.025.445,76	7,07
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	6,03	0,63	-2,25	28.991.122,85	3,42	398.688.469,96	7,27
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,36	0,24	0,30	135.893.062,73	16,02	7.571.217.894,67	1,79
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	7,14	0,57	-3,82	59.544.211,50	7,02	942.141.386,95	6,32
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	6,04	0,65	-2,22	30.765.532,51	3,63	7.329.081.978,43	0,42
BRAM	BRASESCO	BRASESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	6,04	0,61	-2,30	32.081.447,13	3,78	697.120.178,04	4,60
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,04	0,63	-2,25	62.510.607,90	7,37	5.864.609.190,92	1,07
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,49	0,26	0,25	17.044,62	0,00	77.771.945,35	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,33	0,28	0,34	44.299.439,18	5,22	9.264.610.224,23	0,48
BRAM	BRASESCO	BRASESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,37	0,20	0,22	1.030.445,39	0,12	812.995.869,37	0,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,67	0,48	-1,20	15.863.308,25	1,87	1.104.820.252,02	1,44
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,52	0,45	-1,38	431.715.772,63	50,88		

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	6,02	0,63	-2,29	33.440.891,16	3,94	2.776.974.863,16	1,20
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			6,02	0,63	-2,29	33.440.891,16	3,94		

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	0,29	0,27	0,81	48.016.698,33	5,66	1.372.984.841,70	3,50
BRAM	BRASESCO	BRASESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,17	0,24	0,79	13.322.841,31	1,57	3.016.948.676,00	0,44

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	2,50	0,99	0,64	18.014.295,35	2,12	461.600.874,69	3,90
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	2,92	0,62	-1,00	68.279.118,11	8,05	660.779.454,35	10,33
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	6,32	0,70	-2,76	33.269.763,15	3,92	1.865.646.887,17	1,78
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	6,05	0,65	-2,26	39.932.658,33	4,71	1.247.424.461,94	3,20
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			3,09	0,57	-0,88	220.835.374,58	26,03		

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	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			0,00	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	0,34	0,39	1,02	8.307.342,88	0,98	4.857.640.599,98	0,17
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			0,34	0,39	1,02	8.307.342,88	0,98		
Renda Fixa			3,46	0,50	-1,24	694.299.381,25	81,83		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

18,17%

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	21,93	3,37	-1,98	22.067.905,05	2,60	346.355.262,10	6,37
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	21,99	1,67	-1,27	9.946.655,92	1,17	1.480.903.129,89	0,67
4UM	BEM	4UM SMALL CAPS FIA	20,64	3,42	3,88	15.289.560,16	1,80	393.159.893,91	3,89
4UM	BEM	4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	19,53	2,18	1,51	20.224.937,24	2,38	274.103.126,92	7,38
ITAU	ITAU	ITAU INDEX IBOVESPA 1	23,42	1,89	-0,30	5.669.608,98	0,67	55.085.861,44	10,29
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	22,59	3,51	0,72	39.901.736,86	4,70	1.157.154.321,35	3,45
ARX	BEM	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	19,49	1,96	2,57	28.776.134,15	3,39	97.596.468,22	29,48
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	21,20	3,84	4,04	4.868.753,82	0,57	308.934.770,89	1,58
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			20,35	2,81	1,02	146.745.292,18	17,30		

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	17,24	5,36	12,29	5.271.650,44	0,62	1.203.793.787,09	0,44
Sub-total Artigo 8º III			17,24	5,36	12,29	5.271.650,44	0,62		

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	11,86	-0,06	-5,68	2.148.750,00	0,25	0,00	
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			11,86	-0,06	-5,68	2.148.750,00	0,25		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			19,88	2,85	1,26	154.165.692,62	18,17		
Total			5,20	0,92	-0,79	848.465.073,87	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	431.715.772,63	50,88	0,00	40,50	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	33.440.891,16	3,94	0,00	4,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	220.835.374,58	26,03	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"	8.307.342,88	0,98	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	694.299.381,25	81,83					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	146.745.292,18	17,30	0,00	20,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	5.271.650,44	0,62	0,00	9,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	2.148.750,00	0,25	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	154.165.692,62	18,17					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	0,45 217,31	-1,38 -198,19	-0,79 -144,99	2,59 256,52	5,71 266,16	1.973.541,44	-6.040.187,61
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,63 301,44	-2,29 -329,60	-1,42 -260,90	4,45 439,92	9,32 434,74	208.159,59	-783.639,18
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,57 274,12	-0,88 -126,27	-0,54 -99,22	2,63 260,61	5,85 272,76	1.250.198,32	-1.949.721,65
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,39 186,05	1,02 146,43	0,82 150,19	1,56 153,85	2,97 138,73	31.992,84	83.651,67
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	2,81 0,87	1,02 1,12	4,22 0,89	23,59 -2,96	40,61 -7,07	4.010.279,06	1.476.804,53
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	5,36 3,42	12,29 12,39	12,49 9,16			268.193,40	576.997,97
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-0,06 -2,00	-5,68 -5,58	-5,16 -8,49	0,45 -26,10	3,73 -43,96	-1.300,00	-130.050,00
CUBATÃO (Total)						7.741.064,65	-6.766.144,27

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	30.567.246,75	0,00	0,00	0,00	30.765.532,51	198.285,76	-698.691,63
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	135.137.725,29	4.808.372,93	-4.390.300,00	0,00	135.893.062,73	337.264,51	405.928,87
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	1.028.346,28	0,00	0,00	0,00	1.030.445,39	2.099,11	2.260,27
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	31.885.547,41	0,00	0,00	0,00	32.081.447,13	195.899,72	-756.283,32
BTG PACTUAL TESOUREO IPCA GERAL FI RF	20.592.249,08	0,00	0,00	0,00	20.719.550,57	127.301,49	-479.562,80
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.787.303,73	0,00	0,00	0,00	15.863.308,25	76.004,52	-192.524,99
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	62.119.105,44	0,00	0,00	0,00	62.510.607,90	391.502,46	-1.439.375,26
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	44.209.120,55	188.000,00	-222.970,00	0,00	44.299.439,18	125.288,63	148.442,45
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	28.809.228,80	0,00	0,00	0,00	28.991.122,85	181.894,05	-667.673,69
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	59.206.254,62	0,00	0,00	0,00	59.544.211,50	337.956,88	-2.362.750,90

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	17.000,31	0,00	0,00	0,00	17.044,62	44,31	43,39
					431.715.772,63	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	33.232.731,56	0,01	0,00	0,00	33.440.891,16	208.159,59	-783.639,18
					33.440.891,16	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	39.673.292,47	0,00	0,00	0,00	39.932.658,33	259.365,86	-921.280,34
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	13.290.543,60	0,00	0,00	0,00	13.322.841,31	32.297,71	104.637,11
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	67.857.407,78	0,00	-0,01	0,00	68.279.118,11	421.710,34	-686.350,48
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	33.039.473,21	0,00	0,00	0,00	33.269.763,15	230.289,94	-945.574,78
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	17.837.591,51	0,00	0,00	0,00	18.014.295,35	176.703,84	114.908,17
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	47.591.448,93	295.530,00	-111,23	0,00	48.016.698,33	129.830,63	383.938,67
					220.835.374,58	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	8.275.350,04	0,00	0,00	0,00	8.307.342,88	31.992,84	83.651,67
					8.307.342,88	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	19.793.742,11	0,00	0,00	0,00	20.224.937,24	431.195,13	301.205,58
4UM SMALL CAPS FIA	14.783.444,00	0,00	0,00	0,00	15.289.560,16	506.116,16	571.269,18
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	28.224.138,29	0,00	0,00	0,00	28.776.134,15	551.995,86	721.785,78
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	21.349.417,55	0,00	0,00	0,00	22.067.905,05	718.487,50	-445.752,97
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	9.783.309,91	0,00	0,00	0,00	9.946.655,92	163.346,01	-127.975,26
ITAU INDEX IBOVESPA 1	5.564.510,32	0,00	0,00	0,00	5.669.608,98	105.098,66	-16.961,17
OCCAM FIC FIA	38.547.642,91	0,00	0,00	0,00	39.901.736,86	1.354.093,95	284.099,62
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	4.688.808,03	0,00	0,00	0,00	4.868.753,82	179.945,79	189.133,77
					146.745.292,18	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	5.003.457,04	0,00	0,00	0,00	5.271.650,44	268.193,40	576.997,97
					5.271.650,44	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	2.161.250,00	0,00	0,00	0,00	11.200,00	2.148.750,00	-1.300,00	-130.050,00
						2.148.750,00	0,00	0,00

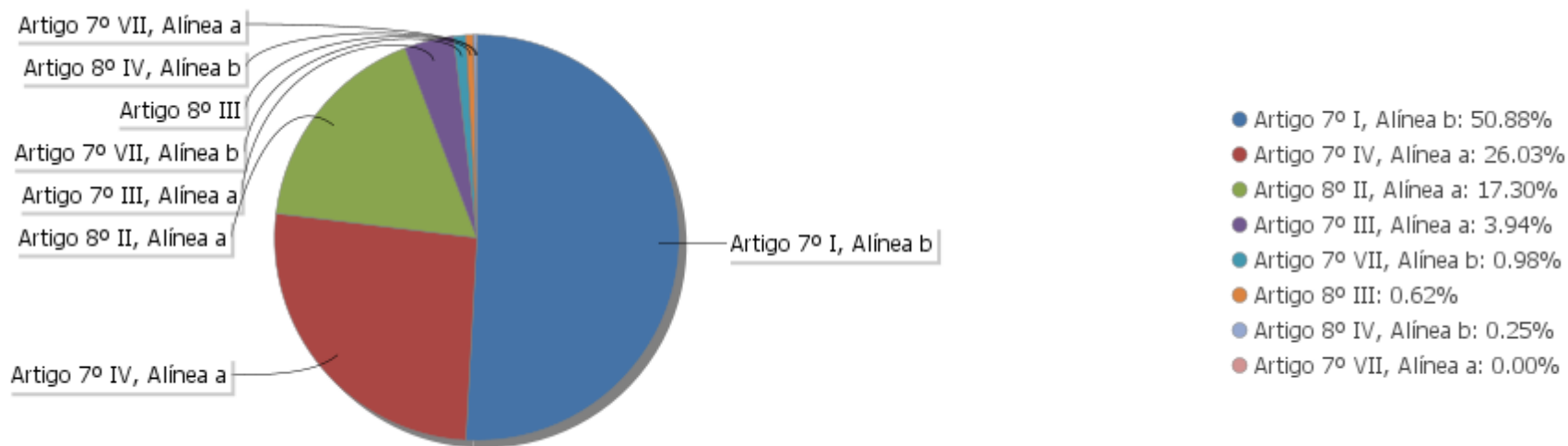
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

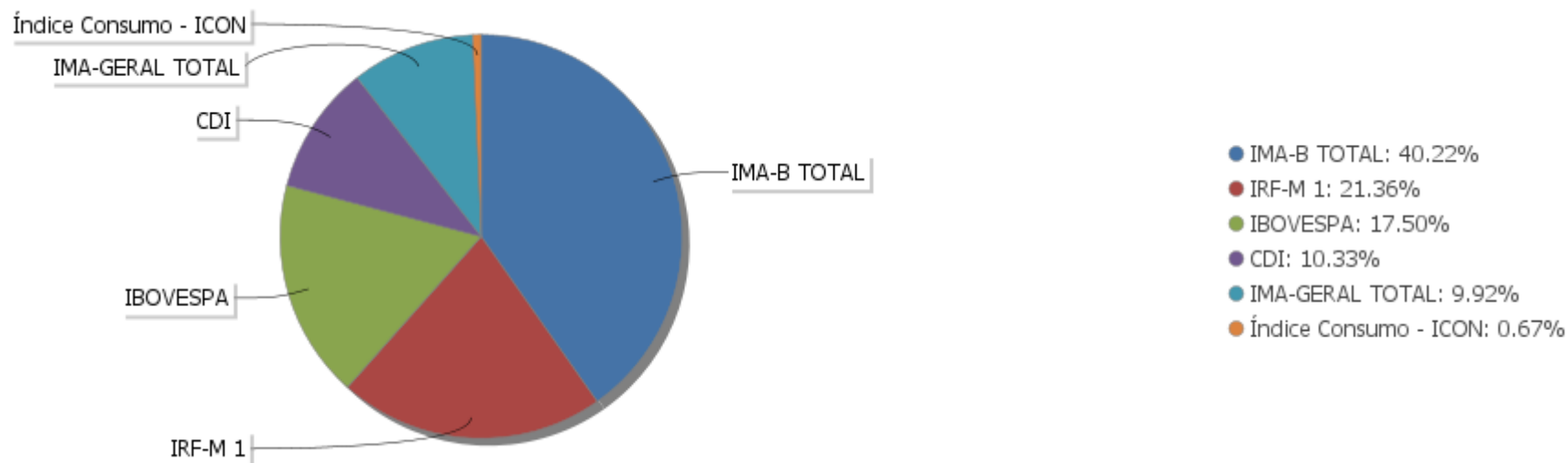
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	843.596.320,05	99,43	843.596.320,05	99,43
de 31 a 365 dias	4.868.753,82	0,57	848.465.073,87	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	848.465.073,87	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

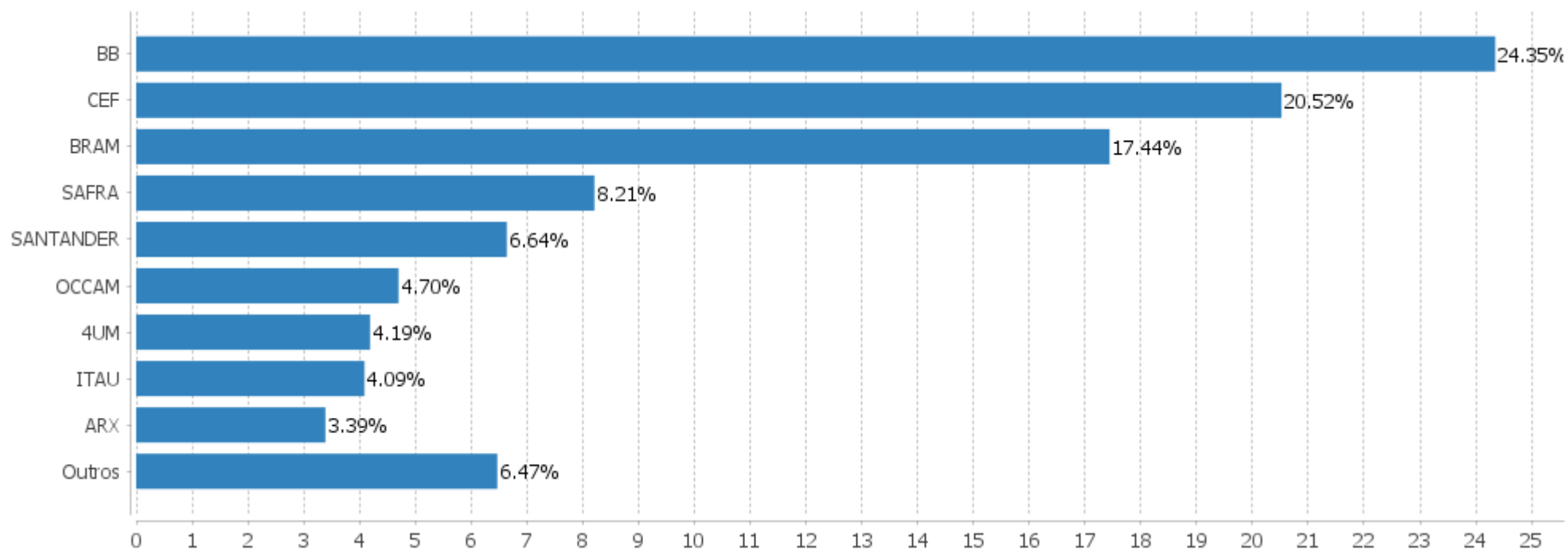


Alocação Por Estratégia



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	-1,27	0,53	0,92									-0,79
INPC + 5,86%	0,72	1,23	1,39	0,83									4,24
p.p. indexador	-1,67	-2,50	-0,86	0,08									-5,03
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

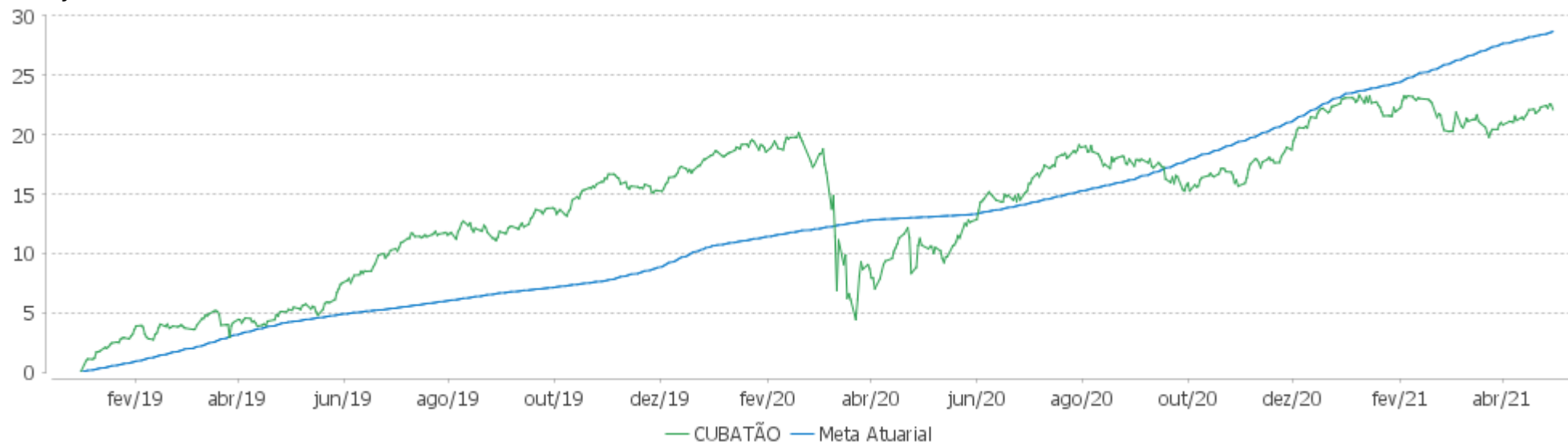
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

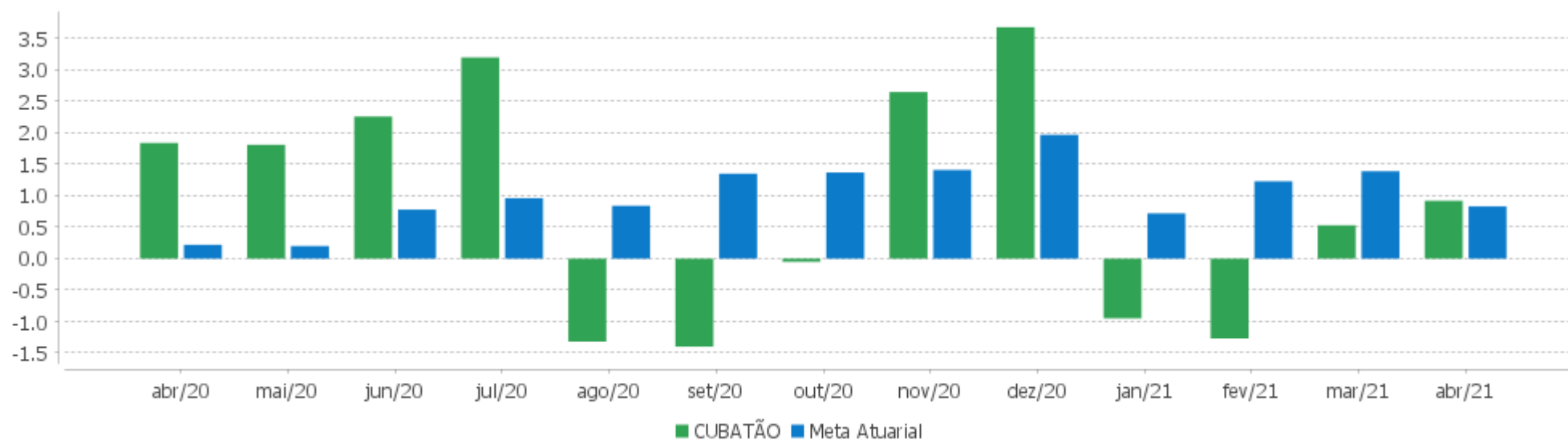
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	14	50,00	03 meses	0,16	3,49	-3,33	5,10
Meses abaixo - Meta Atuarial	14	50,00	06 meses	5,58	7,78	-2,20	4,80
			12 meses	10,33	13,84	-3,51	5,20
			24 meses	16,01	23,62	-7,61	8,21
Maior rentabilidade da Carteira	3,68	2020-12	Desde 31/12/2018	22,12	28,87	-6,75	7,79
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
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	-96,39	-98,51
% do CDI	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	-1.294,21	-690,67
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	0,63	-2,29	-1,42	4,45	9,32	18,55	36,86
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,12	-0,09	-0,18	-0,34	-0,91	-1,22
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	0,63	-2,25	-1,39	4,48	9,30	18,82	36,64
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,08	-0,05	-0,14	-0,37	-0,64	-1,45
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,63	-2,25	-1,39	4,52	9,41	18,68	36,95
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,08	-0,06	-0,11	-0,25	-0,78	-1,13
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,20	0,22	0,19	0,74	1,90	8,31	15,25
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,07	-0,18	-0,17	-0,20	-0,43	-0,77	-1,13
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,24	0,30	0,26	0,81	1,94	8,38	15,39
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,11	-0,09	-0,13	-0,39	-0,71	-0,98
BTG PACTUAL TESOUREO IPCA GERAL FI RF	0,62	-2,26	-1,39	4,47	9,06	18,78	36,81
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,09	-0,06	-0,15	-0,61	-0,68	-1,27
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,28	0,34	0,31	0,84	2,12	8,64	15,73
Var. IRF-M 1 p.p.	0,01	-0,07	-0,05	-0,10	-0,21	-0,44	-0,65
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	0,57	-3,82	-2,16	3,68	7,68	18,21	39,12
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,08	-1,64	-0,83	-0,95	-1,98	-1,25	1,04
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,65	-2,22	-1,37	4,55	9,38	18,91	37,07
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,00	-0,05	-0,04	-0,08	-0,28	-0,55	-1,01
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,48	-1,20	-0,75	1,58	3,81	12,21	23,06
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,03	-0,38	-0,17	-0,34	-0,81	-1,27	-1,89
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	0,61	-2,30	-1,43	4,43	9,29	18,62	36,59
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,04	-0,13	-0,10	-0,19	-0,37	-0,84	-1,50
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,26	0,25	0,22	0,83	1,73	7,92	14,74
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,01	-0,15	-0,14	-0,11	-0,61	-1,17	-1,64
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	0,99	0,64	0,59	3,67	8,35	17,16	26,56
% do CDI	476,73	92,41	107,66	363,25	389,54	230,39	186,24
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	0,70	-2,76	-1,76	4,09	9,09	18,56	36,80
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,05	-0,59	-0,43	-0,53	-0,57	-0,91	-1,28
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,24	0,79	0,64	1,05	2,35	6,79	13,44
% do CDI	116,95	113,95	116,72	103,79	109,67	91,19	94,26
BB PREV RF IMA-B	0,65	-2,26	-1,41	4,44	9,38	18,56	36,75

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.	0,00	-0,08	-0,08	-0,19	-0,28	-0,91	-1,33
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,27 130,64	0,81 116,65	0,63 114,86	1,25 123,66	2,26 105,63	6,70 90,02	13,45 94,28
BRANCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,62 0,11	-1,00 -0,17	-0,75 -0,17	1,93 -0,00	5,02 0,40	13,92 0,44	25,28 0,34
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	0,39 186,05	1,02 146,43	0,82 150,19	1,56 153,85	2,97 138,73	6,80 91,31	13,53 94,85
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	5,36 3,42	12,29 12,39	12,49 9,16	27,99 1,44	42,57 -5,12	40,85 17,46	62,85 24,79
GERAÇÃO FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	3,37 1,43	-1,98 -1,88	1,54 -1,78	21,09 -5,45	43,20 -4,48	17,08 -6,31	33,94 -4,13
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,96 0,02	2,57 2,68	5,85 2,53				
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,84 1,90	4,04 4,15	4,48 1,15	23,35 -3,20	50,60 2,92		
4UM SMALL CAPS FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,42 1,49	3,88 3,99	6,78 3,46	22,18 -4,37	35,76 -11,93	48,76 25,37	74,82 36,76
ITAU INDEX IBOVESPA 1 Var. Índice Consumo - ICON p.p.	1,89 1,13	-0,30 3,31	3,18 5,54	26,19 15,95	46,78 17,54	21,81 -8,75	20,09 -21,93
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,67 -0,27	-1,27 -1,17	2,75 -0,57	21,06 -5,48	27,68 -20,00	12,67 -10,72	39,23 1,16
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,51 1,57	0,72 0,82	3,97 0,64	24,08 -2,47	47,85 0,17	35,85 12,46	55,47 17,40
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,18 0,24	1,51 1,62	4,49 1,16	22,74 -3,81	34,34 -13,34	23,36 -0,03	37,32 -0,74
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS Var. IBOVESPA p.p.	-0,06 -2,00	-5,68 -5,58	-5,16 -8,49	0,45 -26,10	3,73 -43,96	9,73 -13,66	4,05 -34,01
CUBATÃO Var. INPC + 5,86% p.p.	0,92 0,08	-0,79 -5,03	0,16 -3,33	5,58 -2,20	10,33 -3,51	16,01 -7,50	
CDI	0,21	0,69	0,54	1,01	2,14	7,45	14,26
IBOVESPA	1,94	-0,10	3,33	26,55	47,68	23,39	38,06
INPC + 6,00%	0,85	4,28	3,52	7,85	13,99	23,83	37,86
IPCA + 6,00%	0,77	4,30	3,56	7,69	13,11	22,80	36,54

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	0,27	0,40	0,36	0,94	2,33	9,09	16,37	26,78	44,35
IRF-M 1+	1,12	-3,70	-2,35	-0,31	1,43	15,56	27,60	45,71	73,67
IRF-M TOTAL	0,84	-1,98	-1,19	0,30	1,94	13,86	24,44	40,36	65,09
IMA-B 5	0,87	0,72	0,62	3,92	8,92	18,36	30,12	45,28	64,42
IMA-B 5+	0,45	-4,67	-3,03	5,14	10,30	19,64	43,74	58,75	88,40
IMA-B TOTAL	0,65	-2,17	-1,33	4,63	9,66	19,46	38,08	53,18	78,59
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,49	-1,16	-0,72	1,64	3,81	12,47	23,58	36,90	58,87
IMA-GERAL TOTAL	0,51	-0,82	-0,58	1,93	4,62	13,48	24,94	38,46	60,37
IDKA 2	1,35	1,30	1,16	4,35	9,41	18,84	30,03	46,02	65,35
IDKA 20	0,37	-6,86	-4,17	7,21	13,61	19,99	56,00	68,62	112,68
CDI	0,21	0,69	0,54	1,01	2,14	7,45	14,26	23,52	40,13

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	1,94	-0,10	3,33	26,55	47,68	23,39	38,06	81,79	120,54
IBRX 100	2,84	2,09	5,28	28,66	51,24	28,38	44,99	90,20	132,38
IBRX 50	2,90	2,08	5,01	29,80	53,43	25,21	38,51	83,01	120,07
SMALL CAP	4,38	3,46	7,14	29,74	55,90	48,74	65,09	118,72	207,37
IFIX	0,51	-0,31	-0,64	3,41	9,89	14,06	22,42	40,54	84,10
Índice Consumo - ICON	0,76	-3,61	-2,36	10,24	29,24	30,56	42,01	63,09	90,95
Índice Dividendos - IDIV	2,03	-1,25	4,03	23,07	37,02	27,18	51,25	79,16	149,56

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	0,31	2,37	2,11	4,67	6,76	9,32	14,72	17,89	22,70
INPC	0,38	2,35	2,07	4,83	7,59	10,24	15,83	17,79	22,49
IGPM	1,51	9,89	7,13	14,58	32,02	40,84	53,01	55,90	61,15
SELIC	0,21	0,69	0,54	1,01	2,14	7,45	14,27	23,54	40,18

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	-0,18	15,75	11,09	19,71	42,94	94,40	145,10	196,28	217,01
MSCI ACWI	-1,13	12,92	7,72	19,25	42,86	83,15	113,74	160,50	172,47
MSCI World	-0,87	13,60	8,95	19,99	42,54	84,75	118,63	164,34	175,43

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,62	3,67	3,09	6,70	11,00	18,22	28,99	37,81	49,15
IPCA + 5,00%	0,70	3,99	3,33	7,20	12,05	20,50	32,73	43,16	56,42
IPCA + 5,50%	0,74	4,15	3,45	7,45	12,58	21,65	34,63	45,89	60,16
IPCA + 5,89%	0,77	4,27	3,54	7,64	13,00	22,55	36,12	48,05	63,13
IPCA + 6,00%	0,77	4,30	3,56	7,69	13,11	22,80	36,54	48,66	63,98
INPC + 4,00%	0,69	3,65	3,05	6,86	11,86	19,21	30,23	37,69	48,89
INPC + 6,00%	0,85	4,28	3,52	7,85	13,99	23,83	37,86	48,54	63,69

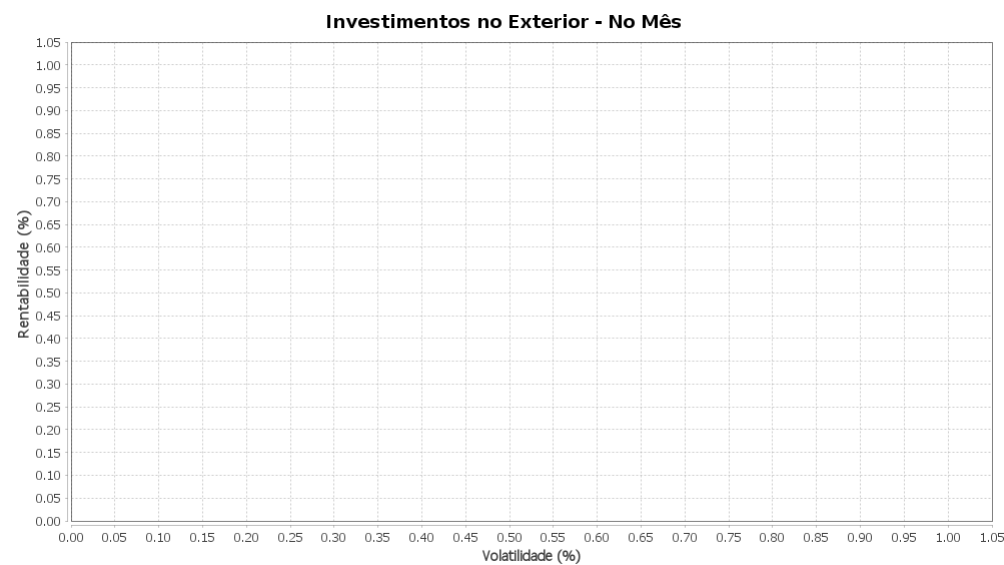
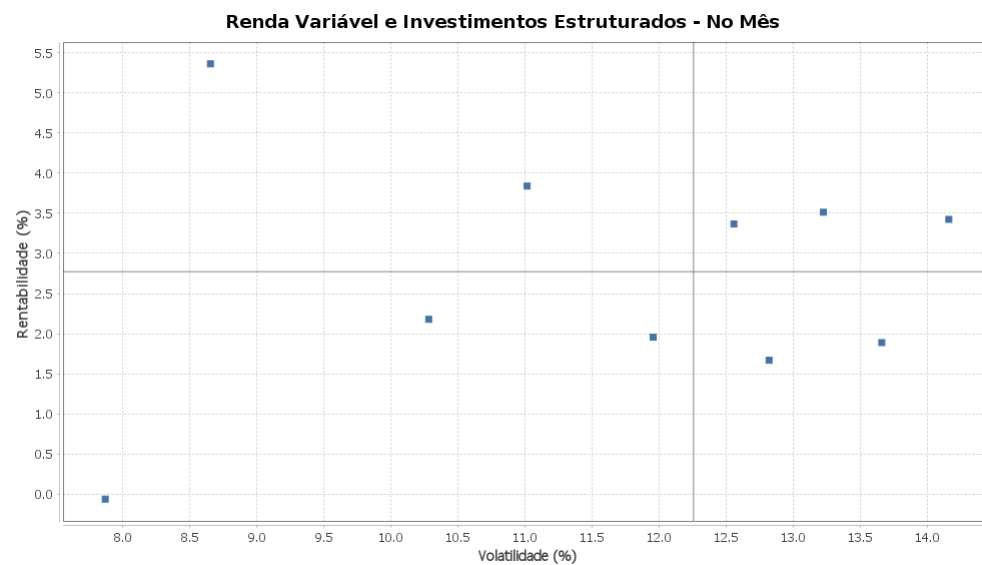
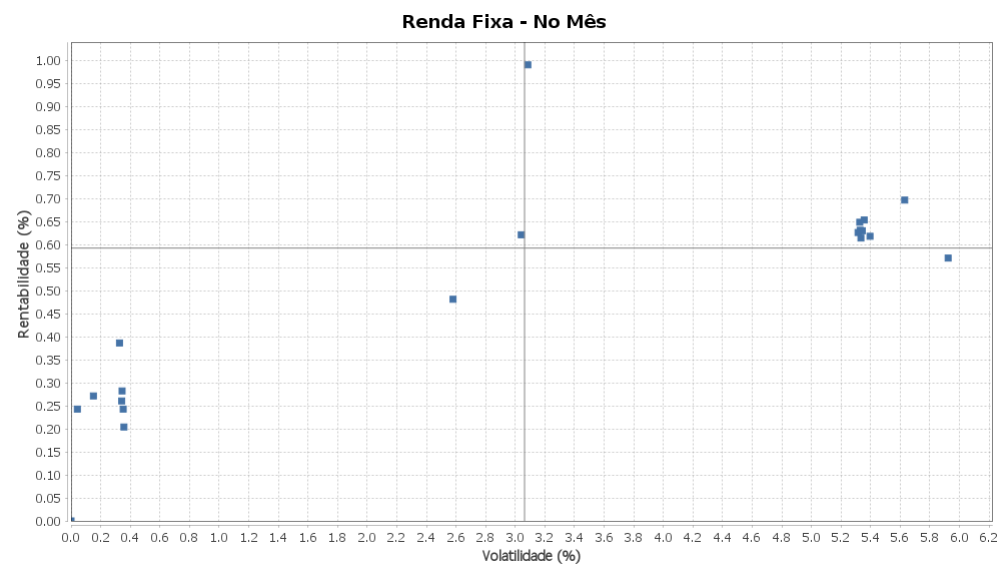
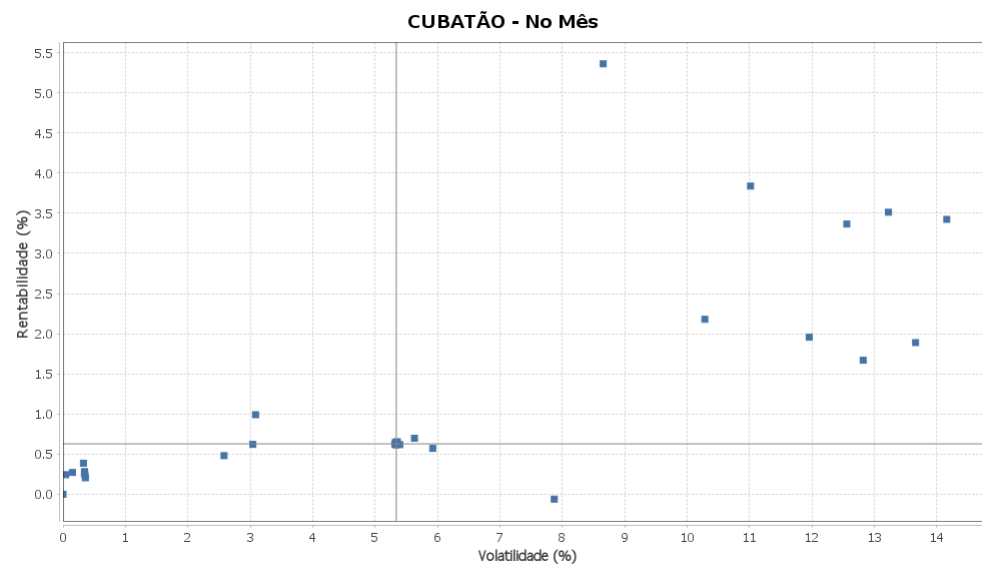
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
70	05/04/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	111,23	0,59183846	187,9397955000
71	05/04/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	100,00	0,00	0,53208529	187,9397955000
64	07/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	75.000,00	27.512,18089000	2,7260652400
74	07/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	860.000,00	0,00	315.473,00753500	2,7260652400
80	07/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.000.000,00	0,00	733.658,15705800	2,7260652400
67	08/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	188.000,00	0,00	71.875,11469433	2,6156480000
72	08/04/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	288.300,00	0,00	1.533,50254010	188,0009928000
79	08/04/2021	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	7.130,00	0,00	37,92533164	188,0009928000
75	12/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	640.000,00	0,00	234.672,76318300	2,7272018760
81	16/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	808.900,00	0,00	296.341,58296400	2,7296202980
65	22/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	15.000,00	0,00	5.492,27848200	2,7311069620
76	22/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	170.000,00	0,00	62.245,82279800	2,7311069620
82	22/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	98.000,00	0,00	35.882,88608300	2,7311069620
73	27/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.172,93	0,00	4.089,32911600	2,7322158920
66	28/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	205.300,00	0,00	75.127,99549800	2,7326697410
77	28/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	4.174.600,00	1.527.663,56554800	2,7326697410
68	28/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	69.100,00	26.361,62967518	2,6212340000
83	28/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	140.700,00	51.488,10992000	2,7326697410
61	29/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.310,00	881,08516127	2,6217670000
69	29/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	118.970,00	45.377,79291600	2,6217670000
78	29/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	32.590,00	12.430,54779467	2,6217670000
84	30/04/2021	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	0,01	0,00	0,00260165	3,8437180000
85	30/04/2021	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	0,00	0,01	0,00226263	4,4196409000
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 20.522.669,86

Value-At-Risk: 2,42%

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
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,03	-0,00	0,83	0,24	13.322.841,31	1,57
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,15	0,03	-0,00	0,42	0,27	48.016.698,33	5,66
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,33	0,07	0,00	0,55	0,39	8.307.342,88	0,98
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,34	0,15	0,00	0,15	0,26	17.044,62	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,34	0,14	0,00	0,22	0,28	44.299.439,18	5,22
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,35	0,15	0,01	0,10	0,24	135.893.062,73	16,02
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,36	0,15	0,00	-0,01	0,20	1.030.445,39	0,12
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,58	1,16	0,02	0,11	0,48	15.863.308,25	1,87
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	3,04	1,33	0,08	0,14	0,62	68.279.118,11	8,05
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	Artigo 7º IV, Alínea a	3,08	1,40	0,02	0,25	0,99	18.014.295,35	2,12
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	5,32	2,87	0,09	0,08	0,63	33.440.891,16	3,94
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,33	2,90	0,08	0,08	0,65	30.765.532,51	3,63
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	5,33	2,89	0,08	0,08	0,63	28.991.122,85	3,42
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	5,33	2,89	0,09	0,08	0,61	32.081.447,13	3,78
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,34	2,89	0,17	0,08	0,63	62.510.607,90	7,37
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	5,36	2,91	0,11	0,08	0,65	39.932.658,33	4,71
BTG PACTUAL TESOUREIRO IPCA GERAL FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,40	2,89	0,06	0,08	0,62	20.719.550,57	2,44
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	5,63	3,06	0,09	0,09	0,70	33.269.763,15	3,92
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	5,92	3,23	0,18	0,06	0,57	59.544.211,50	7,02
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	Artigo 8º IV, Alínea b	7,87	4,57	0,00	-0,03	-0,06	2.148.750,00	0,25
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	8,65	6,31	0,02	0,60	5,36	5.271.650,44	0,62
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	10,28	7,94	0,15	0,19	2,18	20.224.937,24	2,38
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	11,02	8,99	0,04	0,33	3,84	4.868.753,82	0,57
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	11,96	9,93	0,28	0,15	1,96	28.776.134,15	3,39
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	12,56	9,33	0,20	0,25	3,37	22.067.905,05	2,60
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,82	8,09	0,08	0,11	1,67	9.946.655,92	1,17
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	13,22	10,39	0,40	0,25	3,51	39.901.736,86	4,70

Carteira: CUBATÃO

Data Extrato: 30/04/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INDEX IBOVESPA 1	Artigo 8º II, Alínea a	13,66	9,69	0,06	0,12	1,89	5.669.608,98	0,67
4UM SMALL CAPS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	14,16	8,82	0,11	0,23	3,42	15.289.560,16	1,80