



LDB
EMPRESAS

CUBATÃO
JULHO 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 30.07.2021.

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	81,92%
------------	--------

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	5,56	-0,40	-1,30	20.923.799,82	2,43	345.883.972,79	6,05
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,63	-0,39	-1,23	29.293.598,38	3,40	410.571.085,67	7,13
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,37	0,16	0,82	142.603.655,35	16,54	6.744.375.720,34	2,11
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	6,73	-0,61	-2,77	60.193.301,91	6,98	883.565.121,33	6,81
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,65	-0,38	-1,20	31.087.128,69	3,61	7.757.107.360,64	0,40
BRAM	BRASESCO	BRASESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,64	-0,40	-1,31	32.407.975,85	3,76	683.982.144,63	4,74
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,64	-0,40	-1,23	63.163.065,82	7,33	5.838.267.480,63	1,08
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,49	0,17	0,77	17.131,61	0,00	38.203.247,37	0,04
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	0,17	0,86	44.609.088,57	5,17	7.606.396.263,31	0,59
BRAM	BRASESCO	BRASESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,38	0,19	0,81	1.036.533,99	0,12	692.783.606,96	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,55	-0,13	-0,58	15.962.952,02	1,85	1.173.650.305,38	1,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,30	-0,18	-0,57	441.298.232,01	51,19		

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	5,62	-0,39	-1,21	33.810.855,97	3,92	2.818.884.270,28	1,20
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			5,62	-0,39	-1,21	33.810.855,97	3,92		

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	0,24	0,38	1,89	48.532.290,74	5,63	1.682.615.918,69	2,88
BRAM	BRASESCO	BRASESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,17	0,39	1,84	13.461.334,40	1,56	3.447.645.804,86	0,39

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	2,78	-0,44	0,77	18.037.239,20	2,09	481.490.219,06	3,75
BRAM	BRADERCO	BRADERCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	2,86	-0,29	-0,34	68.733.232,76	7,97	670.296.168,81	10,25
BRAM	BRADERCO	BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	5,92	-0,44	-1,80	33.599.666,03	3,90	1.762.335.812,16	1,91
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	5,65	-0,39	-1,21	40.358.349,35	4,68	1.244.836.023,36	3,24
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,97	-0,16	-0,03	222.722.112,48	25,84		

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	0,48	0,44	2,32	8.414.524,55	0,98	4.565.699.651,32	0,18
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			0,48	0,44	2,32	8.414.524,55	0,98		
Renda Fixa			3,27	-0,17	-0,40	706.245.725,01	81,92		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

18,08%

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	19,54	-3,63	-0,71	22.353.543,34	2,59	306.665.771,79	7,29
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	18,45	-4,91	-1,81	9.892.600,56	1,15	1.169.640.883,53	0,85
4UM	BEM	4UM SMALL CAPS FIA	18,49	-6,76	4,23	15.341.406,93	1,78	395.284.060,70	3,88
4UM	BEM	4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	16,29	-1,25	5,40	20.998.689,97	2,44	256.717.741,11	8,18
ITAU	ITAU	ITAU INDEX IBOVESPA 1	20,87	-3,98	1,99	5.799.915,81	0,67	55.918.832,44	10,37
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	20,74	-4,12	0,31	39.741.449,10	4,61	1.227.059.317,62	3,24
ARX	BEM	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	17,97	-4,97	3,31	28.983.204,99	3,36	205.075.657,30	14,13
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	17,83	-2,49	10,01	5.148.041,82	0,60	570.809.683,55	0,90
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			18,06	-4,09	2,06	148.258.852,52	17,20		

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	14,78	2,58	18,78	5.576.369,57	0,65	1.584.576.000,04	0,35
Sub-total Artigo 8º III			14,78	2,58	18,78	5.576.369,57	0,65		

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	12,86	2,24	-11,84	1.989.750,00	0,23	0,00	
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			12,86	2,24	-11,84	1.989.750,00	0,23		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			17,62	-3,79	2,37	155.824.972,09	18,08		
Total			4,84	-0,85	0,10	862.070.697,10	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	441.298.232,01	51,19	0,00	40,50	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	33.810.855,97	3,92	0,00	4,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	222.722.112,48	25,84	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"	8.414.524,55	0,98	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	706.245.725,01	81,92					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	148.258.852,52	17,20	0,00	20,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	5.576.369,57	0,65	0,00	9,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.989.750,00	0,23	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	155.824.972,09	18,08					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	-0,18 -49,86	-0,57 -35,00	0,81 87,00	0,02 1,29	1,58 64,71	-783.849,85	-2.505.864,30
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,39 -108,35	-1,21 -73,80	1,11 118,12	-0,33 -22,19	2,25 92,35	-130.780,53	-413.674,37
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,16 -44,08	-0,03 -1,85	0,85 91,22	0,31 20,83	2,23 91,22	-349.659,86	-62.983,75
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,44 124,68	2,32 141,69	1,29 137,75	2,12 142,55	3,61 148,05	37.144,72	190.833,34
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,09 -0,15	2,06 -0,28	1,03 -1,41	5,29 -0,56	13,09 -5,27	-6.325.511,72	2.990.364,87
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,58 6,53	18,78 16,44	5,78 3,34	18,99 13,14		140.426,32	881.717,10
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	2,24 6,18	-11,84 -14,18	-6,53 -8,98	-11,35 -17,21	-3,36 -21,71	43.500,00	-269.050,00
CUBATÃO (Total)						-7.368.730,92	811.342,89

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	31.206.819,52	0,00	0,00	0,00	31.087.128,69	-119.690,83	-377.095,45
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	142.369.681,83	0,00	0,00	0,00	142.603.655,35	233.973,52	1.144.035,42
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	1.034.551,92	0,00	0,00	0,00	1.036.533,99	1.982,07	8.348,87
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	32.539.703,15	0,00	0,00	0,00	32.407.975,85	-131.727,30	-429.754,60
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	21.007.157,61	0,00	0,00	0,00	20.923.799,82	-83.357,79	-275.313,55
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.984.247,30	0,00	0,00	0,00	15.962.952,02	-21.295,28	-92.881,22
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	63.415.867,52	0,00	0,00	0,00	63.163.065,82	-252.801,70	-786.917,34
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	44.534.953,61	0,00	0,00	0,00	44.609.088,57	74.134,96	382.441,84
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	29.408.285,46	0,00	0,00	0,00	29.293.598,38	-114.687,08	-365.198,16
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	60.563.712,08	0,00	0,00	0,00	60.193.301,91	-370.410,17	-1.713.660,49

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	17.101,86	0,00	0,00	0,00	17.131,61	29,75	130,38
					441.298.232,01	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	33.941.636,50	0,00	0,00	0,00	33.810.855,97	-130.780,53	-413.674,37
					33.810.855,97	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	40.514.659,37	0,00	0,00	0,00	40.358.349,35	-156.310,02	-495.589,32
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	13.409.364,78	0,00	0,00	0,00	13.461.334,40	51.969,62	243.130,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	68.935.619,55	0,00	0,00	0,00	68.733.232,76	-202.386,79	-232.235,83
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	33.748.482,29	0,00	0,00	0,00	33.599.666,03	-148.816,26	-615.671,90
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	18.116.103,71	0,00	0,00	0,00	18.037.239,20	-78.864,51	137.852,02
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	48.347.542,64	0,00	0,00	0,00	48.532.290,74	184.748,10	899.531,08
					222.722.112,48	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	8.377.379,83	0,00	0,00	0,00	8.414.524,55	37.144,72	190.833,34
					8.414.524,55	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	21.263.484,32	0,00	0,00	0,00	20.998.689,97	-264.794,35	1.074.958,31
4UM SMALL CAPS FIA	16.453.761,35	0,00	0,00	0,00	15.341.406,93	-1.112.354,42	623.115,95
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	30.499.081,15	0,00	0,00	0,00	28.983.204,99	-1.515.876,16	928.856,62
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	23.196.418,77	0,00	0,00	0,00	22.353.543,34	-842.875,43	-160.114,68
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	10.403.866,86	0,00	0,00	0,00	9.892.600,56	-511.266,30	-182.030,62
ITAU INDEX IBOVESPA 1	6.040.447,18	0,00	0,00	0,00	5.799.915,81	-240.531,37	113.345,66
OCCAM FIC FIA	41.447.545,13	0,00	0,00	0,00	39.741.449,10	-1.706.096,03	123.811,86
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	5.279.759,48	0,00	0,00	0,00	5.148.041,82	-131.717,66	468.421,77
					148.258.852,52	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	5.435.943,25	0,00	0,00	0,00	5.576.369,57	140.426,32	881.717,10
					5.576.369,57	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	1.946.250,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1.989.750,00	43.500,00	-269.050,00
						1.989.750,00	0,00	0,00

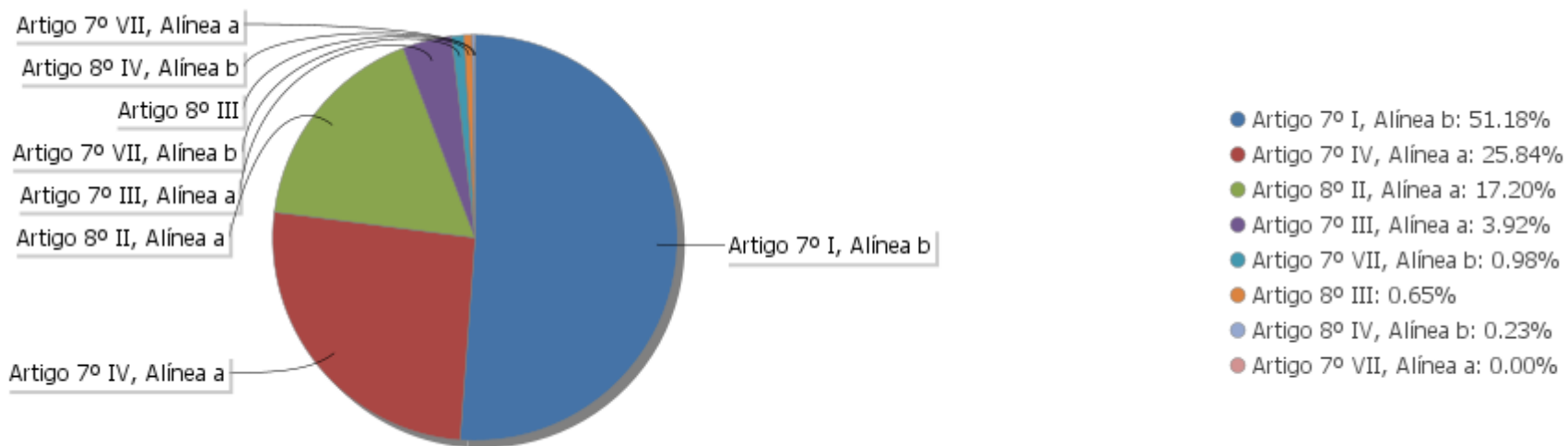
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

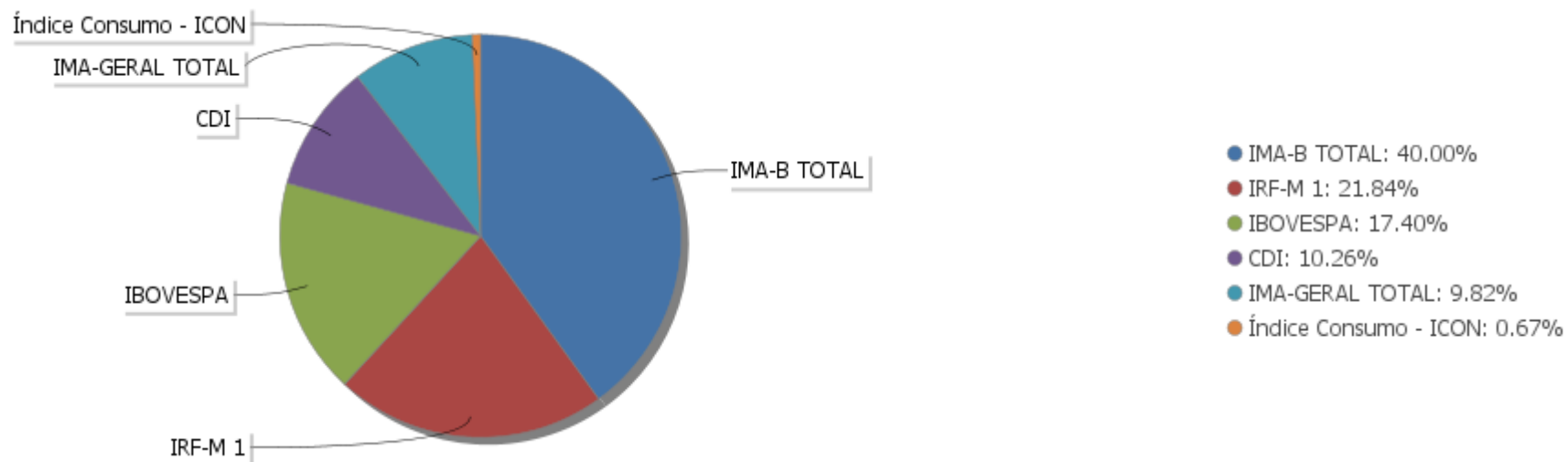
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	856.922.655,28	99,40	856.922.655,28	99,40
de 31 a 365 dias	5.148.041,82	0,60	862.070.697,10	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	862.070.697,10	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

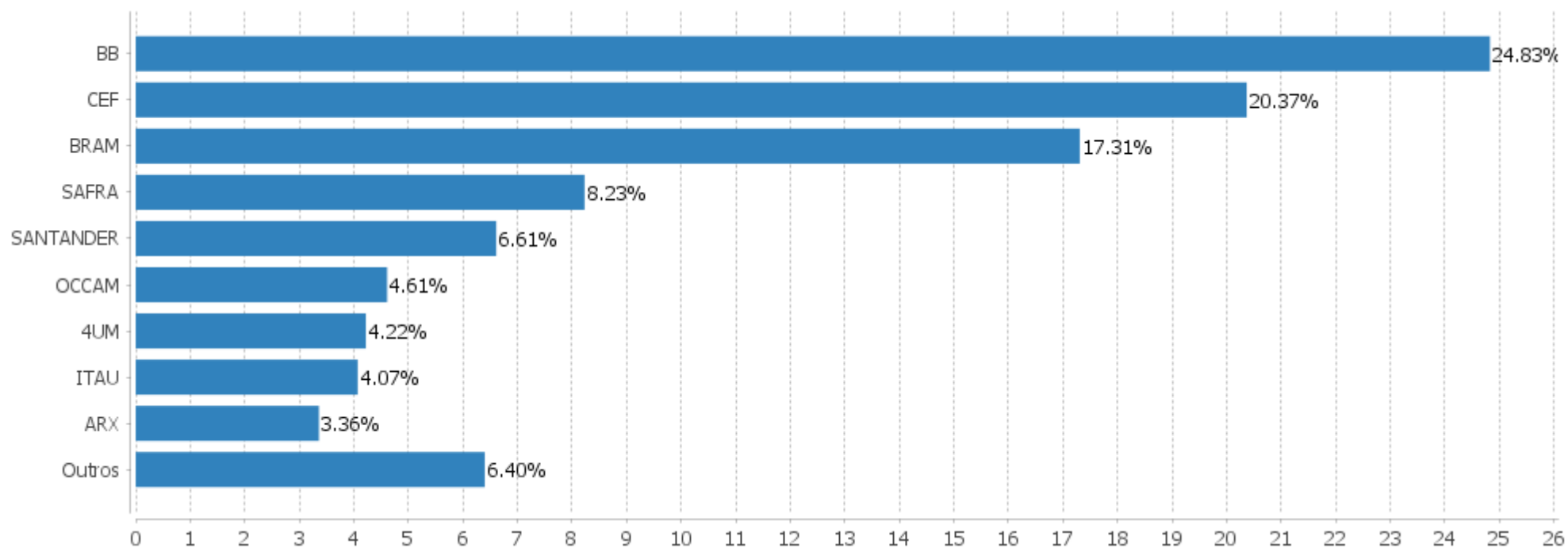


Alocação Por Estratégia



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	1,42	0,34	-0,85						0,10
INPC + 5,86%	0,72	1,23	1,39	0,83	1,44	1,08	1,52						8,51
p.p. indexador	-1,67	-2,50	-0,86	0,08	-0,02	-0,74	-2,37						-8,41
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

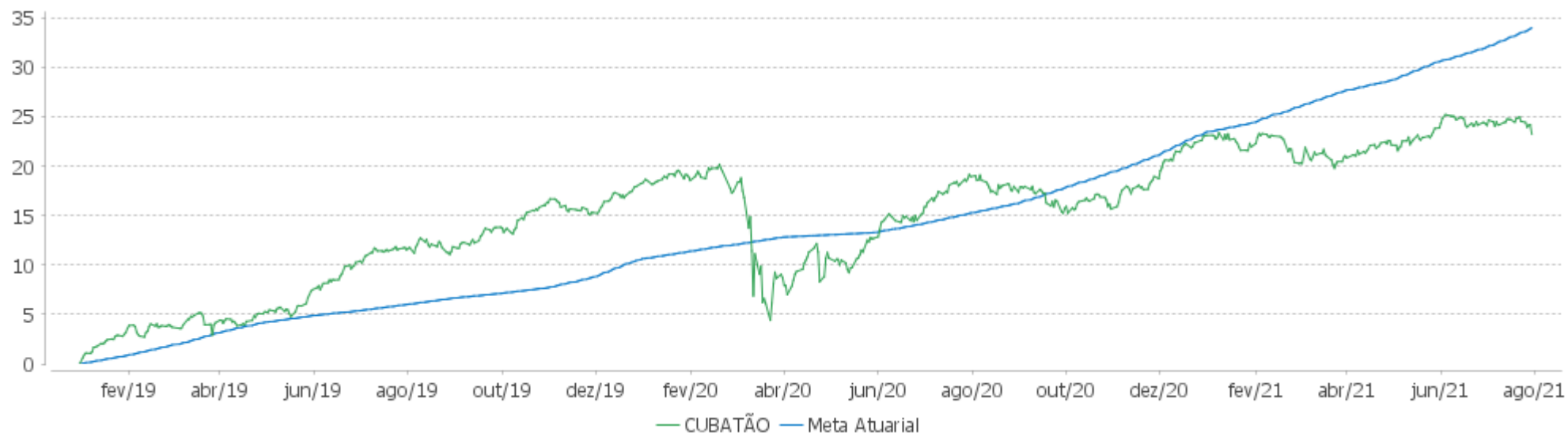
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

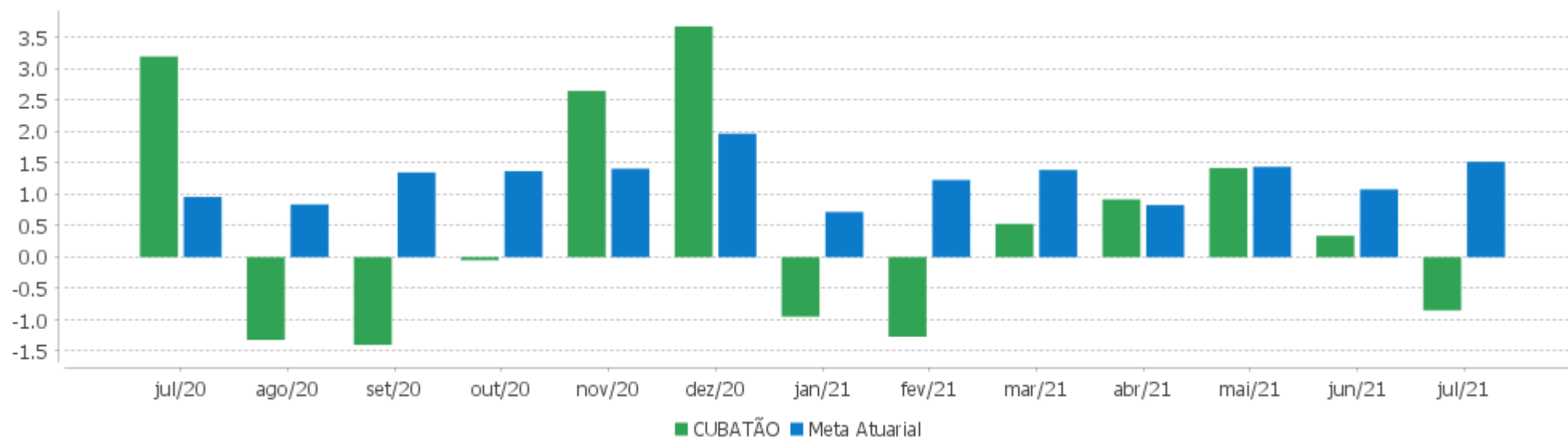
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	14	45,16	03 meses	0,89	4,10	-3,20	4,19
Meses abaixo - Meta Atuarial	17	54,84	06 meses	1,06	7,73	-6,67	4,64
			12 meses	3,60	16,24	-12,64	4,84
			24 meses	10,47	26,46	-16,00	8,24
Maior rentabilidade da Carteira	3,68	2020-12	Desde 31/12/2018	23,22	34,15	-10,93	7,51
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
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,40 -0,03	-1,23 -0,14	1,04 -0,06	-0,36 -0,12	2,28 -0,24	10,19 -0,70	40,21 -1,14
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,39 -0,02	-1,23 -0,14	1,04 -0,06	-0,36 -0,11	2,24 -0,28	10,32 -0,57	39,96 -1,39
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,19 0,00	0,81 -0,19	0,59 -0,01	0,78 -0,18	1,61 -0,37	6,90 -0,70	14,40 -1,04
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,16 -0,02	0,82 -0,18	0,52 -0,08	0,79 -0,17	1,58 -0,40	6,89 -0,72	14,43 -1,01
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,61 -0,24	-2,77 -1,68	1,09 -0,01	-1,09 -0,85	0,19 -2,33	10,13 -0,76	43,12 1,77
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,38 -0,01	-1,20 -0,11	1,05 -0,06	-0,34 -0,09	2,27 -0,25	10,39 -0,50	40,32 -1,03
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,17 -0,02	0,86 -0,14	0,53 -0,07	0,84 -0,12	1,75 -0,24	7,14 -0,46	14,76 -0,69
BTG PACTUAL TESOUREO IPCA GERAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,40 -0,02	-1,30 -0,21	0,99 -0,12	-0,42 -0,18	2,24 -0,29	10,31 -0,58	39,99 -1,36
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,13 -0,03	-0,58 -0,62	0,63 -0,24	-0,12 -0,40	0,89 -0,78	7,81 -1,31	23,87 -2,05
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,40 -0,03	-1,31 -0,22	1,02 -0,09	-0,43 -0,18	2,17 -0,35	10,13 -0,76	39,87 -1,48
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,17 -0,02	0,77 -0,24	0,51 -0,09	0,73 -0,23	1,41 -0,58	6,48 -1,12	13,84 -1,60
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,39 -0,01	-1,21 -0,12	1,11 0,00	-0,33 -0,09	2,25 -0,27	10,23 -0,66	40,05 -1,29
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP % do CDI	-0,44 -122,42	0,77 47,02	0,13 13,60	0,71 48,06	4,19 171,50	12,92 191,13	25,04 184,99
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,44 -0,07	-1,80 -0,71	0,99 -0,11	-0,79 -0,54	1,64 -0,88	9,99 -0,90	40,23 -1,12
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,39 108,98	1,84 112,31	1,04 110,99	1,68 113,15	2,55 104,37	6,22 92,08	12,88 95,19
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,39 -0,01	-1,21 -0,12	1,07 -0,04	-0,36 -0,11	2,22 -0,31	10,14 -0,75	39,94 -1,41
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,38	1,89	1,07	1,71	2,83	6,19	12,92

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	107,45	115,57	114,65	114,78	115,76	91,55	95,46
BRANCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	-0,29	-0,34	0,67	-0,09	1,53	9,15	26,12
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,19	-0,37	-0,20	-0,37	-0,15	0,02	0,21
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	0,44	2,32	1,29	2,12	3,61	6,52	13,25
% do CDI	124,68	141,69	137,75	142,55	148,05	96,48	97,88
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	-94,34	-98,25
% do CDI	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	-1.395,82	-725,96
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	-3,63	-0,71	1,29	2,86	13,11	13,63	46,34
Var. IBOVESPA p.p.	0,31	-3,05	-1,15	-3,00	-5,24	-6,01	-7,41
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	-4,97	3,31	0,72	6,61			
Var. IBOVESPA p.p.	-1,03	0,97	-1,73	0,76			
4UM SMALL CAPS FIA	-6,76	4,23	0,34	7,14	10,49	30,96	94,66
Var. IBOVESPA p.p.	-2,82	1,89	-2,11	1,29	-7,87	11,33	40,91
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	-2,49	10,01	5,74	10,47	23,25	45,27	
Var. IBOVESPA p.p.	1,45	7,67	3,29	4,62	4,90	25,64	
ITAU INDEX IBOVESPA 1	-3,98	1,99	2,30	5,56	17,63	18,16	35,50
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	1,24	4,07	0,71	6,36	14,68	2,71	-23,48
OCCAM FIC FIA	-4,12	0,31	-0,40	3,55	13,55	21,51	66,10
Var. IBOVESPA p.p.	-0,17	-2,03	-2,85	-2,30	-4,80	1,88	12,35
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	-4,91	-1,81	-0,54	2,20	6,58	1,88	53,04
Var. IBOVESPA p.p.	-0,97	-4,15	-2,99	-3,66	-11,78	-17,76	-0,71
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	-1,25	5,40	3,83	8,49	16,54	18,27	46,28
Var. IBOVESPA p.p.	2,70	3,06	1,38	2,63	-1,81	-1,36	-7,47
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	2,58	18,78	5,78	18,99	34,57	46,45	60,37
Var. IBOVESPA p.p.	6,53	16,44	3,34	13,14	16,22	26,82	6,63
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	2,24	-11,84	-6,53	-11,35	-3,36	-11,86	15,71
Var. IBOVESPA p.p.	6,18	-14,18	-8,98	-17,21	-21,71	-31,50	-38,04
CUBATÃO	-0,85	0,10	0,89	1,06	3,60	10,47	
Var. INPC + 5,86% p.p.	-2,37	-8,41	-3,20	-6,67	-12,64	-15,93	
CDI	0,36	1,64	0,94	1,49	2,44	6,76	13,53
IBOVESPA	-3,94	2,34	2,44	5,85	18,35	19,63	53,75
INPC + 6,00%	1,54	8,59	4,13	7,80	16,39	26,73	38,51
IPCA + 6,00%	1,47	8,33	3,86	7,56	15,48	25,26	36,99

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	0,19	1,00	0,60	0,96	1,99	7,60	15,44	23,97	40,68
IRF-M 1+	-0,83	-4,11	-0,42	-2,76	-3,34	8,28	28,38	38,97	66,27
IRF-M TOTAL	-0,47	-2,04	-0,06	-1,25	-1,40	8,27	24,82	34,87	59,02
IMA-B 5	0,03	1,31	0,59	1,21	5,06	14,34	30,43	41,23	60,61
IMA-B 5+	-0,76	-3,29	1,44	-1,63	0,34	8,18	49,88	56,72	81,63
IMA-B TOTAL	-0,37	-1,09	1,10	-0,24	2,53	10,89	41,35	50,46	72,98
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,10	-0,44	0,72	-0,00	0,96	8,10	24,45	33,52	54,06
IMA-GERAL TOTAL	-0,10	0,04	0,87	0,28	1,67	9,12	25,92	35,34	55,62
IDKA 2	-0,18	1,68	0,38	1,54	5,88	15,07	29,57	41,20	61,95
IDKA 20	-1,44	-5,02	1,98	-2,27	-1,21	3,68	67,33	69,21	99,56
CDI	0,36	1,64	0,94	1,49	2,44	6,76	13,53	21,57	36,78

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,94	2,34	2,44	5,85	18,35	19,63	53,75	84,77	112,54
IBRX 100	-3,99	4,47	2,33	7,73	20,73	23,34	61,40	92,00	121,47
IBRX 50	-3,85	4,91	2,77	7,91	22,23	22,51	54,85	86,08	113,55
SMALL CAP	-5,80	4,96	1,45	8,69	20,13	29,57	86,53	106,58	160,32
IFIX	2,51	-1,60	-1,29	-1,92	3,33	6,19	31,08	36,68	62,68
Índice Consumo - ICON	-5,22	-2,08	1,59	-0,81	2,95	15,45	58,99	62,68	71,63
Índice Dividendos - IDIV	-1,72	0,31	1,58	5,67	14,21	18,21	67,31	86,37	136,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,96	4,76	2,34	4,50	8,99	11,51	15,10	20,26	23,52
INPC	1,02	5,01	2,60	4,73	9,85	12,81	16,38	20,58	23,08
IGPM	0,78	15,98	5,54	13,06	33,83	46,23	55,58	68,40	65,60
SELIC	0,36	1,64	0,94	1,49	2,44	6,76	13,54	21,59	36,81

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	4,72	15,33	-0,37	10,68	32,26	100,62	112,87	191,07	219,74
MSCI ACWI	2,99	10,44	-2,20	5,36	29,16	87,89	90,03	148,07	175,22
MSCI World	4,15	12,45	-1,01	7,85	31,07	90,86	94,44	156,03	181,87

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,31	7,15	3,36	6,55	13,32	20,59	29,41	40,58	50,15
IPCA + 5,00%	1,39	7,74	3,61	7,06	14,40	22,91	33,17	46,04	57,47
IPCA + 5,50%	1,43	8,04	3,74	7,31	14,94	24,08	35,07	48,83	61,23
IPCA + 5,89%	1,47	8,27	3,84	7,51	15,36	25,00	36,57	51,03	64,22
IPCA + 6,00%	1,47	8,33	3,86	7,56	15,48	25,26	36,99	51,65	65,07
INPC + 4,00%	1,37	7,41	3,63	6,79	14,21	22,00	30,85	40,95	49,61
INPC + 6,00%	1,54	8,59	4,13	7,80	16,39	26,73	38,51	52,05	64,49

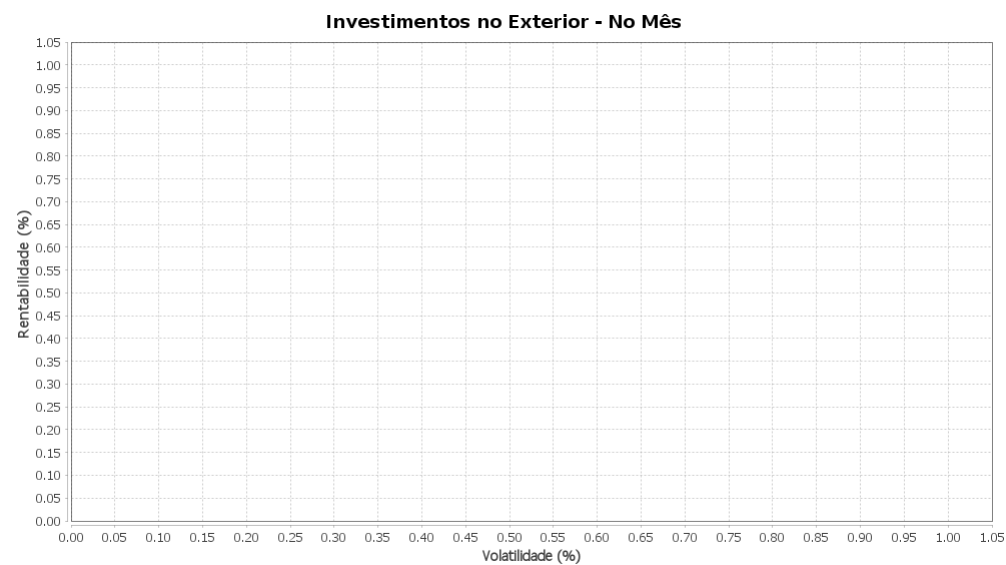
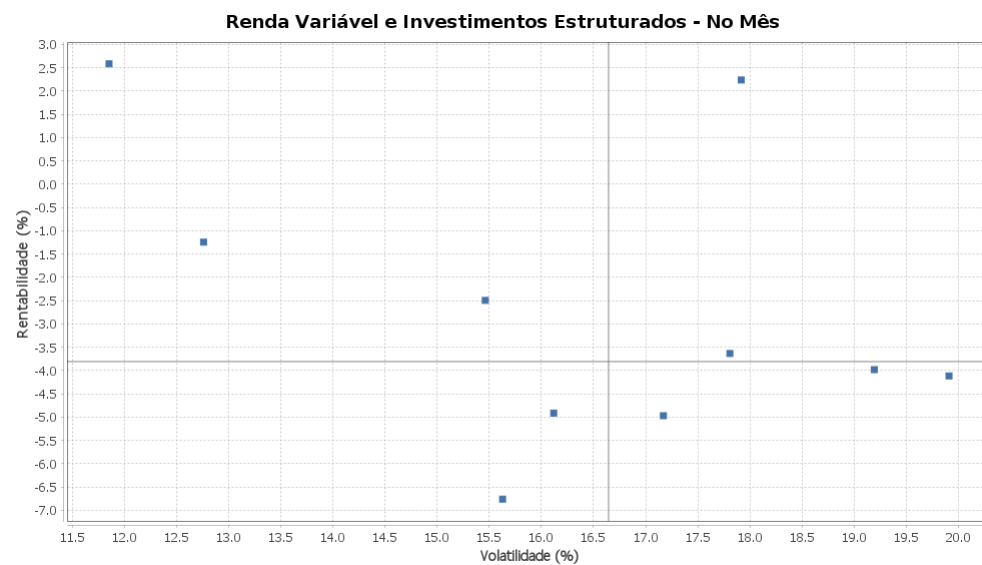
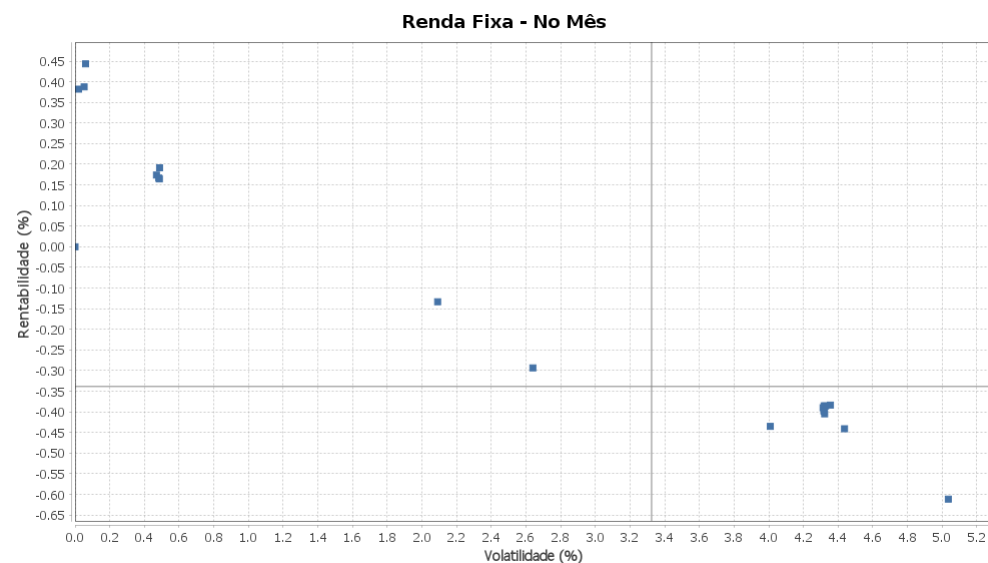
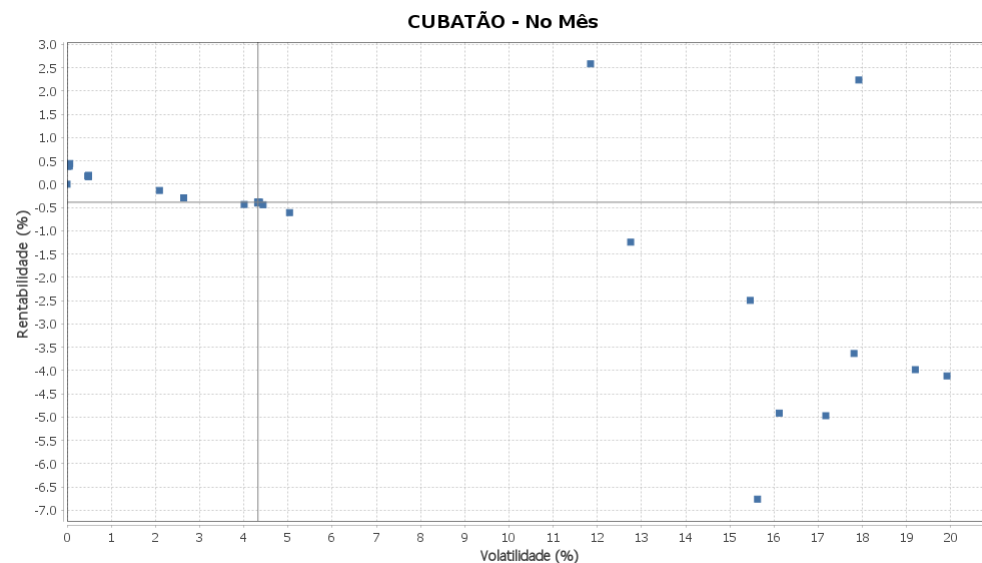
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 16.676.688,03

Value-At-Risk: 1,93%

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	0,02	0,03	-0,00	1,31	0,38	48.532.290,74	5,63
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,03	-0,00	0,61	0,39	13.461.334,40	1,56
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,06	0,06	0,00	1,45	0,44	8.414.524,55	0,98
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,47	0,17	0,00	-0,39	0,17	17.131,61	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,48	0,17	0,01	-0,39	0,17	44.609.088,57	5,17
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,49	0,17	0,02	-0,39	0,16	142.603.655,35	16,54
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,49	0,16	0,00	-0,34	0,19	1.036.533,99	0,12
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,09	1,06	0,02	-0,23	-0,13	15.962.952,02	1,85
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	2,64	1,28	0,08	-0,25	-0,29	68.733.232,76	7,97
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	Artigo 7º IV, Alínea a	4,01	1,55	0,03	-0,20	-0,44	18.037.239,20	2,09
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	4,31	2,38	0,07	-0,17	-0,39	29.293.598,38	3,40
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,32	2,41	0,05	-0,17	-0,40	20.923.799,82	2,43
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,32	2,40	0,15	-0,17	-0,40	63.163.065,82	7,33
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	4,32	2,38	0,08	-0,17	-0,39	33.810.855,97	3,92
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TÍTULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	4,32	2,38	0,08	-0,18	-0,40	32.407.975,85	3,76
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	4,33	2,39	0,09	-0,17	-0,39	40.358.349,35	4,68
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,36	2,32	0,07	-0,17	-0,38	31.087.128,69	3,61
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	4,44	2,53	0,08	-0,18	-0,44	33.599.666,03	3,90
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	5,04	2,65	0,16	-0,19	-0,61	60.193.301,91	6,98
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	11,85	6,25	0,02	0,19	2,58	5.576.369,57	0,65
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,75	7,24	0,12	-0,13	-1,25	20.998.689,97	2,44
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,46	6,53	0,03	-0,18	-2,49	5.148.041,82	0,60
4UM SMALL CAPS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,63	6,44	0,07	-0,46	-6,76	15.341.406,93	1,78
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	16,12	6,71	0,06	-0,33	-4,91	9.892.600,56	1,15
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	17,17	6,85	0,19	-0,31	-4,97	28.983.204,99	3,36
GERAÇÃO FI EM AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	17,81	6,53	0,14	-0,22	-3,63	22.353.543,34	2,59
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	Artigo 8º IV, Alínea b	17,92	6,28	0,00	0,10	2,24	1.989.750,00	0,23

Carteira: CUBATÃO

Data Extrato: 30/07/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INDEX IBOVESPA 1	Artigo 8º II, Alínea a	19,20	7,06	0,04	-0,23	-3,98	5.799.915,81	0,67
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	19,91	7,63	0,29	-0,22	-4,12	39.741.449,10	4,61