



LDB
EMPRESAS

PORTO FERREIRA
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 23.02.2021.

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 82,20%

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	6,16	-0,80	-0,80	4.746.386,44	2,69	8.385.200.938,98	0,06
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,85	-0,86	-0,86	5.092.828,25	2,89	8.335.200.025,45	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,90	-0,87	-0,87	12.008.168,24	6,82	6.185.705.380,20	0,19
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,56	0,03	0,03	6.546.143,18	3,72	10.435.150.283,00	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,06	0,08	0,08	12.204.847,94	6,93	13.518.203.391,91	0,09
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,24	0,18	0,18	7.978.329,29	4,53	9.200.599.633,08	0,09
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,86	-1,70	-1,70	4.204.520,68	2,39	1.607.704.843,41	0,26
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	5,09	0,08	0,08	1.586.392,97	0,90	1.322.067.161,73	0,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,97	-1,70	-1,70	7.824.631,49	4,44	1.699.071.109,60	0,46
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,18	0,13	0,13	7.995.275,06	4,54	10.852.113.121,11	0,07
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,33	-0,55	-0,55	7.101.206,77	4,03	9.495.985.226,13	0,07
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	0,03	0,03	18.308.357,29	10,39	14.822.912.413,17	0,12
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			8,11	-0,41	-0,41	95.597.087,60	54,26		

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	14.310.693,38	8,12	2.989.640.382,47	0,48
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,82	-0,88	-0,88	14.310.693,38	8,12		

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
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,50	0,20	0,20	24.164.859,02	13,72	4.253.317.532,07	0,57
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,22	0,16	0,17	5.210,19	0,00	2.962.335.860,83	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GRAPHEN	ORLA	LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	19,76	-0,28	-0,28	4.592.383,65	2,61	70.801.203,92	6,49
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			3,25	0,12	0,12	28.762.452,86	16,33		
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
RJI	RJI	INCENTIVO MULTISSETORIAL I FIDC SÉRIE B	1.037,97	0,00	0,00	0,00	0,00	861.375,60	0,00
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	2,88	0,03	0,03	1.222.984,04	0,69	72.706.030,51	1,68
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			56,60	0,03	0,03	1.222.984,04	0,69		
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
BRPP	INTRADER	PIATÁ FI RF LONGO PRAZO	2,85	0,70	0,70	4.921.920,39	2,79	109.528.266,68	4,49
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			2,85	0,70	0,70	4.921.920,39	2,79		
Renda Fixa			6,35	-0,32	-0,32	144.815.138,27	82,20		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

17,80%

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	45,64	-2,82	-2,82	4.102.634,45	2,33	1.218.203.539,76	0,34
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			45,64	-2,82	-2,82	4.102.634,45	2,33		

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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	43,97	-3,06	-3,06	2.900.744,49	1,65	502.570.935,25	0,58
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	44,62	-2,48	-2,48	4.625.813,59	2,63	781.607.838,45	0,59
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	42,34	-4,28	-4,28	3.661.318,36	2,08	1.728.171.065,55	0,21
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	44,46	-2,67	-2,67	1.444.608,12	0,82	2.134.082.790,72	0,07
XP	XP	XP INVESTOR FI DE ACOES	49,91	-4,48	-4,48	7.259.153,12	4,12	361.162.198,09	2,01
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	44,05	-3,64	-3,64	4.929.157,76	2,80	460.698.573,61	1,07
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			45,00	-3,65	-3,65	24.820.795,44	14,09		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GRAPHEN	ORLA	LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	0,67	-0,38	-0,38	19.698,85	0,01	1.624.772,25	1,21
Sub-total Artigo 8º III			0,67	-0,38	-0,38	19.698,85	0,01		

Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRPP	BNY MELLON	GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	245,77	-0,46	-0,46	130.204,08	0,07	8.008.142,29	1,63
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			245,77	-0,46	-0,46	130.204,08	0,07		

Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RJI	RJI	HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	2,33	-0,46	-0,46	2.290.231,18	1,30	71.761.520,85	3,19
		Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b	2,33	-0,46	-0,46	2.290.231,18	1,30		
		Renda Variável e Investimentos Estruturados	39,30	-3,30	-3,30	31.363.564,00	17,80		
		Total	10,85	-0,87	-0,87	176.178.702,27	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	95.597.087,60	54,26	0,00	42,00	100,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	14.310.693,38	8,12	0,00	10,00	60,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	28.762.452,86	16,33	0,00	14,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	1.222.984,04	0,69	0,00	1,00	5,00	5,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	4.921.920,39	2,79	0,00	3,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	144.815.138,27	82,20				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	4.102.634,45	2,33	0,00	3,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	24.820.795,44	14,09	0,00	18,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	19.698,85	0,01	0,00	3,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	130.204,08	0,07	0,00	1,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	2.290.231,18	1,30	0,00	2,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	31.363.564,00	17,80				30,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades por Artigo

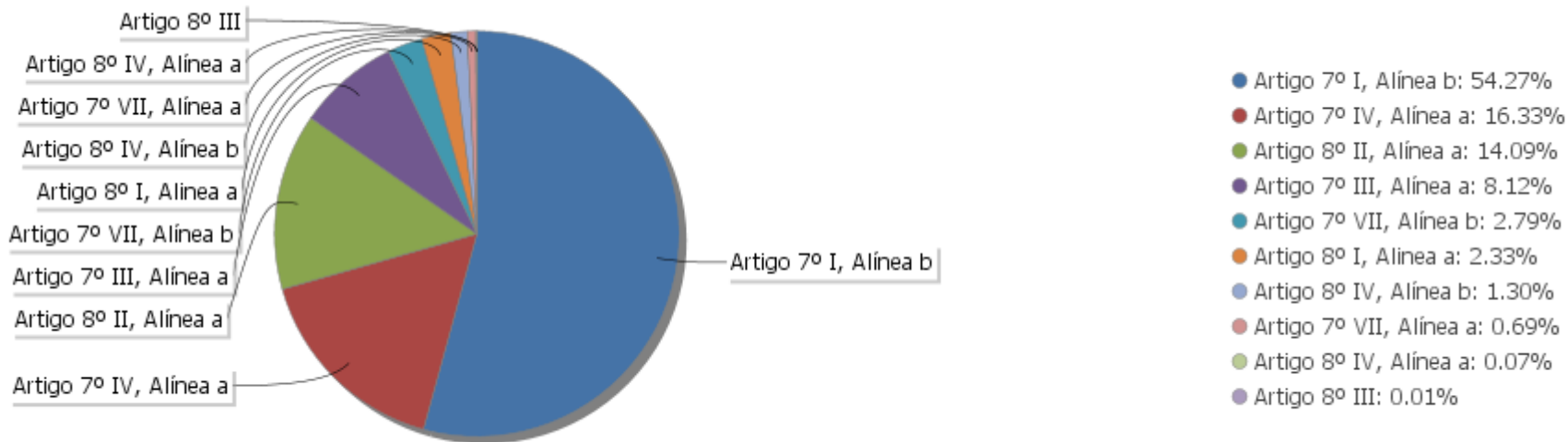
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,41 -273,73	-0,41 -273,73	3,78 814,05	2,21 235,40	4,88 193,25	-392.789,18	-392.789,18
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,88 -589,95	-0,88 -589,95	5,95 1.282,51	2,59 275,53	4,87 193,03	-127.332,27	-127.332,27
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,12 79,70	0,12 79,70	0,67 143,28	0,41 43,22	1,61 63,63	32.834,84	32.834,84
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	0,03 20,77	0,03 20,77	0,82 176,01	73,00 7.757,91	70,16 2.778,42	379,62	379,62
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,70 470,63	0,70 470,63	0,37 79,36	-0,22 -23,75	-1,06 -42,14	34.386,00	34.386,00
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,82 0,50	-2,82 0,50	21,89 -0,59	11,05 -0,77	0,49 -0,66	-119.038,57	-119.038,57
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,65 -0,33	-3,65 -0,33	16,53 -5,95	7,51 -4,31	-7,57 -8,72	-939.094,54	-939.094,54
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,38 2,94	-0,38 2,94	-1,15 -23,63	-2,42 -14,24	-4,07 -5,22	-75,80	-75,80
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,46 2,86	-0,46 2,86	-3,29 -25,76	-4,56 -16,38	-97,02 -98,17	-603,15	-603,15
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-0,46 2,86	-0,46 2,86	-0,33 -22,80	-0,47 -12,28	1,99 0,84	-10.600,48	-10.600,48
PORTO FERREIRA (Total)						-1.521.933,53	-1.521.933,53

Análise de Liquidez

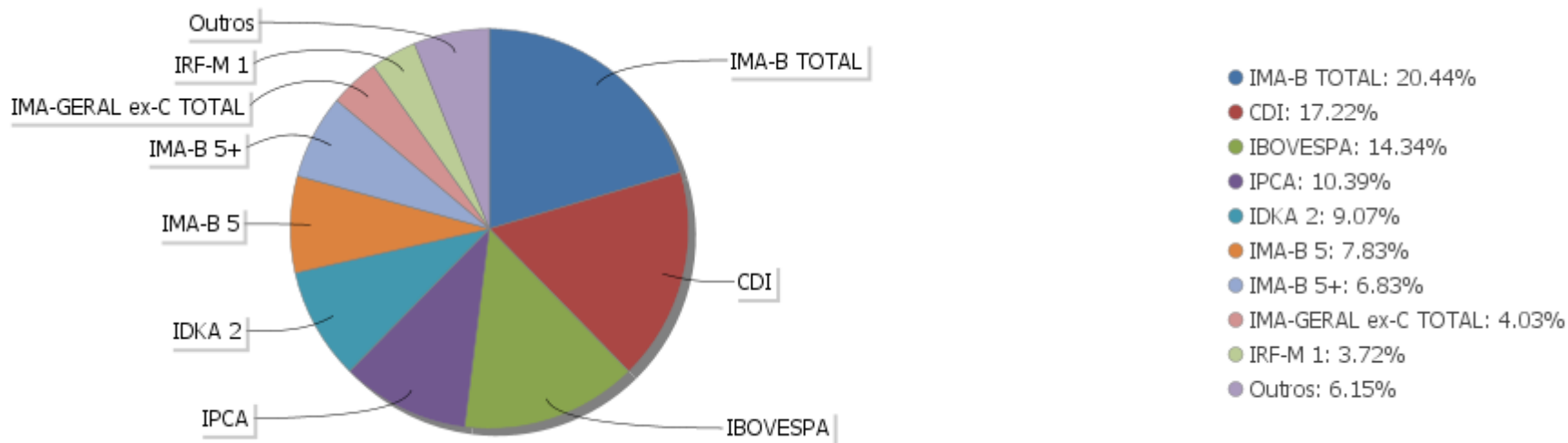
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	165.441.414,19	93,91	165.441.414,19	93,91
de 31 a 365 dias	1.222.984,04	0,69	166.664.398,23	94,60
acima de 365 dias	9.514.304,04	5,40	176.178.702,27	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

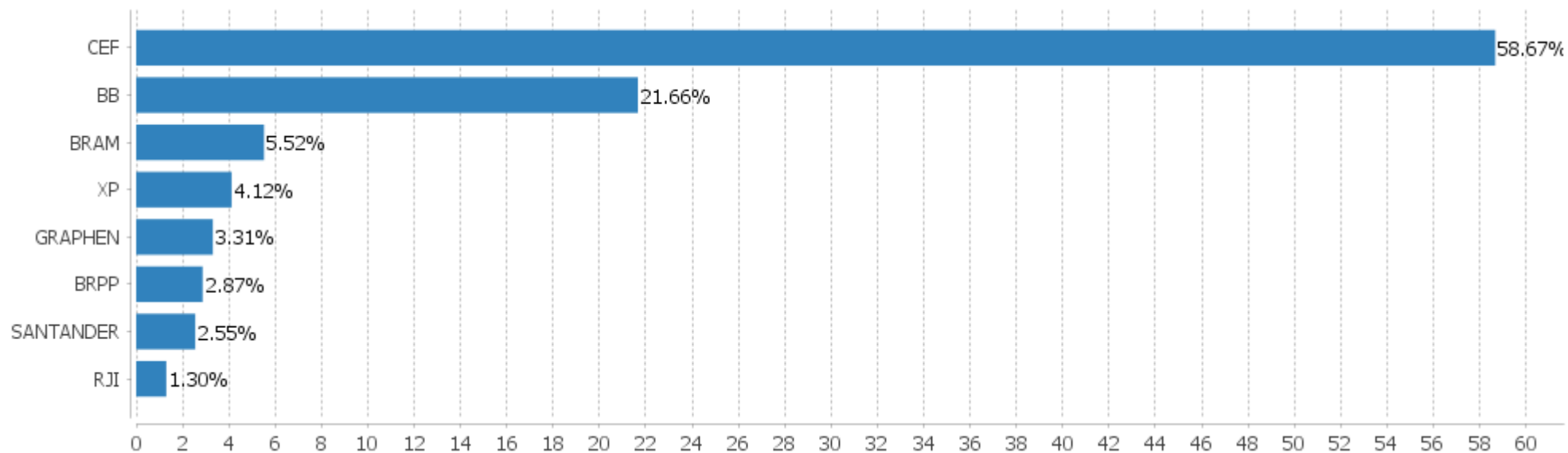


Alocação Por Estratégia



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	-0,87												-0,87
IPCA + 5,41%	0,67												0,67
p.p. indexador	-1,54												-1,54
2020	0,22	-1,14	-7,62	-0,32	1,94	1,77	2,89	0,49	-1,40	-0,10	2,74	3,33	2,34
IPCA + 5,86%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,62
p.p. indexador	-0,49	-1,80	-8,19	-0,46	1,87	1,03	2,01	-0,22	-2,52	-1,44	1,40	1,48	-8,28
2019	3,17	0,13	0,33	0,93	1,68	2,27	1,00	0,16	1,69	1,80	0,46	2,27	17,05
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	2,34	-0,76	-0,87	-0,13	1,04	1,82	0,27	-0,46	1,25	1,17	-0,52	0,63	6,46
2018	2,72	-0,87	0,78	0,37	-2,04	-0,27	2,02	-0,90	0,55	4,00	0,72	0,93	8,16
IPCA + 6,00%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	1,92	-1,61	0,20	-0,34	-2,93	-2,02	1,18	-1,34	-0,37	3,04	0,46	0,31	-1,76

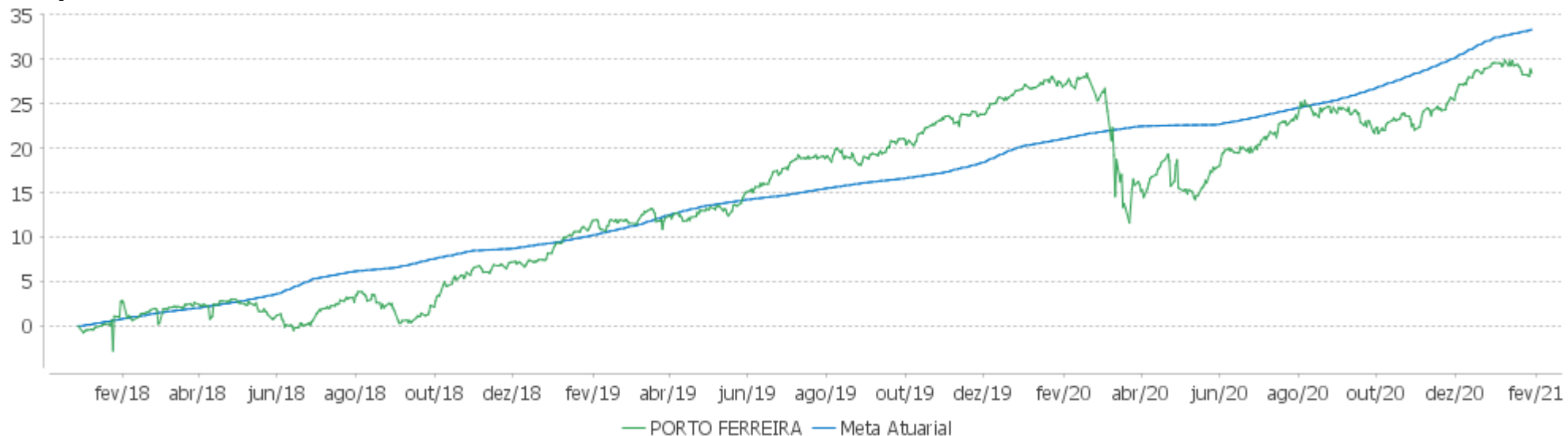
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

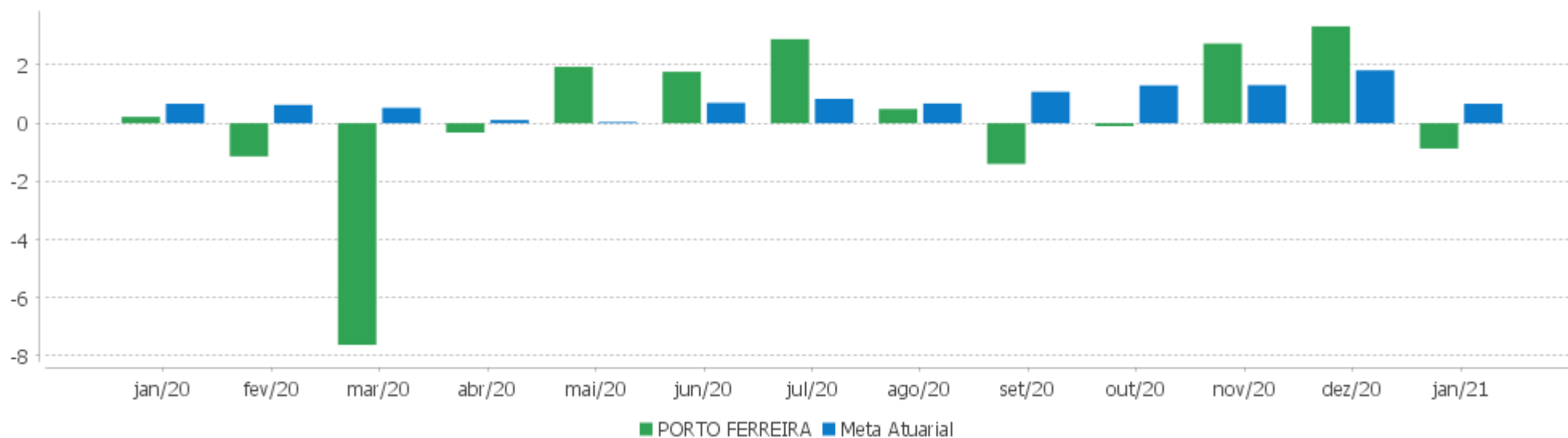
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	18	48,65	03 meses	5,25	3,92	1,33	4,40
Meses abaixo da Meta Atuarial	19	51,35	06 meses	4,17	7,25	-3,08	5,52
			12 meses	1,23	10,57	-9,34	10,85
			24 meses	15,11	22,14	-7,03	8,18
			36 meses	25,04	34,29	-9,25	7,39
Maior rentabilidade da Carteira	4,00	2018-10	Desde 29/12/2017	28,44	35,37	-6,93	7,95
Menor rentabilidade da Carteira	-7,62	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
PIATÃ FI RF LONGO PRAZO % do CDI	0,70 470,63	0,70 470,63	0,37 79,36	-0,22 -23,75	-1,06 -42,14	30,91 365,51	-3,68 -23,97
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
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,08 -0,02	0,08 -0,02	3,22 -0,07	3,67 -0,14	7,34 -0,21	20,01 -0,51	31,87 -0,82
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,08 -0,02	0,08 -0,02	3,22 -0,07	3,64 -0,16	7,25 -0,30	19,86 -0,66	31,74 -0,94
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,18 0,03	0,18 0,03	3,07 -0,09	4,24 -0,05	7,69 -0,51	18,77 -1,35	30,05 -2,43
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,55 -0,11	-0,55 -0,11	2,68 0,29	0,93 -0,03	4,00 0,14	15,84 0,48	27,67 0,72
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,03 -0,22	0,03 -0,22	2,18 -0,33	0,99 -3,31	5,82 1,27	20,75 11,80	32,60 19,54
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,13 -0,01	0,13 -0,01	3,03 -0,13	4,04 -0,24	7,68 -0,52	18,78 -1,35	30,23 -2,26
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,80 0,00	-0,80 0,00	1,50 -0,01	-0,29 -0,14	4,65 -0,26	16,40 -0,55	28,76 -0,85
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
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
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,70 -0,01	-1,70 -0,01	8,45 0,02	1,96 -0,05	3,49 -0,19	25,98 -0,85	47,09 -1,60
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,70 -0,01	-1,70 -0,01	8,29 -0,14	1,74 -0,27	3,23 -0,45	26,02 -0,81	47,40 -1,29
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,88 -0,03	-0,88 -0,03	5,95 -0,09	2,59 -0,18	4,87 -0,35	23,40 -0,89	40,74 -1,09
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,17 110,47	0,17 110,47	0,58 124,04	0,94 100,20	2,21 87,55	7,89 93,26	14,67 95,44
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,20 134,42	0,20 134,42	0,55 118,44	0,63 67,04	2,27 89,78	8,16 96,53	14,80 96,24
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	-0,28	-0,28	1,25	-0,70	-2,74	5,69	-14,85

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.	0,57	0,57	-4,79	-3,47	-7,96	-18,60	-56,68
INCENTIVO MULTISSETORIAL I FIDC SÉRIE B % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	9.940,48 393.636,54	-99,97 -1.182,29	-99,97 -650,28
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	0,03 20,77	0,03 20,77	0,82 176,01	-1,37 -145,88	-4,58 -181,50	-4,70 -55,60	1.092,18 7.104,08
BRADESCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-4,28 0,80	-4,28 0,80	21,53 3,24	8,42 0,34	-7,17 -2,65	3,03 -18,24	21,51 -22,44
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,64 -0,32	-3,64 -0,32	21,73 -0,74	11,61 -0,21	-4,05 -5,20	14,63 -3,52	31,93 -3,59
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-2,48 0,84	-2,48 0,84	13,85 -8,62	13,11 1,30	-4,84 -5,98	13,16 -4,98	33,95 -1,56
XP INVESTOR FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-4,48 -1,16	-4,48 -1,16	12,59 -9,88	1,60 -10,21	-11,58 -12,73	24,86 6,72	52,32 16,81
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-3,06 0,26	-3,06 0,26	17,53 -4,95	8,32 -3,49	-8,34 -9,49	11,24 -6,91	29,43 -6,08
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p.	-2,67 0,65	-2,67 0,65	14,64 -7,84	4,51 -7,31	-6,04 -7,19	27,57 9,42	61,16 25,65
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,46 -1,18	-0,46 -1,18	-3,29 -7,28	-4,56 -11,92	-97,02 -107,77	-97,02 -119,37	-97,00 -131,52
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V % do CDI	-0,38 -256,41	-0,38 -256,41	-1,15 -248,19	-2,42 -257,69	-4,00 -158,58	2,35 27,77	-94,63 -615,53
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	-2,82 0,50	-2,82 0,50	21,89 -0,59	11,05 -0,77	0,49 -0,66	20,53 2,38	39,88 4,37
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO Var. IFIX p.p.	-0,46 -0,78	-0,46 -0,78	-0,33 -4,40	-0,47 -5,82	1,99 8,41	3,27 -16,22	19,17 -6,84
PORTO FERREIRA Var. IPCA + 5,41% p.p.	-0,87 -1,54	-0,87 -1,54	5,25 1,41	4,17 -2,89	1,23 -8,92	15,11 -5,89	25,04 -7,26
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

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,04	0,04	0,58	1,02	3,43	10,27	17,95
IRF-M 1+	-1,39	-1,39	2,09	-0,60	5,77	20,12	35,07
IRF-M TOTAL	-0,80	-0,80	1,50	-0,15	4,92	16,95	29,61
IMA-B 5	0,11	0,11	3,28	3,80	7,55	20,52	32,68
IMA-B 5+	-1,69	-1,69	8,43	2,01	3,68	26,83	48,69
IMA-B TOTAL	-0,85	-0,85	6,04	2,78	5,22	24,29	41,83
IMA-C TOTAL	6,46	6,46	7,31	15,99	26,73	52,15	76,01
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,44	-0,44	2,38	0,96	3,87	15,36	26,95
IMA-GERAL TOTAL	-0,24	-0,24	2,52	1,39	4,50	16,33	28,20
IDKA 2	0,15	0,15	3,16	4,28	8,20	20,12	32,49
IDKA 20	-2,81	-2,81	11,88	1,09	0,71	29,02	58,93
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,37
Renda Variável							
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
IBRX 100	-3,03	-3,03	22,21	12,06	1,64	20,92	39,53
IBRX 50	-2,78	-2,78	23,61	13,27	2,67	17,81	33,39
SMALL CAP	-3,43	-3,43	21,10	10,52	-4,50	38,71	57,28
IFIX	0,32	0,32	4,07	5,35	-6,43	19,49	26,00
Índice Consumo - ICON			12,91	3,78	-3,99	37,57	37,84
Índice Dividendos - IDIV	-5,08	-5,08	18,30	8,08	-4,52	21,27	43,95
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,25	0,25	2,51	4,30	4,56	8,94	13,06
INPC	0,27	0,27	2,70	4,89	5,53	10,07	14,00
IGPM	2,58	2,58	6,95	18,36	25,71	35,53	44,66
SELIC	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,38
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

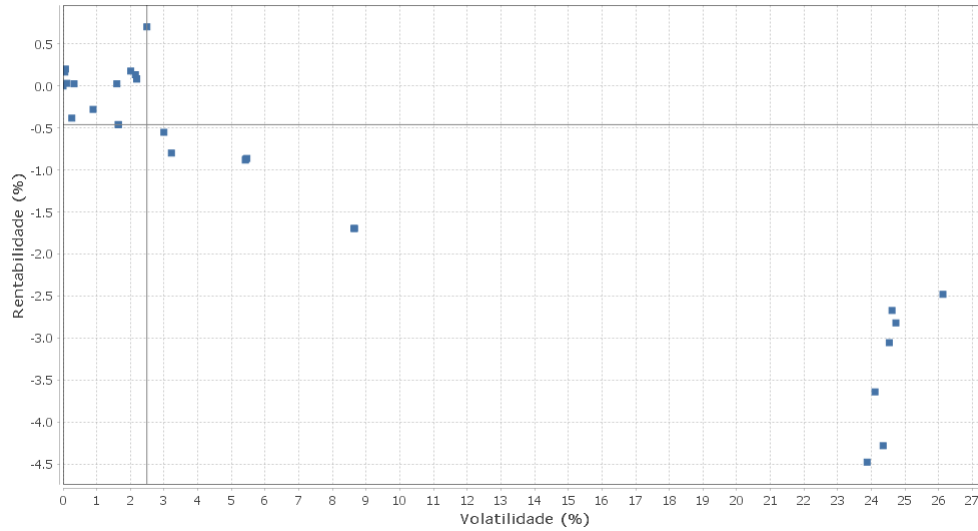
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	26/01/2021	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.489.000,00	0,00	367.018,78943900	4,0570130000
2	27/01/2021	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	53.000,00	0,00	13.062,92583900	4,0572840000
3	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	46.000,00	0,00	11.335,25342600	4,0581360000
Total						

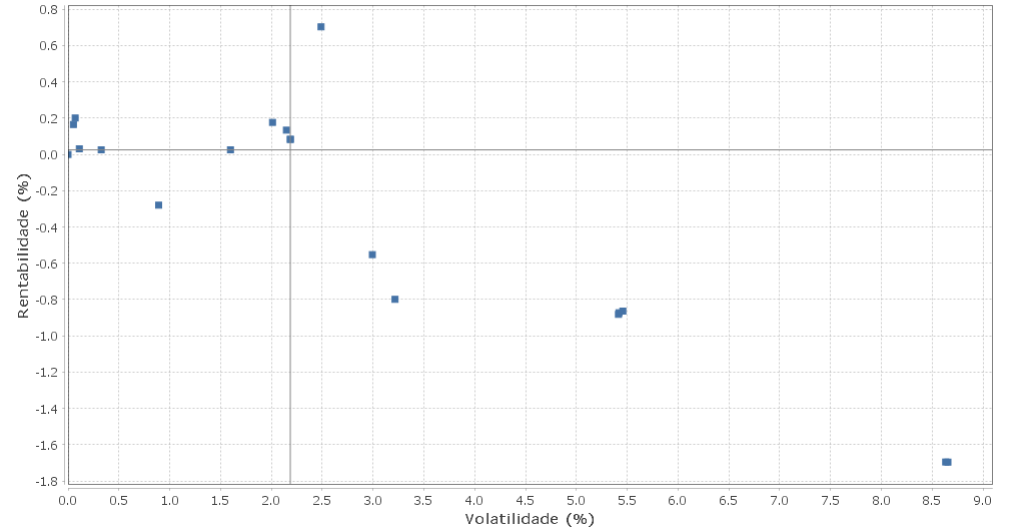
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

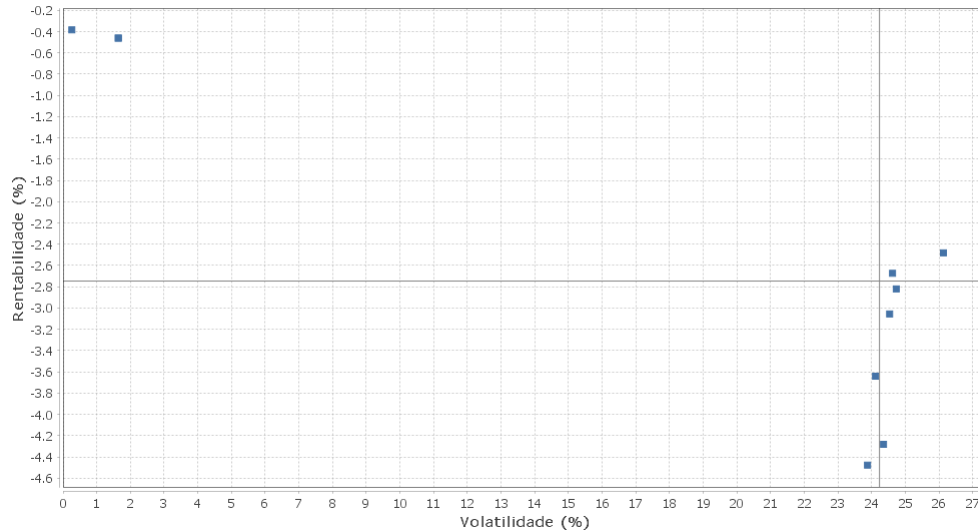
PORTO FERREIRA - No Mês



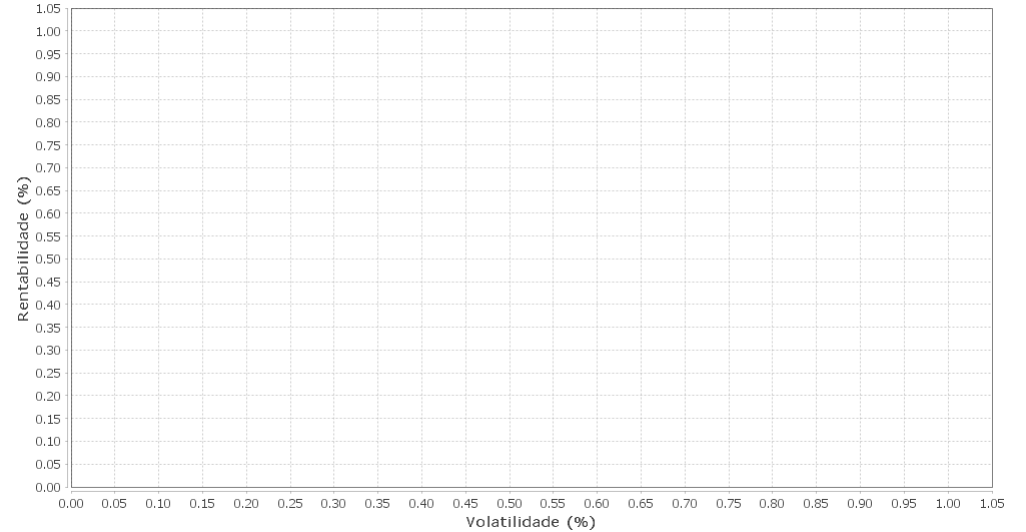
Renda Fixa - No Mês



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\$): 4.433.011,27

Value-At-Risk: 2,52%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
INCENTIVO MULTISSETORIAL I FIDC SÉRIE B	Artigo 7º VII, Alínea a	0,00	NaN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,09	0,00	0,29	0,17	5.210,19	0,00
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,18	0,00	0,74	0,20	24.164.859,02	13,72
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	Artigo 7º VII, Alínea a	0,11	0,05	-0,00	-1,07	0,03	1.222.984,04	0,69
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	Artigo 8º III	0,26	0,04	0,00	-2,04	-0,38	19.698,85	0,01
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,15	0,00	-0,38	0,03	6.546.143,18	3,72
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	Artigo 7º IV, Alínea a	0,89	1,00	0,02	-0,48	-0,28	4.592.383,65	2,61
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,60	1,03	0,08	-0,08	0,03	18.308.357,29	10,39
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Artigo 8º IV, Alínea b	1,64	0,02	0,00	-0,37	-0,46	2.290.231,18	1,30
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	Artigo 8º IV, Alínea a	1,64	0,19	0,00	-0,37	-0,46	130.204,08	0,07
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,08	0,03	0,01	0,18	7.978.329,29	4,53
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,15	1,17	0,04	-0,01	0,13	7.995.275,06	4,54
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	1,23	0,01	-0,03	0,08	1.586.392,97	0,90
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	1,23	0,06	-0,03	0,08	12.204.847,94	6,93
PIATÁ FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	2,49	0,00	-0,00	0,22	0,70	4.921.920,39	2,79
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,99	1,33	0,04	-0,23	-0,55	7.101.206,77	4,03
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,22	1,48	0,03	-0,29	-0,80	4.746.386,44	2,69
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	5,41	2,56	0,17	-0,19	-0,88	14.310.693,38	8,12
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,42	2,57	0,14	-0,19	-0,87	12.008.168,24	6,82
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,46	2,56	0,06	-0,19	-0,86	5.092.828,25	2,89
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	8,63	4,24	0,08	-0,21	-1,70	4.204.520,68	2,39
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	8,65	4,24	0,15	-0,21	-1,70	7.824.631,49	4,44
XP INVESTOR FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	23,87	10,69	0,40	-0,19	-4,48	7.259.153,12	4,12
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,11	10,79	0,27	-0,16	-3,64	4.929.157,76	2,80
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	24,35	11,28	0,21	-0,18	-4,28	3.661.318,36	2,08
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	24,53	11,42	0,17	-0,13	-3,06	2.900.744,49	1,65
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	24,61	10,39	0,07	-0,11	-2,67	1.444.608,12	0,82
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	24,73	11,58	0,24	-0,12	-2,82	4.102.634,45	2,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRABESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	26,13	11,48	0,24	-0,10	-2,48	4.625.813,59	2,63