



CARAGUATATUBA
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

79,13%

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	16.368.899,06	3,08	8.385.200.938,98	0,20
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,57	0,06	0,06	22.462.500,26	4,22	237.534.424,77	9,46
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,79	-0,88	-0,88	16.843.315,03	3,17	403.585.829,79	4,17
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,58	0,03	0,03	4.595.876,69	0,86	8.572.331.669,58	0,05
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,85	-0,86	-0,86	16.448.177,40	3,09	8.335.200.025,45	0,20
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,90	-0,87	-0,87	45.838.625,11	8,62	6.185.705.380,20	0,74
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,86	-1,70	-1,70	26.114.582,50	4,91	1.607.704.843,41	1,62
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	12,89	-0,88	-0,88	4.501.387,07	0,85	1.222.496.391,55	0,37
ITAU	ITAU	ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	19,80	-1,70	-1,70	4.428.401,01	0,83	104.924.089,00	4,22
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,97	-1,70	-1,70	54.881.692,27	10,32	1.699.071.109,60	3,23
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	9,18	-1,39	-1,39	34.029.609,38	6,40	2.764.051.643,34	1,23
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,18	0,13	0,13	16.224.972,27	3,05	10.852.113.121,11	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,14	-0,77	-0,77	4.960.078,31	0,93	2.465.176.454,79	0,20
BB	BB	BB PREV RF VII	2,45	0,29	0,29	475.459,82	0,09	246.568.875,27	0,19
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	0,03	0,03	51.954.332,93	9,77	14.822.912.413,17	0,35
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			9,93	-0,89	-0,89	320.127.909,11	60,20		

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
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,23	0,13	0,13	6.592.365,10	1,24	923.966.338,05	0,71
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	14,66	-1,05	-1,05	41.243.343,65	7,76	641.898.631,44	6,43
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,37	0,16	0,16	799.824,32	0,15	5.006.506.249,23	0,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,67	0,13	0,13	50.590.063,08	9,51	3.621.561.522,63	1,40
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			6,48	-0,36	-0,36	99.225.596,15	18,66		

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
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	241,50	0,07	0,07	1.417.673,86	0,27	56.027.774,26	2,53
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			241,50	0,07	0,07	1.417.673,86	0,27		

Renda Fixa			9,06	-0,76	-0,76	420.771.179,12	79,13		
-------------------	--	--	-------------	--------------	--------------	-----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

18,17%

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	24.845.240,34	4,67	1.218.203.539,76	2,04
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			45,64	-2,82	-2,82	24.845.240,34	4,67		

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
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	44,62	-2,48	-2,48	5.859.143,66	1,10	781.607.838,45	0,75
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	39,53	-4,39	-4,39	1.527.787,22	0,29	998.958.997,80	0,15
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	44,46	-2,67	-2,67	6.544.037,28	1,23	2.134.082.790,72	0,31
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	44,91	-2,34	-2,34	16.381.068,96	3,08	945.642.826,43	1,73
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	42,37	-3,14	-3,14	7.726.680,22	1,45	744.259.231,51	1,04
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	40,22	-3,76	-3,76	13.361.038,32	2,51	968.458.637,18	1,38
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	43,04	-2,04	-2,04	12.146.240,43	2,28	2.190.224.065,15	0,55
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	44,50	-1,46	-1,46	6.232.634,72	1,17	3.479.599.111,95	0,18
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			42,32	-2,66	-2,66	69.778.630,81	13,12		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	33,67	-0,18	-0,18	2.015.744,80	0,38	2.016.215.141,87	0,10
Sub-total Artigo 8º III			33,67	-0,18	-0,18	2.015.744,80	0,38		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			43,12	-2,65	-2,65	96.639.615,95	18,17		
--	--	--	--------------	--------------	--------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,70%

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	30,33	5,79	5,79	14.365.674,01	2,70	2.159.778.426,35	0,67
Sub-total Artigo 9º A, III			30,33	5,79	5,79	14.365.674,01	2,70		
Investimentos no Exterior			22,87	5,79	5,79	14.365.674,01	2,70		
Total			13,16	-0,94	-0,94	531.776.469,08	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos			
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	320.127.909,11	60,20	20,00	40,00	80,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	99.225.596,15	18,66	10,00	19,50	35,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	1.417.673,86	0,27	0,00	0,50	1,00	5,00
	Total Renda Fixa	420.771.179,12	79,13				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	24.845.240,34	4,67	0,00	5,00	5,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	69.778.630,81	13,12	5,00	15,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	2.015.744,80	0,38	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	96.639.615,95	18,17				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	14.365.674,01	2,70	0,00	5,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	14.365.674,01	2,70				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

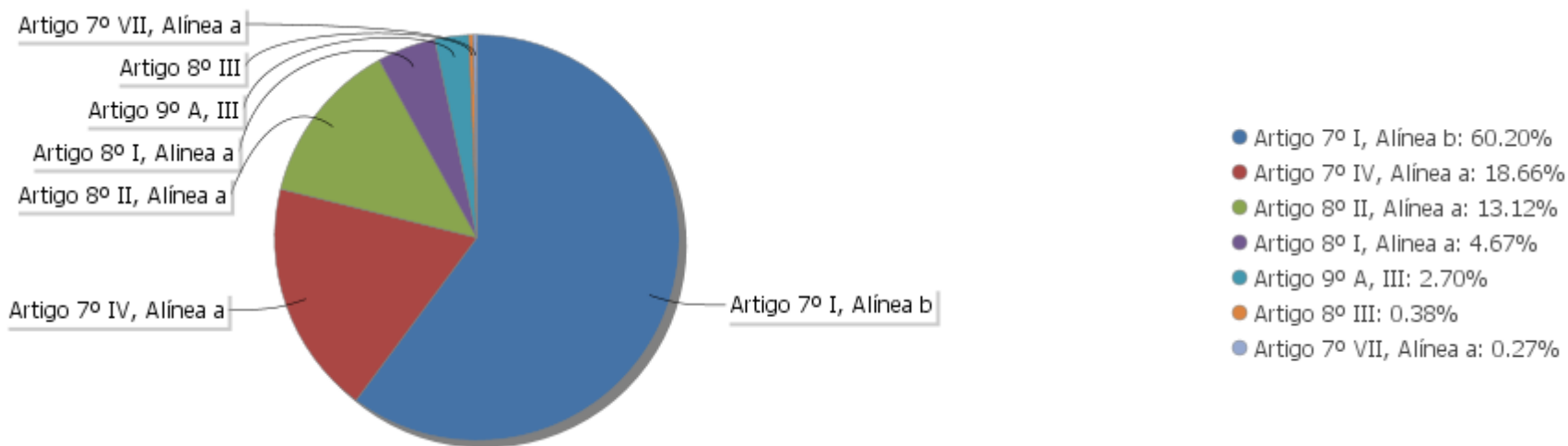
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,89 -597,60	-0,89 -597,60	4,72 1.017,67	1,88 199,53	4,24 167,79	-2.809.240,24	-2.809.240,24
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,36 -242,80	-0,36 -242,80	2,74 589,91	1,09 115,51	3,91 154,79	-362.005,66	-362.005,66
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	0,07 48,60	0,07 48,60	0,09 20,30	1.277,26 135.744,22	1.478,13 58.532,92	1.029,27	1.029,27
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	-720.888,49	-720.888,49
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,66 0,66	-2,66 0,66	18,51 -3,96	9,77 -2,04	-2,77 -3,91	-1.909.069,45	-1.909.069,45
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,18 3,14	-0,18 3,14				-3.599,86	-3.599,86
Artigo 9º A, III % do CDI	5,79 3.871,18	5,79 3.871,18	9,11 1.962,59			785.870,19	785.870,19
CARAGUATATUBA (Total)						-5.017.904,24	-5.017.904,24

Análise de Liquidez

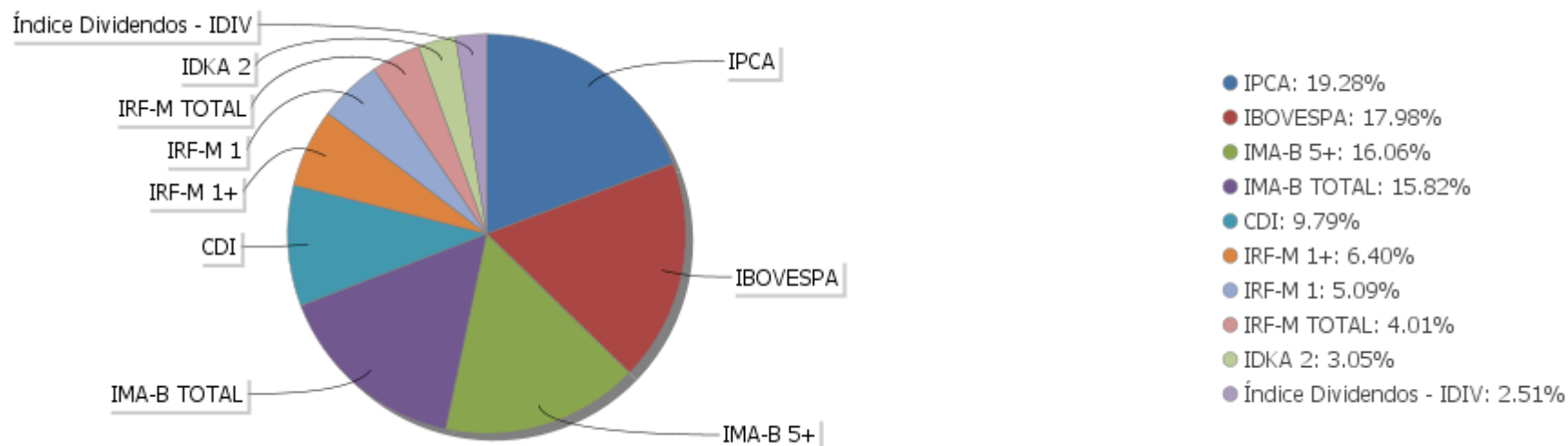
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	490.416.741,71	92,22	490.416.741,71	92,22
de 31 a 365 dias	39.466.593,69	7,42	529.883.335,40	99,64
acima de 365 dias	1.893.133,68	0,36	531.776.469,08	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

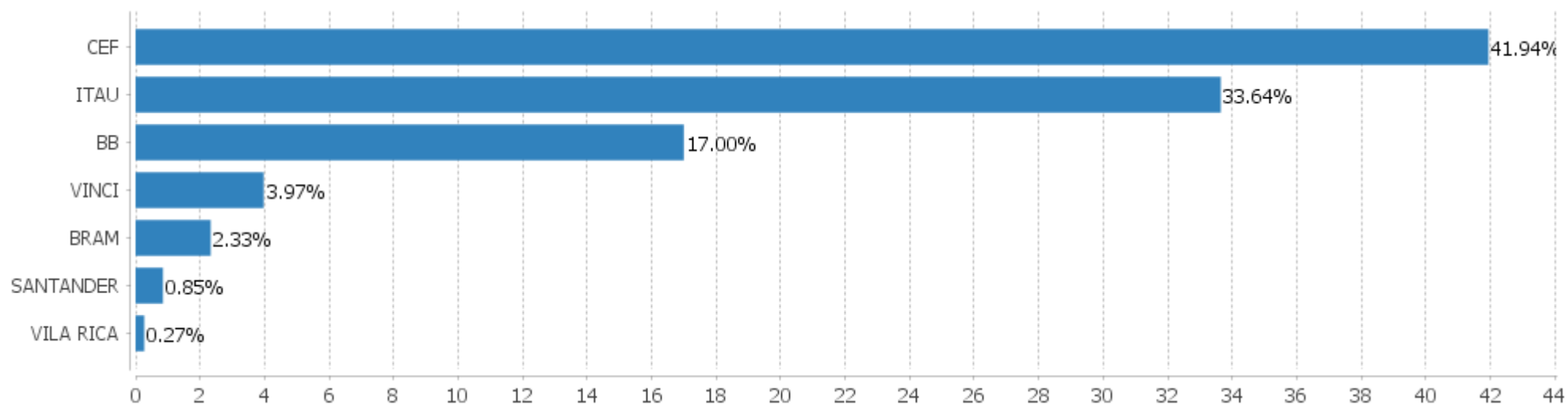


Alocação Por Estratégia



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	-0,94												-0,94
IPCA + 5,89%	0,71												0,71
p.p. indexador	-1,65												-1,65
2020	0,26	-1,20	-8,82	2,26	2,04	2,60	3,94	-1,32	-1,68	-0,06	3,29	4,43	5,12
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,65
p.p. indexador	-0,45	-1,86	-9,40	2,11	1,97	1,86	3,06	-2,04	-2,80	-1,40	1,94	2,58	-5,52
2019	1,51	0,37	0,41	0,94	1,99	2,58	1,16	0,11	1,85	2,11	-0,78	2,17	15,34
IPCA + 6%	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	0,68	-0,53	-0,78	-0,12	1,35	2,13	0,44	-0,51	1,40	1,47	-1,75	0,52	4,75

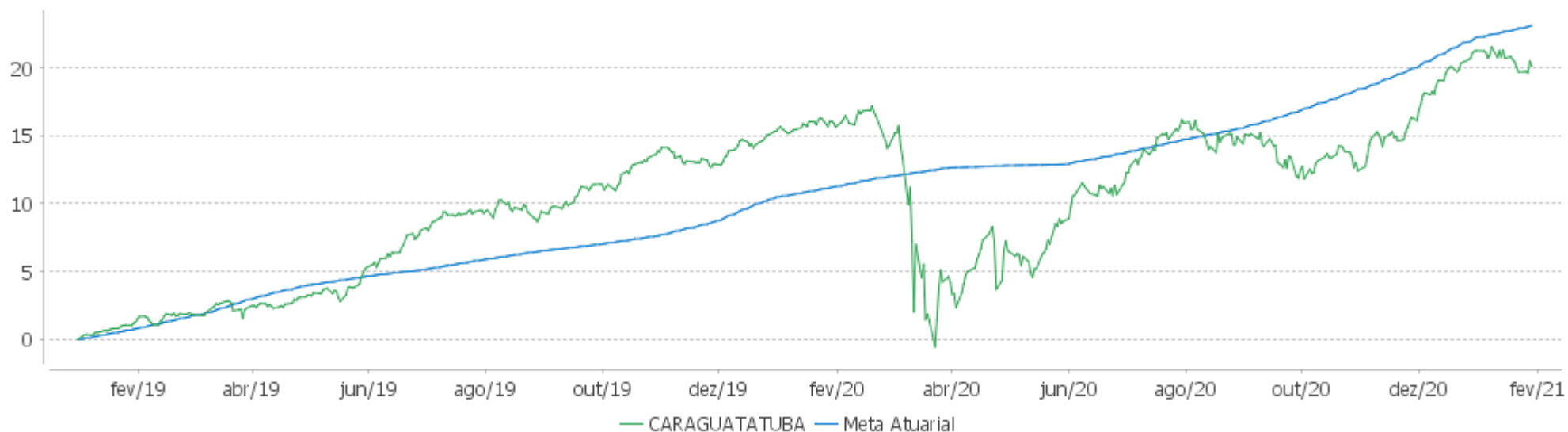
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

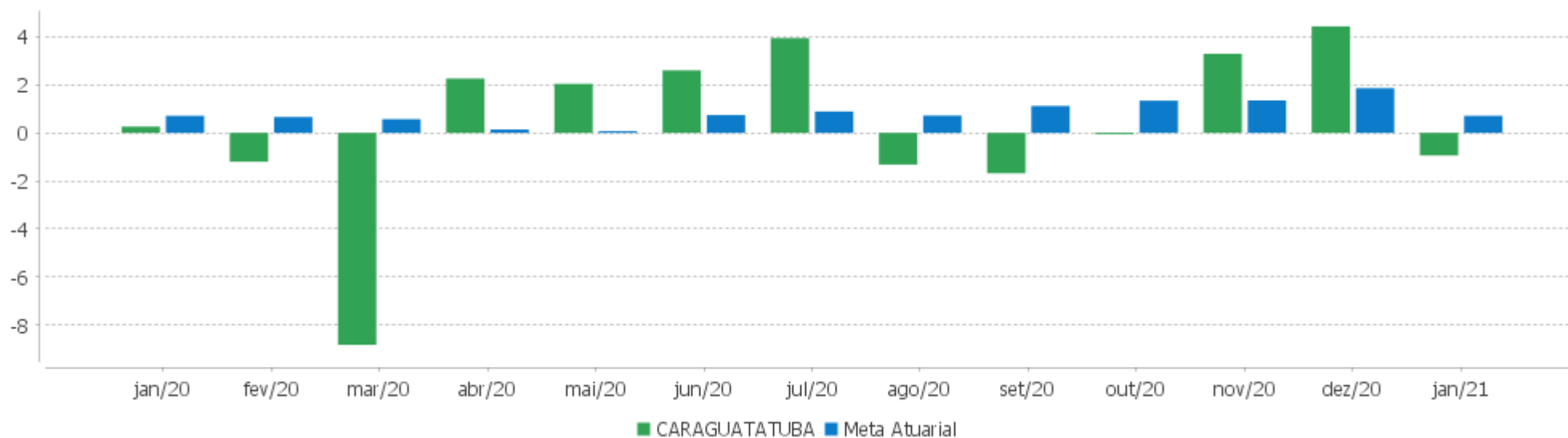
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	13	52,00	03 meses	6,85	3,96	2,89	5,34
Meses abaixo da Meta Atuarial	12	48,00	06 meses	3,61	7,30	-3,70	6,43
			12 meses	3,86	10,64	-6,78	13,16
			24 meses	18,32	22,21	-3,89	9,57
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	4,43	2020-12	Desde 31/12/2018	20,11	23,23	-3,12	9,37
Menor rentabilidade da Carteira	-8,82	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
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,13 84,94	0,13 84,94	0,47 100,93	0,92 97,51	2,28 90,23	7,99 94,55	14,73 95,81
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	-1,05 -705,19	-1,05 -705,19	5,99 1.290,45	2,22 236,39	6,18 244,63	26,80 316,92	44,28 288,00
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,16 108,14	0,16 108,14	0,68 146,62	0,95 100,44	2,20 87,20	7,87 93,11	14,55 94,64
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,13 -0,12	0,13 -0,12	0,44 -2,07	0,16 -4,14	2,65 -1,91	12,60 3,66	22,91 9,86
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	0,07 48,60	0,07 48,60	0,09 20,30	1.277,26 135.744,22	1.478,13 58.532,92	72.397,76 856.184,25	25.772,90 167.640,53
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,06 0,02	0,06 0,02	0,59 0,01	0,82 -0,19	3,10 -0,33	9,71 -0,56	17,05 -0,89
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
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
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,77 0,03	-0,77 0,03	1,51 0,01	-0,25 -0,10	4,73 -0,18	16,38 -0,57	28,81 -0,80
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
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,70 -0,01	-1,70 -0,01	8,30 -0,13	1,85 -0,16	3,21 -0,47	25,74 -1,09	46,51 -2,18
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO Var. IRF-M 1+ p.p.	-1,39 0,00	-1,39 0,00	2,05 -0,04	-0,70 -0,10	5,58 -0,19	19,55 -0,57	34,26 -0,81
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
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,29 1,14	0,29 1,14	2,68 -3,36	3,87 1,09	5,71 0,48	15,45 -8,84	26,97 -14,86
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	-0,80	-0,80	1,50	-0,29	4,65	16,40	28,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,00	0,00	-0,01	-0,14	-0,26	-0,55	-0,85
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,86	-0,86	6,00	2,62	4,95	23,66	40,75
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,01	-0,04	-0,16	-0,27	-0,63	-1,07
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	-1,70	-1,70	8,29	1,74	3,23	26,02	47,40
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,01	-0,01	-0,14	-0,27	-0,45	-0,81	-1,29
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	-0,88	-0,88	5,96	2,62	4,67	23,27	40,32
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,03	-0,08	-0,16	-0,56	-1,01	-1,50
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	-0,18	-0,18	13,99	13,41	12,32	38,60	37,63
% do CDI	-119,25	-119,25	3.013,26	1.424,80	487,93	456,47	244,74
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-2,82	-2,82	21,89	11,05	0,49	20,53	39,88
Var. IBOVESPA p.p.	0,50	0,50	-0,59	-0,77	-0,66	2,38	4,37
BRADESCO F I A SELECTION	-2,48	-2,48	13,85	13,11	-4,84	13,16	33,95
Var. IBOVESPA p.p.	0,84	0,84	-8,62	1,30	-5,98	-4,98	-1,56
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	-2,04	-2,04	18,77	10,41	1,79	28,75	60,11
Var. IBOVESPA p.p.	1,28	1,28	-3,71	-1,40	0,64	10,60	24,60
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	-3,14	-3,14	19,35	8,34	-2,73	31,72	63,12
Var. IBOVESPA p.p.	0,18	0,18	-3,13	-3,47	-3,88	13,58	27,61
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-1,46	-1,46	17,60	12,10	-6,09	23,46	49,45
Var. IBOVESPA p.p.	1,85	1,85	-4,88	0,29	-7,24	5,31	13,93
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	-2,34	-2,34	20,39	10,30	-0,91	22,60	42,55
Var. IBOVESPA p.p.	0,98	0,98	-2,09	-1,52	-2,06	4,46	7,04
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-3,76	-3,76	20,27	10,03	-2,32	25,54	47,60
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,32	1,32	1,97	1,95	2,19	4,27	3,65
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-4,39	-4,39	16,96	6,10	-11,60	4,52	20,38
Var. IBOVESPA p.p.	-1,07	-1,07	-5,51	-5,71	-12,75	-13,63	-15,13
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	-2,67	-2,67	14,64	4,51	-6,04	27,57	61,16
Var. IBOVESPA p.p.	0,65	0,65	-7,84	-7,31	-7,19	9,42	25,65
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5,79	5,79	9,11	20,97	53,70	118,69	138,83
Var. IBOVESPA p.p.	9,11	9,11	-13,36	9,15	52,55	100,54	103,32
CARAGUATATUBA	-0,94	-0,94	6,85	3,61	3,86	18,32	
Var. IPCA + 5,89% p.p.	-1,65	-1,65	2,89	-3,70	-6,78	-3,77	
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%	0,73	0,73	4,18	7,97	11,79	23,62	35,65
IPCA + 6%	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

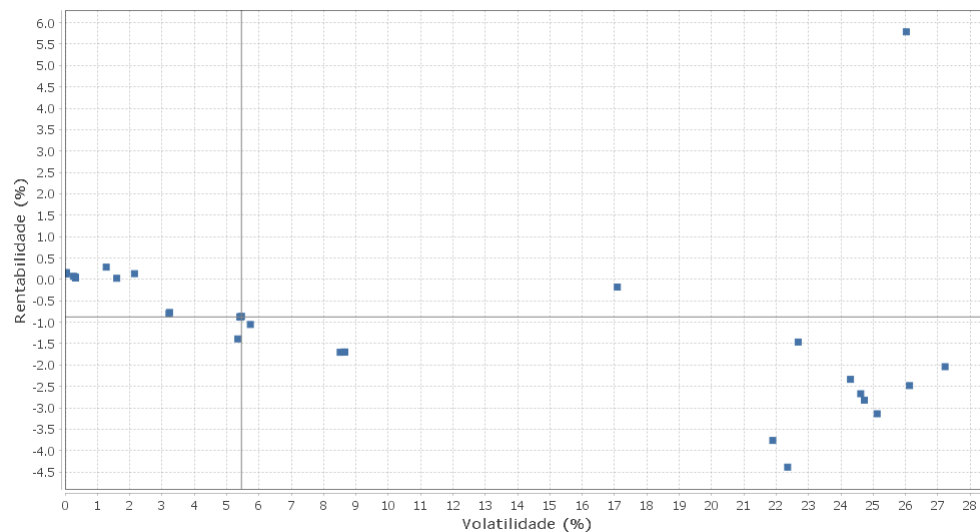
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
249	04/01/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	46.280,85	0,00	14,50299282	3.191,1241070000
254	13/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	33.000,00	8.819,66201300	3,7416400000
245	15/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.207,61	0,00	810,51233400	2,7237216590
255	15/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	4.000,00	1.068,85766600	3,7423130000
246	19/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	316.501,58	0,00	116.145,89484100	2,7250345820
258	19/01/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	5.308.021,56	0,00	157.188,14995689	33,7685860000
259	20/01/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	1.329.604,01	0,00	39.364,53148577	33,7767010000
247	22/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	12.309,62	0,00	4.517,81117000	2,7246866980
260	22/01/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	301.356,48	0,00	8.923,75122804	33,7701570000
248	27/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.314,51	0,00	849,50916400	2,7245262270
261	27/01/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	1.600,30	0,00	47,38609135	33,7715130000
262	27/01/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	306.447,94	0,00	9.074,15489499	33,7715130000
250	28/01/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	13.725,88	0,00	4,29655500	3.194,6245280000
256	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	149.147,86	39.825,36435800	3,7450470000
257	28/01/2021	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,00	2.383.823,96	70.582,56590838	33,7735520000
251	29/01/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	502,00	0,00	0,15712367	3.194,9355200000
252	29/01/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1.044,80	0,00	0,32701755	3.194,9355200000
253	29/01/2021	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	106.462,49	0,00	33,32226561	3.194,9355200000
Total						

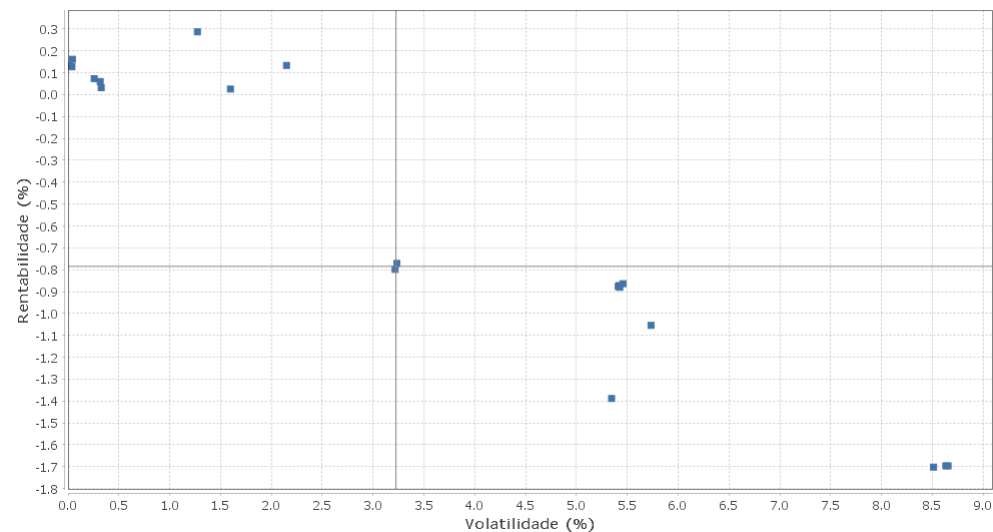
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

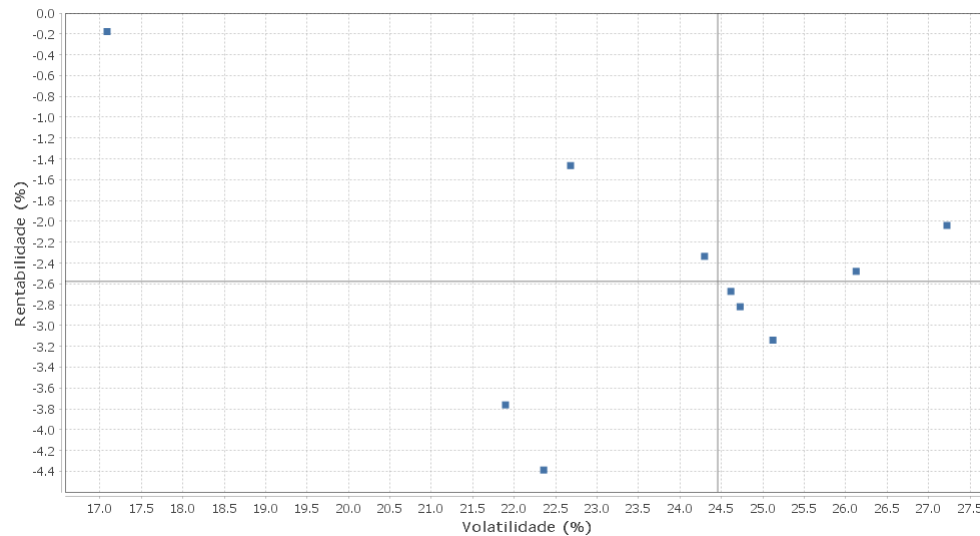
CARAGUATATUBA - No Mês



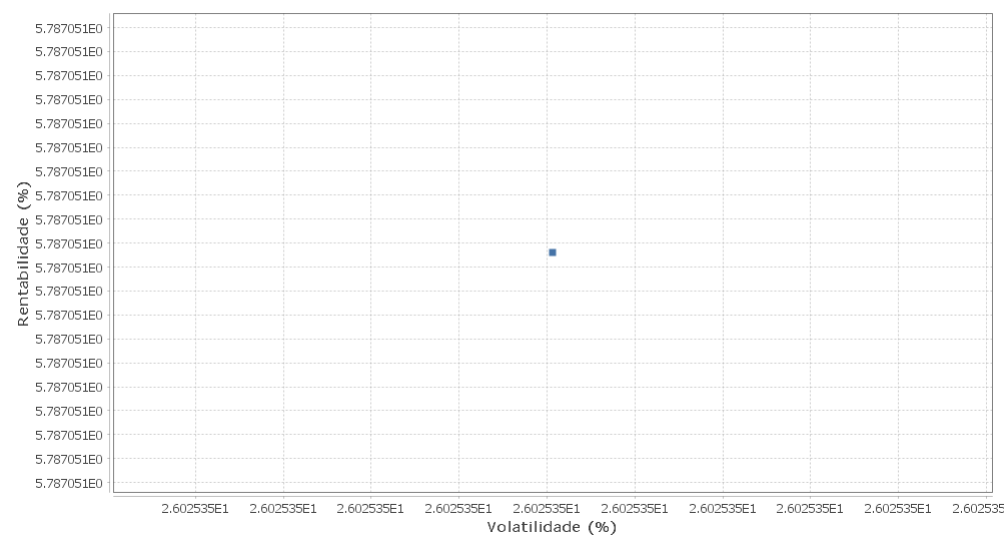
Renda Fixa - No Mês



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\$): 16.146.446,06

Value-At-Risk: 3,04%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,23	0,01	-1,01	0,13	50.590.063,08	9,51
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,02	-0,00	-0,59	0,13	6.592.365,10	1,24
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,13	0,00	0,28	0,16	799.824,32	0,15
FIDC ITALIA SENIOR	Artigo 7º VII, Alínea a	0,26	1,50	-0,00	-0,30	0,07	1.417.673,86	0,27
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,32	0,18	-0,00	-0,28	0,06	22.462.500,26	4,22
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,19	0,00	-0,36	0,03	4.595.876,69	0,86
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,27	1,09	0,00	0,11	0,29	475.459,82	0,09
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,60	1,03	0,08	-0,08	0,03	51.954.332,93	9,77
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,15	1,17	0,02	-0,01	0,13	16.224.972,27	3,05
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,22	1,48	0,03	-0,29	-0,80	16.368.899,06	3,08
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,23	1,49	0,01	-0,28	-0,77	4.960.078,31	0,93
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	5,35	2,39	0,11	-0,29	-1,39	34.029.609,38	6,40
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	5,41	2,56	0,07	-0,19	-0,88	16.843.315,03	3,17
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,42	2,57	0,18	-0,19	-0,87	45.838.625,11	8,62
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,43	2,57	0,02	-0,19	-0,88	4.501.387,07	0,85
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,46	2,56	0,06	-0,19	-0,86	16.448.177,40	3,09
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	5,73	2,78	0,18	-0,21	-1,05	41.243.343,65	7,76
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	Artigo 7º I, Alínea b	8,51	4,19	0,03	-0,22	-1,70	4.428.401,01	0,83
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	8,63	4,24	0,17	-0,21	-1,70	26.114.582,50	4,91
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	8,65	4,24	0,35	-0,21	-1,70	54.881.692,27	10,32
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	Artigo 8º III	17,09	8,34	0,02	-0,02	-0,18	2.015.744,80	0,38
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,89	9,87	0,21	-0,18	-3,76	13.361.038,32	2,51
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	22,35	10,05	0,03	-0,20	-4,39	1.527.787,22	0,29
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	22,68	9,86	0,10	-0,07	-1,46	6.232.634,72	1,17
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	24,30	10,58	0,29	-0,10	-2,34	16.381.068,96	3,08
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	24,61	10,39	0,11	-0,11	-2,67	6.544.037,28	1,23
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	24,73	11,58	0,47	-0,12	-2,82	24.845.240,34	4,67
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	25,12	9,96	0,13	-0,13	-3,14	7.726.680,22	1,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	26,03	11,89	0,03	0,22	5,79	14.365.674,01	2,70
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	26,13	11,48	0,10	-0,10	-2,48	5.859.143,66	1,10
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	27,22	10,75	0,21	-0,08	-2,04	12.146.240,43	2,28