



LDB
EMPRESAS

HORTOLÂNDIA
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 19.02.2021.

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 80,24%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	8,80	-0,14	-0,14	36.793.432,03	5,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	22,04	-1,56	-1,56	16.908.385,62	2,73
TESOURO NACIONAL	NTN-C 010421	2,32	3,48	3,48	42.702.620,74	6,90
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		7,52	1,17	1,17	96.404.438,39	15,58

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-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,58	0,03	0,03	63.201.372,95	10,21	8.572.331.669,58	0,74
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,85	-0,86	-0,86	71.790.702,04	11,60	8.335.200.025,45	0,86
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,18	0,13	0,13	65.162.805,52	10,53	10.852.113.121,11	0,60
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,14	-0,77	-0,77	44.320.426,28	7,16	2.465.176.454,79	1,80
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,33	-0,55	-0,55	48.207.732,21	7,79	9.495.985.226,13	0,51
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	0,03	0,03	51.205.126,20	8,27	14.822.912.413,17	0,35
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			5,70	-0,34	-0,34	343.888.165,20	55,57		

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
QUELUZ	ORLA	BRA1 FI RENDA FIXA	24,21	-0,30	-0,30	587.080,01	0,09	14.075.954,52	4,17
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	1,67	0,13	0,13	47.221.203,80	7,63	3.621.561.522,63	1,30
VERITAS	RJI	FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	31,14	-0,34	-0,34	1.113.417,59	0,18	169.755.094,93	0,66
GRAPHEN	ORLA	LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	19,76	-0,28	-0,28	3.736.662,87	0,60	70.801.203,92	5,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,34	0,09	0,09	52.658.364,27	8,51		

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
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	2,88	0,03	0,03	1.836.431,92	0,30	72.706.030,51	2,53
FINAXIS	FINAXIS	FIDC PREMIUM	11,25	-0,20	-0,20	1.767.271,08	0,29	81.898.860,94	2,16
BRPP	BRPP	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	136,67	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
BRPP	BRPP	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4	136,67	0,00	0,00	0,00	0,00	4.957,59	0,00
BRPP	BRPP	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3	136,67	0,00	0,00	0,00	0,00	7.125,27	0,00
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			5,79	-0,08	-0,08	3.603.703,00	0,58		
Renda Fixa			5,48	-0,00	-0,00	496.554.670,86	80,24		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

18,86%

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
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	45,86	-2,64	-2,64	27.995.160,05	4,52	756.617.943,05	3,70
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	46,73	-1,91	-1,91	22.944.886,67	3,71	1.364.096.457,43	1,68
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	42,16	-3,25	-3,25	28.746.247,61	4,65	313.134.957,52	9,18
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	44,50	-1,46	-1,46	27.868.164,80	4,50	3.479.599.111,95	0,80
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			44,41	-2,35	-2,35	107.554.459,13	17,38		

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	229.422,75	0,04	1.624.772,25	14,12
Sub-total Artigo 8º III			0,67	-0,38	-0,38	229.422,75	0,04		

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	217.006,80	0,04	8.008.142,29	2,71
VALORA	BEM	FIP BRASIL ÓLEO & GÁS	252,17	-25,66	-25,66	78,73	0,00	26.477,56	0,30
QUELUZ	BNY MELLON	ÁTICO FIC DE FI EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL	19,11	-0,16	-0,16	1.528.633,97	0,25	28.252.242,74	5,41
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			118,70	-0,20	-0,20	1.745.719,50	0,28		

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
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	29,35	-2,87	-2,87	2.274.000,00	0,37	1.221.784.872,82	0,19
QUELUZ	PLANNER	VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	8,63	-1,55	-1,55	2.585.504,22	0,42	31.376.185,18	8,24
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BRCR11	22,94	1,88	1,88	291.815,40	0,05	2.871.280.443,66	0,01
AQUILLA	ÍNDIGO	ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	2,02	-0,16	-0,16	2.037.092,42	0,33	181.485.441,09	1,12

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
		Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b	10,97	-1,45	-1,45	7.188.412,04	1,16		
		Renda Variável e Investimentos Estruturados	42,08	-2,26	-2,26	116.718.013,42	18,86		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,90%

Artigo 9º A, II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	24,67	6,27	6,27	5.568.690,03	0,90	82.428.056,04	6,76
Sub-total Artigo 9º A, II			24,67	6,27	6,27	5.568.690,03	0,90		
Investimentos no Exterior			23,27	6,27	6,27	5.568.690,03	0,90		
Total			10,03	-0,37	-0,37	618.841.374,31	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	96.404.438,39	15,58	5,00	10,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	343.888.165,20	55,57	10,00	52,50	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	52.658.364,27	8,51	0,00	10,00	40,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	3.603.703,00	0,58	0,00	0,50	3,00	5,00
	Total Renda Fixa	496.554.670,86	80,24				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	107.554.459,13	17,38	5,00	17,50	20,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	229.422,75	0,04	0,00	0,50	5,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	1.745.719,50	0,28	0,00	1,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	7.188.412,04	1,16	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	116.718.013,42	18,86				35,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	5.568.690,03	0,90	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	5.568.690,03	0,90				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

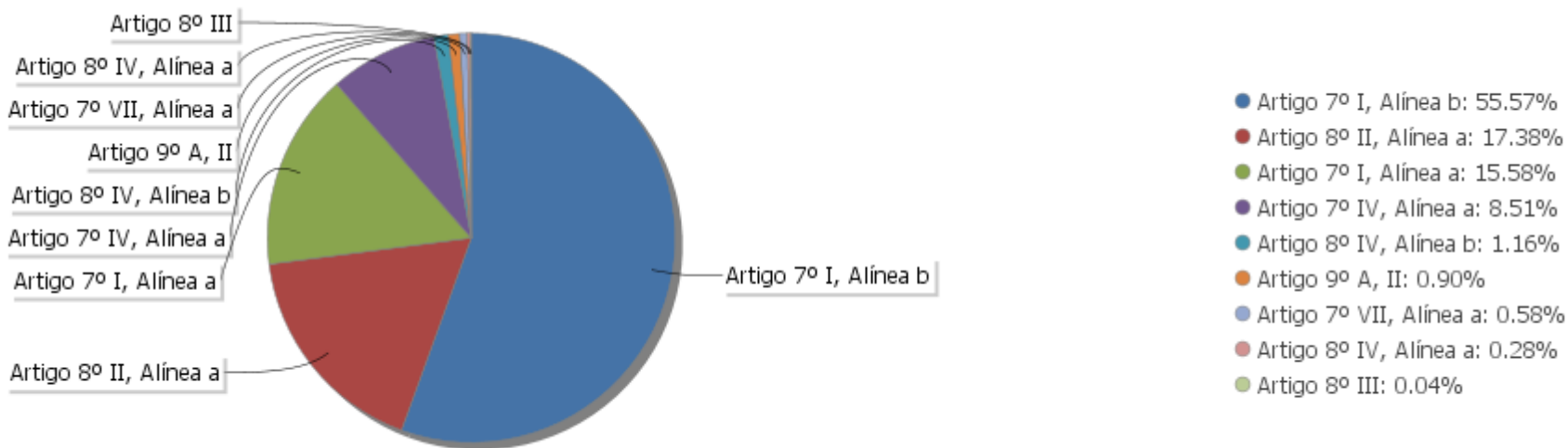
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,17 784,22	1,17 784,22	5,74 1.236,37	8,88 943,33	14,42 571,11	1.117.082,04	1.117.082,04
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,34 -230,46	-0,34 -230,46	2,81 606,19	1,67 177,21	5,46 216,02	-1.111.207,20	-1.111.207,20
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,09 59,90	0,09 59,90	0,46 98,29	0,10 10,38	1,80 71,10	47.114,29	47.114,29
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-0,08 -56,59	-0,08 -56,59	0,16 35,42	1,98 210,24	-4,62 -182,77	-3.051,33	-3.051,33
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,35 0,97	-2,35 0,97	17,31 -5,16	7,74 -4,07	-7,20 -8,35	-2.584.756,14	-2.584.756,14
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	-882,83	-882,83
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,20 3,12	-0,20 3,12	-0,84 -23,32	-1,30 -13,11	-79,57 -80,72	-3.449,80	-3.449,80
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-1,45 1,87	-1,45 1,87	0,93 -21,54	2,57 -9,24	-0,13 -1,28	-105.406,91	-105.406,91
Artigo 9º A, II % do CDI	6,27 4.191,45	6,27 4.191,45				328.350,85	328.350,85
HORTOLÂNDIA (Total)						-2.316.207,03	-2.316.207,03

Análise de Liquidez

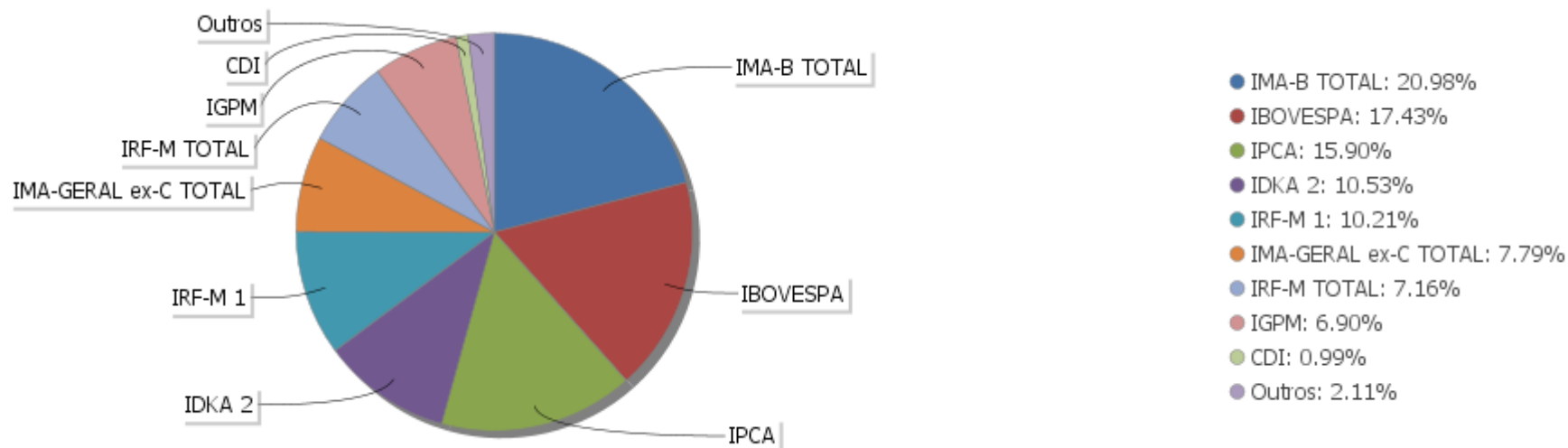
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	480.398.582,09	77,63	480.398.582,09	77,63
de 31 a 365 dias	72.407.217,46	11,70	552.805.799,55	89,33
acima de 365 dias	66.035.574,76	10,67	618.841.374,31	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

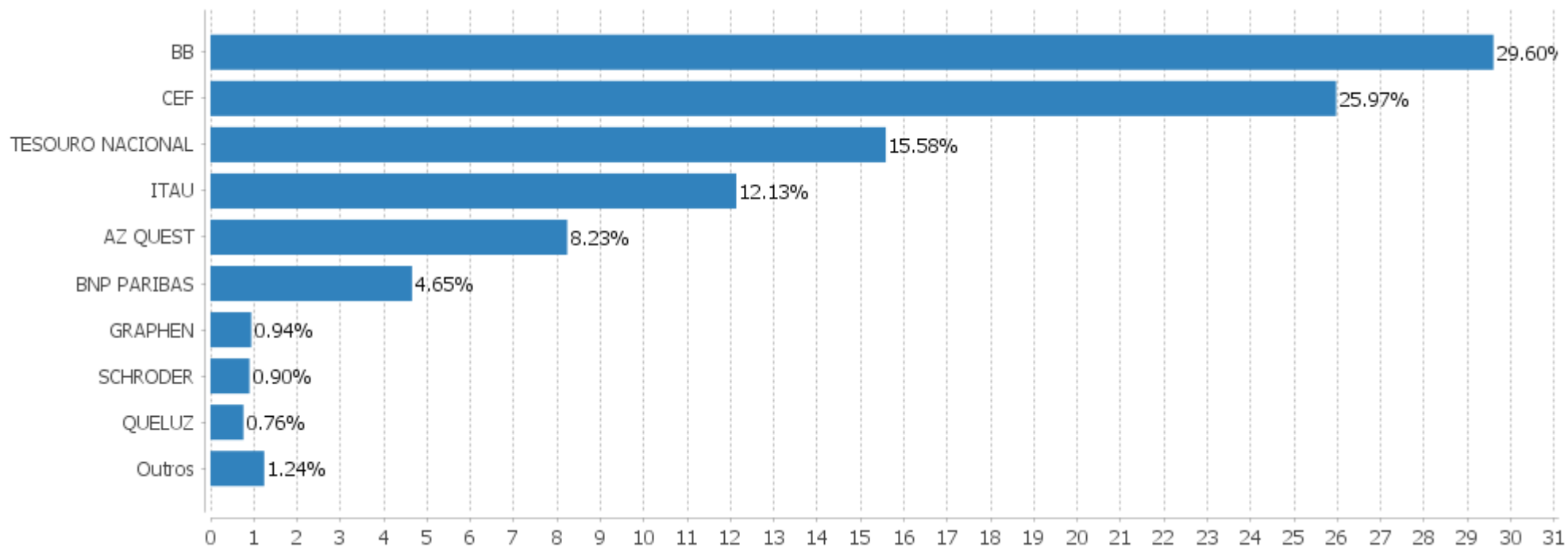


Alocação Por Estratégia



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	-0,37												-0,37
IPCA + 5,41%	0,67												0,67
p.p. indexador	-1,04												-1,04
2020	0,74	-0,95	-6,76	0,85	2,01	1,95	2,67	-0,62	-1,01	0,15	2,81	2,88	4,40
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,63
p.p. indexador	0,03	-1,61	-7,33	0,71	1,94	1,21	1,79	-1,34	-2,13	-1,19	1,46	1,02	-6,22
2019	2,83	0,10	0,40	1,16	1,59	2,44	1,21	0,05	1,70	1,87	-0,25	2,19	16,35
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	2,00	-0,79	-0,79	0,10	0,95	1,99	0,49	-0,57	1,25	1,24	-1,23	0,55	5,76

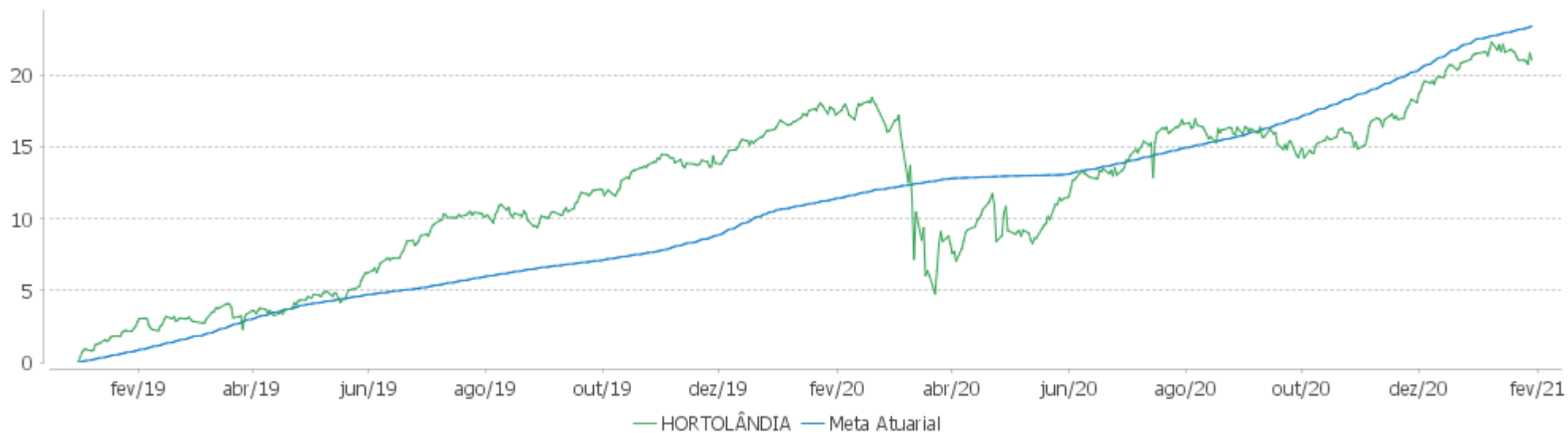
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

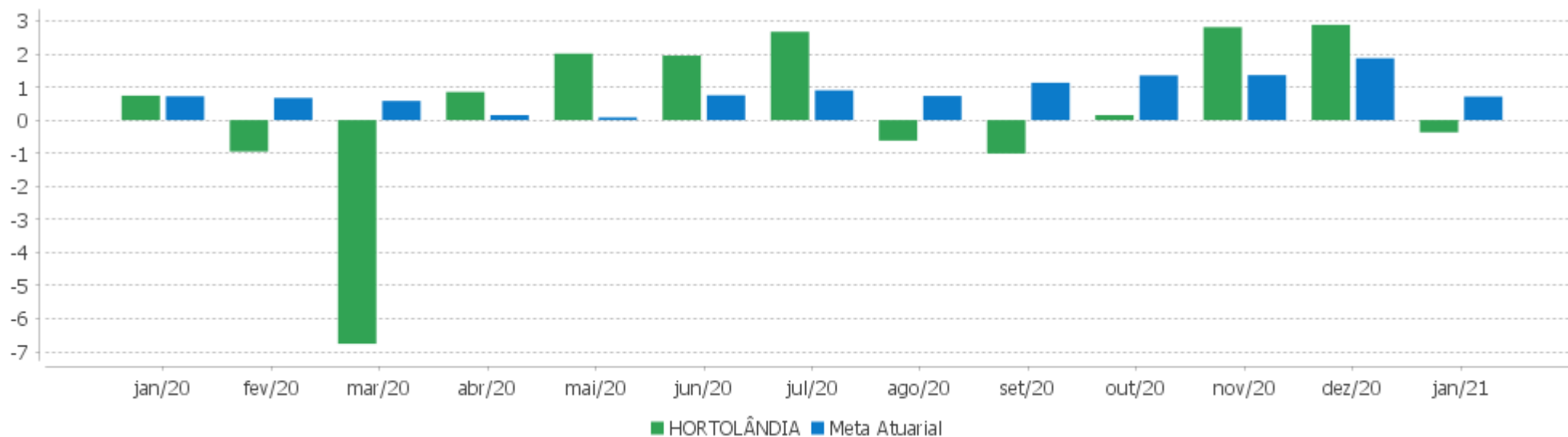
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	15	60,00	03 meses	5,38	3,92	1,46	4,21
Meses abaixo da Meta Atuarial	10	40,00	06 meses	3,82	7,26	-3,43	4,79
			12 meses	3,26	10,58	-7,33	10,03
			24 meses	17,70	22,15	-4,45	7,50
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,88	2020-12	Desde 31/12/2018	21,03	23,16	-2,14	7,37
Menor rentabilidade da Carteira	-6,76	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
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,56 -0,71	-1,56 -0,71	8,97 2,93	2,05 -0,73	2,42 -2,81	26,98 2,69	46,97 5,14
NTN-B 150824 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,14 0,71	-0,14 0,71	4,02 -2,02	2,85 0,07	7,97 2,75	25,16 0,88	39,37 -2,45
NTN-C 010421 Var. IGPM p.p.	3,48 0,91	3,48 0,91	6,00 -0,95	17,86 -0,50	26,74 1,03	43,92 8,39	63,13 18,47
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3 % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-74,30 -2.942,13	-97,31 -1.150,84	-99,18 -645,13
FIDC PREMIUM % do CDI	-0,20 -136,79	-0,20 -136,79	-0,50 -108,76	5,71 606,88	-4,51 -178,59	-13,57 -160,52	-17,85 -116,10
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4 % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-74,30 -2.942,13	-97,31 -1.150,84	-99,13 -644,79
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2 % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-74,30 -2.942,13	-97,31 -1.150,84	-99,08 -644,47
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
BRA1 FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,30 0,55	-0,30 0,55	0,62 -5,42	-1,02 -3,80	-20,40 -25,62	-68,04 -92,33	-64,80 -106,63
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA 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
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,28 0,57	-0,28 0,57	1,25 -4,79	-0,70 -3,47	-2,74 -7,96	5,69 -18,60	-14,85 -56,68
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-0,34 -0,45	-0,34 -0,45	-1,53 -4,82	0,66 -3,15	1,43 -6,13	-18,65 -39,17	-9,19 -41,87
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
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
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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,86	-0,86	6,00	2,62	4,95	23,66	40,75

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.	-0,01	-0,01	-0,04	-0,16	-0,27	-0,63	-1,07
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
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
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-3,25 0,07	-3,25 0,07	20,20 -2,28	9,42 -2,39	0,04 -1,11	22,84 4,69	41,56 6,05
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,64 0,68	-2,64 0,68	14,42 -8,06	4,55 -7,26	-9,84 -10,99	12,05 -6,09	33,40 -2,11
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,91 1,41	-1,91 1,41	17,05 -5,42	4,39 -7,42	-10,95 -12,10	33,55 15,40	64,60 29,08
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	-1,46 1,85	-1,46 1,85	17,60 -4,88	12,10 0,29	-6,09 -7,24	23,46 5,31	49,45 13,93
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA 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
ÁTICO FIC DE FI EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,16 -0,87	-0,16 -0,87	-0,47 -4,46	-1,00 -8,36	18,74 7,99	-21,28 -43,63	-21,86 -56,38
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS % do CDI	-25,67 -17.170,16	-25,67 -17.170,16	-77,83 -16.768,45	54,25 5.765,68	13,84 548,09	-97,64 -1.154,70	-98,64 -641,59
BRCR11 Var. IBOVESPA p.p.	1,88 5,20	1,88 5,20	5,68 -16,79	2,00 -9,81	-16,82 -17,96	9,27 -8,88	8,12 -27,39
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII Var. IFIX p.p.	-0,16 -0,48	-0,16 -0,48	-0,84 -4,91	0,73 -4,62	-0,19 6,24	-11,94 -31,44	-19,32 -45,32
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII % do CDI	-2,87 -1.918,73	-2,87 -1.918,73	-3,57 -769,32	-6,69 -710,47	-18,29 -724,29	-88,69 -1.048,85	-88,60 -576,29
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII Var. IFIX p.p.	-1,55 -1,87	-1,55 -1,87	5,23 1,16	11,70 6,35	17,03 23,46	8,30 -11,20	17,27 -8,73
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	6,27 1,44	6,27 1,44	11,76 1,06				
HORTOLÂNDIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,37 -1,08	-0,37 -1,08	5,38 1,39	3,82 -3,53	3,26 -7,50	17,70 -4,65	
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

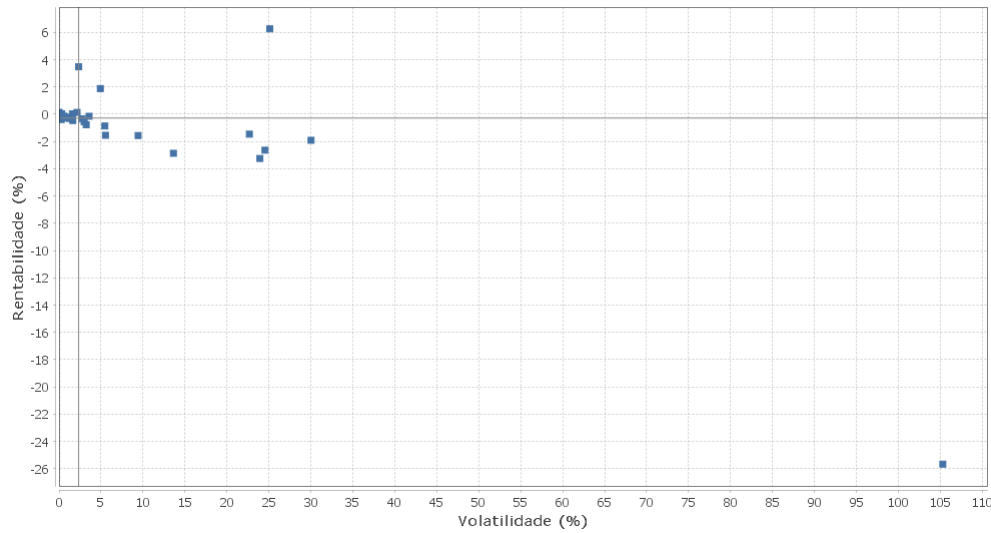
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	11/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	13.350.000,00	0,00	4.901.584,41123900	2,7236091190
2	27/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	3.550.000,00	1.302.978,83162900	2,7245262270
3	27/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	300.000,00	0,00	110.110,88717900	2,7245262270
Total						

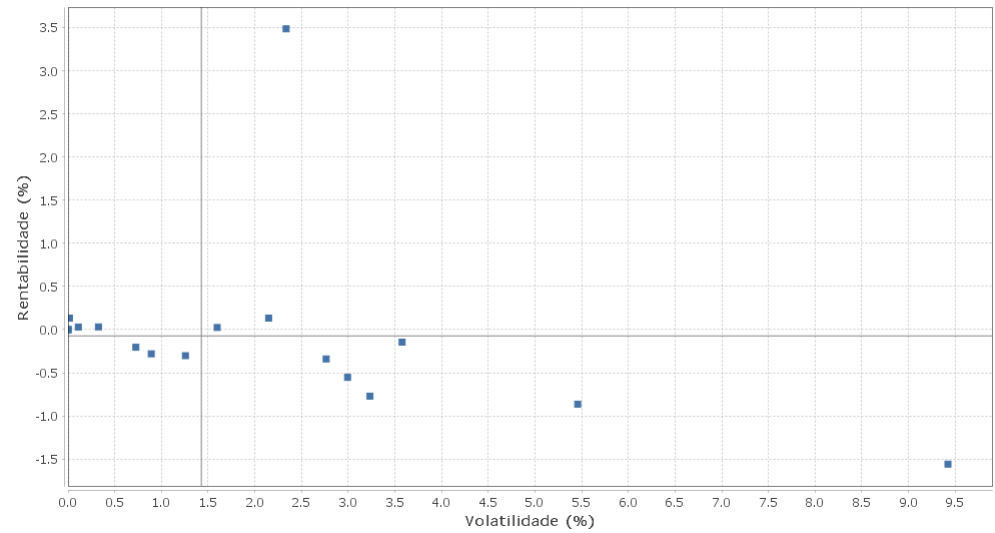
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

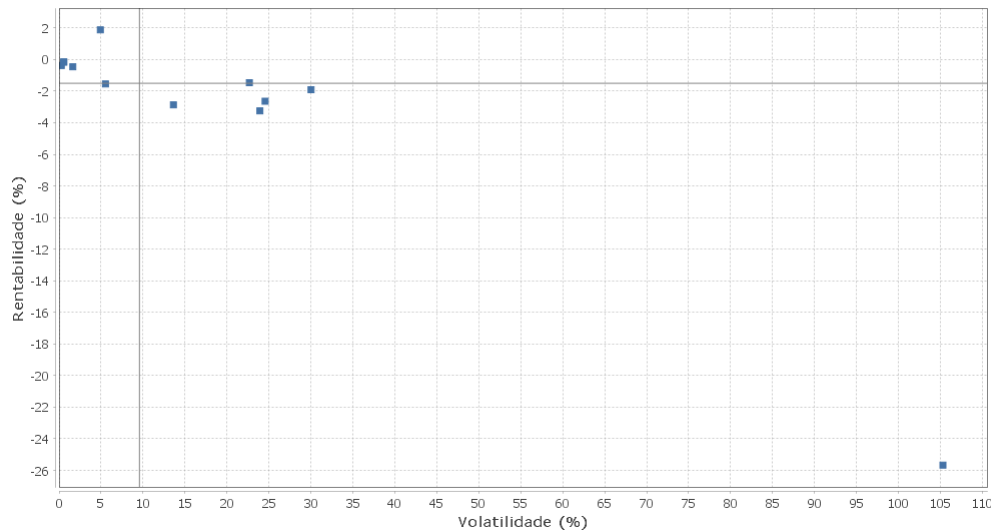
HORTOLÂNDIA - No Mês



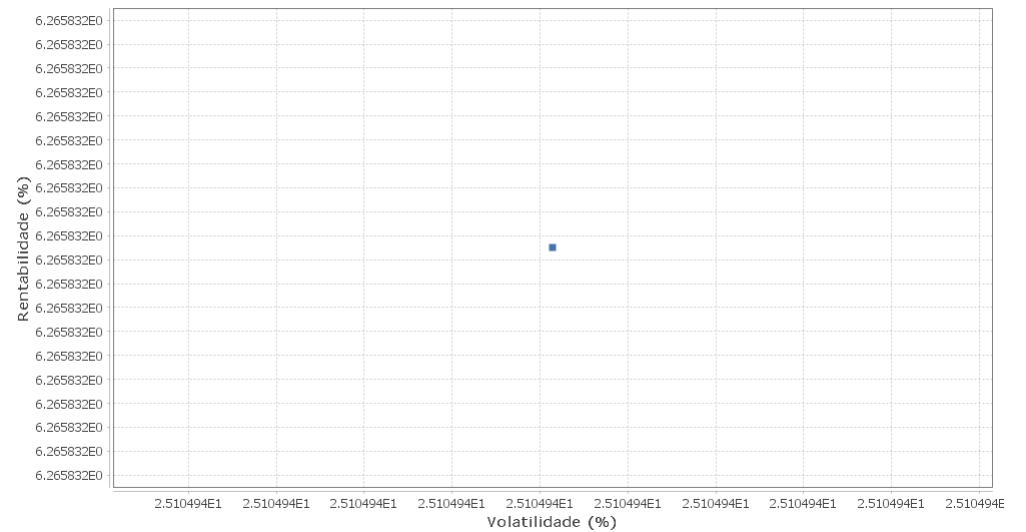
Renda Fixa - No Mês



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\$): 15.304.594,84

Value-At-Risk: 2,47%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3	Artigo 7º VII, Alínea a	0,00	NaN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4	Artigo 7º VII, Alínea a	0,00	NaN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
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
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,23	0,01	-1,01	0,13	47.221.203,80	7,63
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	Artigo 7º VII, Alínea a	0,11	0,05	-0,00	-1,07	0,03	1.836.431,92	0,30
LEME FIC FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO V	Artigo 8º III	0,26	0,04	0,00	-2,04	-0,38	229.422,75	0,04
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,19	0,01	-0,36	0,03	63.201.372,95	10,21
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	Artigo 8º IV, Alínea b	0,56	0,04	-0,00	-0,55	-0,16	2.037.092,42	0,33
ÁTICO FIC DE FI EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL	Artigo 8º IV, Alínea a	0,56	0,04	0,00	-0,55	-0,16	1.528.633,97	0,25
FIDC PREMIUM	Artigo 7º VII, Alínea a	0,73	0,04	0,00	-0,49	-0,20	1.767.271,08	0,29
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	Artigo 7º IV, Alínea a	0,89	1,00	0,00	-0,48	-0,28	3.736.662,87	0,60
BRA1 FI RENDA FIXA	Artigo 7º IV, Alínea a	1,26	0,90	0,00	-0,36	-0,30	587.080,01	0,09
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,60	1,03	0,06	-0,08	0,03	51.205.126,20	8,27
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	Artigo 8º IV, Alínea a	1,64	0,19	0,00	-0,37	-0,46	217.006,80	0,04
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,15	1,17	0,08	-0,01	0,13	65.162.805,52	10,53
NTN-C 010421	Artigo 7º I, Alínea a	2,34	1,38	-0,00	1,43	3,48	42.702.620,74	6,90
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	2,76	2,88	-0,00	-0,18	-0,34	1.113.417,59	0,18
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,99	1,33	0,08	-0,23	-0,55	48.207.732,21	7,79
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,23	1,49	0,07	-0,28	-0,77	44.320.426,28	7,16
NTN-B 150824	Artigo 7º I, Alínea a	3,58	1,62	0,07	-0,08	-0,14	36.793.432,03	5,95
BRCR11	Artigo 8º IV, Alínea b	4,93	2,31	0,00	0,35	1,88	291.815,40	0,05
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,46	2,56	0,21	-0,19	-0,86	71.790.702,04	11,60
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	Artigo 8º IV, Alínea b	5,53	0,49	-0,00	-0,31	-1,55	2.585.504,22	0,42
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	9,42	4,78	0,09	-0,18	-1,56	16.908.385,62	2,73
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	Artigo 8º IV, Alínea b	13,63	3,28	0,00	-0,22	-2,87	2.274.000,00	0,37
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	22,68	9,86	0,41	-0,07	-1,46	27.868.164,80	4,50
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	23,92	11,48	0,50	-0,14	-3,25	28.746.247,61	4,65
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,54	11,98	0,50	-0,11	-2,64	27.995.160,05	4,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	Artigo 9º A, II	25,10	11,61	-0,01	0,24	6,27	5.568.690,03	0,90
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	30,02	12,02	0,40	-0,07	-1,91	22.944.886,67	3,71
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS	Artigo 8º IV, Alínea a	105,29	4,06	-0,00	-0,25	-25,67	78,73	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de janeiro de 2021, vale observar que:

- O Instituto está com 14,12% do patrimônio líquido do fundo LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V (Art. 8, Inciso III), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- O Instituto está com 5,41% do patrimônio líquido do fundo ÁTICO FIC DE FI EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL (Art. 8, Inciso IV, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- O Instituto está com 8,24% do patrimônio líquido do fundo VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII (Art. 8, Inciso IV, Alínea B), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;