



LDB
EMPRESAS

HORTOLÂNDIA
ABRIL 2021



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 30.04.2021.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

76,22%

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	4,20	1,51	0,01	35.916.448,56	5,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	10,28	0,40	-4,09	16.473.916,26	2,60
TESOURO NACIONAL	NTN-C 010421	2,13	0,12	8,94	0,00	0,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		3,54	1,25	3,74	52.390.364,82	8,28

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	0,36	0,24	0,30	93.115.697,03	14,71	7.571.217.894,67	1,23
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	6,04	0,65	-2,22	70.808.131,99	11,19	7.329.081.978,43	0,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,36	1,02	0,99	66.726.161,23	10,54	11.053.033.773,31	0,60
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,08	0,78	-2,03	43.757.782,31	6,91	1.814.422.370,50	2,41
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	3,06	0,62	-1,27	47.861.580,48	7,56	9.467.835.833,78	0,51
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,49	0,66	0,48	51.438.173,33	8,13	15.772.466.647,51	0,33
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b		2,78	0,61	-0,64	373.707.526,37	59,05			

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	6,37	0,07	-1,04	536.765,09	0,08	12.869.593,45	4,17
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	0,67	0,11	0,45	47.368.576,50	7,48	3.564.171.265,99	1,33
VERITAS	RJI	FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	30,74	-0,25	0,17	1.119.140,89	0,18	170.627.686,48	0,66
GRAPHEN	RJI	LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	18,66	0,28	-0,63	3.723.711,16	0,59	70.555.799,06	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			1,61	0,11	0,35	52.748.193,64	8,33		
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
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	3,68	0,32	-2,28	1.794.039,52	0,28	71.027.676,17	2,53
FINAXIS	FINAXIS	FIDC PREMIUM	11,23	-0,09	-0,69	1.758.622,92	0,28	81.086.680,01	2,17
BRPP	BRPP	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
BRPP	BRPP	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4.957,59	0,00
BRPP	BRPP	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	7.125,27	0,00
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			5,89	0,11	-1,50	3.552.662,44	0,56		
Renda Fixa			2,62	0,62	0,23	482.398.747,27	76,22		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

19,16%

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	22,07	4,82	1,52	29.190.668,22	4,61	713.911.861,10	4,09
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	22,14	6,93	6,51	24.914.944,83	3,94	1.608.800.534,35	1,55
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	22,23	1,86	-1,67	29.213.217,71	4,62	314.033.198,90	9,30
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	22,09	3,31	4,45	29.540.236,43	4,67	3.432.293.082,37	0,86
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			21,29	4,09	2,47	112.859.067,19	17,83		

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	0,35	-0,39	-1,61	226.586,81	0,04	1.604.688,16	14,12
Sub-total Artigo 8º III			0,35	-0,39	-1,61	226.586,81	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	180,33	-0,48	-1,70	214.300,80	0,03	7.909.558,59	2,71
VALORA	BEM	FIP BRASIL ÓLEO & GÁS	265,96	15,83	-74,23	27,16	0,00	5.876,23	0,46
QUELUZ	BNY MELLON	BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	0,52	-0,10	-0,46	1.523.942,08	0,24	28.150.124,51	5,41
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			50,02	-0,15	-0,62	1.738.270,04	0,27		

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	25,26	-0,73	-4,62	2.181.000,00	0,34	1.322.246.699,64	0,16
QUELUZ	PLANNER	VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	36,20	3,50	1,23	1.988.905,26	0,31	10.740.150,05	18,52
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BRCR11	12,12	4,80	-1,54	277.403,16	0,04	2.861.919.636,26	0,01
AQUILLA	ÍNDIGO	ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	2,17	-0,29	-1,32	2.013.310,57	0,32	145.997.093,41	1,38
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			15,60	0,91	-0,38	6.460.618,99	1,02		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	27,82	3,84	2,31	121.284.543,03	19,16
---	-------	------	------	----------------	-------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,61%

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
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	27,43	-4,04	-4,04	14.394.490,38	2,27	1.746.414.996,99	0,82
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	22,59	1,24	15,52	14.798.659,68	2,34	198.099.965,04	7,47
Sub-total Artigo 9º A, II			19,66	0,62	14,81	29.193.150,06	4,61		
Investimentos no Exterior			19,66	0,62	14,81	29.193.150,06	4,61		
Total			5,63	1,09	0,63	632.876.440,36	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	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	52.390.364,82	8,28	5,00	10,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	373.707.526,37	59,05	10,00	52,50	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	52.748.193,64	8,33	0,00	10,00	40,00	0,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	3.552.662,44	0,56	0,00	0,50	3,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	482.398.747,27	76,22					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	112.859.067,19	17,83	5,00	17,50	20,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	226.586,81	0,04	0,00	0,50	5,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	1.738.270,04	0,27	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	6.460.618,99	1,02	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	121.284.543,03	19,16					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	29.193.150,06	4,61	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	29.193.150,06	4,61					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	1,25 599,55	3,74 538,16	2,54 465,93	8,42 832,85	19,85 925,94	651.210,31	2.992.016,57
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,61 294,01	-0,64 -91,96	-0,30 -54,26	2,51 248,25	5,42 252,60	2.330.187,95	-1.963.846,03
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,11 53,75	0,35 50,05	0,26 47,37	0,72 70,75	1,99 92,90	58.844,65	182.822,46
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	0,11 53,94	-1,50 -215,89	-1,42 -260,17	-1,25 -124,06	-4,53 -211,43	3.977,59	-54.091,89
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	4,09 2,15	2,47 2,57	4,93 1,61	23,10 -3,45	44,40 -3,29	4.436.232,14	2.719.851,93
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,39 -2,33	-1,61 -1,51	-1,24 -4,56	-2,37 -28,92	-4,60 -52,29	-897,74	-3.718,77
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,15 -2,09	-0,62 -0,52	-0,43 -3,75	-1,27 -27,81	-40,57 -88,25	-2.598,98	-10.899,26
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,91 -1,03	-0,38 -0,27	1,09 -2,24	2,03 -24,52	7,84 -39,85	58.158,13	20.784,20
Artigo 9º A, II % do CDI	0,62 296,51	14,81 2.132,46	8,04 1.477,65			-786.645,75	-47.189,12
HORTOLÂNDIA (Total)						6.748.468,30	3.835.730,09

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150545	16.409.086,76	0,00	0,00	0,00	16.473.916,26	64.829,50	-702.144,07
NTN-B 150824	35.383.275,10	0,00	0,00	0,00	35.916.448,56	533.173,46	5.686,05
NTN-C 010421	44.899.850,43	0,00	-44.953.057,78	0,00	0,00	53.207,35	3.688.474,59
					52.390.364,82	0,00	0,00

Artigo 7º I, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	47.565.975,45	0,00	0,00	0,00	47.861.580,48	295.605,03	-613.908,65
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	70.351.769,20	0,00	0,00	0,00	70.808.131,99	456.362,79	-1.608.067,37
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	68.910.725,66	51.420.000,00	-27.444.000,00	0,00	93.115.697,03	228.971,37	268.889,76
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	66.003.650,04	50.000,00	0,00	0,00	66.726.161,23	672.511,19	650.307,49
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	43.420.609,36	0,00	0,00	0,00	43.757.782,31	337.172,95	-907.061,46
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	51.098.608,71	0,00	0,00	0,00	51.438.173,33	339.564,62	245.994,20
					373.707.526,37	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRA1 FI RENDA FIXA	536.371,31	0,00	0,00	0,00	536.765,09	393,78	-6.213,10
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	1.121.935,51	0,00	0,00	0,00	1.119.140,89	-2.794,62	1.926,60
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	47.317.740,48	0,00	0,00	0,00	47.368.576,50	50.836,02	210.533,16
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.713.301,69	0,00	0,00	0,00	3.723.711,16	10.409,47	-23.424,20
					52.748.193,64	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 PREMIUM	1.760.282,79	0,00	0,00	0,00	1.758.622,92	-1.659,87	-12.269,54
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1.788.402,06	0,00	0,00	0,00	1.794.039,52	5.637,46	-41.822,35
					3.552.662,44	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST ACOES FIC FIA	27.848.930,28	0,00	0,00	0,00	29.190.668,22	1.341.737,94	436.935,79
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	23.299.847,73	0,00	0,00	0,00	24.914.944,83	1.615.097,10	1.522.423,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	28.681.000,35	0,00	0,00	0,00	29.213.217,71	532.217,36	-497.527,75
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	28.593.056,69	0,00	0,00	0,00	29.540.236,43	947.179,74	1.258.019,93
					112.859.067,19	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	227.484,55	0,00	0,00	0,00	226.586,81	-897,74	-3.718,77
					226.586,81	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	1.525.517,32	0,00	0,00	0,00	1.523.942,08	-1.575,24	-7.109,25
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS	23,50	0,00	0,00	0,00	27,16	3,66	-78,76
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	215.328,20	0,00	0,00	0,00	214.300,80	-1.027,40	-3.711,25
					1.738.270,04	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\$)
BRCR11	266.172,00	0,00	0,00	0,00	1.493,16	277.403,16	12.724,32	-4.381,27
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	2.214.000,00	0,00	0,00	0,00	17.000,00	2.181.000,00	-16.000,00	-107.000,00
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	1.921.566,10	0,00	0,00	0,00	0,00	1.988.905,26	67.339,16	159.140,86
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	2.019.215,92	0,00	0,00	0,00	0,00	2.013.310,57	-5.905,35	-26.975,39
						6.460.618,99	0,00	0,00

Artigo 9º A, II

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	0,00	15.000.000,00	0,00	0,00	14.394.490,38	-605.509,62	-605.509,62

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	5.979.795,81	9.000.000,00	0,00	0,00	14.798.659,68	-181.136,13	558.320,50
					29.193.150,06	0,00	0,00

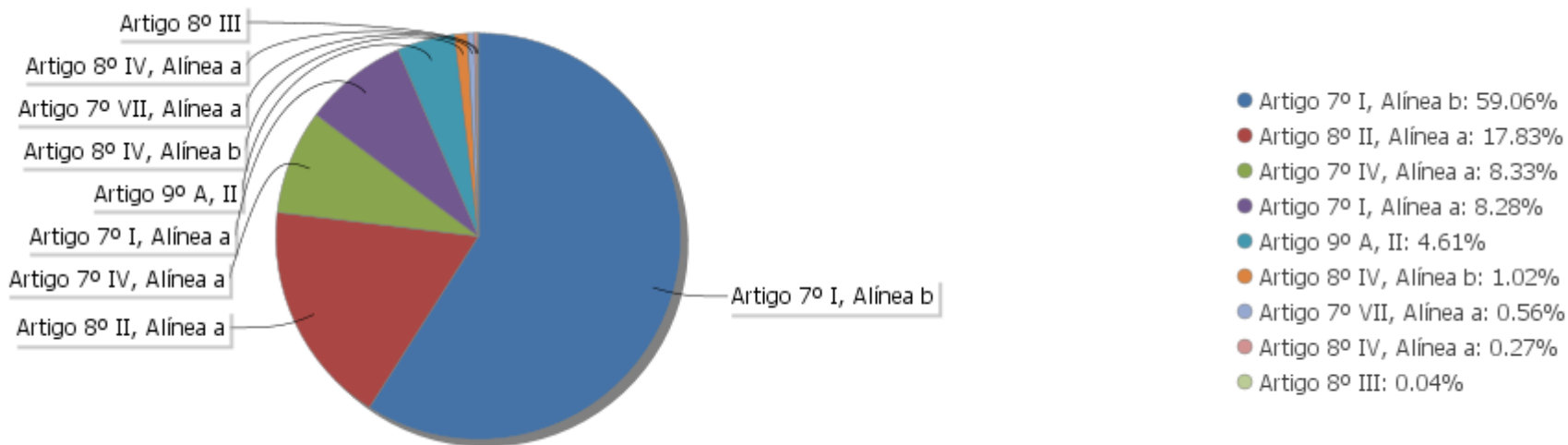
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

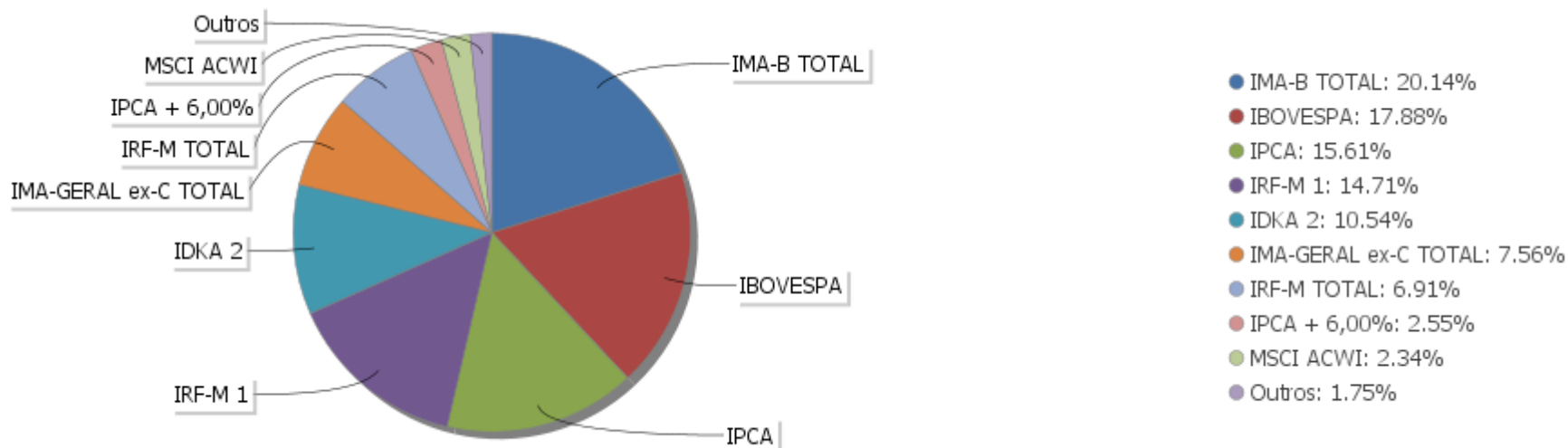
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	537.588.966,62	84,94	537.588.966,62	84,94
de 31 a 365 dias	31.334.275,95	4,95	568.923.242,57	89,89
acima de 365 dias	63.953.197,79	10,11	632.876.440,36	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

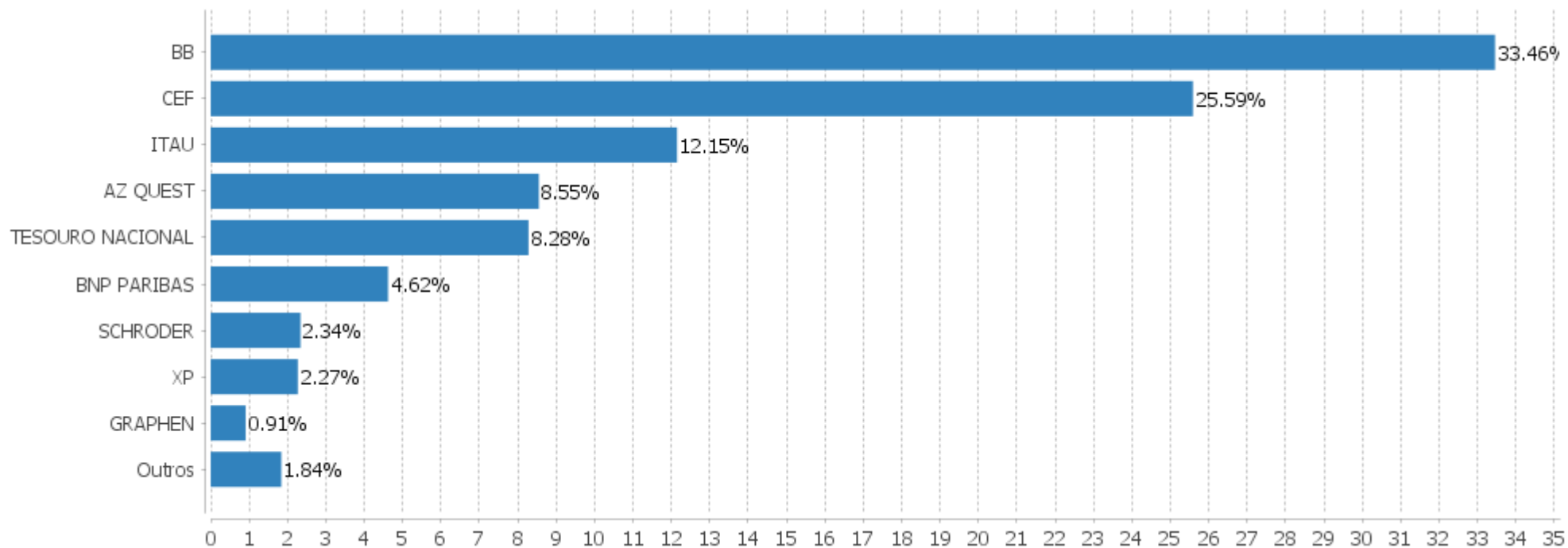


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

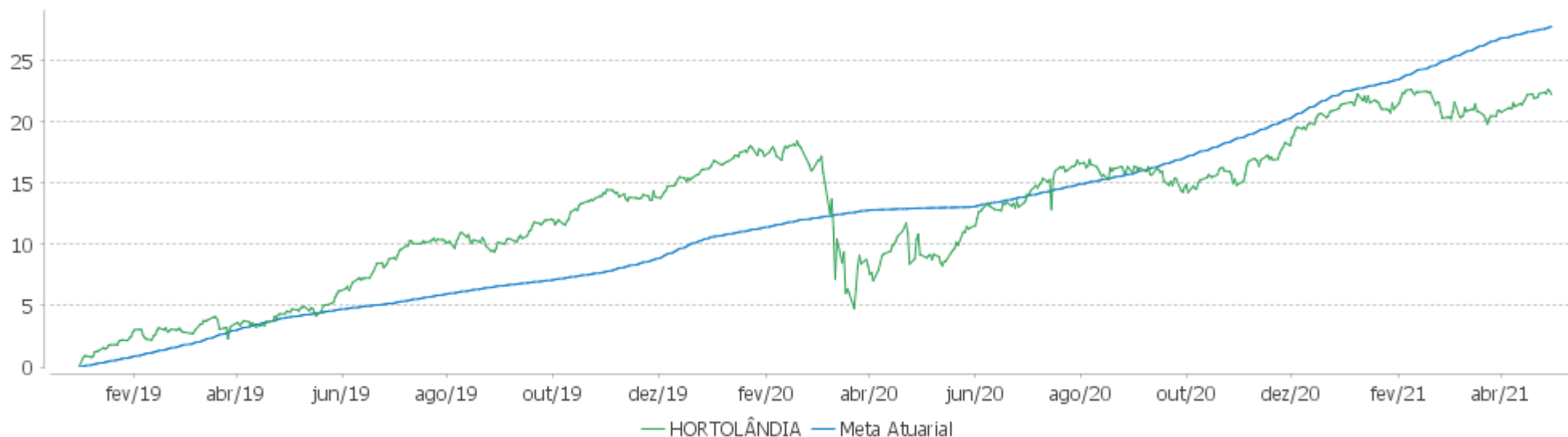
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,37	-0,60	0,51	1,09									0,63
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,42	0,73									4,12
p.p. indexador	-1,04	-1,84	-0,90	0,36									-3,49
2020	0,74	-0,95	-6,76	0,85	2,01	1,95	2,67	-0,62	-1,01	0,15	2,81	2,88	4,40
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	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

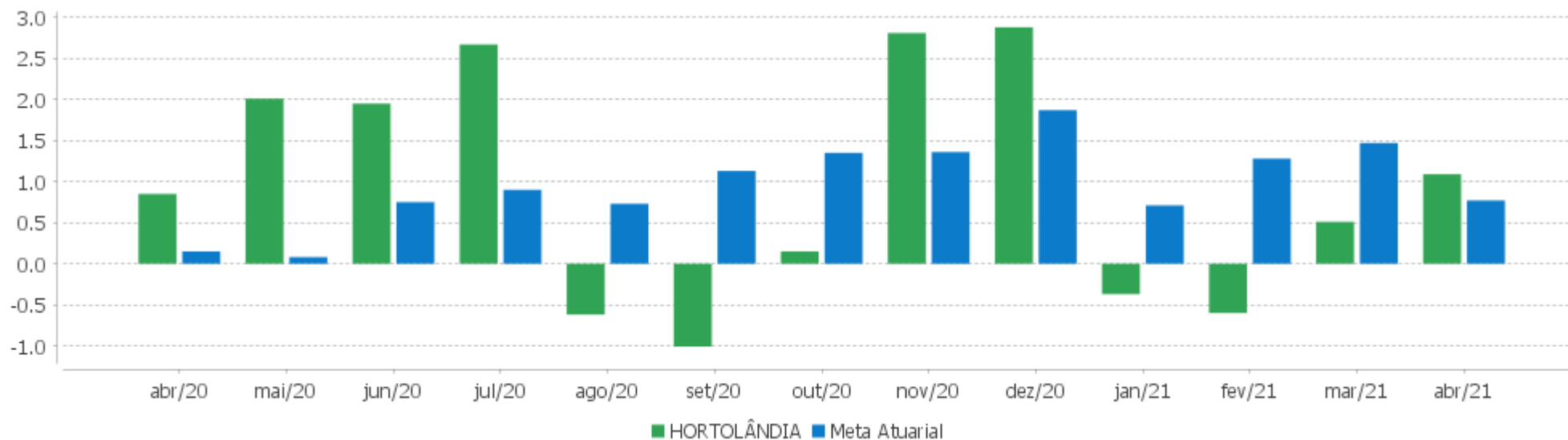
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	16	57,14	03 meses	1,00	3,42	-2,43	4,81
Meses abaixo - Meta Atuarial	12	42,86	06 meses	6,43	7,48	-1,04	4,53
			12 meses	11,97	12,82	-0,85	5,63
			24 meses	16,92	22,43	-5,52	7,55
Maior rentabilidade da Carteira	2,88	2020-12	Desde 31/12/2018	22,23	27,38	-5,15	7,14
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 150824 Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,51 0,86	0,01 2,19	0,16 1,49	4,19 -0,44	9,55 -0,11	22,28 2,81	36,27 -1,81
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,40 -0,26	-4,09 -1,92	-2,57 -1,24	6,17 1,54	11,17 1,51	20,03 0,56	43,58 5,50
NTN-C 010421 Var. IGPM p.p.							
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	0,00 0,00	-96,39 -1.294,21	-98,68 -691,82
FIDC PREMIUM % do CDI	-0,09 -45,38	-0,69 -99,73	-0,49 -89,89	-0,99 -98,08	-4,39 -204,87	-12,45 -167,23	-16,67 -116,89
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	0,00 0,00	-96,39 -1.294,21	-98,59 -691,23
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	0,00 0,00	-96,39 -1.294,21	-98,51 -690,67
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	0,32 151,70	-2,28 -327,93	-2,31 -424,04	-1,51 -149,38	-4,67 -217,83	-10,32 -138,55	1.117,70 7.836,21
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,62 0,13	-1,27 -0,11	-0,72 0,00	1,94 0,29	4,05 0,23	12,99 0,52	24,29 0,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,66 0,35	0,48 -1,89	0,46 -1,66	2,64 -2,03	4,63 -2,13	18,72 9,40	30,38 15,66
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,24 -0,03	0,30 -0,11	0,26 -0,09	0,81 -0,13	1,94 -0,39	8,38 -0,71	15,39 -0,98
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,02 -0,33	0,99 -0,31	0,86 -0,30	3,91 -0,44	9,09 -0,32	17,10 -1,74	27,65 -2,37
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,65 -0,00	-2,22 -0,05	-1,37 -0,04	4,55 -0,08	9,38 -0,28	18,91 -0,55	37,07 -1,01
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,78 -0,06	-2,03 -0,05	-1,27 -0,08	0,22 -0,08	1,72 -0,22	13,32 -0,54	23,66 -0,78
BRA1 FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,07 -0,58	-1,04 1,13	-0,74 0,59	-0,13 -4,76	5,69 -3,97	-68,69 -88,15	-66,11 -104,19
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,11 -0,20	0,45 -1,92	0,31 -1,80	0,75 -3,92	2,02 -4,74	11,39 2,07	20,76 6,04
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,28	-0,63	-0,35	0,90	1,71	4,06	-15,67

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.	-0,37	1,55	0,99	-3,73	-7,95	-15,40	-53,75
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-0,25 -1,12	0,17 -0,55	0,51 -0,10	-1,03 -4,95	-0,42 -9,34	-18,09 -36,45	-13,02 -43,14
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	1,86 -0,08	-1,67 -1,57	1,62 -1,70	22,15 -4,40	40,22 -7,46	23,35 -0,04	43,46 5,39
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,82 2,88	1,52 1,62	4,27 0,95	19,30 -7,24	42,56 -5,12	18,55 -4,84	32,13 -5,93
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	6,93 4,99	6,51 6,61	8,59 5,26	27,10 0,56	48,64 0,96	48,11 24,71	69,17 31,11
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	3,31 1,37	4,45 4,55	6,00 2,67	24,65 -1,89	47,13 -0,56	33,10 9,71	51,64 13,58
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V % do CDI	-0,39 -189,91	-1,61 -232,43	-1,24 -227,06	-2,37 -234,78	-4,57 -213,31	-1,34 -18,04	-94,83 -664,85
BRCR11 Var. IBOVESPA p.p.	4,80 2,87	-1,54 -1,43	-3,35 -6,68	2,14 -24,41	-1,50 -49,18	3,58 -19,81	5,37 -32,69
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII Var. IFIX p.p.	-0,29 -0,80	-1,32 -1,01	-1,17 -0,53	-1,99 -5,41	-0,94 -10,83	-12,53 -26,59	-20,05 -42,47
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII % do CDI	-0,73 -353,29	-4,62 -664,45	-1,80 -330,49	-5,31 -524,77	-2,01 -93,95	-89,59 -1.202,99	-88,70 -621,87
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII Var. IFIX p.p.	3,50 3,00	1,23 1,54	2,82 3,45	8,20 4,79	20,75 10,86	8,93 -5,13	18,52 -3,90
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,48 -1,25	-1,70 -6,01	-1,25 -4,81	-4,49 -12,19	-84,45 -97,56	-97,05 -119,85	-97,03 -133,57
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,10 -0,88	-0,46 -4,77	-0,31 -3,87	-0,77 -8,47	-1,78 -14,90	-21,52 -44,32	-21,76 -58,30
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS % do CDI	15,55 7.485,72	-74,35 -10.703,33	-65,50 -12.031,80	-92,35 -9.134,13	-40,05 -1.868,33	-79,39 -1.066,01	-99,20 -695,46
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	1,24 2,37	15,52 2,60	8,71 0,99	21,49 2,24			
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	2,55 1,77	9,29 4,99	4,78 1,22	13,42 5,73	56,51 43,39		
HORTOLÂNDIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,09 0,32	0,63 -3,67	1,00 -2,57	6,43 -1,26	11,97 -1,14	16,92 -5,89	
CDI	0,21	0,69	0,54	1,01	2,14	7,45	14,26
IBOVESPA	1,94	-0,10	3,33	26,55	47,68	23,39	38,06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
INPC + 6,00%	0,85	4,28	3,52	7,85	13,99	23,83	37,86
IPCA + 6,00%	0,77	4,30	3,56	7,69	13,11	22,80	36,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,27	0,40	0,36	0,94	2,33	9,09	16,37
IRF-M 1+	1,12	-3,70	-2,35	-0,31	1,43	15,56	27,60
IRF-M TOTAL	0,84	-1,98	-1,19	0,30	1,94	13,86	24,44
IMA-B 5	0,87	0,72	0,62	3,92	8,92	18,36	30,12
IMA-B 5+	0,45	-4,67	-3,03	5,14	10,30	19,64	43,74
IMA-B TOTAL	0,65	-2,17	-1,33	4,63	9,66	19,46	38,08
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,49	-1,16	-0,72	1,64	3,81	12,47	23,58
IMA-GERAL TOTAL	0,51	-0,82	-0,58	1,93	4,62	13,48	24,94
IDKA 2	1,35	1,30	1,16	4,35	9,41	18,84	30,03
IDKA 20	0,37	-6,86	-4,17	7,21	13,61	19,99	56,00
CDI	0,21	0,69	0,54	1,01	2,14	7,45	14,26
Renda Variável							
IBOVESPA	1,94	-0,10	3,33	26,55	47,68	23,39	38,06
IBRX 100	2,84	2,09	5,28	28,66	51,24	28,38	44,99
IBRX 50	2,90	2,08	5,01	29,80	53,43	25,21	38,51
SMALL CAP	4,38	3,46	7,14	29,74	55,90	48,74	65,09
IFIX	0,51	-0,31	-0,64	3,41	9,89	14,06	22,42
Índice Consumo - ICON	0,76	-3,61	-2,36	10,24	29,24	30,56	42,01
Índice Dividendos - IDIV	2,03	-1,25	4,03	23,07	37,02	27,18	51,25
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,31	2,37	2,11	4,67	6,76	9,32	14,72
INPC	0,38	2,35	2,07	4,83	7,59	10,24	15,83
IGPM	1,51	9,89	7,13	14,58	32,02	40,84	53,01
SELIC	0,21	0,69	0,54	1,01	2,14	7,45	14,27
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

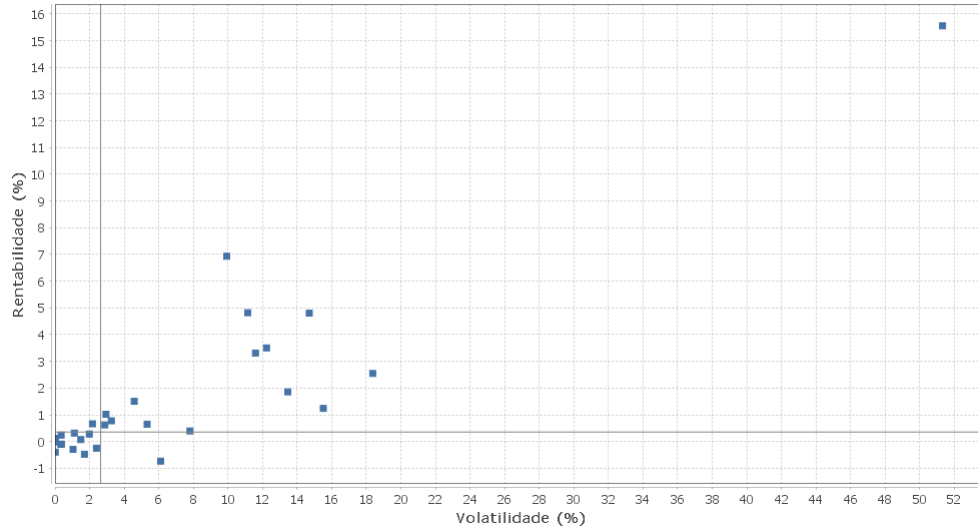
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
15	01/04/2021	NTN-C 010421	0,00	44.953.057,78	7.928,00000000	5.670,1636950467
20	06/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	44.950.000,00	0,00	16.482.800,62840700	2,7270851000
24	12/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	24.000.000,00	8.800.228,61937900	2,7272018760
21	13/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	5.260.000,00	0,00	1.929.032,17235200	2,7267559740
22	13/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	190.000,00	0,00	69.679,86934300	2,7267559740
26	13/04/2021	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	15.000.000,00	0,00	66.868,04304741	224,3224015000
27	13/04/2021	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	9.000.000,00	0,00	6.794.493,74227120	1,3246020000
16	13/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	420.000,00	0,00	154.029,18486400	2,7267559740
19	19/04/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	50.000,00	0,00	20.717,16184800	2,4134580000
25	29/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	3.340.000,00	1.222.010,07911800	2,7332016790
18	29/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	104.000,00	38.050,61324200	2,7332016790
23	30/04/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	600.000,00	0,00	219.524,87439600	2,7331754620
Total						

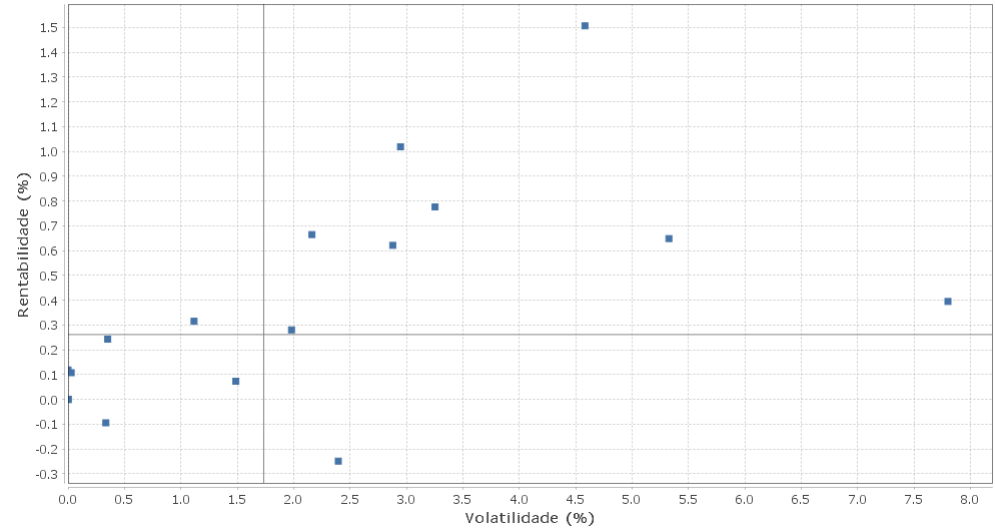
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

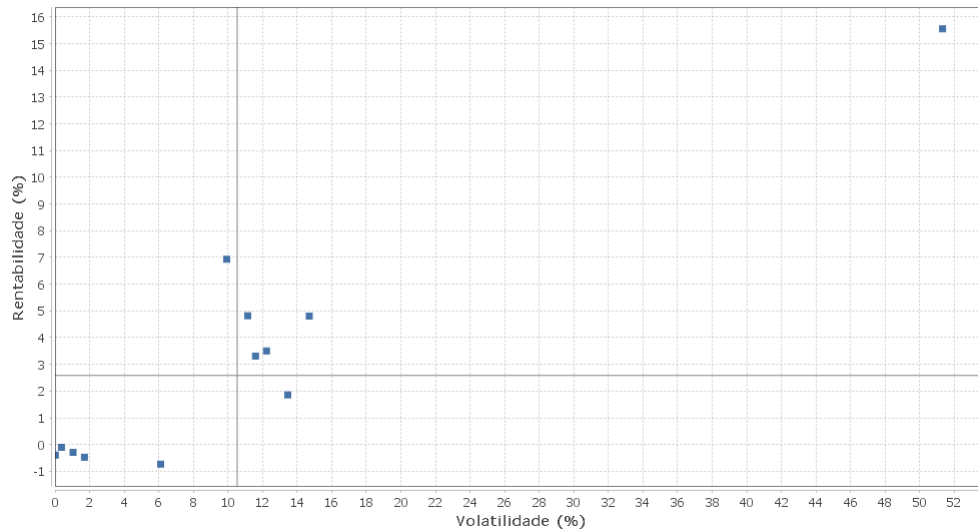
HORTOLÂNDIA - No Mês



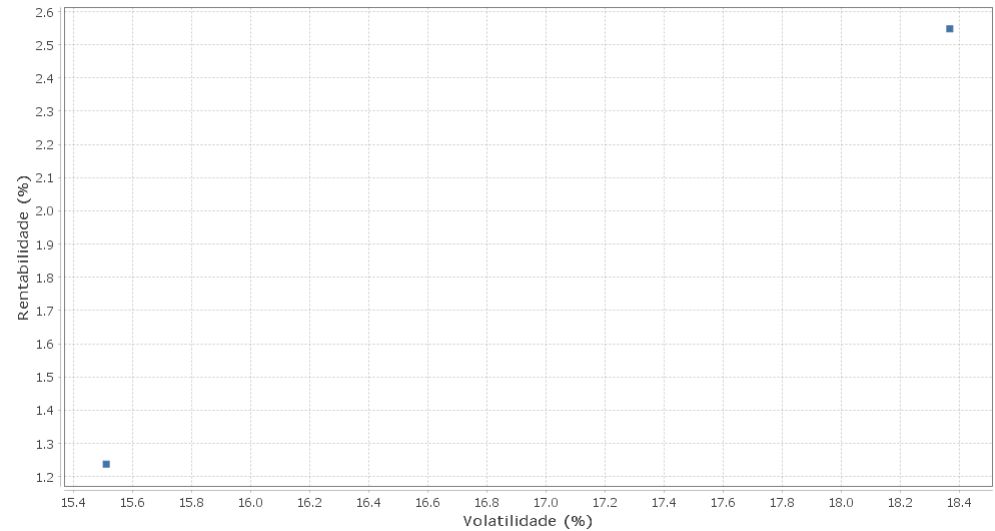
Renda Fixa - No Mês



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\$): 13.759.012,58

Value-At-Risk: 2,17%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-C 010421	Artigo 7º I, Alínea a	0,00	NaN	0,00	0,00	0,12	0,00	0,00
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
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	Artigo 8º III	0,02	0,03	-0,00	-35,98	-0,39	226.586,81	0,04
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	0,00	-3,67	0,11	47.368.576,50	7,48
FIDC PREMIUM	Artigo 7º VII, Alínea a	0,33	0,04	0,00	-0,90	-0,09	1.758.622,92	0,28
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,35	0,15	0,01	0,10	0,24	93.115.697,03	14,71
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	Artigo 8º IV, Alínea a	0,37	0,03	0,00	-0,85	-0,10	1.523.942,08	0,24
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	Artigo 8º IV, Alínea b	1,04	0,07	0,00	-0,48	-0,29	2.013.310,57	0,32
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	Artigo 7º VII, Alínea a	1,12	0,08	0,00	0,10	0,32	1.794.039,52	0,28
BRA1 FI RENDA FIXA	Artigo 7º IV, Alínea a	1,49	0,77	0,00	-0,09	0,07	536.765,09	0,08
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	Artigo 8º IV, Alínea a	1,70	0,19	0,00	-0,40	-0,48	214.300,80	0,03
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	Artigo 7º IV, Alínea a	1,98	0,66	0,00	0,04	0,28	3.723.711,16	0,59
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,16	1,14	0,06	0,21	0,66	51.438.173,33	8,13
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	2,40	1,73	0,00	-0,19	-0,25	1.119.140,89	0,18
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,88	1,39	0,07	0,14	0,62	47.861.580,48	7,56
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,95	1,44	0,10	0,28	1,02	66.726.161,23	10,54
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,25	1,44	0,06	0,17	0,78	43.757.782,31	6,91
NTN-B 150824	Artigo 7º I, Alínea a	4,58	2,00	0,07	0,28	1,51	35.916.448,56	5,68
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,33	2,90	0,20	0,08	0,65	70.808.131,99	11,19
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	Artigo 8º IV, Alínea b	6,11	0,41	0,00	-0,15	-0,73	2.181.000,00	0,34
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	7,80	4,80	0,07	0,02	0,40	16.473.916,26	2,60
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	9,92	12,18	0,41	0,68	6,93	24.914.944,83	3,94
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	11,14	9,37	0,39	0,41	4,82	29.190.668,22	4,61
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	11,59	8,73	0,36	0,27	3,31	29.540.236,43	4,67
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	Artigo 8º IV, Alínea b	12,23	0,29	0,00	0,27	3,50	1.988.905,26	0,31
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	13,46	8,67	0,36	0,12	1,86	29.213.217,71	4,62

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRCR11	Artigo 8º IV, Alínea b	14,70	2,55	-0,00	0,31	4,80	277.403,16	0,04
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	Artigo 9º A, II	15,51	9,39	-0,01	0,07	1,24	14.798.659,68	2,34
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	18,37	12,81	0,01	0,13	2,55	14.394.490,38	2,27
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS	Artigo 8º IV, Alínea a	51,32	11,41	0,00	0,30	15,55	27,16	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de abril 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 BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP (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 18,52% 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;