



LDB
EMPRESAS

HORTOLÂNDIA
MARÇO 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 31.03.2021.

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 80,29%

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	5,26	0,09	-1,47	35.383.275,10	5,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	13,57	-1,11	-4,47	16.409.086,76	2,63
TESOURO NACIONAL	NTN-C 010421	2,15	2,64	8,81	44.899.850,43	7,21
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		4,44	1,05	2,46	96.692.212,29	15,52

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	0,45	0,02	0,05	68.910.725,66	11,06	7.884.684.396,22	0,87
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	7,89	-0,48	-2,85	70.351.769,20	11,29	7.644.309.269,72	0,92
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,74	0,37	-0,02	66.003.650,04	10,59	10.861.361.928,62	0,61
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,14	-0,89	-2,79	43.420.609,36	6,97	1.953.428.365,60	2,22
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	4,08	-0,42	-1,88	47.565.975,45	7,63	9.507.617.903,00	0,50
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,78	0,30	-0,18	51.098.608,71	8,20	15.491.489.347,05	0,33
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b		3,71	-0,14	-1,24	347.351.338,42	55,75			

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	8,88	-0,13	-1,12	536.371,31	0,09	12.860.151,99	4,17
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,65	0,14	0,34	47.317.740,48	7,59	3.580.849.195,10	1,32
VERITAS	RJI	FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	30,86	0,62	0,42	1.121.935,51	0,18	171.057.623,65	0,66
GRAPHEN	RJI	LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	18,90	-0,31	-0,90	3.713.301,69	0,60	70.358.563,74	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			2,26	0,12	0,24	52.689.348,99	8,46		
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	3,67	0,08	-2,59	1.788.402,06	0,29	70.804.484,24	2,53
FINAXIS	FINAXIS	FIDC PREMIUM	11,23	-0,20	-0,60	1.760.282,79	0,28	81.898.860,94	2,15
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	-0,06	-1,61	3.548.684,85	0,57		
Renda Fixa			3,56	0,11	-0,39	500.281.584,55	80,29		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

18,75%

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	25,56	1,92	-3,15	27.848.930,28	4,47	745.741.603,95	3,73
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	26,23	0,73	-0,40	23.299.847,73	3,74	1.471.825.306,87	1,58
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	25,44	4,45	-3,47	28.681.000,35	4,60	308.858.985,72	9,29
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	26,61	2,12	1,10	28.593.056,69	4,59	3.385.715.282,16	0,84
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			25,20	2,37	-1,56	108.422.835,05	17,40		

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	-0,47	-1,22	227.484,55	0,04	1.611.045,87	14,12
Sub-total Artigo 8º III			0,35	-0,47	-1,22	227.484,55	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	245,28	-0,44	-1,23	215.328,20	0,03	7.909.558,59	2,72
VALORA	BEM	FIP BRASIL ÓLEO & GÁS	267,76	-56,36	-77,76	23,50	0,00	5.876,23	0,40
QUELUZ	BNY MELLON	BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	19,07	-0,11	-0,36	1.525.517,32	0,24	28.150.124,51	5,42
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			118,47	-0,15	-0,47	1.740.869,02	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	25,48	0,54	-3,91	2.214.000,00	0,36	1.221.784.872,82	0,18
QUELUZ	PLANNER	VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	36,05	-4,42	-2,20	1.921.566,10	0,31	31.376.185,18	6,12
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BRCR11	11,87	-5,13	-6,05	266.172,00	0,04	2.871.280.443,66	0,01
AQUILLA	ÍNDIGO	ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	2,15	-0,64	-1,03	2.019.215,92	0,32	181.485.441,09	1,11
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			15,62	-0,54	-1,27	6.420.954,02	1,03		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	31,31	2,19	-1,48	116.812.142,64	18,75
---	-------	------	-------	----------------	-------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,96%

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	23,36	1,94	14,11	5.979.795,81	0,96	179.286.951,95	3,34
Sub-total Artigo 9º A, II			23,36	1,94	14,11	5.979.795,81	0,96		
Investimentos no Exterior			20,88	1,94	14,11	5.979.795,81	0,96		
Total			6,65	0,51	-0,46	623.073.523,00	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	96.692.212,29	15,52	5,00	10,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	347.351.338,42	55,75	10,00	52,50	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	52.689.348,99	8,46	0,00	10,00	40,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	3.548.684,85	0,57	0,00	0,50	3,00	5,00
	Total Renda Fixa	500.281.584,55	80,29				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	108.422.835,05	17,40	5,00	17,50	20,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	227.484,55	0,04	0,00	0,50	5,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	1.740.869,02	0,28	0,00	1,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	6.420.954,02	1,03	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	116.812.142,64	18,75				35,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	5.979.795,81	0,96	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	5.979.795,81	0,96				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

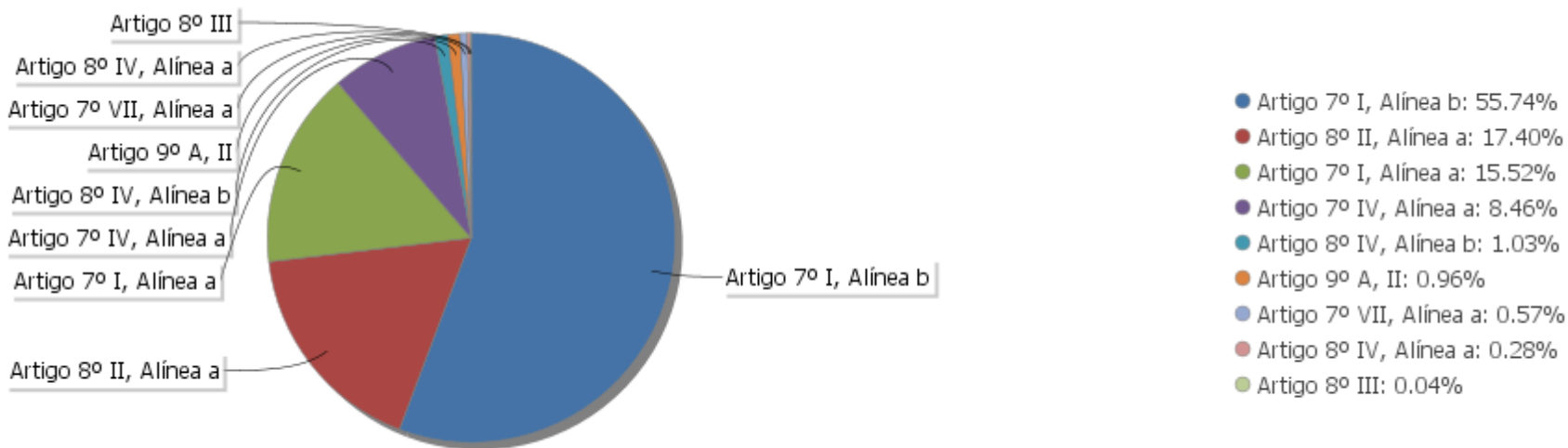
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,05 521,69	2,46 506,71	2,46 506,71	8,61 897,28	19,65 884,07	1.003.821,24	2.340.806,26
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,14 -71,00	-1,24 -255,66	-1,24 -255,66	1,90 197,70	5,70 256,27	-520.721,18	-4.294.033,98
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,12 59,61	0,24 48,52	0,24 48,52	0,75 78,38	1,94 87,33	63.094,95	123.977,81
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-0,06 -29,18	-1,61 -331,36	-1,61 -331,36	-1,29 -134,91	-4,85 -218,13	-2.083,66	-58.069,48
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	2,37 -3,63	-1,56 0,44	-1,56 0,44	17,31 -5,97	54,23 -5,50	2.511.211,45	-1.716.380,21
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,47 -6,47	-1,22 0,78	-1,22 0,78	-2,38 -25,67	-4,54 -64,27	-1.080,11	-2.821,03
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,15 -6,15	-0,47 1,53	-0,47 1,53	-1,31 -24,60	-79,62 -139,35	-2.605,88	-8.300,28
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-0,54 -6,54	-1,27 0,73	-1,27 0,73	4,08 -19,21	6,11 -53,62	15.130,52	-37.373,93
Artigo 9º A, II % do CDI	1,94 962,40	14,11 2.904,17	14,11 2.904,17			113.528,32	739.456,63
HORTOLÂNDIA (Total)						3.180.295,65	-2.912.738,21

Análise de Liquidez

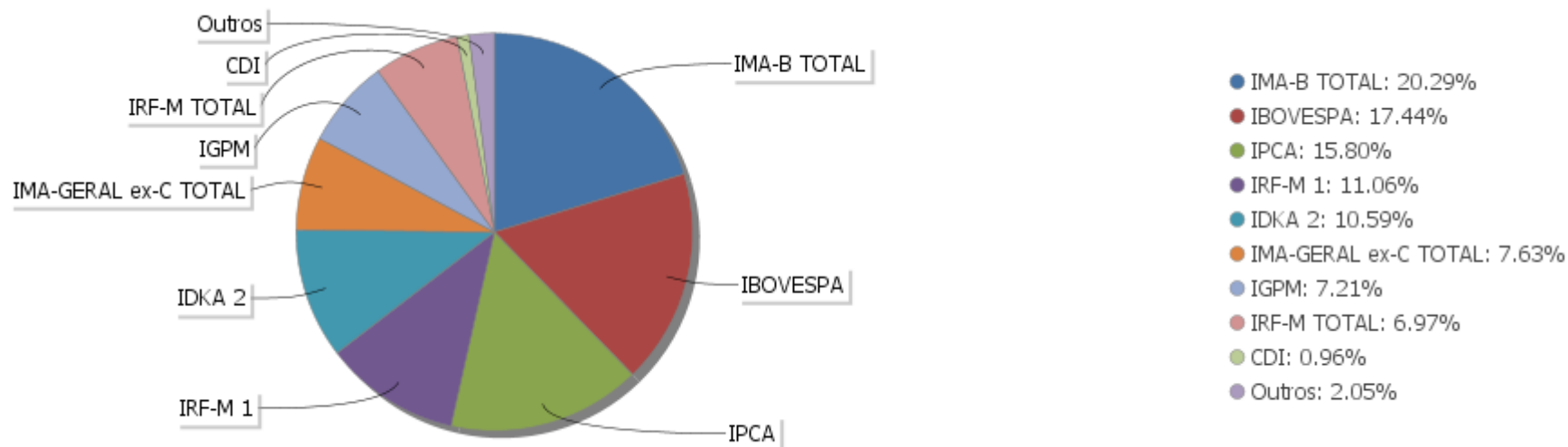
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	529.373.311,86	84,96	529.373.311,86	84,96
de 31 a 365 dias	30.381.458,75	4,88	559.754.770,61	89,84
acima de 365 dias	63.318.752,39	10,16	623.073.523,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

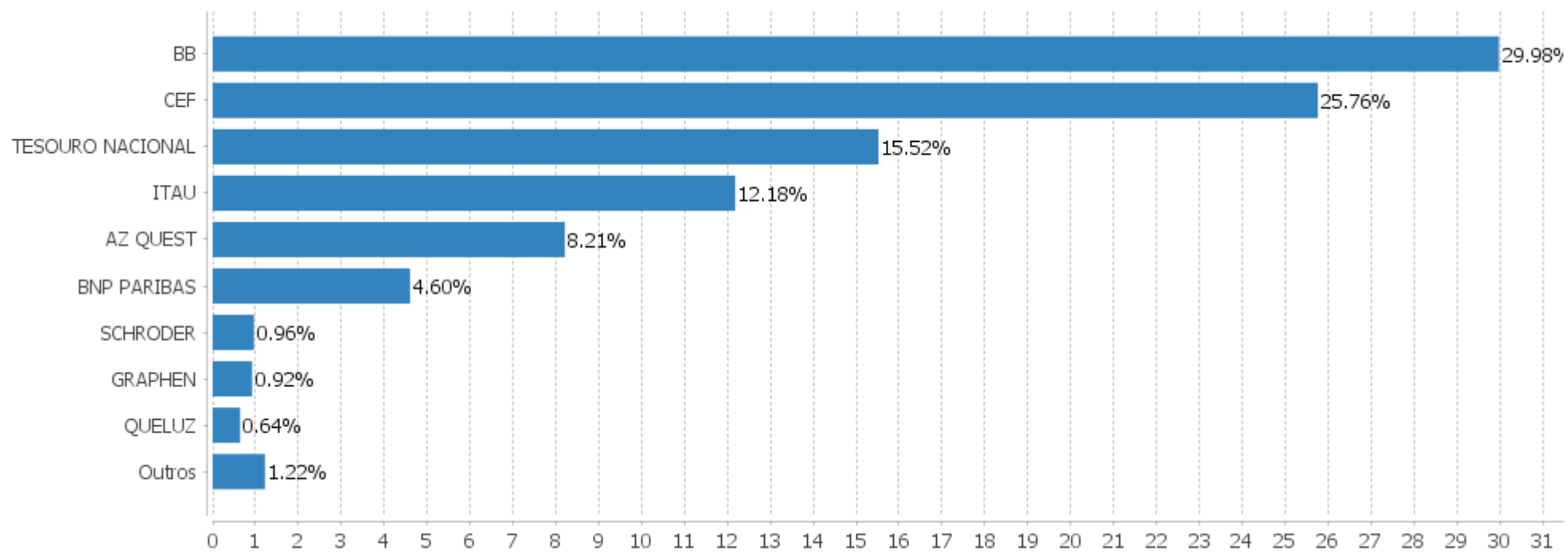


Alocação Por Estratégia



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										-0,46
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,42										3,36
p.p. indexador	-1,04	-1,84	-0,90										-3,82
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

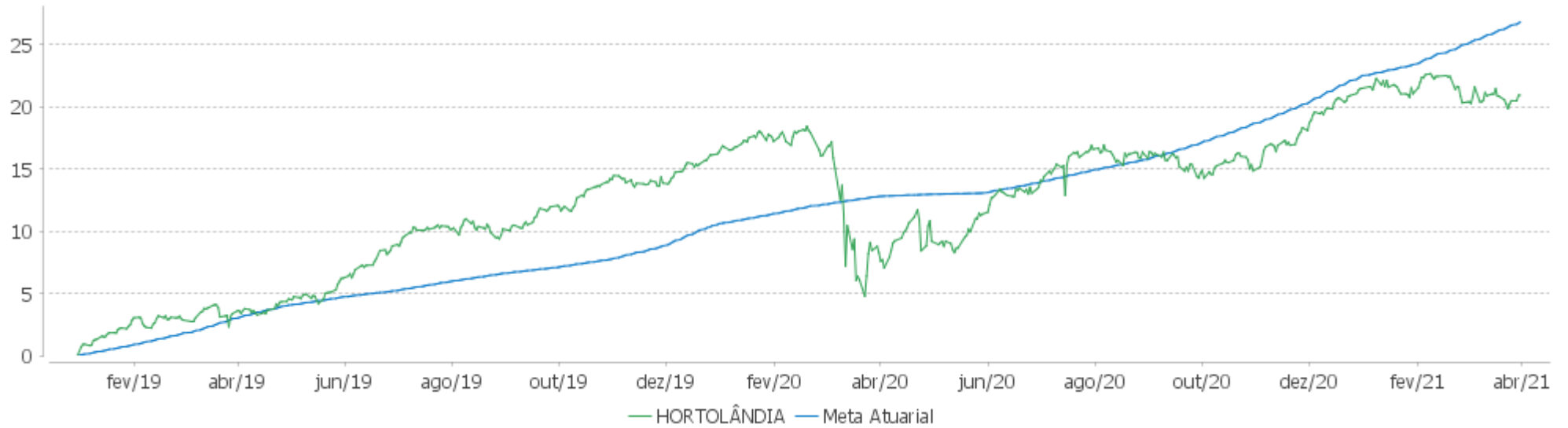
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

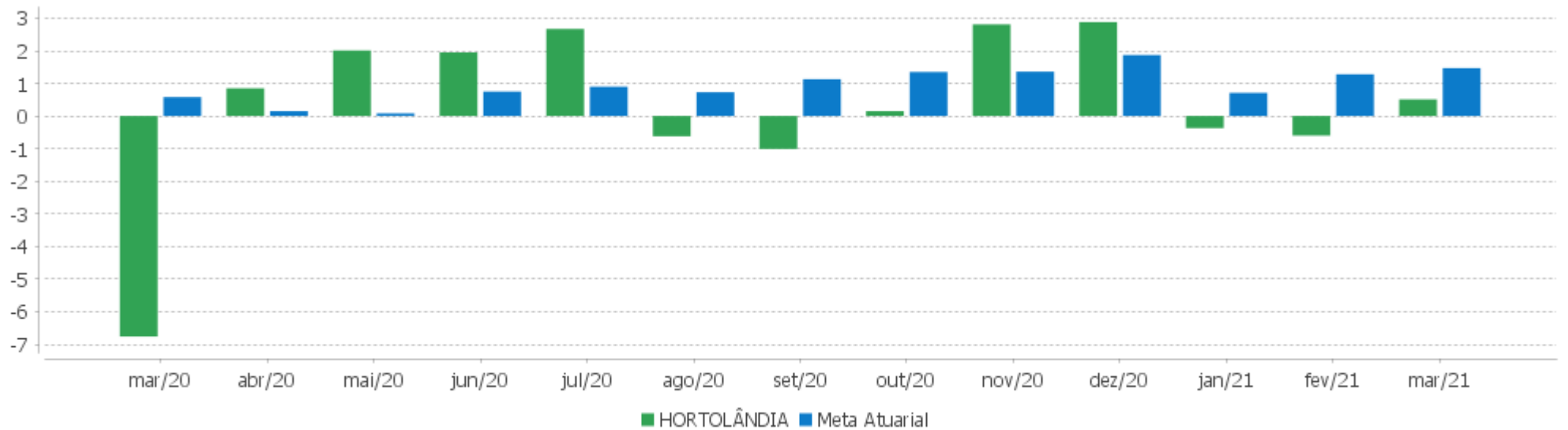
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	15	55,56	03 meses	-0,46	3,36	-3,82	5,27
Meses abaixo da Meta Atuarial	12	44,44	06 meses	5,44	8,13	-2,69	4,76
			12 meses	11,70	12,16	-0,46	6,65
			24 meses	17,00	22,83	-5,84	7,54
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,88	2020-12	Desde 31/12/2018	20,91	26,46	-5,54	7,25
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
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,42 -0,04	-1,88 -0,24	-1,88 -0,24	1,24 0,09	4,35 0,17	13,27 0,41	23,79 0,44
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,02 -0,03	0,05 -0,07	0,05 -0,07	0,68 -0,15	2,12 -0,39	8,66 -0,68	15,66 -0,98
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,30 -0,63	-0,18 -2,24	-0,18 -2,24	1,85 -3,39	5,09 -1,01	19,24 9,64	29,94 15,33
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,37 0,08	-0,02 0,02	-0,02 0,02	3,02 0,02	8,45 -0,13	17,15 -1,31	27,36 -2,00
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,48 -0,02	-2,85 -0,05	-2,85 -0,05	4,08 -0,09	10,09 -0,30	19,91 -0,56	35,98 -1,01
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,89 -0,04	-2,79 0,01	-2,79 0,01	-0,91 -0,04	2,08 -0,17	13,08 -0,51	23,14 -0,84
NTN-B 150824 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,09 0,55	-1,47 1,34	-1,47 1,34	2,47 -1,70	8,70 -1,69	21,91 1,44	33,88 -3,11
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,11 -0,64	-4,47 -1,66	-4,47 -1,66	6,08 1,91	13,09 2,70	22,18 1,70	41,85 4,86
NTN-C 010421 Var. IGPM p.p.	2,64 -0,30	8,81 0,55	8,81 0,55	15,16 -1,37	33,18 2,08	47,41 7,38	67,23 15,63
BRA1 FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,13 0,33	-1,12 1,69	-1,12 1,69	-0,83 -5,00	-0,60 -10,98	-68,52 -88,99	-65,87 -102,86
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,14 -0,79	0,34 -1,71	0,34 -1,71	0,72 -4,52	2,06 -4,04	12,01 2,41	21,02 6,40
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,31 0,16	-0,90 1,90	-0,90 1,90	0,43 -3,74	1,77 -8,61	4,68 -15,80	-16,03 -53,03
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,62 0,28	0,42 0,57	0,42 0,57	3,72 0,49	-0,28 -8,78	-18,85 -37,48	-11,59 -41,12
FIDC PREMIUM % do CDI	-0,20 -98,32	-0,60 -123,30	-0,60 -123,30	-1,05 -109,66	-4,47 -201,15	-13,63 -175,22	-16,87 -115,41
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	-96,78 -1.243,94	-98,93 -676,84
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	-96,78 -1.243,94	-98,86 -676,38
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	-96,78	-98,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	-1.243,94	-675,93
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	0,08	-2,59	-2,59	-1,53	-5,22	-7,26	1.113,05
% do CDI	39,06	-532,05	-532,05	-159,65	-234,72	-93,29	7.615,03
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	4,45	-3,47	-3,47	18,38	52,70	24,14	42,56
Var. IBOVESPA p.p.	-1,54	-1,46	-1,46	-4,91	-7,03	1,90	5,93
AZ QUEST ACOES FIC FIA	1,92	-3,15	-3,15	13,11	51,47	15,09	28,48
Var. IBOVESPA p.p.	-4,07	-1,14	-1,14	-10,18	-8,26	-7,15	-8,15
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	0,73	-0,40	-0,40	16,48	54,84	42,03	59,89
Var. IBOVESPA p.p.	-5,27	1,61	1,61	-6,81	-4,89	19,80	23,26
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	2,12	1,10	1,10	21,26	58,11	30,49	51,12
Var. IBOVESPA p.p.	-3,88	3,10	3,10	-2,03	-1,62	8,25	14,50
BRCR11	-5,13	-6,05	-6,05	-6,91	-2,27	-4,53	-2,43
Var. IBOVESPA p.p.	-11,13	-4,05	-4,05	-30,19	-62,00	-26,77	-39,05
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	-0,64	-1,03	-1,03	0,15	-0,78	-12,41	-19,99
Var. IFIX p.p.	0,74	-0,22	-0,22	-1,71	-14,92	-27,07	-40,74
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	0,54	-3,91	-3,91	-3,31	-4,27	-88,99	-88,71
% do CDI	268,07	-804,81	-804,81	-344,95	-192,31	-1.143,76	-606,89
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	-4,42	-2,20	-2,20	10,34	17,13	6,18	14,87
Var. IFIX p.p.	-3,04	-1,39	-1,39	8,48	2,99	-8,47	-5,88
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	-0,47	-1,22	-1,22	-2,38	-4,51	-0,02	-94,77
% do CDI	-235,00	-252,09	-252,09	-248,46	-202,84	-0,28	-648,36
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	-0,44	-1,23	-1,23	-4,46	-97,04	-97,04	-97,02
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,91	-4,73	-4,73	-12,77	-109,45	-120,19	-133,47
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	-0,11	-0,36	-0,36	-0,83	18,87	-21,44	-21,92
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,57	-3,86	-3,86	-9,14	6,45	-44,59	-58,37
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS	-56,43	-77,81	-77,81	-93,87	-63,25	-82,21	-99,30
% do CDI	-28.062,85	-16.013,49	-16.013,49	-9.780,17	-2.845,76	-1.056,58	-679,40
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	1,94	14,11	14,11	22,96			
Var. MSCI ACWI p.p.	-3,62	-0,11	-0,11	2,63			
HORTOLÂNDIA	0,51	-0,46	-0,46	5,44	11,70	17,00	
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,96	-3,96	-3,96	-2,87	-0,71	-6,15	
CDI	0,20	0,49	0,49	0,96	2,22	7,78	14,62
IBOVESPA	6,00	-2,00	-2,00	23,29	59,73	22,24	36,63
INPC + 6,00%	1,40	3,41	3,41	8,43	13,30	24,13	37,66
IPCA + 6,00%	1,47	3,50	3,50	8,31	12,41	23,15	36,45

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	0,13	0,13	0,83	2,51	9,33	16,64
IRF-M 1+	-1,45	-4,77	-4,77	-2,02	1,81	15,01	26,76
IRF-M TOTAL	-0,84	-2,80	-2,80	-0,87	2,25	13,59	23,98
IMA-B 5	0,34	-0,15	-0,15	3,23	8,50	18,63	29,54
IMA-B 5+	-1,17	-5,10	-5,10	4,90	12,01	21,24	42,19
IMA-B TOTAL	-0,46	-2,81	-2,81	4,17	10,39	20,48	36,99
IMA-C TOTAL	-0,72	9,62	9,62	13,61	34,42	51,98	77,98
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,38	-1,64	-1,64	1,15	4,18	12,86	23,35
IMA-GERAL TOTAL	-0,39	-1,32	-1,32	1,50	4,98	13,88	24,71
IDKA 2	0,29	-0,05	-0,05	3,00	8,57	18,47	29,35
IDKA 20	-1,89	-7,21	-7,21	7,55	15,19	22,04	53,40
CDI	0,20	0,49	0,49	0,96	2,22	7,78	14,62
Renda Variável							
IBOVESPA	6,00	-2,00	-2,00	23,29	59,73	22,24	36,63
IBRX 100	6,04	-0,72	-0,72	24,43	62,17	26,16	42,14
IBRX 50	6,08	-0,80	-0,80	25,46	64,73	22,50	35,45
SMALL CAP	4,56	-0,88	-0,88	21,46	64,58	44,87	61,92
IFIX	-1,38	-0,81	-0,81	1,86	14,14	14,65	20,75
Índice Consumo - ICON	2,32	-4,34	-4,34	6,29	50,94	40,41	39,42
Índice Dividendos - IDIV	7,57	-3,21	-3,21	21,41	39,35	28,51	46,14
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,93	2,05	2,05	5,25	6,10	9,60	14,62
INPC	0,86	1,96	1,96	5,36	6,94	10,48	15,64
IGPM	2,94	8,26	8,26	16,52	31,10	40,02	51,60
SELIC	0,20	0,49	0,49	0,96	2,22	7,78	14,62
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

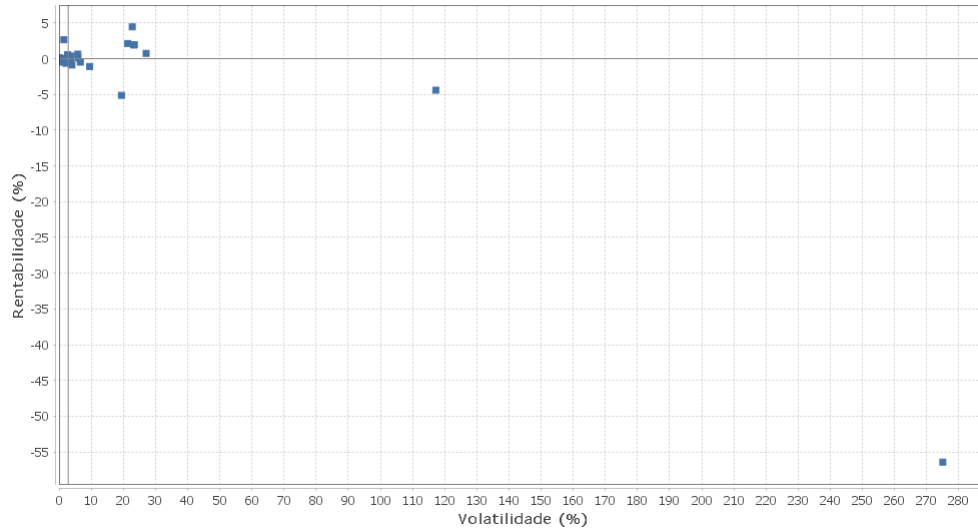
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
10	05/03/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	190.000,00	0,00	69.673,04516800	2,7270230480
11	10/03/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	5.320.000,00	0,00	1.951.480,57971300	2,7261352510
8	10/03/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	400.000,00	0,00	146.727,86313600	2,7261352510
12	22/03/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	540.000,00	0,00	198.240,04674400	2,7239703020
13	30/03/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	2.660.000,00	975.941,74631600	2,7255725150
9	30/03/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	104.000,00	38.157,12090860	2,7255725150

Total

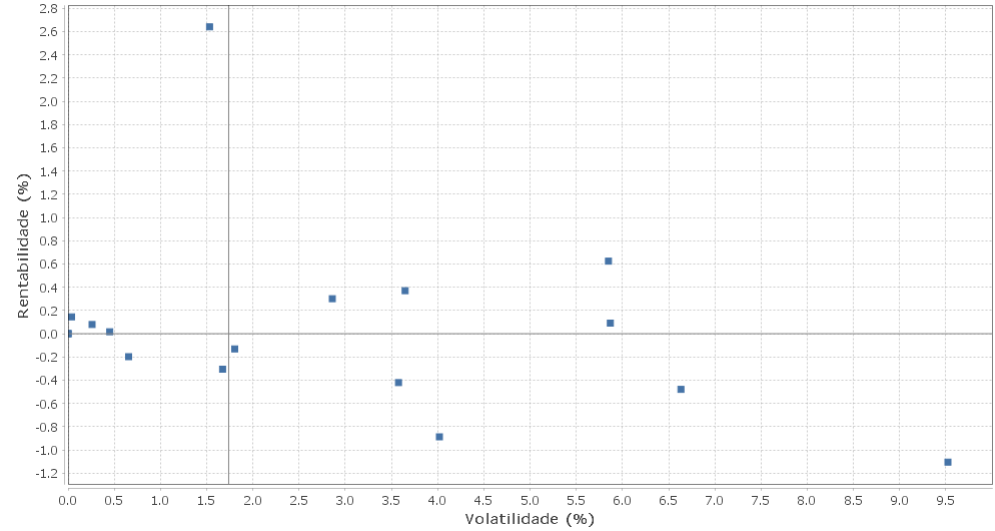
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

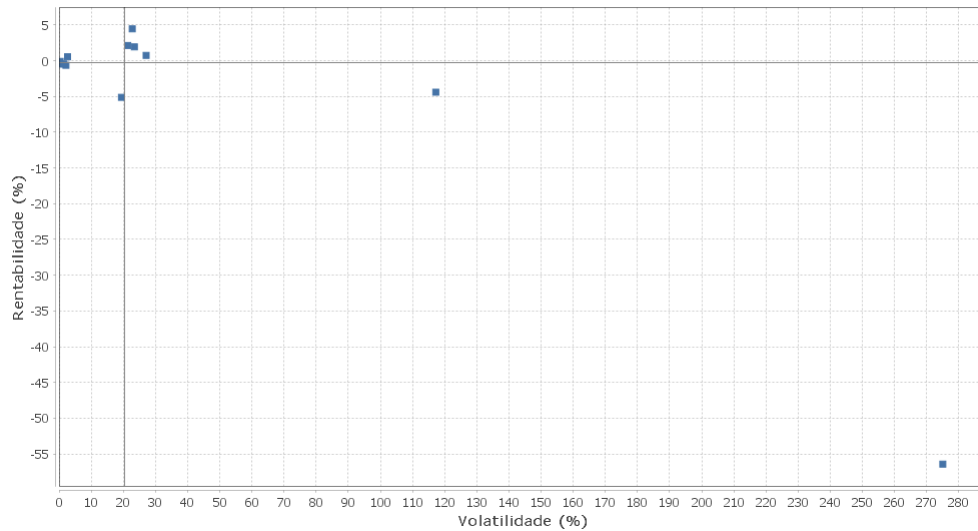
HORTOLÂNDIA - No Mês



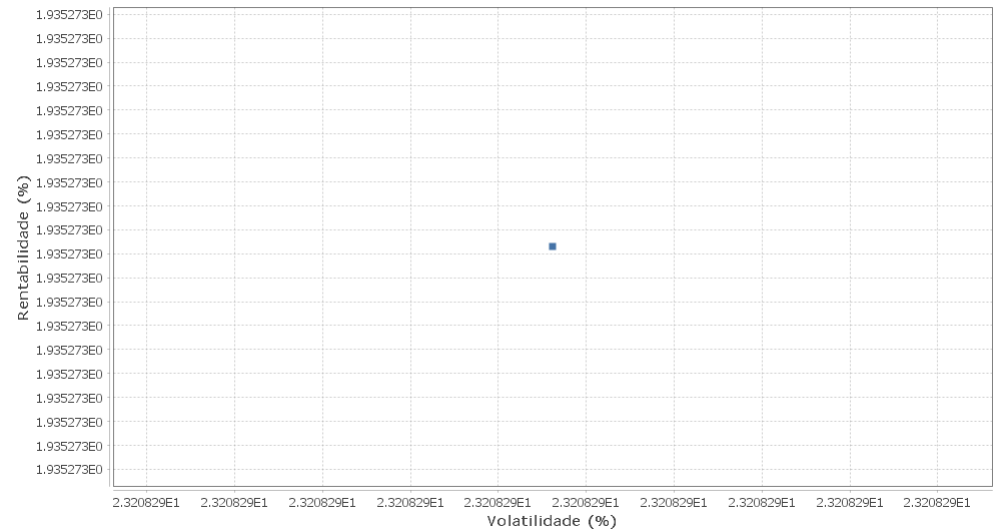
Renda Fixa - No Mês



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\$): 14.049.478,56

Value-At-Risk: 2,25%

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 ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,02	0,00	-1,52	0,14	47.317.740,48	7,59
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	Artigo 8º III	0,24	0,31	-0,00	-2,80	-0,47	227.484,55	0,04
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	Artigo 7º VII, Alínea a	0,26	0,08	0,00	-0,47	0,08	1.788.402,06	0,29
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	Artigo 8º IV, Alínea a	0,35	0,03	0,00	-0,88	-0,11	1.525.517,32	0,24
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,45	0,15	0,01	-0,41	0,02	68.910.725,66	11,06
FIDC PREMIUM	Artigo 7º VII, Alínea a	0,66	0,04	0,00	-0,61	-0,20	1.760.282,79	0,28
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA	Artigo 8º IV, Alínea a	1,47	0,19	0,00	-0,44	-0,44	215.328,20	0,03
NTN-C 010421	Artigo 7º I, Alínea a	1,53	1,27	-0,00	1,59	2,64	44.899.850,43	7,21
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	Artigo 7º IV, Alínea a	1,67	0,76	0,00	-0,30	-0,31	3.713.301,69	0,60
BRA1 FI RENDA FIXA	Artigo 7º IV, Alínea a	1,80	0,67	0,00	-0,18	-0,13	536.371,31	0,09
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	Artigo 8º IV, Alínea b	2,13	0,08	0,00	-0,40	-0,64	2.019.215,92	0,32
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	Artigo 8º IV, Alínea b	2,67	0,38	0,00	0,13	0,54	2.214.000,00	0,36
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,86	0,94	0,06	0,03	0,30	51.098.608,71	8,20
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,58	1,36	0,07	-0,17	-0,42	47.565.975,45	7,63
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,65	1,45	0,10	0,05	0,37	66.003.650,04	10,59
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,02	1,34	0,06	-0,27	-0,89	43.420.609,36	6,97
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	5,85	2,25	0,00	0,07	0,62	1.121.935,51	0,18
NTN-B 150824	Artigo 7º I, Alínea a	5,87	2,01	0,08	-0,02	0,09	35.383.275,10	5,68
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,63	2,84	0,22	-0,10	-0,48	70.351.769,20	11,29
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	9,52	4,89	0,08	-0,14	-1,11	16.409.086,76	2,63
BRCR11	Artigo 8º IV, Alínea b	19,42	2,64	-0,00	-0,27	-5,13	266.172,00	0,04
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	21,36	8,95	0,37	0,09	2,12	28.593.056,69	4,59
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	22,79	10,76	0,45	0,19	4,45	28.681.000,35	4,60
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	Artigo 9º A, II	23,21	11,07	-0,02	0,07	1,94	5.979.795,81	0,96
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,44	9,32	0,37	0,07	1,92	27.848.930,28	4,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	27,11	12,18	0,39	0,02	0,73	23.299.847,73	3,74
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	Artigo 8º IV, Alínea b	117,25	0,23	0,00	-0,04	-4,42	1.921.566,10	0,31
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS	Artigo 8º IV, Alínea a	275,01	12,44	0,00	-0,21	-56,43	23,50	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de março 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 5,42% 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 6,12% 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;