



LDB
EMPRESAS

NOBRES
FEVEREIRO 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 26.02.2021.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 82,06%

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	6,18	-1,19	-1,98	3.880.726,69	14,03	8.803.004.981,39	0,04
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,56	0,02	0,04	109.934,21	0,40	9.935.744.303,82	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,97	-2,35	-4,01	4.423.090,49	15,99	1.625.335.228,61	0,27
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,23	-0,53	-0,39	968.591,71	3,50	10.914.192.598,49	0,01
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	5,06	-0,61	-0,52	41.602,55	0,15	5.161.165.829,74	0,00
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	5,29	-0,67	-0,59	1.587.708,39	5,74	422.731.206,91	0,38
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,34	-0,91	-1,46	4.480.978,34	16,20	9.434.126.715,63	0,05
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			9,66	-1,34	-2,16	15.492.632,38	56,00		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SICREDI	SICREDI	SICREDI FC FI INSTITUCIONAL RF IMA B LP	12,98	-1,53	-2,37	4.997.061,51	18,06	481.093.760,70	1,04
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,98	-1,53	-2,37	4.997.061,51	18,06		

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
QUANTITAS	QUANTITAS	SICREDI FI RF PERFORMANCE LP	0,17	0,09	0,26	995.849,69	3,60	754.018.822,50	0,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,37	0,08	0,24	41.327,96	0,15	5.566.337.148,97	0,00
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,15	0,05	0,13	723.347,94	2,61	2.459.370.188,78	0,03
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	6,99	-0,96	-1,53	450.696,46	1,63	1.387.800.811,45	0,03
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,11	-0,14	-0,15	2.211.222,05	7,99		
Renda Fixa			9,22	-1,27	-2,02	22.700.915,94	82,06		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

15,39%

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	45,27	-3,28	-6,01	993.213,83	3,59	1.143.330.805,79	0,09
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			45,27	-3,28	-6,01	993.213,83	3,59		

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	44,14	-3,24	-5,64	513.722,04	1,86	748.567.197,38	0,07
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	42,65	-3,68	-5,65	479.352,74	1,73	2.112.204.537,83	0,02
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	43,99	0,47	-1,00	414.789,87	1,50	3.416.632.575,89	0,01
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	42,30	-5,03	-10,33	58.621,35	0,21	1.081.575.624,12	0,01
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	44,29	4,99	1,65	0,00	0,00	1.348.241.759,13	0,00
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVSPA - FIA	43,95	-5,61	-9,35	906.517,02	3,28	407.660.695,34	0,22
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			42,72	-3,65	-6,35	2.373.003,02	8,58		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO FI LP	2,97	-0,28	-0,39	890.153,57	3,22	404.264.423,73	0,22
BB	BB	BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI	4,48	0,15	0,22	0,00	0,00	2.200.496.659,58	0,00
Sub-total Artigo 8º III			3,14	-0,30	-0,39	890.153,57	3,22		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			29,60	-2,96	-5,09	4.256.370,42	15,39		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,55%

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
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	29,18	4,00	0,87	706.091,40	2,55	752.514.178,74	0,09
Sub-total Artigo 9º A, III			29,18	4,00	0,87	706.091,40	2,55		
Investimentos no Exterior			15,33	4,00	0,87	706.091,40	2,55		
Total			11,10	-1,38	-2,47	27.663.377,76	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	15.492.632,38	56,00	0,00	50,00	100,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	4.997.061,51	18,06	0,00	12,50	60,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	2.211.222,05	7,99	0,00	7,50	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	22.700.915,94	82,06				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	993.213,83	3,59	0,00	10,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	2.373.003,02	8,58	0,00	15,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	890.153,57	3,22	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	4.256.370,42	15,39				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	706.091,40	2,55	0,00	0,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	706.091,40	2,55				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

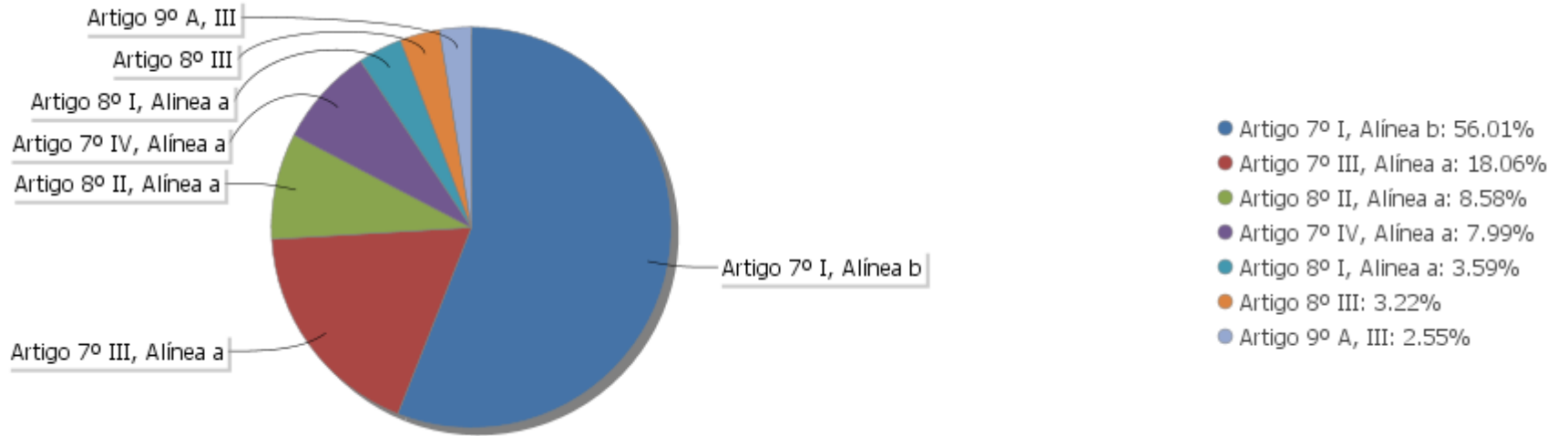
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-1,34 -996,29	-2,16 -760,73	1,36 303,19	1,44 156,86	2,63 111,39	-210.460,20	-342.719,72
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-1,53 -1.136,98	-2,37 -834,02	2,47 550,35	2,85 311,48	2,04 86,42	-77.622,29	-121.329,99
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,14 -104,78	-0,15 -54,23	0,34 75,15	0,38 41,46	1,57 66,28	-3.207,16	-3.688,76
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,28 1,09	-6,01 1,54	2,21 1,17	11,03 0,29	5,37 -0,26	-33.695,27	-63.491,19
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,65 0,72	-6,35 1,20	0,91 -0,14	8,23 -2,51	2,14 -3,49	-88.374,37	-163.061,39
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,30 4,07	-0,39 7,16	0,72 -0,33	0,80 -9,93	1,63 -4,00	-2.272,56	-3.181,58
Artigo 9º A, III % do CDI	4,00 2.976,21	0,87 529,15				27.183,12	6.091,40
NOBRES (Total)						-388.448,73	-691.381,23

Análise de Liquidez

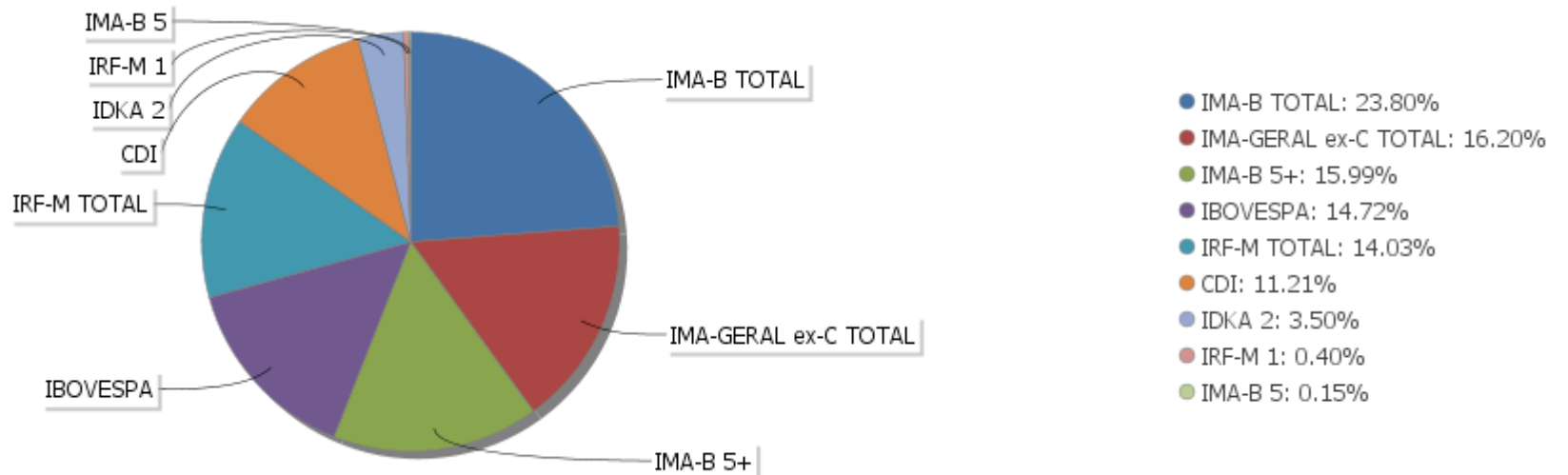
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	25.122.905,41	90,82	25.122.905,41	90,82
de 31 a 365 dias	952.763,96	3,44	26.075.669,37	94,26
acima de 365 dias	1.587.708,39	5,74	27.663.377,76	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

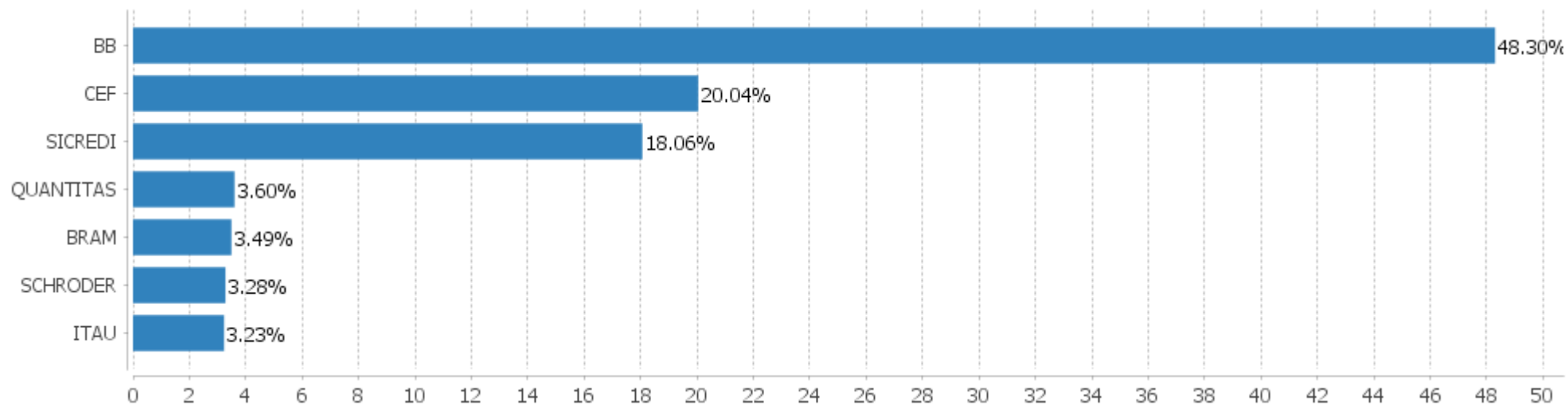


Alocação Por Estratégia



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	-1,10	-1,38											-2,47
INPC + 6,00%	0,73	1,24											1,98
p.p. indexador	-1,84	-2,62											-4,46
2020	0,28	-0,57	-6,96	1,69	1,70	2,04	3,39	-1,37	-1,43	0,01	2,23	3,81	4,45
INPC + 6,00%	0,70	0,59	0,69	0,23	0,21	0,79	0,98	0,85	1,36	1,38	1,42	1,98	11,75
p.p. indexador	-0,42	-1,15	-7,65	1,46	1,49	1,25	2,41	-2,21	-2,79	-1,38	0,81	1,84	-7,30
2019	1,32	0,39	0,51	0,70	1,24	1,39	0,81	-0,01	2,11	2,51	-1,37	1,82	11,96
INPC + 6,00%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,44	0,57	1,01	1,71	10,78
p.p. indexador	0,45	-0,62	-0,71	-0,38	0,58	0,94	0,17	-0,64	1,67	1,93	-2,37	0,10	1,19

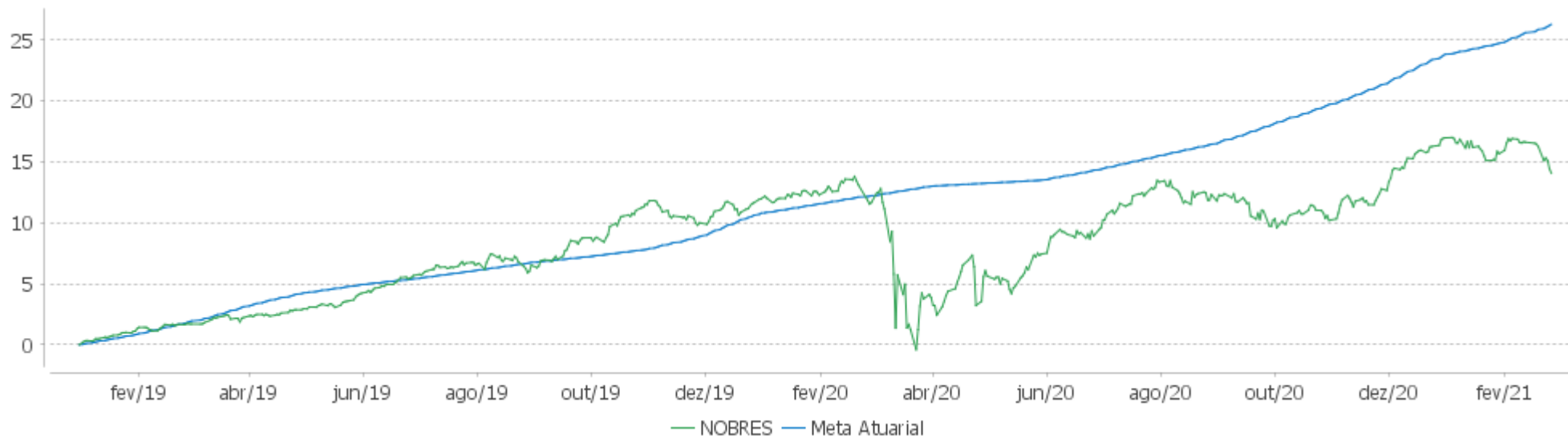
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

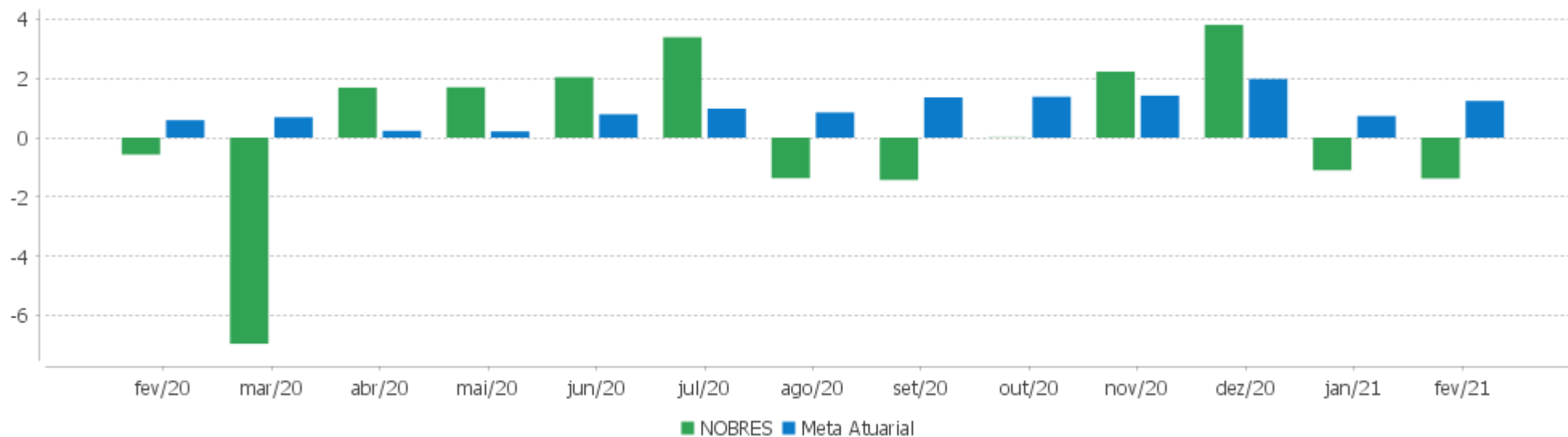
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	13	50,00	03 meses	1,25	4,00	-2,75	4,93
Meses abaixo da Meta Atuarial	13	50,00	06 meses	2,03	8,39	-6,36	5,24
			12 meses	2,15	12,51	-10,36	11,10
			24 meses	12,13	23,91	-11,78	8,14
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,81	2020-12					
Menor rentabilidade da Carteira	-6,96	2020-03	Desde 31/12/2018	14,05	26,25	-12,19	7,83

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.	-0,91 -0,09	-1,46 -0,20	0,88 0,05	0,90 0,09	2,59 0,03	14,34 0,43	25,55 0,55
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,53 -0,05	-0,39 -0,06	1,25 -0,14	2,68 -0,04	6,48 -0,47	17,50 -1,42	28,81 -2,22
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-0,61 -0,02	-0,52 -0,03	1,28 -0,05	2,64 -0,10	5,94 -0,29	18,61 -0,55	30,33 -0,86
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-1,19 -0,01	-1,98 -0,01	-0,05 0,00	-0,68 -0,10	2,76 -0,25	14,70 -0,53	25,84 -0,85
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,02 -0,02	0,04 -0,04	0,33 -0,06	0,82 -0,11	2,87 -0,21	9,36 -0,44	16,69 -0,66
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-2,35 -0,02	-4,01 -0,03	3,25 0,02	3,33 -0,05	0,76 -0,18	22,39 -0,81	42,85 -1,57
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,67 0,85	-0,59 1,76	1,22 -1,17	2,51 -0,56	5,65 2,48	18,87 -2,86	31,19 -7,72
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,05 35,54	0,13 44,47	0,23 51,08	0,34 37,58	1,26 53,42	5,77 71,50	11,34 75,62
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,08 57,89	0,24 84,32	0,60 134,31	0,88 95,86	2,00 84,75	7,44 92,19	14,14 94,27
SICREDI FI RF PERFORMANCE LP % do CDI	0,09 64,95	0,26 90,48	0,47 105,43	0,71 77,22	2,00 84,72	7,23 89,60	13,62 90,85
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINAMICA % do CDI	-0,96 -712,02	-1,53 -538,88	0,91 202,64	0,42 45,96	2,22 93,98	13,17 163,23	24,11 160,79
SICREDI FC FI INSTITUCIONAL RF IMA B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,53 -0,01	-2,37 -0,02	2,47 0,09	2,85 -0,22	2,04 -1,12	20,31 -1,43	37,08 -1,84
BB PREV MULTIMERCADO FI LP % do CDI	-0,28 -208,55	-0,39 -138,80	0,70 156,11	0,73 79,69	1,30 55,16	9,24 114,49	17,41 116,10
BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI % do CDI	-0,30 -221,68	-0,23 -79,61	0,97 215,82	1,37 150,17	3,66 154,80	10,41 129,00	
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-3,68 0,69	-5,65 1,90	2,28 1,23	7,86 -2,87	5,25 -0,38	25,90 10,79	51,75 22,83
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-3,24 1,13	-5,64 1,90	1,81 0,77	10,71 -0,02	3,53 -2,10	10,67 -4,45	27,30 -1,61
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	0,47	-1,00	5,23	12,85	4,60	25,63	48,93

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Varição da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	4,85	6,55	4,19	2,12	-1,03	10,51	20,01
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	-5,61	-8,45	0,21	9,55	2,86	19,62	36,74
Var. IBOVESPA p.p.	-1,24	-0,90	-0,84	-1,19	-2,77	4,50	7,82
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	-1,35	-4,48	3,14	8,77	-0,98	26,47	
Var. IBOVESPA p.p.	3,02	3,06	2,10	-1,96	-6,61	11,35	
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-5,03	-10,33	-0,72	13,05	5,91	20,39	42,48
Var. IBOVESPA p.p.	-0,65	-2,79	-1,77	2,32	0,28	5,27	13,57
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-3,28	-6,01	2,21	11,03	5,37	18,71	35,77
Var. IBOVESPA p.p.	1,09	1,54	1,17	0,29	-0,26	3,60	6,86
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	4,00	9,21	9,86	7,26	63,36	94,82	126,09
Var. IBOVESPA p.p.	8,38	16,75	8,81	-3,47	57,73	79,70	97,17
NOBRES	-1,38	-2,47	1,25	2,03	2,15	12,13	
Var. INPC + 6,00% p.p.	-2,62	-4,46	-2,75	-6,36	-10,36	-11,78	
CDI	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	14,99
IBOVESPA	-4,37	-7,55	1,05	10,73	5,63	15,12	28,92
INPC + 6,00%	1,24	1,98	4,00	8,39	12,51	23,91	36,52
IPCA + 6,00%	1,28	2,00	3,91	7,95	11,43	22,82	35,25

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	0,08	0,39	0,94	3,08	9,80	17,36
IRF-M 1+	-2,01	-3,37	-0,43	-1,48	2,82	17,44	30,64
IRF-M TOTAL	-1,18	-1,97	-0,06	-0,58	3,01	15,23	26,69
IMA-B 5	-0,60	-0,49	1,33	2,75	6,23	19,15	31,19
IMA-B 5+	-2,33	-3,98	3,24	3,38	0,95	23,20	44,42
IMA-B TOTAL	-1,52	-2,36	2,38	3,07	3,16	21,74	38,91
IMA-C TOTAL	3,72	10,42	9,19	17,82	30,63	54,91	81,60
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,83	-1,26	0,83	0,82	2,55	13,91	25,00
IMA-GERAL TOTAL	-0,69	-0,93	1,07	1,29	3,31	14,97	26,40
IDKA 2	-0,48	-0,33	1,40	2,72	6,95	18,92	31,03
IDKA 20	-2,69	-5,42	5,32	4,90	-1,91	24,76	54,08
CDI	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	14,99
Renda Variável							
IBOVESPA	-4,37	-7,55	1,05	10,73	5,63	15,12	28,92
IBRX 100	-3,45	-6,38	2,19	11,97	6,92	18,84	34,16
IBRX 50	-3,80	-6,48	2,33	12,81	8,13	15,27	27,76
SMALL CAP	-1,84	-5,21	1,92	9,84	2,20	38,68	54,97
IFIX	0,25	0,57	2,78	3,75	-2,61	18,56	24,88
Índice Consumo - ICON	-5,29	-6,50	-1,83	-0,23	1,03	36,15	35,39
Índice Dividendos - IDIV	-5,21	-10,02	-1,98	7,65	-3,53	17,34	37,29
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,86	1,11	2,48	4,95	5,20	9,41	13,66
INPC	0,82	1,09	2,57	5,37	6,22	10,38	14,73
IGPM	2,53	5,17	6,18	18,11	28,94	37,73	48,21
SELIC	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	15,00
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

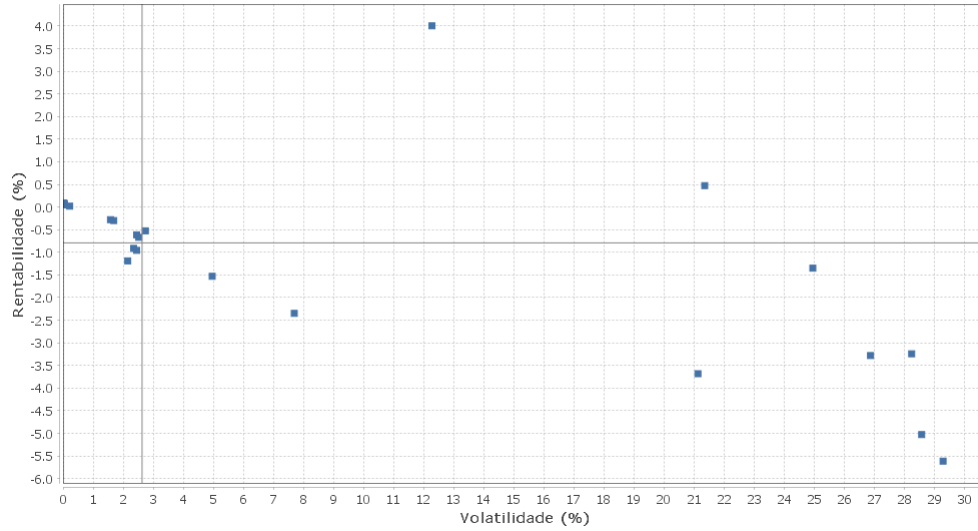
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
21	05/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	886,50	418,90592500	2,1162269310
12	08/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	573,12	0,00	270,81249900	2,1162981830
13	10/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	353.354,21	166.960,31281900	2,1163964300
22	10/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	348.005,11	0,00	164.432,85627700	2,1163964300
10	11/02/2021	BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI	0,00	155.470,61	43.071,87834600	3,6095619570
11	11/02/2021	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	0,00	47.410,81	33.378,14005900	1,4204150620
14	11/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	155.470,61	0,00	73.458,37276100	2,1164450580
15	17/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	47.410,81	0,00	22.399,92334400	2,1165612610
20	17/02/2021	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	0,00	41.790,78	21.204,33362100	1,9708603320
16	18/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	239.873,88	113.328,53325500	2,1166238820
17	19/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	380.576,24	0,00	179.799,25118400	2,1166731090
23	19/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.820,82	2.277,54582400	2,1166731090
24	22/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	200,00	94,48565400	2,1167234450
25	23/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.575,45	1.216,68248700	2,1167806950
26	24/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.517,28	716,78155000	2,1167955560
18	25/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	34.912,61	16.492,73395700	2,1168479460
27	25/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.464,77	3.526,36098100	2,1168479460
19	26/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	19.993,38	0,00	9.444,58091300	2,1169155290
28	26/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.246,86	1.533,76927700	2,1169155290
Total						

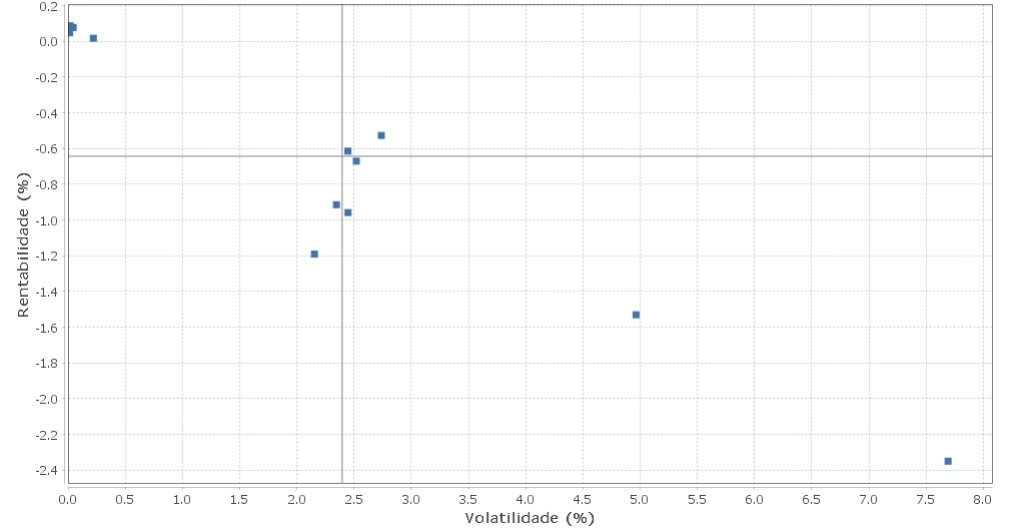
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

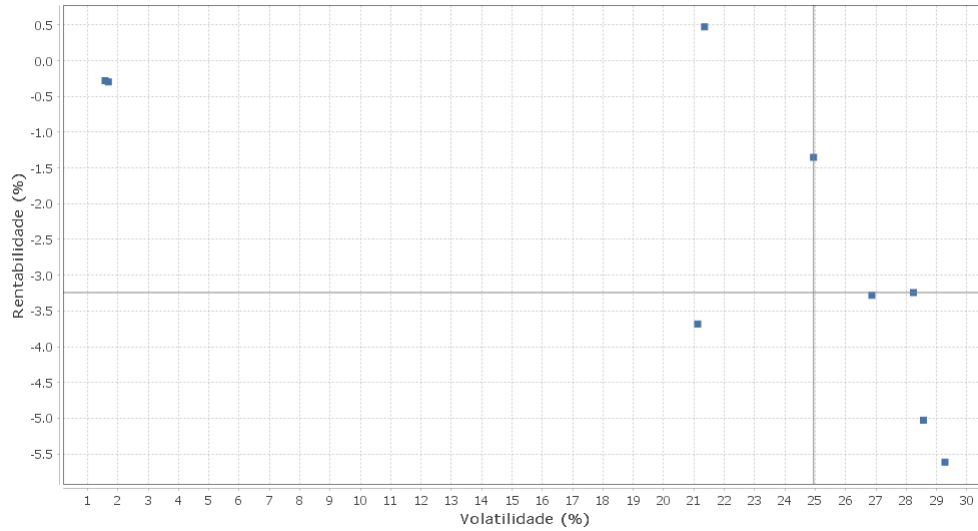
NOBRES - No Mês



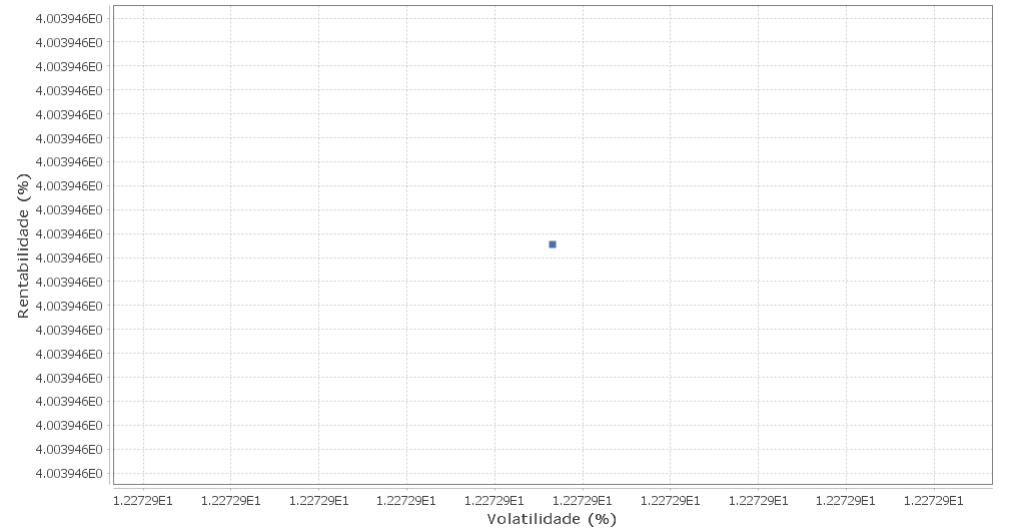
Renda Fixa - No Mês



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\$): 696.028,53

Value-At-Risk: 2,52%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,04	0,00	-6,17	0,05	723.347,94	2,61
SICREDI FI RF PERFORMANCE LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,03	0,00	-2,53	0,09	995.849,69	3,60
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,05	0,00	-1,25	0,08	41.327,96	0,15
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,22	0,15	0,00	-0,53	0,02	109.934,21	0,40
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	Artigo 8º III	1,58	0,93	0,03	-0,26	-0,28	890.153,57	3,22
BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI	Artigo 8º III	1,69	NaN	0,00	-0,26	-0,30	0,00	0,00
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,15	1,36	0,14	-0,62	-1,19	3.880.726,69	14,03
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,35	1,31	0,17	-0,45	-0,91	4.480.978,34	16,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,45	1,22	0,00	-0,31	-0,61	41.602,55	0,15
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	2,45	1,44	0,02	-0,45	-0,96	450.696,46	1,63
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,52	1,24	0,05	-0,32	-0,67	1.587.708,39	5,74
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,74	1,16	0,03	-0,24	-0,53	968.591,71	3,50
SICREDI FC FI INSTITUCIONAL RF IMA B LP	Artigo 7º III, Alínea a	4,96	2,36	0,35	-0,34	-1,53	4.997.061,51	18,06
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,69	3,93	0,50	-0,32	-2,35	4.423.090,49	15,99
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	12,27	12,34	0,03	0,32	4,00	706.091,40	2,55
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	21,12	10,63	0,15	-0,18	-3,68	479.352,74	1,73
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	21,35	10,05	0,12	0,02	0,47	414.789,87	1,50
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	24,95	NaN	0,00	-0,06	-1,35	0,00	0,00
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	26,87	12,47	0,38	-0,13	-3,28	993.213,83	3,59
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	28,24	13,98	0,20	-0,12	-3,24	513.722,04	1,86
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	28,57	12,24	0,02	-0,18	-5,03	58.621,35	0,21
SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA - FIA	Artigo 8º II, Alínea a	29,28	12,17	0,33	-0,20	-5,61	906.517,02	3,28