



PATO BRANCO CONSOLIDADO
JANEIRO 2021



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 29.01.2021.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **78,30%**

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	6,16	-0,80	-0,80	440.452,69	0,83	8.385.200.938,98	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,06	0,08	0,08	6.260.614,81	11,86	13.518.203.391,91	0,05
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,24	0,18	0,18	8.201.460,17	15,54	9.200.599.633,08	0,09
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	9,18	-1,39	-1,39	1.265.051,05	2,40	2.764.051.643,34	0,05
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,14	-0,77	-0,77	415.731,46	0,79	2.465.176.454,79	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	5,04	0,10	0,10	7.903.735,05	14,97	5.043.806.710,80	0,16
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,33	-0,55	-0,55	6.395.766,89	12,12	9.495.985.226,13	0,07
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	0,03	0,03	5.512.007,08	10,44	14.822.912.413,17	0,04
BB	BB	BB PREV IRF-M 1+	9,22	-1,33	-1,33	587.359,82	1,11	400.098.894,86	0,15
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,06	-0,11	-0,11	36.982.179,02	70,06		

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
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,67	0,13	0,13	3.129.086,17	5,93	3.621.561.522,63	0,09
CEF	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	3,91	0,08	0,08	1.218.329,12	2,31	771.843.724,33	0,16
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,70	0,12	0,12	4.347.415,29	8,24		
Renda Fixa			5,42	-0,08	-0,08	41.329.594,31	78,30		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

21,70%

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	45,64	-2,82	-2,82	2.285.320,55	4,33	1.218.203.539,76	0,19
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	45,03	-3,32	-3,32	679.209,29	1,29	761.516.224,91	0,09
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			45,46	-2,93	-2,93	2.964.529,84	5,62		

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
BB	BB	BB AÇÕES ENERGIA FI	37,64	-5,09	-5,09	2.158.170,65	4,09	439.979.544,32	0,49
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	46,81	-1,42	-1,42	731.067,45	1,39	405.215.101,85	0,18
CEF	CEF	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	48,12	-4,12	-4,12	1.993.021,88	3,78	534.728.069,42	0,37
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	44,50	-1,46	-1,46	564.176,95	1,07	3.479.599.111,95	0,02
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	44,98	-3,18	-3,18	681.675,21	1,29	1.366.084.677,93	0,05
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			41,91	-3,81	-3,81	6.128.112,14	11,61		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP	7,86	-0,09	-0,09	869.521,12	1,65	4.834.227.738,16	0,02
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	1,74	0,49	0,49	1.491.428,26	2,83	76.220.647,72	1,96
Sub-total Artigo 8º III			7,69	0,28	0,28	2.360.949,38	4,47		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			40,60	-2,77	-2,77	11.453.591,36	21,70		
--	--	--	--------------	--------------	--------------	----------------------	--------------	--	--

Total			10,30	-0,68	-0,68	52.783.185,67	100,00		
--------------	--	--	--------------	--------------	--------------	----------------------	---------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos			
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	36.982.179,02	70,06	0,00	53,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	4.347.415,29	8,24	0,00	7,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	41.329.594,31	78,30				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alinea a	Fundos de Ações Referenciados	2.964.529,84	5,62	0,00	8,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	6.128.112,14	11,61	0,00	16,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	2.360.949,38	4,47	0,00	6,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	11.453.591,36	21,70				30,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

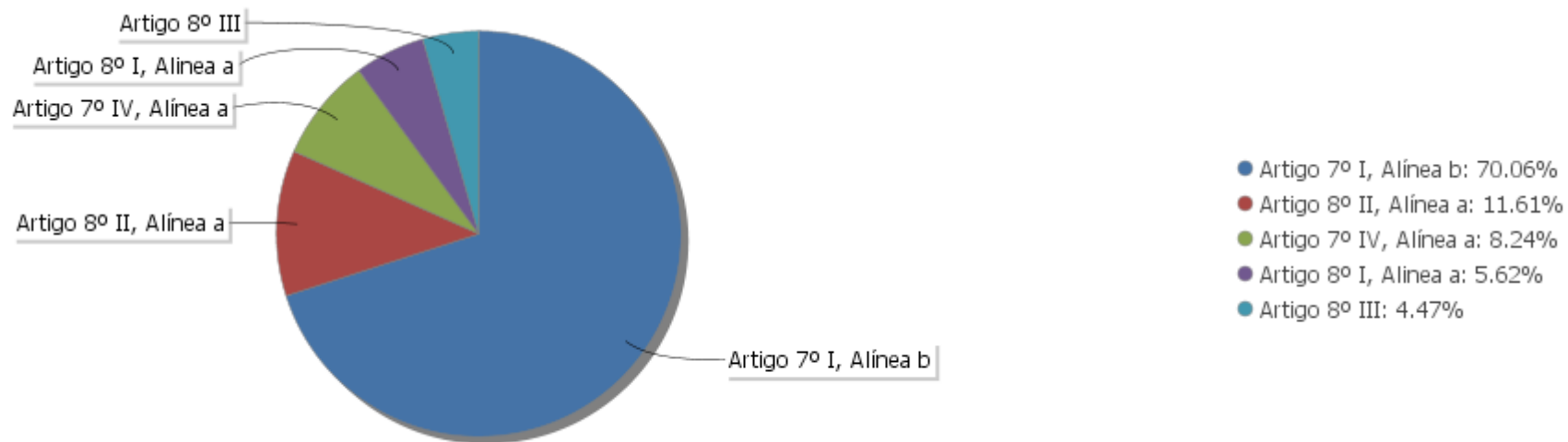
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,11 -71,10	-0,11 -71,10	2,83 608,64	1,80 191,69	5,99 237,27	-39.348,16	-39.348,16
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,12 80,14	0,12 80,14	0,80 173,29	0,43 45,93	2,92 115,67	5.201,88	5.201,88
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,93 0,38	-2,93 0,38	21,97 -0,50	11,20 -0,62	0,61 -0,54	-89.636,12	-89.636,12
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,81 -0,49	-3,81 -0,49	15,74 -6,73	4,89 -6,93	-7,39 -8,54	-242.729,25	-242.729,25
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,28 3,59	0,28 3,59	3,80 -18,68	2,56 -9,26	2,23 1,08	6.488,00	6.488,00
PATO BRANCO CONSOLIDADO (Total)						-360.023,65	-360.023,65

Análise de Liquidez

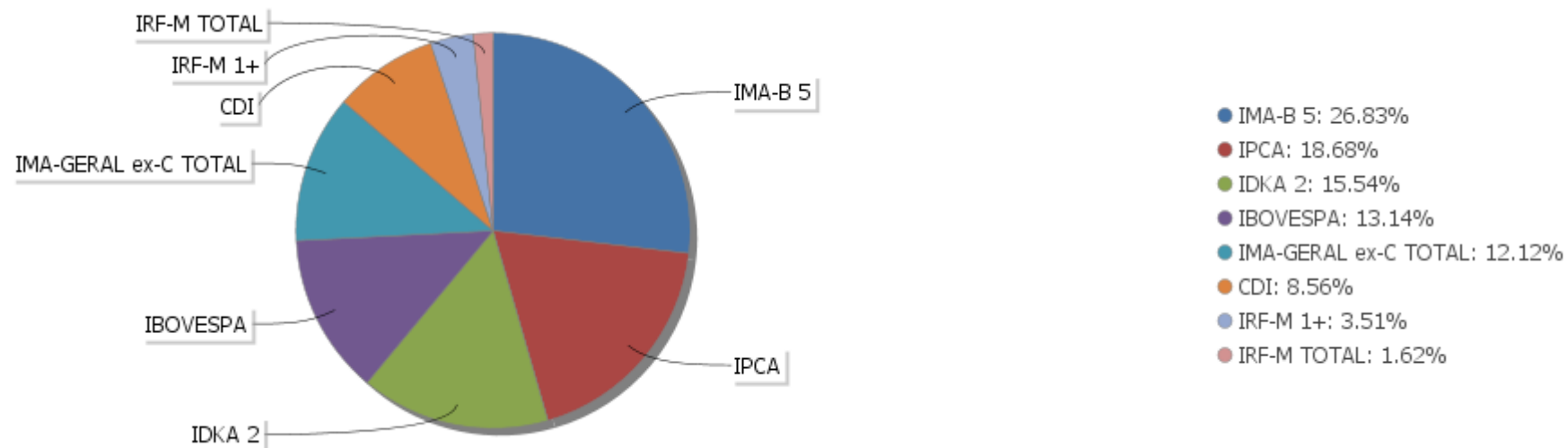
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	52.219.008,72	98,93	52.219.008,72	98,93
de 31 a 365 dias	564.176,95	1,07	52.783.185,67	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	52.783.185,67	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

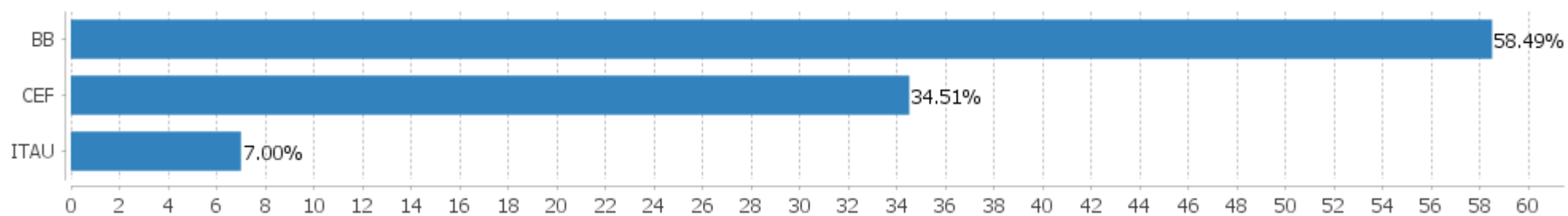


Alocação Por Estratégia



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	-0,68												-0,68
IPCA + 5,43%	0,67												0,67
p.p. indexador	-1,35												-1,35
2020	0,47	-0,63	-5,97	2,01	2,51	1,89	2,32	-0,99	-1,37	-0,16	3,13	2,95	5,94
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,65
p.p. indexador	-0,25	-1,29	-6,54	1,87	2,44	1,15	1,43	-1,71	-2,49	-1,50	1,78	1,09	-4,70
2019	1,43	0,31	0,54	0,84	1,61	1,98	1,00	0,11	1,77	1,74	-0,36	1,55	13,24
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	0,60	-0,58	-0,66	-0,22	0,97	1,53	0,28	-0,51	1,32	1,11	-1,33	-0,09	2,65

PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

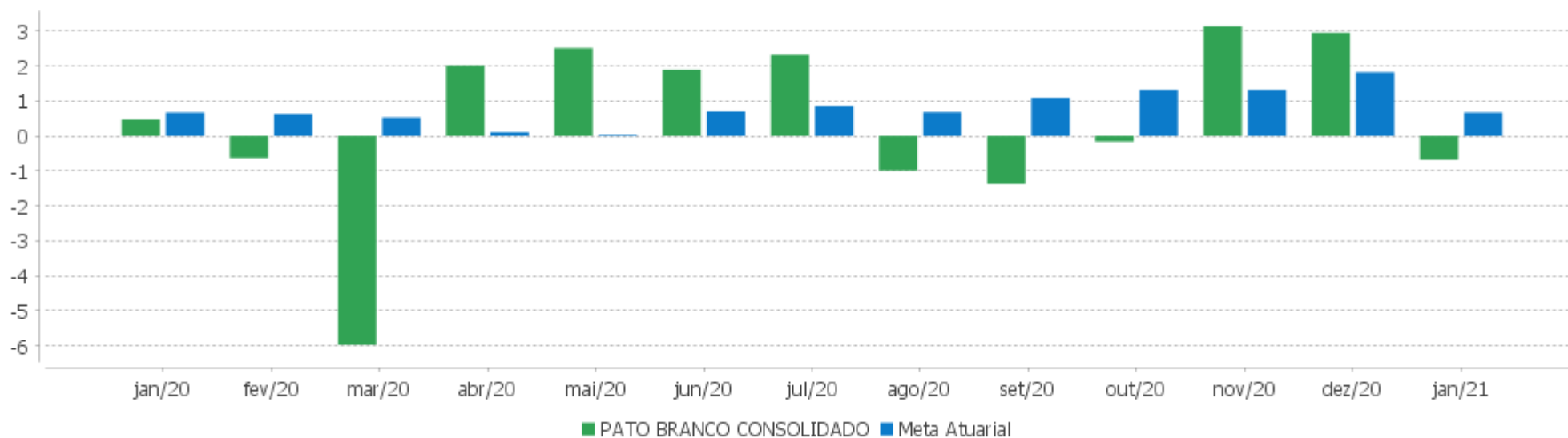
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	12	48,00	03 meses	5,45	3,93	1,53	4,46
Meses abaixo da Meta Atuarial	13	52,00	06 meses	2,81	7,27	-4,45	5,31
			12 meses	4,74	10,60	-5,86	10,30
			24 meses	17,48	22,17	-4,69	7,48
			36 meses				
Desde 31/12/2018				19,16	23,19	-4,02	7,33
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	3,13	2020-11					
Menor rentabilidade da Carteira	-5,97	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,13 -0,12	0,13 -0,12	0,44 -2,07	0,16 -4,14	2,65 -1,91	12,60 3,66	22,91 9,86
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,08 -0,17	0,08 -0,17	1,77 -0,74	0,70 -3,60			
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO Var. IRF-M 1+ p.p.	-1,39 0,00	-1,39 0,00	2,05 -0,04	-0,70 -0,10	5,58 -0,19	19,55 -0,57	34,26 -0,81
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,08 -0,02	0,08 -0,02	3,22 -0,07	3,64 -0,16	7,25 -0,30	19,86 -0,66	31,74 -0,94
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,18 0,03	0,18 0,03	3,07 -0,09	4,24 -0,05	7,69 -0,51	18,77 -1,35	30,05 -2,43
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 IRF-M 1+ Var. IRF-M 1+ p.p.	-1,33 0,06	-1,33 0,06	2,16 0,08	-0,83 -0,23	5,26 -0,51		
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
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,10 -0,01	0,10 -0,01	3,24 -0,04	3,66 -0,15	7,29 -0,27	19,97 -0,56	31,81 -0,87
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,80 0,00	-0,80 0,00	1,50 -0,01	-0,29 -0,14	4,65 -0,26	16,40 -0,55	28,76 -0,85
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
BB AÇÕES ENERGIA FI % do CDI	-5,09 -3.407,29	-5,09 -3.407,29	13,12 2.827,21	2,14 226,98	-5,62 -222,40	24,92 294,75	92,07 598,90
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA Var. IBOVESPA p.p.	-4,12 -0,80	-4,12 -0,80	18,61 -3,86	5,93 -5,88	-4,65 -5,80	30,26 12,11	55,32 19,81
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
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-3,18 0,14	-3,18 0,14	16,79 -5,68	6,58 -5,23	-7,53 -8,68	25,82 7,68	
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	-1,42 1,90	-1,42 1,90	12,36 -10,11	2,77 -9,04	-4,13 -5,28	36,08 17,93	34,59 -0,93
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	0,49	0,49	2,85	2,20			

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	327,07	327,07	613,52	233,93			
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	-0,09	-0,09	4,50	3,05	2,72	17,79	31,56
% do CDI	-59,08	-59,08	968,70	324,54	107,80	210,41	205,29
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,26	11,68	1,02	17,63	34,23
Var. IBOVESPA p.p.	-0,00	-0,00	-0,21	-0,13	-0,13	-0,51	-1,28
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-2,82	-2,82	21,89	11,05	0,49	20,53	39,88
Var. IBOVESPA p.p.	0,50	0,50	-0,59	-0,77	-0,66	2,38	4,37
PATO BRANCO CONSOLIDADO	-0,68	-0,68	5,45	2,81	4,74	17,48	
Var. IPCA + 5,43% p.p.	-1,35	-1,35	1,60	-4,26	-5,43	-3,56	
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,37
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
INPC + 6%	0,73	0,73	4,18	7,97	11,79	23,62	35,65
IPCA + 6%	0,71	0,71	3,99	7,36	10,76	22,35	34,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,04	0,04	0,58	1,02	3,43	10,27	17,95
IRF-M 1+	-1,39	-1,39	2,09	-0,60	5,77	20,12	35,07
IRF-M TOTAL	-0,80	-0,80	1,50	-0,15	4,92	16,95	29,61
IMA-B 5	0,11	0,11	3,28	3,80	7,55	20,52	32,68
IMA-B 5+	-1,69	-1,69	8,43	2,01	3,68	26,83	48,69
IMA-B TOTAL	-0,85	-0,85	6,04	2,78	5,22	24,29	41,83
IMA-C TOTAL	6,46	6,46	7,31	15,99	26,73	52,15	76,01
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,44	-0,44	2,38	0,96	3,87	15,36	26,95
IMA-GERAL TOTAL	-0,24	-0,24	2,52	1,39	4,50	16,33	28,20
IDKA 2	0,15	0,15	3,16	4,28	8,20	20,12	32,49
IDKA 20	-2,81	-2,81	11,88	1,09	0,71	29,02	58,93
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,37
Renda Variável							
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
IBRX 100	-3,03	-3,03	22,21	12,06	1,64	20,92	39,53
IBRX 50	-2,78	-2,78	23,61	13,27	2,67	17,81	33,39
SMALL CAP	-3,43	-3,43	21,10	10,52	-4,50	38,71	57,28
IFIX	0,32	0,32	4,07	5,35	-6,43	19,49	26,00
Índice Consumo - ICON			12,91	3,78	-3,99	37,57	37,84
Índice Dividendos - IDIV	-5,08	-5,08	18,30	8,08	-4,52	21,27	43,95
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,25	0,25	2,51	4,30	4,56	8,94	13,06
INPC	0,27	0,27	2,70	4,89	5,53	10,07	14,00
IGPM	2,58	2,58	6,95	18,36	25,71	35,53	44,66
SELIC	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,38
Meta Atuarial							

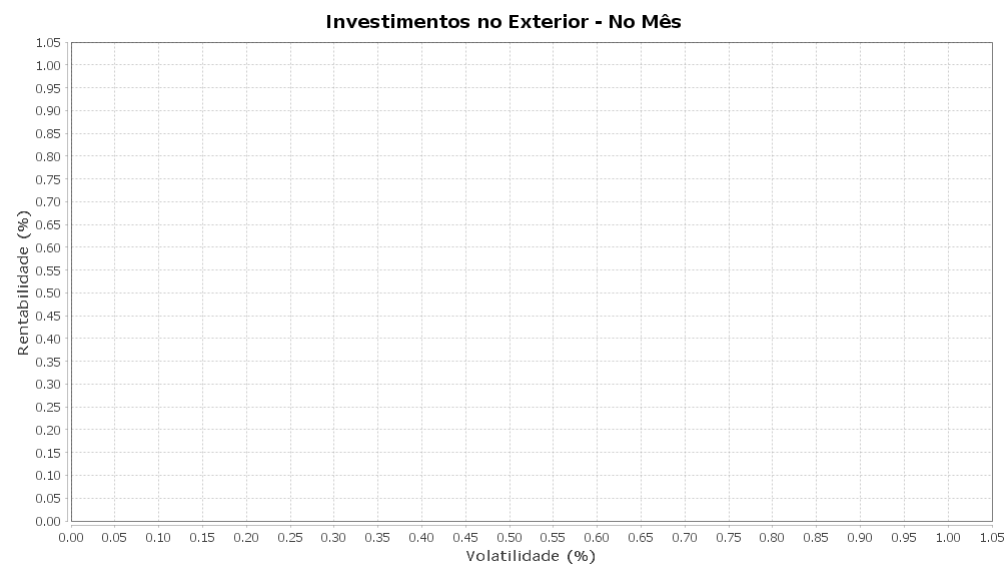
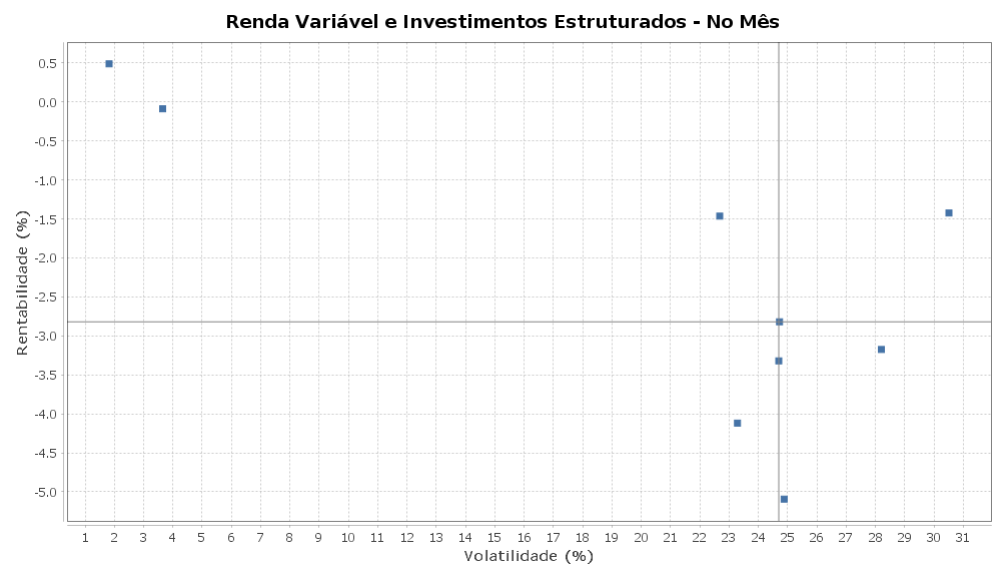
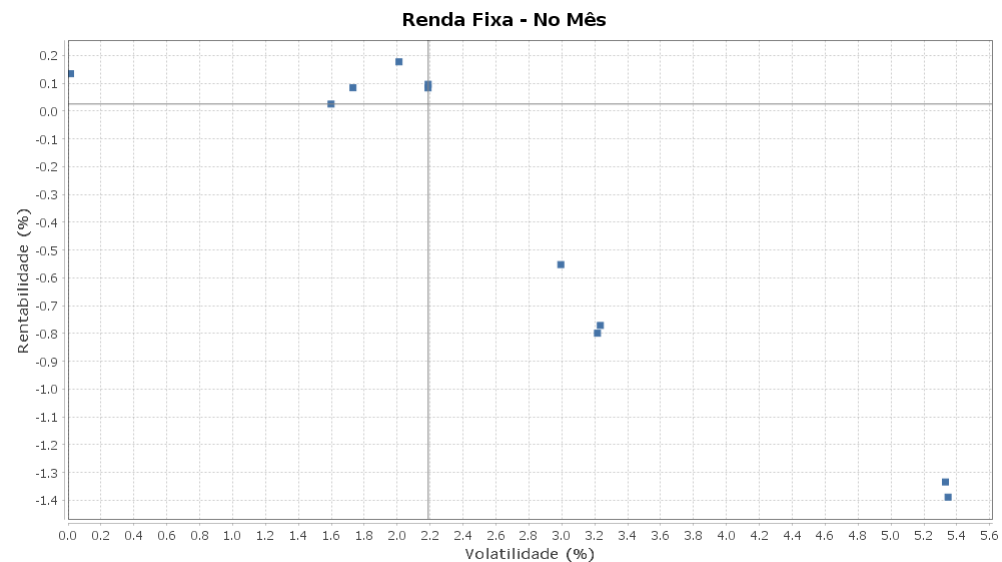
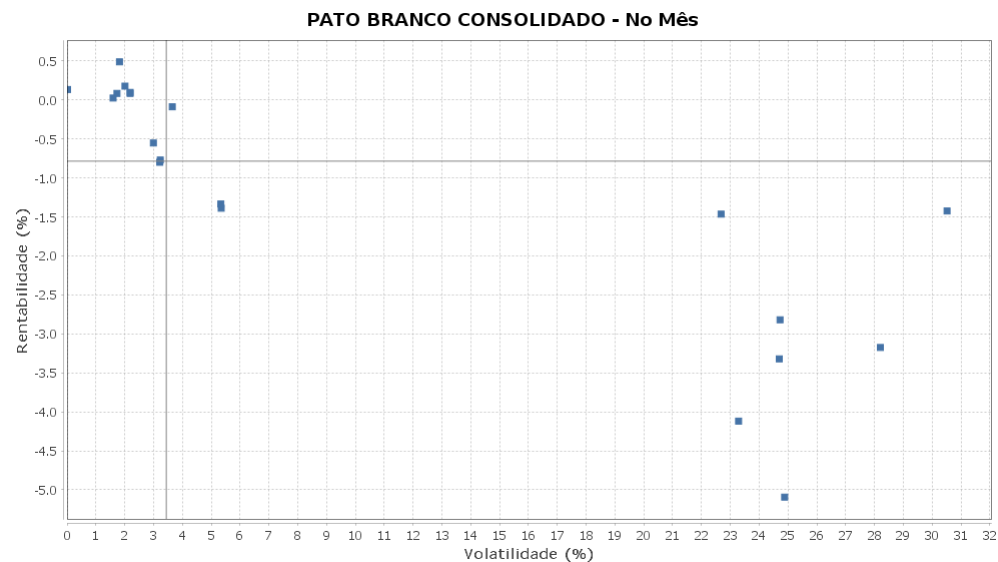
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 1.243.370,00

Value-At-Risk: 2,36%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,23	0,01	-1,01	0,13	3.129.086,17	5,93
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,60	1,03	0,08	-0,08	0,03	5.512.007,08	10,44
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	Artigo 7º IV, Alínea a	1,73	0,93	0,02	-0,04	0,08	1.218.329,12	2,31
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	Artigo 8º III	1,82	1,22	0,02	0,19	0,49	1.491.428,26	2,83
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,08	0,12	0,01	0,18	8.201.460,17	15,54
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	1,23	0,11	-0,03	0,08	6.260.614,81	11,86
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	1,22	0,14	-0,02	0,10	7.903.735,05	14,97
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,99	1,33	0,12	-0,23	-0,55	6.395.766,89	12,12
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,22	1,48	0,01	-0,29	-0,80	440.452,69	0,83
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,23	1,49	0,01	-0,28	-0,77	415.731,46	0,79
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	3,65	1,98	0,03	-0,07	-0,09	869.521,12	1,65
BB PREV IRF-M 1+	Artigo 7º I, Alínea b	5,33	2,42	0,02	-0,28	-1,33	587.359,82	1,11
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	5,35	2,39	0,04	-0,29	-1,39	1.265.051,05	2,40
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	22,68	9,86	0,09	-0,07	-1,46	564.176,95	1,07
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	Artigo 8º II, Alínea a	23,29	10,07	0,34	-0,18	-4,12	1.993.021,88	3,78
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	24,70	11,62	0,13	-0,14	-3,32	679.209,29	1,29
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	24,73	11,58	0,45	-0,12	-2,82	2.285.320,55	4,33
BB AÇÕES ENERGIA FI	Artigo 8º II, Alínea a	24,88	9,98	0,34	-0,21	-5,09	2.158.170,65	4,09
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	28,20	12,60	0,14	-0,12	-3,18	681.675,21	1,29
BB AÇÕES CONSUMO FIC	Artigo 8º II, Alínea a	30,51	10,93	0,13	-0,05	-1,42	731.067,45	1,39