

BENCHMARK RF:60.00%(80.00%CDI + 20.00%IMA-B)
+ RV:25.00%(100.00%IBRX 100)
+ ESTR:10.00%(100.00%IHFA) + OFF:5.00%(100.00%MXWOBRL)

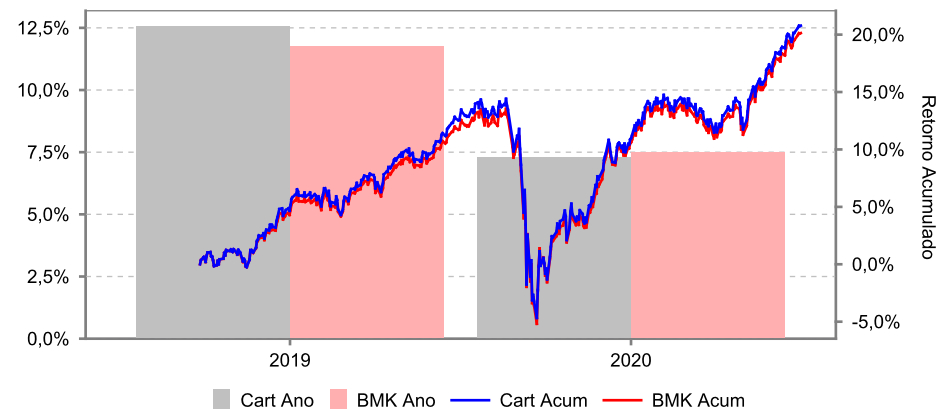
Posição Sintética dos Ativos em 31/12/2020

	Financeiro	% PL
FUNDOS SEGMENTO R FIXA	7.253.082,51	
BRAD MP FPM ARROJADO IE MULTIMERCADO FIC	7.253.082,51	100,01
OUTROS VALORES	-1.025,27	- 0,01
SALDO CONTA	-1.025,27	-0,01
Patrimonio Líquido em 31/12/2020	7.252.057,24	

Rentabilidade dos Investimentos

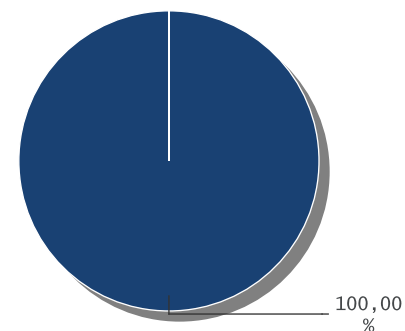
	Carteira	BMK
Rentabilidade no Período	3,36%	3,25%
Rentabilidade no Ano	7,30%	7,51%
Rentabilidade desde 28/03/2019	20,78%	20,13%

Rentabilidade Global x BMK x Meta Atuarial



Posição Consolidada por Tipo de Ativo⁽⁴⁾

■ FDO SEGMENTO R FIXA 100.00%



BENCHMARK RF:60.00%(80.00%CDI + 20.00%IMA-B)
 + RV:25.00%(100.00%IBRX 100)
 + ESTR:10.00%(100.00%IHFA) + OFF:5.00%(100.00%MXWOBRL)

Desempenho da Carteira

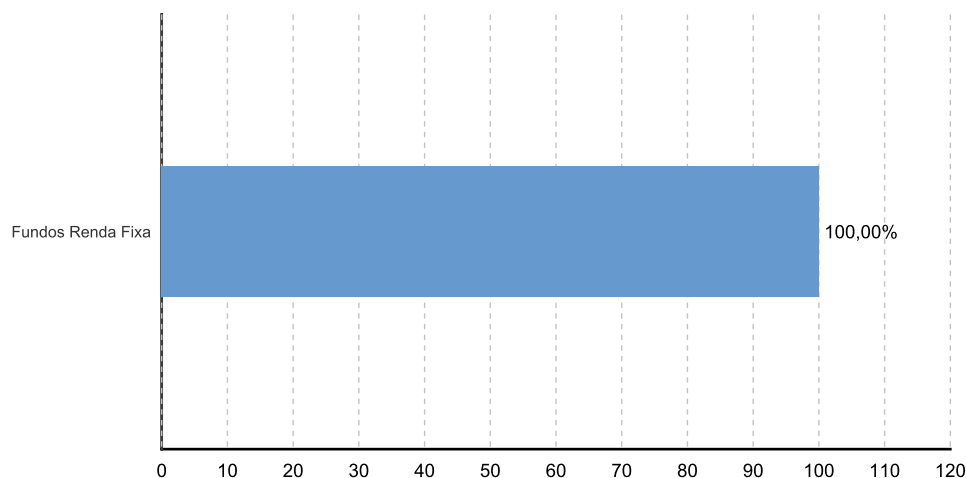
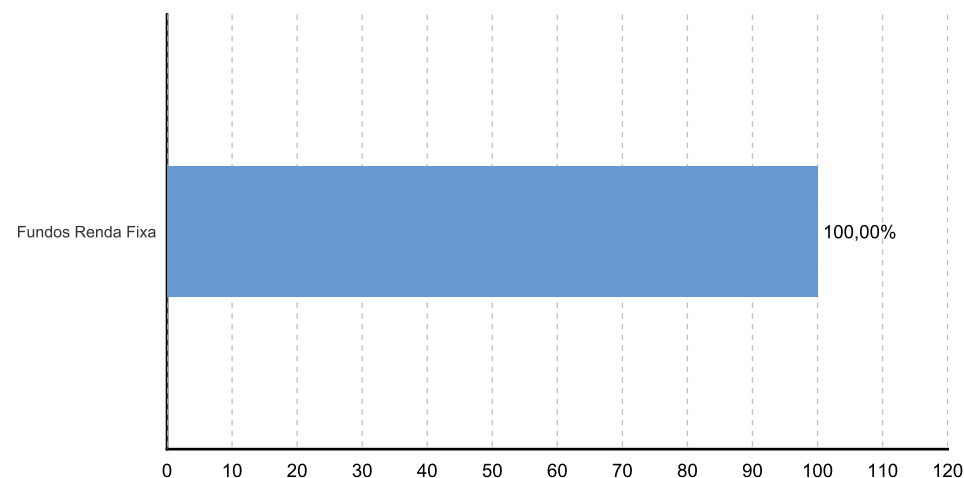
Início - 28/03/2019	No mês	No ano	6 meses	12 meses	24 meses	D.Início
Rentabilidade da Carteira	3,36%	7,30%	9,36%	7,30%	-	20,78%
Distância do BMK	0,11%	-0,20%	0,24%	-0,20%	-	0,65%

Indicadores financeiros

	No mês	No ano	6 meses	12 meses	24 meses	D.Início
CDI	0,16%	2,77%	0,99%	2,77%	8,90%	7,30%
IPCA	1,35%	4,52%	4,42%	4,52%	9,02%	7,77%
IGP-M	0,96%	23,14%	17,96%	23,14%	32,13%	30,10%
DOLAR	-2,53%	28,93%	-5,10%	28,93%	34,12%	30,96%
IBOVESPA	9,30%	2,92%	25,21%	2,92%	35,42%	26,09%
IBrX 50	9,42%	3,62%	26,00%	3,62%	33,83%	24,86%
IBrX 100	9,15%	3,50%	25,28%	3,50%	38,06%	28,51%
IMA-B	4,85%	6,41%	8,21%	6,41%	30,83%	24,17%
INPC	1,46%	5,45%	5,07%	5,45%	10,17%	8,63%
IHFA	2,71%	5,51%	6,52%	5,51%	17,24%	14,92%
MXWOBRL	1,50%	47,44%	17,05%	47,44%	93,05%	70,70%
BMK:	3,25%	7,51%	9,12%	7,51%	-	20,13%

Indicadores de Rentabilidade (%)

2020	Efetiva	Distância do Benchmark	2019	Efetiva	Distância do Benchmark	2018	Efetiva	Distância do Benchmark
Jan	0,21%	-0,05%						
Fev	-2,38%	-0,17%						
Mar	-9,11%	-0,36%	Mar	0,36%	-0,00%			
Abr	4,29%	0,25%	Abr	0,92%	0,02%			
Mai	3,07%	0,27%	Mai	1,14%	0,14%			
Jun	2,64%	-0,30%	Jun	2,22%	0,21%			
Jul	3,23%	0,22%	Jul	0,85%	0,06%			
Ago	-0,34%	0,04%	Ago	0,24%	-0,16%			
Set	-1,51%	-0,07%	Set	1,79%	0,18%			
Out	-0,14%	-0,08%	Out	1,50%	0,15%			
Nov	4,56%	0,01%	Nov	0,20%	-0,13%			
Dez	3,36%	0,11%	Dez	2,70%	0,29%			
Ano	7,30%	-0,20%	Ano	12,56%	0,81%			

Contribuição de cada classe de ativo no desempenho global da Carteira no mês

Contribuição de cada classe de ativo no desempenho global da Carteira no ano


Posição Sintética dos Ativos em 31/12/2020

	Financeiro	% Part
FUNDOS SEGMENTO R FIXA	7.253.082,51	
BRAD MP FPM ARROJADO IE MULTIMERCADO FIC	7.253.082,51	100,00
Total Renda Fixa em 31/12/2020	7.253.082,51	

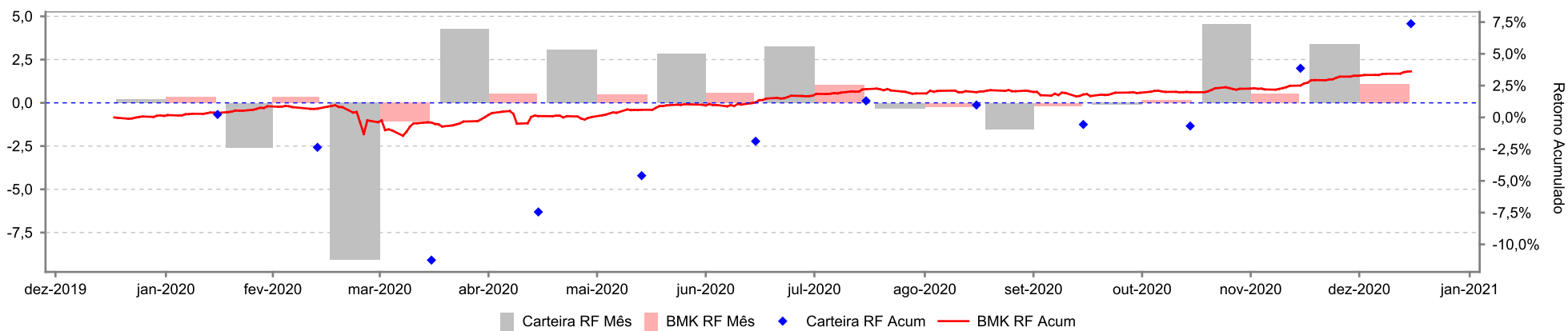
Rentabilidade dos Investimentos

	% Nominal	Distância do Benchmark
Rentabilidade do Período	3,38%	2,29%
Rentabilidade no Ano	7,37%	3,75%

Indicadores de Rentabilidade (%)

2020	Efetiva	Distância do BenchMark	2019	Efetiva	Distância do BenchMark	2018	Efetiva	Distância do BenchMark
Jan	0,23%	-0,12%	Jan	0,00%	0,00%	Jan	0,00%	0,00%
Fev	-2,58%	-2,91%	Fev	0,00%	0,00%	Fev	0,00%	0,00%
Mar	-9,09%	-8,01%	Mar	0,36%	0,31%	Mar	0,00%	0,00%
Abr	4,27%	3,76%	Abr	0,94%	0,23%	Abr	0,00%	0,00%
Mai	3,09%	2,59%	Mai	1,17%	0,01%	Mai	0,00%	0,00%
Jun	2,84%	2,25%	Jun	2,24%	1,13%	Jun	0,00%	0,00%
Jul	3,25%	2,22%	Jul	0,88%	0,16%	Jul	0,00%	0,00%
Ago	-0,32%	-0,09%	Ago	0,27%	-0,06%	Ago	0,00%	0,00%
Set	-1,52%	-1,35%	Set	1,81%	0,87%	Set	0,00%	0,00%
Out	-0,12%	-0,29%	Out	1,53%	0,48%	Out	0,00%	0,00%
Nov	4,57%	4,06%	Nov	0,21%	0,41%	Nov	0,00%	0,00%
Dez	3,38%	2,29%	Dez	2,70%	2,00%	Dez	0,00%	0,00%
Ano	7,37%	3,75%	Ano	12,76%	5,99%	Ano	0,00%	0,00%

Rentabilidade do Segmento de Renda Fixa x Benchmark



Composição da carteira de Títulos Públicos

Emissor	Características	Origem	Emissão	Vencimento	% PL
LTN-O					
TESOURO	PRÉ 1.89%	BRAM H FIA PASS IBRX	31/12/20	04/01/21	0,07%
TESOURO	PRÉ 1.89%	BRAM H FIA PASS IBRX	30/12/20	31/12/20	0,00%
				Total	0,07%

Análise de Risco e Retorno da Carteira

	Valor Bruto em		Rentabilidades					Volat. (%a.a) últimos ^(a) 12m	Liquidez ⁽⁸⁾	Estratégia ⁽⁹⁾	Gestor
	31/12/2020	% Cart	No mês	No ano	6 meses	12 meses	24 meses				
FUNDOS SEGMENTO R FIXA											
BRAD MP FPM ARROJADO IE	7.253.082,51	100,01%	3,38%	8,34%	9,44%	8,34%	-	-	D0	MULTIMERCADO	BRADESCO
			2053,41%	301,38%	956,72%	301,38%					
OUTROS VALORES											
SALDO CONTA INV. E A LIQUIDAR	-1.025,27	-0,01%	-	-	-	-	-	-	D0		
CARTEIRA CONSOLIDADA	7.252.057,24	100,00%	3,36%	7,30%	9,36%	7,30%	-				
VARIAÇÃO DO CDI NOS PERÍODOS			0,16%	2,77%	0,99%	2,77%	8,90%				
VARIAÇÃO IBOVESPA NOS PERÍODOS			9,30%	2,92%	25,21%	2,92%	35,42%				

Fundos de Investimento - Saldos e Movimentação no Período

Fundos de Investimento	Nº de Cotas Anterior	Saldo Anterior	Aplicações		Resgates		IRRF + IOF	Nº de Cotas Atual	Valor atual da Cota	Saldo Bruto Atual
			Nº de Cotas	Valor	Nº de Cotas	Valor				
BRAD MP FPM ARROJADO IE	5.942.501,23	7.038.932,52	3.408,85	4.151,84	22.637,75	27.531,75	0,00	5.923.272,34	1,224505	7.253.082,51
Total		7.038.932,52		4.151,84		27.531,75	0,00			7.253.082,51

Histórico das Movimentações - Investimentos

Data	Operação	Quantidade	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido
04/12/2020	Resgate BRAD MP FPM ARROJADO IE MULTIMERCADO	32,5801533	39,12	0,00	39,12
07/12/2020	Resgate BRAD MP FPM ARROJADO IE MULTIMERCADO	654,4814796	785,09	0,00	785,09
09/12/2020	Resgate BRAD MP FPM ARROJADO IE MULTIMERCADO	549,9907062	659,54	0,00	659,54
16/12/2020	Aplicacao BRAD MP FPM ARROJADO IE MULTIMERCADO	1.234,1103155	1.500,00	0,00	1.500,00
17/12/2020	Resgate BRAD MP FPM ARROJADO IE MULTIMERCADO	21.280,1858743	25.901,54	0,00	25.901,54
18/12/2020	Resgate BRAD MP FPM ARROJADO IE MULTIMERCADO	99,6616371	121,23	0,00	121,23
21/12/2020	Resgate BRAD MP FPM ARROJADO IE MULTIMERCADO	20,8459024	25,23	0,00	25,23
22/12/2020	Aplicacao BRAD MP FPM ARROJADO IE MULTIMERCADO	824,4789788	1.000,00	0,00	1.000,00
23/12/2020	Aplicacao BRAD MP FPM ARROJADO IE MULTIMERCADO	85,7788403	104,48	0,00	104,48
28/12/2020	Aplicacao BRAD MP FPM ARROJADO IE MULTIMERCADO	613,3129136	750,00	0,00	750,00
29/12/2020	Aplicacao BRAD MP FPM ARROJADO IE MULTIMERCADO	651,1680249	797,36	0,00	797,36

Medidas de Risco e Retorno

	Var (%)	Var (R\$) ⁽¹⁾	Sharpe (ano) ⁽³⁾	Vol Ano ⁽²⁾
Carteira Consolidada	-	-	-	-

Comportamento de Retornos Mensais nos últimos 24 meses

	Quantidade	Percentual
Observações acima do CDI	14	63,64%
Observações positivas abaixo do CDI	3	13,64%
Observações negativas	5	22,73%

Maior e Menor desempenho %Rent nos últimos 24 meses

	Rentabilidade	Mês
Maior Rentabilidade da Carteira	4,56%	Nov/2020
Menor Rentabilidade da Carteira	-9,11%	Mar/2020

Apêndice

1- "VaR (R\$)" é a máxima perda estimada que o fundo/carteira pode ter, considerando um período específico de tempo e intervalo de confiança. Parâmetros do VaR: Intervalo de confiança = 99,0% / Holding Period = 1 dia.

2- Vol Ano: Volatilidade anualizada calculada sobre a variação da cota do fundo/carteira.

3- O Índice de Sharpe expressa a relação retorno/risco. O numerador é o retorno excedente em relação a taxa livre de risco (CDI) oferecido pelo fundo/carteira em certa periodicidade. O denominador, é o desvio padrão desses retornos. Retorno excedente é a parcela do rendimento oferecido pelo fundo/carteira que ficou acima ou abaixo da rentabilidade de um indexador adotado livremente. Desvio padrão é o padrão de oscilação desses retornos (risco). Quando menor que zero, o Índice de Sharpe será representado por N/A.

4- O gráfico Posição Consolidada por Tipo de Ativo (Pagina 1) não leva em consideração valores a liquidar e saldo em tesouraria.

5- A BRAM - Bradesco Asset Management S.A. Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários tem como critério sempre demonstrar o Rating da agência de classificação de risco mais conservadora.

Para maiores informações entre em contato com seu gerente ou mesa de Investimentos: 0800 701 7979 - Internet: www.bradescoasset.com.br

O presente demonstrativo tem caráter informativo e distribuição exclusiva ao cotista da carteira ou fundo de investimento. As informações constantes desse relatório são válidas na presente data. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Para a avaliação da performance de fundos de Investimento é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 meses. A rentabilidade divulgada neste material não é livre de impostos. O tratamento tributário depende da situação individual de cada cliente e pode estar sujeito a mudanças em função de alterações na legislação ou mesmo nas condições do cliente. Para questões relativas a temas tributários e jurídicos, o cliente deverá contatar seu consultor qualificado. A BRAM - Bradesco Asset Management S.A. Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários não é responsável pelo tratamento fiscal e jurídico dispensado a qualquer investimento realizado pelo cliente. O risco calculado é apenas uma estimativa estando, portanto, sujeito a limitações inerentes aos modelos utilizados, e retrata o comportamento de portfólio em condições normais de mercado, não considerando situações de crise. Fundos de investimento não contam com a garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. Leia o Prospecto, o Formulário de Informações Complementares, Lâmina de Informações Essenciais e o Regulamento do Fundo de Investimento antes de investir. A descrição do TIPO ABNBIMA está disponível no Formulário de Informações Complementares.



A presente instituição aderiu ao Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para os Fundos de Investimento.

28/3 /2019-1 /1 /2020BENCHMARK RF:70.00% (80.00%CDI + 20.00%IMA-B) + RV:27.50% (100.00%IBrX 100) + OFF:2.50% (100.00%MXWOBRL)

2 /1 /2020- Atual BENCHMARK RF:60.00% (80.00%CDI + 20.00%IMA-B) + RV:25.00% (100.00%IBrX 100) + ESTR:10.00% (100.00%IHFA) + OFF:5.00% (100.00%MXWOBRL)