



SÃO JOSÉ DO RIO PRETO
SETEMBRO 2020



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 21.10.2020.

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

REND A FIXA **69,88%**

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	0,54	0,04	2,83	1.594.495,52	0,43	7.413.658.574,68	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,72	-1,56	-0,93	16.563.225,32	4,51	5.533.318.681,28	0,30
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,13	2,97	9.855.126,99	2,68	10.130.144.603,43	0,10
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,54	0,03	2,79	1.356.144,96	0,37	805.562.235,52	0,17
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,49	-0,61	1,92	4.320.442,93	1,18	1.241.251.655,53	0,35
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,01	-0,16	4,29	12.605.275,51	3,43	17.747.142.317,32	0,07
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PUBLICOS RF	5,03	-0,14	4,37	7.383.802,66	2,01	1.117.588.180,49	0,66
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	4,08	0,04	4,84	3.875.816,54	1,05	9.208.011.978,57	0,04
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,16	-0,81	5,51	8.645.622,27	2,35	717.075.038,12	1,21
BB	BB	BB PREV RF IPCA	6,10	-0,30	5,57	5.055.238,62	1,38	350.162.776,21	1,44
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,22	-0,75	1,86	40.239.199,64	10,95	10.452.752.168,75	0,38
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	-0,50	4,53	39.023.099,40	10,62	13.535.810.678,86	0,29
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	8,72	-0,77	4,62	912.007,70	0,25	214.911.410,12	0,42
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,15	-0,10	3,58	1.719.826,71	0,47	570.142.358,76	0,30
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			5,59	-0,57	3,01	153.149.324,77	41,68		

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
CEF	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	12,71	-1,54	-0,98	50.088.511,48	13,63	2.850.384.468,52	1,76
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,71	-1,54	-0,98	50.088.511,48	13,63		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,23	0,11	1,71	2.529.876,37	0,69	3.791.411.661,08	0,07
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	13,29	-1,60	-0,80	17.348.868,70	4,72	1.950.918.734,76	0,89
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	16,69	-2,18	0,10	4.558.323,35	1,24	591.294.917,81	0,77
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,02	1,82	2.403.902,16	0,65	2.533.726.732,47	0,09
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,08	-0,00	0,02	53.065,89	0,01	1.878.414.583,86	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,07	0,09	1,64	3.944.647,54	1,07	480.823.075,37	0,82
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5,38	-0,19	4,48	6.385.099,41	1,74	788.410.647,13	0,81
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,13	-0,23	1,93	2.395.905,00	0,65	1.154.190.584,67	0,21
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	6,82	-0,98	1,62	11.604.427,31	3,16	1.377.785.815,37	0,84
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			8,21	-1,05	1,43	51.224.115,73	13,94		

Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado")

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4,48	-0,08	4,11	2.278.817,92	0,62	604.107.677,88	0,38
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			4,48	-0,08	4,11	2.278.817,92	0,62		
Renda Fixa			7,11	-0,85	2,04	256.740.769,90	69,88		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

25,79%

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
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVSPA	43,08	-4,69	-18,09	3.555.708,58	0,97	110.541.465,03	3,22
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			43,08	-4,69	-18,09	3.555.708,58	0,97		

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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	42,98	-4,27	-20,98	5.176.566,82	1,41	543.611.577,48	0,95
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	43,55	-5,04	-14,61	15.155.904,51	4,13	1.999.773.052,56	0,76
XP	XP	XP INVESTOR FI DE ACOES	49,05	-6,69	-15,84	3.919.837,25	1,07	346.783.298,23	1,13
BB	BB	BB ACOES SETOR FINANCEIRO FIC FI	46,31	-6,62	-29,99	1.710.916,49	0,47	224.603.122,92	0,76
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	41,38	-2,90	-15,40	15.743.253,43	4,29	578.311.222,57	2,72
XP	XP	XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	40,16	-5,29	-27,30	2.183.033,60	0,59	237.273.673,43	0,92
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	42,87	-4,38	-21,59	18.902.865,80	5,15	406.655.961,35	4,65
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	41,62	-2,47	-14,37	3.173.453,04	0,86	229.362.963,61	1,38
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			42,28	-4,32	-18,43	65.965.830,94	17,95		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	12,88	-2,05	-3,53	4.169.211,02	1,13	2.292.815.963,87	0,18
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	32,62	-4,88	0,56	15.453.526,81	4,21	992.571.971,59	1,56
Sub-total Artigo 8º III			27,51	-4,29	-0,34	19.622.737,83	5,34		

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
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	54,35	-2,03	13,77	5.605.161,27	1,53	178.804.639,26	3,13
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			54,35	-2,03	13,77	5.605.161,27	1,53		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados

35,49

-4,19

-13,64

94.749.438,62

25,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,33%

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
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	28,45	-1,99	52,76	5.179.325,95	1,41	1.671.279.124,17	0,31
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	28,67	-1,39	65,29	8.789.648,90	2,39	1.984.282.330,10	0,44
BB	BB	BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	28,02	-2,46	46,05	1.942.874,32	0,53	440.169.483,64	0,44
Sub-total Artigo 9º A, III			27,77	-1,72	58,51	15.911.849,17	4,33		
Investimentos no Exterior			27,77	-1,72	58,51	15.911.849,17	4,33		
Total			13,40	-1,77	-0,99	367.402.057,69	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	153.149.324,77	41,68	10,00	45,40	70,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	50.088.511,48	13,63	0,00	10,00	20,00	70,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	51.224.115,73	13,94	0,00	14,50	40,00	50,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.278.817,92	0,62	0,00	0,60	5,00	15,00
	Total Renda Fixa	256.740.769,90	69,88				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	3.555.708,58	0,97	0,00	1,00	10,00	40,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	65.965.830,94	17,95	5,00	20,00	30,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	19.622.737,83	5,34	0,00	5,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	5.605.161,27	1,53	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	94.749.438,62	25,79				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	15.911.849,17	4,33	0,00	2,50	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	15.911.849,17	4,33				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

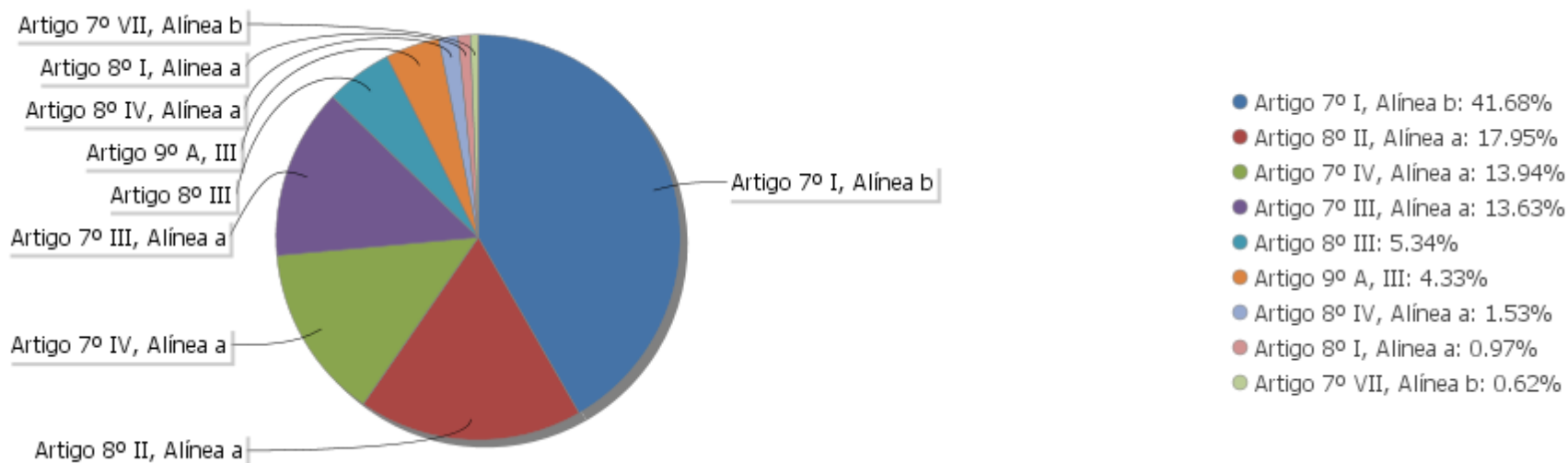
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,57 -364,38	3,01 132,46	0,42 82,43	3,62 289,62	5,12 144,41	-898.901,46	4.948.819,50
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-1,54 -980,31	-0,98 -43,25	0,89 173,47	5,76 460,90	1,73 48,71	-786.756,64	-440.647,05
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-1,05 -667,12	1,43 62,88	0,49 94,73	4,53 362,18	3,51 99,19	-511.256,12	512.058,30
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,08 -50,84	4,11 180,74	1,40 272,95	5,06 404,85	6,65 187,57	-1.820,20	90.014,88
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,69 0,11	-18,09 0,11	-0,46 0,02	28,86 -0,70	-9,73 -0,05	-174.788,09	-785.186,93
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,32 0,48	-18,43 -0,24	0,16 0,64	29,16 -0,40	-6,61 3,07	-2.974.811,65	-14.755.440,86
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-4,29 0,51	-0,34 17,85	5,66 6,13	22,93 -6,63	7,49 17,18	-879.518,04	-67.297,89
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,03 2,77	13,77 31,96	-10,84 -10,36	-3,47 -33,03	33,80 43,49	-115.987,58	999.766,60
Artigo 9º A, III % do CDI	-1,72 -1.095,22	58,51 2.571,34	16,15 3.153,75	47,79 3.821,15	67,57 1.907,24	-278.338,04	5.873.403,49
						-6.622.177,82	-3.624.509,96

Análise de Liquidez

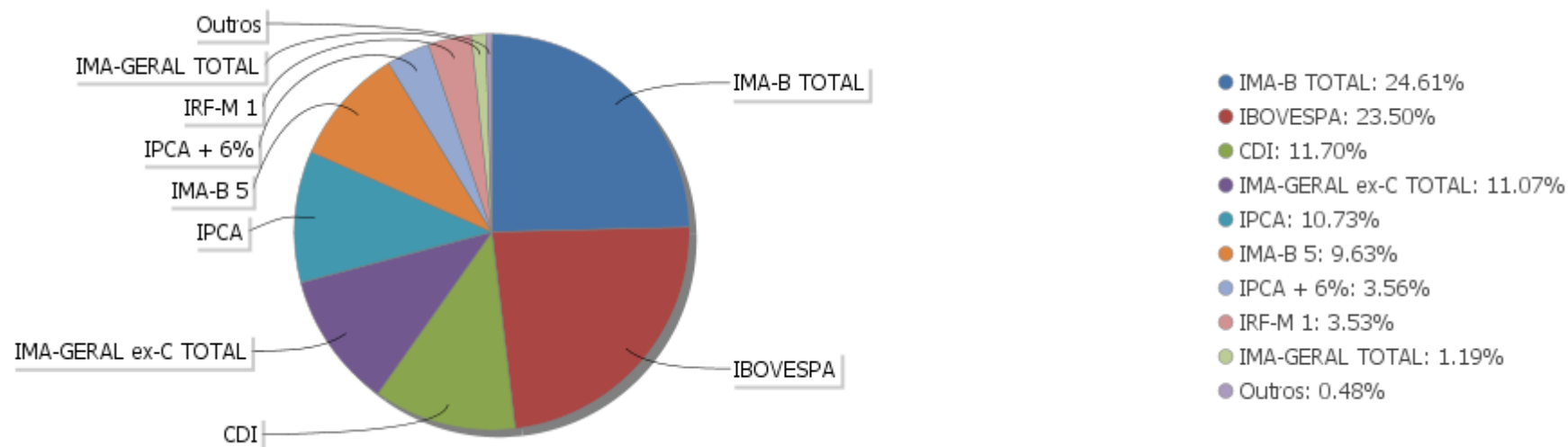
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	336.087.752,04	91,48	336.087.752,04	91,48
de 31 a 364 dias	15.743.253,43	4,29	351.831.005,47	95,76
acima de 365 dias	15.571.052,22	4,24	367.402.057,69	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

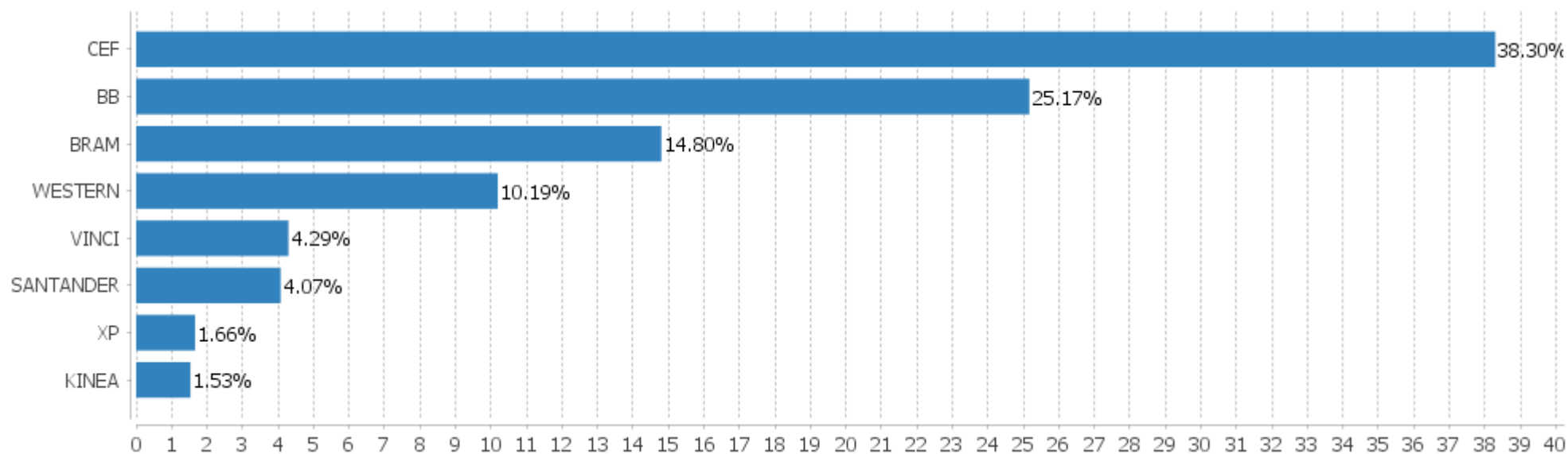


Alocação Por Estratégia



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
2020	0,63	-1,53	-9,41	3,40	2,58	2,85	3,37	-0,44	-1,77				-0,99
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12				5,76
p.p. indexador	-0,08	-2,19	-9,98	3,25	2,51	2,11	2,48	-1,16	-2,89				-6,75
2019	2,75	0,44	0,65	1,23	1,25	2,60	1,03	0,30	1,91	2,01	0,09	2,58	18,15
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	1,92	-0,46	-0,55	0,17	0,61	2,15	0,31	-0,32	1,46	1,37	-0,89	0,93	7,56
2018	2,74	0,16	0,62	0,32	-2,83	-0,62	1,78	0,19	0,78	1,99	0,94	0,34	6,48
IPCA + 6%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	1,93	-0,58	0,04	-0,39	-3,72	-2,37	0,94	-0,25	-0,14	1,03	0,68	-0,27	-3,44

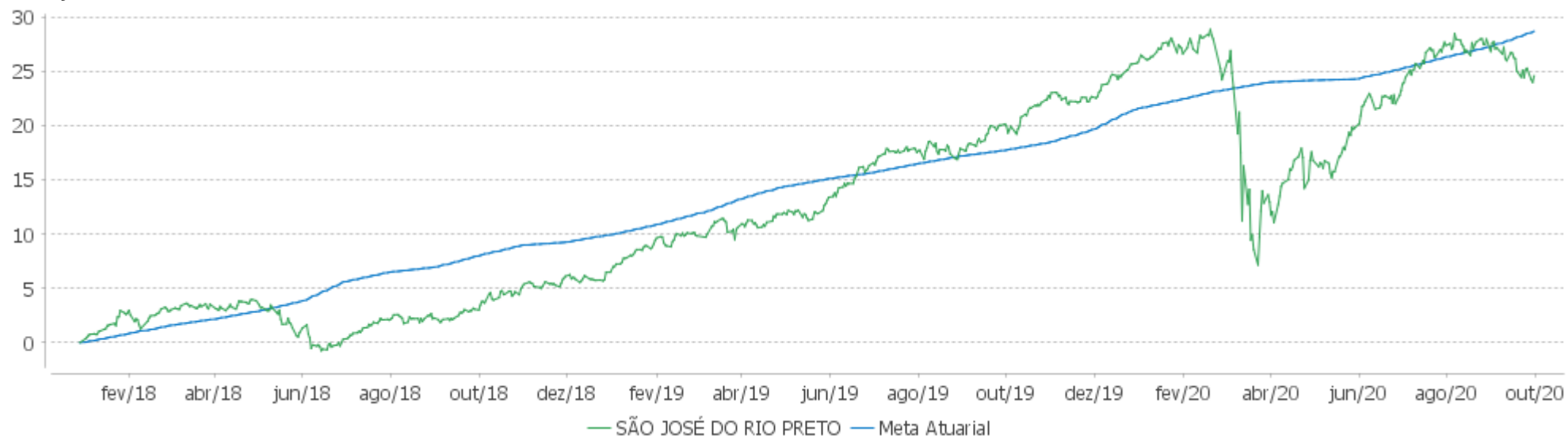
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	17	51,52	03 meses	1,09	2,75	-1,66	6,92
Meses abaixo da Meta Atuarial	16	48,48	06 meses	10,29	3,74	6,55	8,82
			12 meses	3,70	9,24	-5,54	13,40
			24 meses	20,84	19,12	1,73	9,90
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,40	2020-04	Desde 29/12/2017	24,56	28,57	-4,01	8,72
Menor rentabilidade da Carteira	-9,41	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
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	-0,81 -0,69	5,51 1,00	0,67 -0,63	5,99 0,88	8,50 1,26	30,69 6,93	38,27 6,43
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PUBLICOS RF Var. IMA-B 5 p.p.	-0,14 -0,02	4,37 -0,14	1,23 -0,07	5,00 -0,11	7,04 -0,20	23,28 -0,48	31,08 -0,76
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,16 -0,04	4,29 -0,22	1,21 -0,09	4,96 -0,15	6,91 -0,33	23,18 -0,58	30,91 -0,93
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,04 -0,11	2,83 -0,29	0,36 -0,14	1,43 -0,23	4,17 -0,37	11,70 -0,63	18,97 -0,94
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p.	-0,10 -1,47	3,58 -2,99	1,05 -2,17	4,36 -0,13	6,19 -3,93	22,78 2,67	41,08 8,79
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,61 -0,01	1,92 -0,49	0,30 -0,22	3,01 -0,42	3,80 -0,55	20,81 -1,04	26,70 -1,72
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF.. Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,77 0,74	4,62 5,34	0,74 -0,22	5,93 -0,04	7,64 5,54	33,01 -1,13	33,47 -4,10
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,03 -0,12	2,79 -0,33	0,34 -0,17	1,42 -0,25	4,14 -0,40	11,61 -0,71	18,88 -1,03
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,75 -0,04	1,86 -0,10	0,10 -0,15	3,07 0,08	3,70 -0,19	21,50 0,39	27,56 0,18
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6% p.p.	-0,30 -1,43	5,57 -0,28	1,48 -1,30	6,07 2,28	8,40 -0,92	30,87 11,66	36,57 4,58
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,50 -1,14	4,53 3,19	-0,09 -1,34	3,18 2,37	6,41 3,27	25,88 19,76	33,17 22,25
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,04 0,02	4,84 -0,57	1,66 -0,33	5,27 -0,15	7,35 -0,65	20,53 -1,35	29,77 -2,49
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,13 -0,02	2,97 -0,15	0,47 -0,04	1,57 -0,10	4,34 -0,21	11,93 -0,39	19,28 -0,63
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,56 -0,04	-0,93 -0,21	0,83 -0,13	5,77 -0,20	1,83 -0,28	33,39 -0,75	36,49 -1,07
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,54 -0,03	-0,98 -0,26	0,89 -0,07	5,76 -0,20	1,73 -0,38	33,13 -1,01	36,52 -1,04
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6% p.p.	-0,08 -1,21	4,11 -1,73	1,40 -1,38	5,06 1,27	6,65 -2,68	21,92 2,71	31,74 -0,25
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	-1,60	-0,80	0,92	6,12	2,03	34,42	37,01

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.	-0,09	-0,08	-0,04	0,15	-0,08	0,28	-0,55
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	-0,19	4,48	1,21	5,10	7,13	23,57	31,06
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,06	-0,02	-0,08	-0,01	-0,11	-0,19	-0,78
SANTANDER RF ATIVO FIC	-0,23	1,93	-0,05	1,22	4,33	18,61	22,63
% do CDI	-143,41	84,99	-8,89	97,87	122,14	185,39	130,35
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11	1,71	0,55	1,08	2,90	9,28	16,46
% do CDI	72,39	75,26	107,65	86,27	81,72	92,41	94,83
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	-2,18	0,10	0,14	6,57	3,16	41,32	43,49
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,67	0,82	-0,82	0,60	1,05	7,18	5,93
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,02	1,82	0,44	1,22	2,98	9,27	16,58
% do CDI	15,30	79,94	86,28	97,65	84,04	92,40	95,53
BB PREV RF FLUXO FIC	-0,00	1,42	0,18	0,66	2,40	7,66	13,60
% do CDI	-0,19	62,49	34,55	53,10	67,81	76,30	78,36
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,09	1,64	0,29	0,83	2,68	8,21	14,47
% do CDI	55,34	71,97	57,43	66,45	75,66	81,83	83,39
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	-0,98	1,62	-0,16	2,97	3,46	20,62	
% do CDI	-626,37	71,12	-30,69	237,17	97,53	205,46	
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	-4,69	-18,09	-0,46	28,86	-9,73	18,23	25,46
Var. IBOVESPA p.p.	0,11	0,11	0,02	-0,70	-0,05	-1,00	-1,88
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	-2,47	-14,37	-0,68	29,13	0,95		
Var. IBOVESPA p.p.	2,32	3,82	-0,20	-0,43	10,63		
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	-4,38	-21,59	-0,62	27,14	-12,24	12,08	22,35
Var. IBOVESPA p.p.	0,42	-3,40	-0,14	-2,42	-2,56	-7,15	-4,99
XP INVESTOR FI DE ACOES	-6,69	-15,84	1,82	40,15	-1,97	47,75	55,01
Var. IBOVESPA p.p.	-1,89	2,36	2,30	10,60	7,71	28,52	27,67
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	-2,90	-15,40	0,62	29,23	-0,02	56,46	48,61
Var. IBOVESPA p.p.	1,90	2,80	1,10	-0,33	9,66	37,23	21,27
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	-4,27	-20,98	2,37	31,68	-11,99	20,08	24,09
Var. IBOVESPA p.p.	0,52	-2,79	2,85	2,12	-2,31	0,85	-3,25
BB ACOES SETOR FINANCEIRO FIC FI	-6,62	-29,99	-6,20	14,15	-24,79	12,02	10,31
Var. IBOVESPA p.p.	-1,83	-11,80	-5,72	-15,41	-15,11	-7,21	-17,03
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	-5,29	-27,30	-4,20	10,07	-15,94	41,44	30,27
Var. IBOVESPA p.p.	-0,50	-9,10	-3,72	-19,49	-6,26	22,21	2,94
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	-5,04	-14,61	1,16	33,49	-1,67	48,47	60,05
Var. IBOVESPA p.p.	-0,24	3,59	1,63	3,94	8,01	29,23	32,71
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-4,88	0,56	7,43	27,61	9,43	16,25	40,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-3.106,08	24,45	1.451,94	2.207,30	266,17	161,91	231,23
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	-2,05	-3,53	-0,45	8,24	0,88	14,18	20,95
% do CDI	-1.308,64	-155,35	-87,00	658,60	24,84	141,26	120,69
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	-2,03	13,77	-10,84	-3,47	33,80	150,37	
Var. IPCA + 6% p.p.	-3,16	7,92	-13,61	-7,26	24,48	131,16	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-1,99	52,76	14,98	43,04	61,21	70,33	154,87
Var. IBOVESPA p.p.	2,80	70,95	15,46	13,48	70,90	51,09	127,53
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	-2,46	46,05	12,94	37,50	56,62	52,67	131,20
Var. IBOVESPA p.p.	2,33	64,24	13,41	7,94	66,30	33,44	103,86
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	-1,39	65,29	17,59	53,33	74,32	84,99	173,02
Var. IBOVESPA p.p.	3,41	83,49	18,07	23,77	84,00	65,75	145,69
CDI	0,16	2,28	0,51	1,25	3,54	10,04	17,36
IBOVESPA	-4,80	-18,20	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34
INPC + 6%	1,36	6,58	3,22	4,50	10,12	20,11	32,29
IPCA + 6%	1,13	5,85	2,78	3,79	9,32	19,21	31,99

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	0,15	3,12	0,51	1,66	4,54	12,32	19,91
IRF-M 1+	-0,91	5,40	-0,59	3,90	7,61	30,00	36,94
IRF-M TOTAL	-0,56	4,62	-0,24	3,15	6,56	24,50	31,64
IMA-B 5	-0,12	4,51	1,30	5,11	7,24	23,75	31,84
IMA-B 5+	-2,60	-4,56	0,75	6,78	-1,67	42,42	41,26
IMA-B TOTAL	-1,51	-0,72	0,96	5,97	2,11	34,14	37,56
IMA-C TOTAL	2,95	17,78	9,60	18,32	19,95	48,39	67,40
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,71	1,96	0,25	2,99	3,90	21,11	27,38
IMA-GERAL TOTAL	-0,60	2,41	0,53	3,43	4,35	21,85	28,42
IDKA 2	0,02	5,41	1,99	5,41	8,00	21,88	32,26
IDKA 20	-4,30	-11,82	0,58	7,11	-8,89	56,79	46,43
CDI	0,16	2,28	0,51	1,25	3,54	10,04	17,36
Renda Variável							
IBOVESPA	-4,80	-18,20	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34
IBRX 100	-4,58	-17,42	-0,04	30,33	-8,59	23,26	30,47
IBRX 50	-4,62	-18,06	-0,37	31,30	-10,02	16,09	24,57
SMALL CAP	-5,44	-18,93	2,27	35,50	-1,78	54,49	42,68
IFIX	0,46	-12,59	-0,41	12,06	4,12	30,92	25,84
Índice Consumo - ICON	-3,96	-9,26	1,83	42,00	-1,04	53,03	27,90
Índice Dividendos - IDIV	-4,63	-21,08	-3,31	14,78	-9,81	37,85	30,49
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,64	1,34	1,24	0,81	3,14	6,12	10,92
INPC	0,87	2,04	1,68	1,49	3,89	6,93	11,17
IGPM	4,34	14,40	9,59	12,51	17,94	21,91	34,14
SELIC	0,16	2,28	0,51	1,25	3,54	10,04	17,37
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
234	01/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	13.832,68	0,00	6.556,60103900	2,1097333690
235	01/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.043.643,60	556.554,11617395	1,8751880000
236	02/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	4.333,18	0,00	2.053,81932000	2,1098155800
237	02/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	6.976,25	3.720,14088675	1,8752650000
238	03/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	113.484,16	53.787,15151100	2,1098748830
239	03/09/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	118.091,42	0,00	78.941,85378800	1,4959291470
240	03/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	5.236,32	0,00	2.792,19321479	1,8753430000
241	04/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	33.501,68	0,00	15.877,94331700	2,1099508500
242	04/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.261,11	1.205,65526655	1,8754200000
243	08/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.207.833,36	644.007,08718809	1,8754970000
244	08/09/2020	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	1.133.194,81	0,00	302.725,34468158	3,7433100000
245	10/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	16.791,01	0,00	7.957,25427100	2,1101512440
246	10/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	2.386,44	0,00	1.272,32556999	1,8756520000
247	11/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	71,26	37,99054235	1,8757300000
248	14/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	53.491,98	28.516,78237686	1,8758070000
249	15/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	34.356,31	16.281,33596700	2,1101652880
250	15/09/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	54.904,10	0,00	36.805,28358000	1,4917450610
251	15/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	7.329,23	3.907,08060840	1,8758840000
252	16/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	8.619,54	0,00	4.084,95965300	2,1100673520
253	16/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	4.644,95	2.476,03761485	1,8759610000
254	18/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	11.610,38	0,00	5.502,48424900	2,1100251220
255	18/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	19.924,19	0,00	10.619,91369404	1,8761160000
256	21/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	7.042,99	3.753,87086836	1,8761940000
257	22/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	18.710,20	0,00	9.972,01363769	1,8762710000
258	24/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.989,65	0,00	1.890,77243800	2,1100635480
259	25/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	156.870,91	83.597,42904891	1,8765040000
260	29/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	938.539,35	0,00	500.111,55457035	1,8766600000
261	29/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.050.000,00	789.793,55566985	2,5956150000

Carteira: SÃO JOSÉ DO RIO PRETO

Data Extrato: 30/09/2020

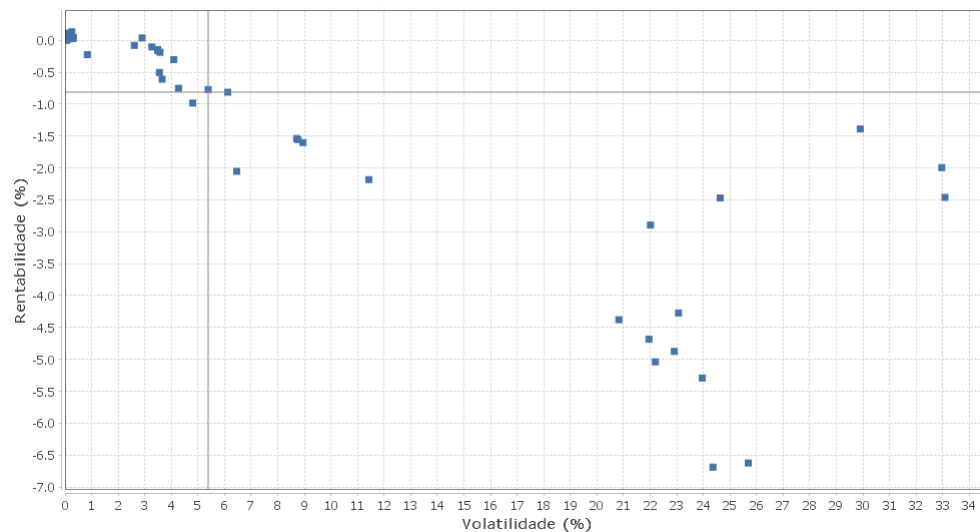
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
262	29/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	600,00	231,15908946	2,5956150000
263	30/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	8.308,05	0,00	3.938,11350400	2,1096522460
264	30/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.208.557,64	0,00	643.966,81690954	1,8767390000

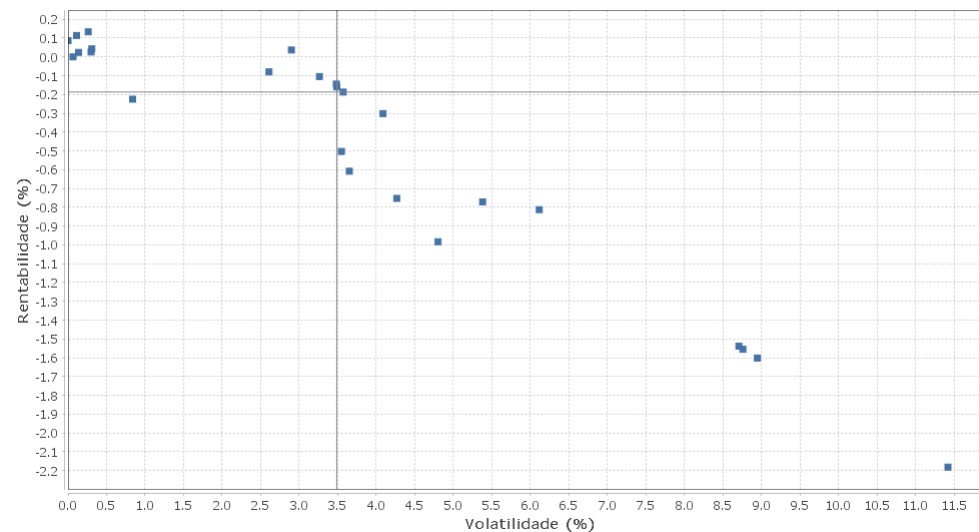
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

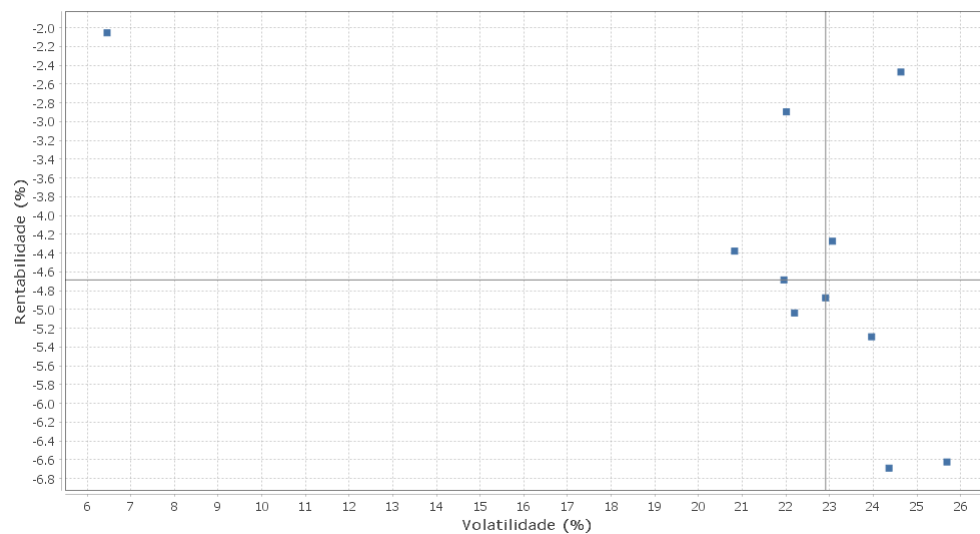
SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - No Mês



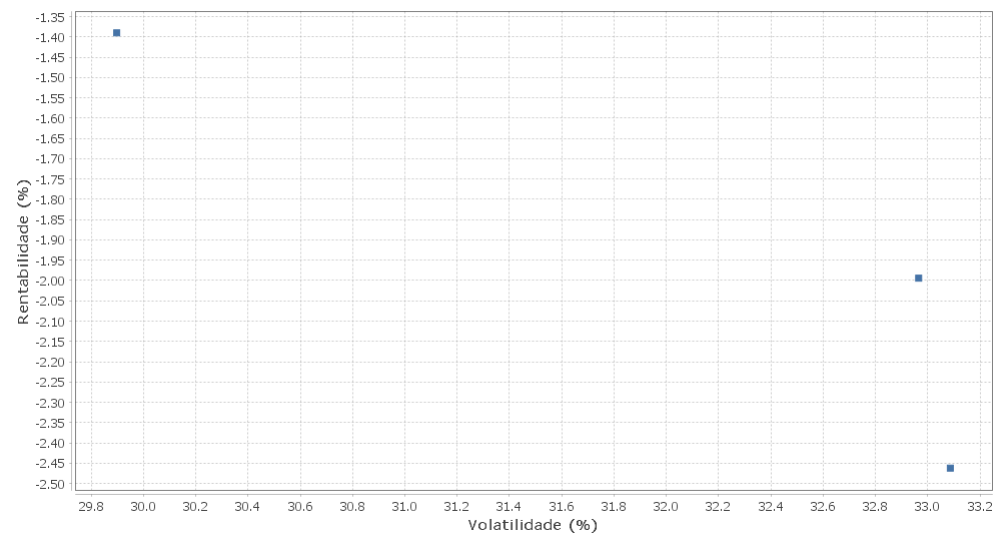
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,01	0,00	-140,08	0,09	3.944.647,54	1,07
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,04	0,00	-2,43	-0,00	53.065,89	0,01
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,11	0,05	-0,00	-0,39	0,11	2.529.876,37	0,69
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,14	0,06	0,00	-0,97	0,02	2.403.902,16	0,65
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,26	0,14	0,00	-0,09	0,13	9.855.126,99	2,68
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,30	0,14	0,00	-0,44	0,03	1.356.144,96	0,37
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,31	0,14	0,00	-0,37	0,04	1.594.495,52	0,43
SANTANDER RF ATIVO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,84	0,40	0,00	-0,46	-0,23	2.395.905,00	0,65
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	2,61	0,87	0,00	-0,09	-0,08	2.278.817,92	0,62
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,90	1,03	0,01	-0,04	0,04	3.875.816,54	1,05
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,26	0,92	0,00	-0,08	-0,10	1.719.826,71	0,47
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PUBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,48	1,01	0,01	-0,09	-0,14	7.383.802,66	2,01
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,49	1,02	0,02	-0,09	-0,16	12.605.275,51	3,43
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,55	1,33	0,11	-0,19	-0,50	39.023.099,40	10,62
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	3,57	1,07	0,01	-0,10	-0,19	6.385.099,41	1,74
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,65	1,31	0,01	-0,21	-0,61	4.320.442,93	1,18
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	4,09	1,32	0,01	-0,11	-0,30	5.055.238,62	1,38
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,27	1,43	0,12	-0,21	-0,75	40.239.199,64	10,95
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	4,80	1,44	0,04	-0,24	-0,98	11.604.427,31	3,16
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	Artigo 7º I, Alínea b	5,38	1,83	0,00	-0,17	-0,77	912.007,70	0,25
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	6,12	2,00	0,03	-0,16	-0,81	8.645.622,27	2,35
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	Artigo 8º III	6,46	3,08	0,03	-0,34	-2,05	4.169.211,02	1,13
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	8,71	3,22	0,35	-0,19	-1,54	50.088.511,48	13,63
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	8,76	3,22	0,12	-0,20	-1,56	16.563.225,32	4,51
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	8,95	3,31	0,13	-0,20	-1,60	17.348.868,70	4,72
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	11,42	3,98	0,04	-0,20	-2,18	4.558.323,35	1,24
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,83	10,55	0,51	-0,22	-4,38	18.902.865,80	5,15
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	21,95	11,05	0,10	-0,22	-4,69	3.555.708,58	0,97
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	22,01	12,43	0,49	-0,14	-2,90	15.743.253,43	4,29
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	22,20	11,47	0,42	-0,23	-5,04	15.155.904,51	4,13

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	22,91	11,00	0,31	-0,22	-4,88	15.453.526,81	4,21
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	23,07	11,01	0,14	-0,19	-4,27	5.176.566,82	1,41
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	23,96	14,36	0,08	-0,23	-5,29	2.183.033,60	0,59
XP INVESTOR FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	24,36	11,85	0,11	-0,28	-6,69	3.919.837,25	1,07
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	Artigo 8º II, Alínea a	24,63	13,71	0,11	-0,11	-2,47	3.173.453,04	0,86
BB ACOES SETOR FINANCEIRO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	25,69	17,95	0,07	-0,26	-6,62	1.710.916,49	0,47
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	29,90	12,89	0,06	-0,05	-1,39	8.789.648,90	2,39
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	32,97	12,73	0,02	-0,07	-1,99	5.179.325,95	1,41
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	33,09	12,51	0,01	-0,08	-2,46	1.942.874,32	0,53