



**LDB**  
EMPRESAS

**SÃO JOSÉ DO RIO PRETO**  
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

66,92%

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	0,58	0,03	0,03	1.604.965,53	0,41	8.572.331.669,58	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,85	-0,86	-0,86	17.591.693,57	4,51	8.335.200.025,45	0,21
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,56	0,03	0,03	3.365.533,06	0,86	10.435.150.283,00	0,03
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,58	0,03	0,03	2.761.449,69	0,71	856.175.117,14	0,32
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,58	-0,46	-0,46	4.423.078,94	1,13	1.190.995.528,69	0,37
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,06	0,08	0,08	13.034.359,76	3,34	13.518.203.391,91	0,10
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	5,09	0,08	0,08	7.635.048,21	1,96	1.322.067.161,73	0,58
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,18	0,13	0,13	3.999.283,74	1,03	10.852.113.121,11	0,04
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,34	-0,66	-0,66	8.969.208,51	2,30	1.071.755.183,33	0,84
BB	BB	BB PREV RF IPCA	6,15	0,02	0,02	5.075.753,41	1,30	351.583.780,87	1,44
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,33	-0,55	-0,55	44.231.747,41	11,34	9.495.985.226,13	0,47
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	0,03	0,03	39.829.765,53	10,21	14.822.912.413,17	0,27
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	8,78	-0,16	-0,16	946.293,40	0,24	222.990.846,21	0,42
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,22	0,15	0,15	1.777.808,83	0,46	589.364.098,33	0,30
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>5,69</b>	<b>-0,27</b>	<b>-0,27</b>	<b>155.245.989,59</b>	<b>39,81</b>		

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	12,82	-0,88	-0,88	55.219.980,39	14,16	2.989.640.382,47	1,85
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>12,82</b>	<b>-0,88</b>	<b>-0,88</b>	<b>55.219.980,39</b>	<b>14,16</b>		

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	BRDESCO	BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	13,42	-1,02	-1,02	18.400.751,65	4,72	2.084.064.922,01	0,88
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	16,96	-1,73	-1,73	4.859.330,76	1,25	520.963.267,43	0,93
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,15	0,03	0,03	35.045,85	0,01	2.320.539.431,87	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,05	0,08	0,08	3.927.738,90	1,01	608.020.020,83	0,65
BRAM	BRDESCO	BRDESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5,44	-0,02	-0,02	6.589.870,22	1,69	1.002.679.832,30	0,66
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,00	0,03	0,03	2.414.682,51	0,62	902.348.660,42	0,27
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	6,98	-0,58	-0,58	11.882.784,29	3,05	1.406.368.486,30	0,84
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,03	0,00	0,00	16.550,66	0,00	1.165.859.718,78	0,00
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>8,36</b>	<b>-0,73</b>	<b>-0,73</b>	<b>48.126.754,84</b>	<b>12,34</b>		

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	4,57	0,10	0,10	2.365.341,80	0,61	627.044.892,55	0,38
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>4,57</b>	<b>0,10</b>	<b>0,10</b>	<b>2.365.341,80</b>	<b>0,61</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>7,24</b>	<b>-0,48</b>	<b>-0,48</b>	<b>260.958.066,62</b>	<b>66,92</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

28,00%

## 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	44,32	-3,24	-3,24	4.307.980,93	1,10	120.659.555,57	3,57
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b>			<b>44,32</b>	<b>-3,24</b>	<b>-3,24</b>	<b>4.307.980,93</b>	<b>1,10</b>		

## 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	43,97	-3,06	-3,06	5.965.536,23	1,53	502.570.935,25	1,19
BRAM	BEM	BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	44,46	-2,67	-2,67	16.946.420,57	4,35	2.134.082.790,72	0,79
XP	XP	XP INVESTOR FI DE ACOES	49,91	-4,48	-4,48	4.249.253,84	1,09	361.162.198,09	1,18
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	42,37	-3,14	-3,14	18.454.006,66	4,73	744.259.231,51	2,48
XP	XP	XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	41,55	-8,33	-8,33	2.328.709,87	0,60	214.299.142,25	1,09
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	44,05	-3,64	-3,64	22.811.816,69	5,85	460.698.573,61	4,95
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	42,64	-3,56	-3,56	3.671.244,24	0,94	296.764.545,63	1,24
BB	BB	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	46,54	-4,97	-4,97	2.084.784,31	0,53	660.307.850,27	0,32
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>43,29</b>	<b>-3,49</b>	<b>-3,49</b>	<b>76.511.772,41</b>	<b>19,62</b>		

## 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	13,09	-0,58	-0,58	4.405.332,66	1,13	2.188.049.553,95	0,20
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	33,64	-0,16	-0,16	17.211.460,85	4,41	1.233.747.922,53	1,40
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>28,38</b>	<b>-0,25</b>	<b>-0,25</b>	<b>21.616.793,51</b>	<b>5,54</b>		

## 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	50,87	-0,35	-0,35	6.726.518,34	1,73	214.575.918,14	3,13
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b>			<b>50,87</b>	<b>-0,35</b>	<b>-0,35</b>	<b>6.726.518,34</b>	<b>1,73</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	36,38	-2,67	-2,67	109.163.065,19	28,00
---	-------	-------	-------	----------------	-------

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**INVESTIMENTOS NO EXTERIOR** **5,08%**

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
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	30,10	4,30	4,30	3.123.312,31	0,80	1.477.834.874,26	0,21
<b>Sub-total Artigo 9º A, II</b>			<b>30,10</b>	<b>4,30</b>	<b>4,30</b>	<b>3.123.312,31</b>	<b>0,80</b>		

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	30,33	5,79	5,79	5.550.999,77	1,42	2.159.778.426,35	0,26
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	30,49	2,89	2,89	9.083.463,71	2,33	2.553.021.534,73	0,36
BB	BB	BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	29,90	5,00	5,00	2.054.325,87	0,53	609.313.979,93	0,34
<b>Sub-total Artigo 9º A, III</b>			<b>29,70</b>	<b>4,10</b>	<b>4,10</b>	<b>16.688.789,35</b>	<b>4,28</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>29,67</b>	<b>4,13</b>	<b>4,13</b>	<b>19.812.101,66</b>	<b>5,08</b>		
<b>Total</b>			<b>13,74</b>	<b>-0,89</b>	<b>-0,89</b>	<b>389.933.233,47</b>	<b>100,00</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	155.245.989,59	39,81	10,00	41,50	70,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	55.219.980,39	14,16	0,00	14,00	20,00	70,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	48.126.754,84	12,34	0,00	14,00	40,00	50,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.365.341,80	0,61	0,00	0,63	5,00	15,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>260.958.066,62</b>	<b>66,92</b>				100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	4.307.980,93	1,10	0,00	1,00	10,00	40,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	76.511.772,41	19,62	5,00	18,37	30,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	21.616.793,51	5,54	0,00	4,50	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	6.726.518,34	1,73	0,00	2,00	5,00	5,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>109.163.065,19</b>	<b>28,00</b>				40,00
<b>Investimentos no Exterior</b>							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	3.123.312,31	0,80	0,00	0,00	3,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	16.688.789,35	4,28	0,00	4,00	5,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>19.812.101,66</b>	<b>5,08</b>				10,00

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades por Artigo**

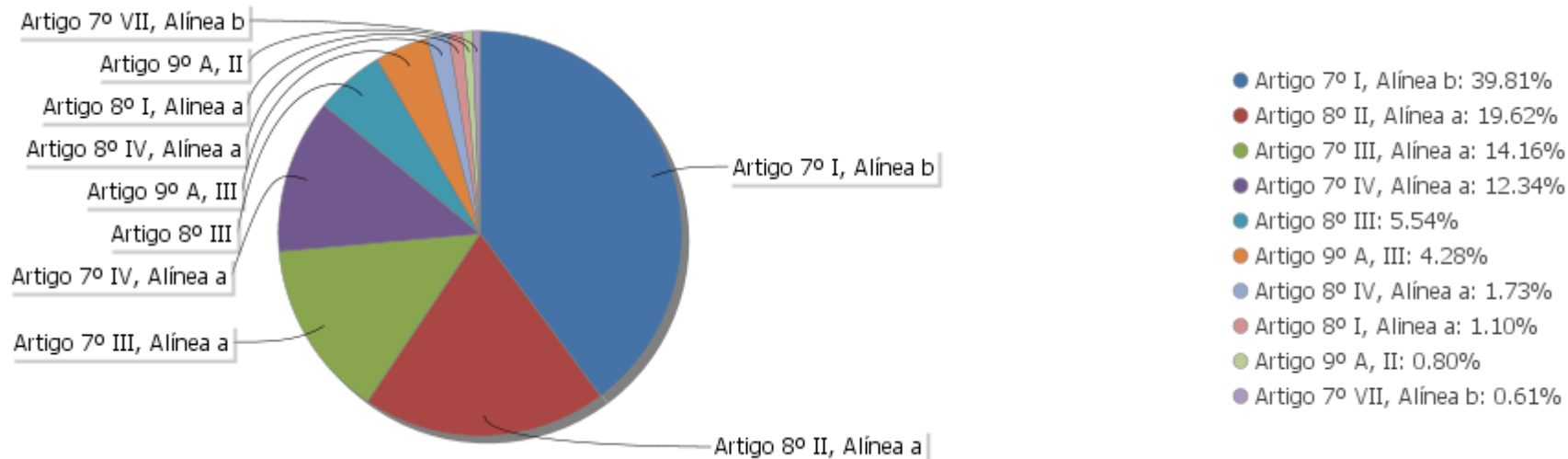
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,27 -183,92	-0,27 -183,92	2,96 637,79	1,86 197,29	5,47 216,43	-441.533,65	-441.533,65
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,88 -589,95	-0,88 -589,95	5,95 1.282,51	2,59 275,53	4,87 193,03	-491.330,90	-491.330,90
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,73 -487,41	-0,73 -487,41	3,66 788,25	1,49 158,14	4,70 185,95	-344.145,63	-344.145,63
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,10 65,49	0,10 65,49	3,47 747,95	4,22 448,73	7,17 284,02	2.313,59	2.313,59
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,24 0,08	-3,24 0,08	22,13 -0,34	11,59 -0,22	0,97 -0,18	-144.374,66	-144.374,66
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,49 -0,17	-3,49 -0,17	18,05 -4,43	7,54 -4,27	-5,80 -6,95	-2.769.176,20	-2.769.176,20
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,25 3,07	-0,25 3,07	12,32 -10,15	10,95 -0,87	9,53 8,38	-53.108,10	-53.108,10
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,35 2,96	-0,35 2,96	1,05 -21,42	-9,37 -21,18	10,45 9,31	-23.938,25	-23.938,25
Artigo 9º A, II % do CDI	4,30 2.878,05	4,30 2.878,05				128.834,84	128.834,84
Artigo 9º A, III % do CDI	4,10 2.740,94	4,10 2.740,94	7,06 1.521,52	19,27 2.047,96	56,10 2.221,38	656.898,12	656.898,12
<b>SÃO JOSÉ DO RIO PRETO (Total)</b>						<b>-3.479.560,84</b>	<b>-3.479.560,84</b>

**Análise de Liquidez**

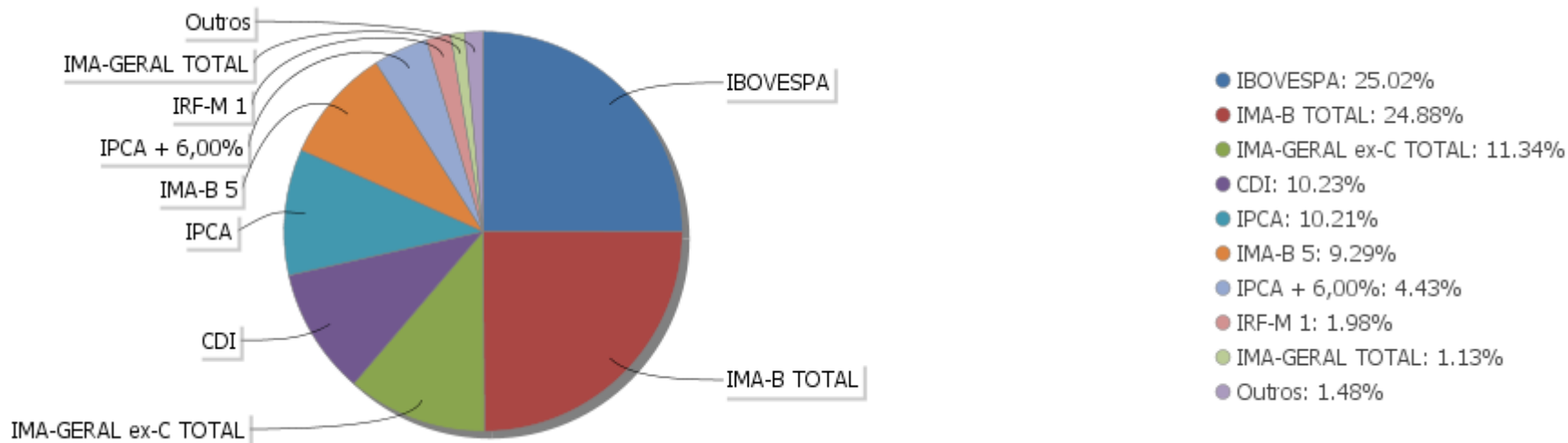
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	354.587.511,03	90,94	354.587.511,03	90,94
de 31 a 365 dias	18.454.006,66	4,73	373.041.517,69	95,67
acima de 365 dias	16.891.715,78	4,33	389.933.233,47	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

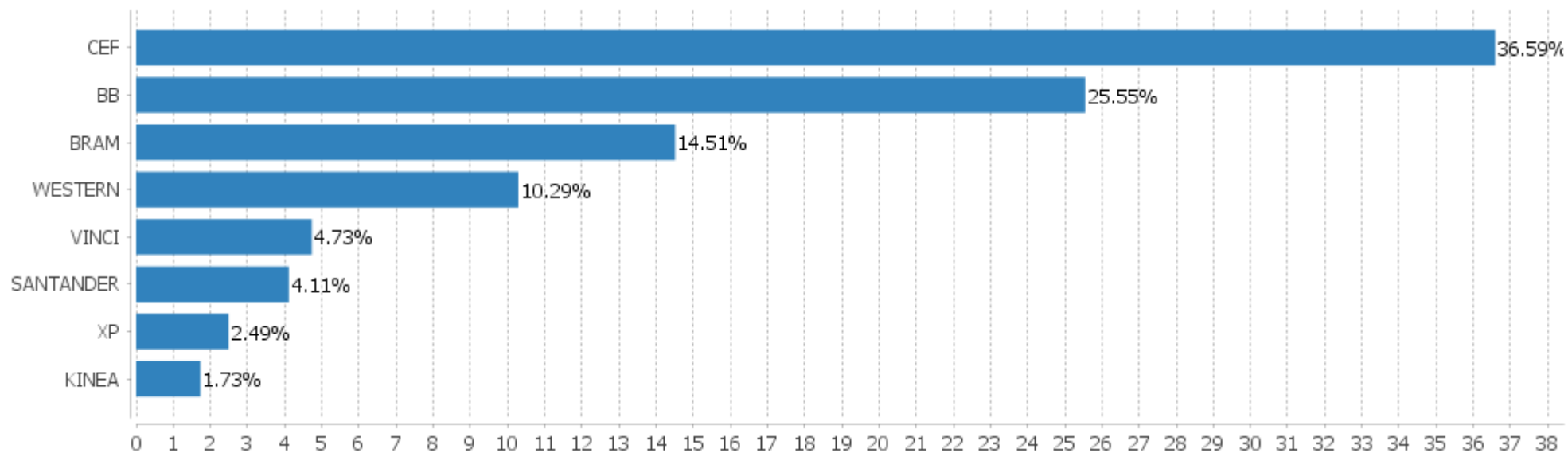


Alocação Por Estratégia



## 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	-0,89												-0,89
IPCA + 5,41%	0,67												0,67
p.p. indexador	-1,56												-1,56
2020	0,63	-1,53	-9,41	3,40	2,58	2,85	3,37	-0,44	-1,77	-0,52	3,92	3,93	6,38
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	-0,08	-2,19	-9,98	3,25	2,51	2,11	2,48	-1,16	-2,89	-1,86	2,57	2,07	-4,27
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 + 6,00%	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	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 + 6,00%	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

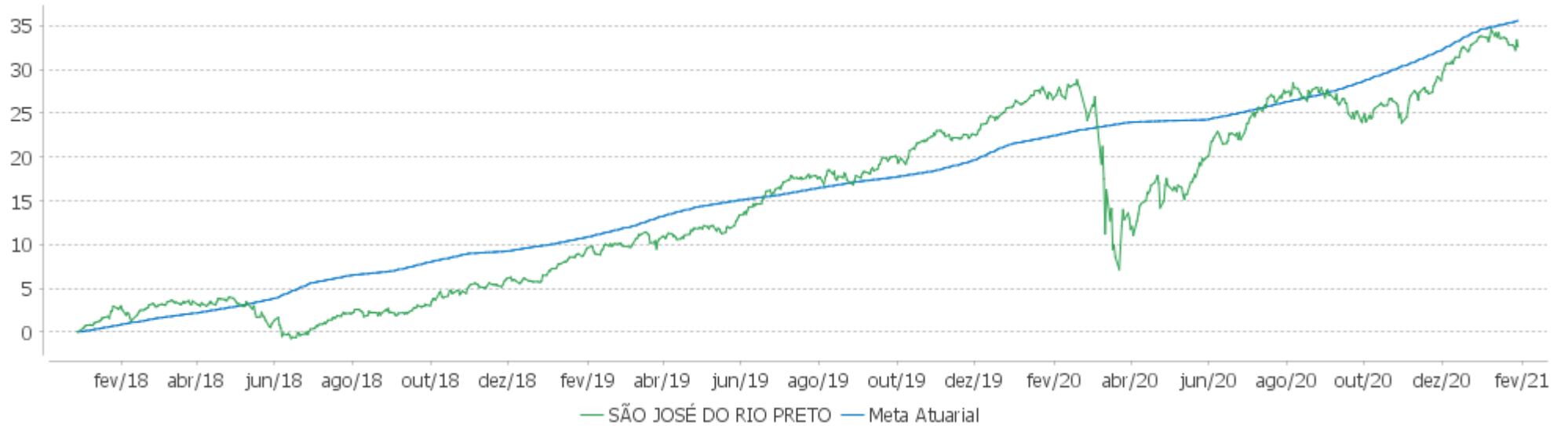
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

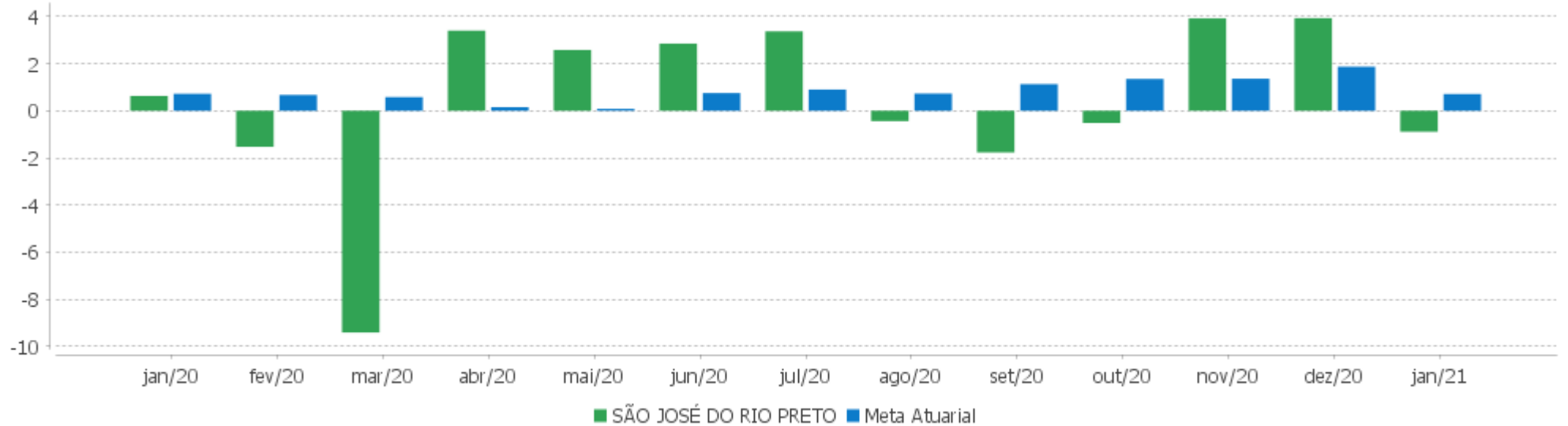
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	19	51,35	03 meses	7,04	3,92	3,11	5,67
Meses abaixo da Meta Atuarial	18	48,65	06 meses	4,14	7,27	-3,13	6,64
			12 meses	4,77	10,60	-5,83	13,74
			24 meses	21,23	22,17	-0,94	10,11
			36 meses	29,10	34,33	-5,23	8,58
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-12	Desde 29/12/2017	32,63	35,41	-2,77	8,48
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
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,02 -0,17	-1,02 -0,17	5,96 -0,08	2,45 -0,33	4,93 -0,30	23,73 -0,55	41,11 -0,71
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02 -0,13	-0,02 -0,13	3,08 -0,21	3,45 -0,35	7,24 -0,32	19,88 -0,65	31,75 -0,94
SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI	0,03 21,03	0,03 21,03	0,78 168,23	0,20 21,49	2,38 94,36	14,58 172,38	20,59 133,90
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,73 -0,88	-1,73 -0,88	6,90 0,86	1,55 -1,23	6,13 0,90	27,83 3,54	48,53 6,70
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,08 52,55	0,08 52,55	0,24 51,76	0,37 39,48	1,43 56,73	6,15 72,72	11,72 76,21
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO % do CDI	0,02 15,42	0,02 15,42	0,07 15,42	0,06 6,75	0,42 16,70	3,52 41,66	
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,08 54,86	0,08 54,86	0,25 54,81	0,52 55,23	1,68 66,42	6,66 78,75	12,53 81,49
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA % do CDI	-0,58 -387,50	-0,58 -387,50	2,68 578,29	0,52 55,25	3,61 143,02	14,74 174,36	26,30 171,10
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	-0,66 -0,77	-0,66 -0,77	4,04 0,76	2,59 -1,21	8,48 0,92	24,20 3,67	39,61 6,92
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,08 -0,02	0,08 -0,02	3,22 -0,07	3,67 -0,14	7,34 -0,21	20,01 -0,51	31,87 -0,82
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 IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,03 -0,01	0,03 -0,01	0,54 -0,04	0,79 -0,23	3,07 -0,36	9,59 -0,68	16,98 -0,96
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,46 -0,21	-0,46 -0,21	2,35 -0,18	1,02 -0,37	3,84 -0,66	15,02 -1,30	26,37 -1,82
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6,00% p.p.	0,15 -0,59	0,15 -0,59	3,08 -1,11	3,70 -4,27	6,62 -5,16	18,65 -4,97	40,83 5,18
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF.. Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,16 0,69	-0,16 0,69	3,95 -2,09	2,71 -0,07	7,70 2,47	24,55 0,26	34,90 -6,93
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,02 -0,69	0,02 -0,69	3,33 -0,66	3,31 -4,04	7,96 -2,79	23,13 0,78	36,96 2,43
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,03	0,03	0,55	0,82	3,08	9,60	16,95

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,01	-0,01	-0,03	-0,19	-0,35	-0,67	-1,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	-0,55	-0,55	2,68	0,93	4,00	15,84	27,67
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,11	-0,11	0,29	-0,03	0,14	0,48	0,72
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,03	0,03	2,18	0,99	5,82	20,75	32,60
Var. IPCA p.p.	-0,22	-0,22	-0,33	-3,31	1,27	11,80	19,54
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,13	0,13	3,03	4,04	7,68	18,78	30,23
Var. IDKA 2 p.p.	-0,01	-0,01	-0,13	-0,24	-0,52	-1,35	-2,26
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,86	-0,86	6,00	2,62	4,95	23,66	40,75
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,01	-0,04	-0,16	-0,27	-0,63	-1,07
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,03	0,03	0,53	0,90	3,22	9,83	17,30
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,02	-0,05	-0,12	-0,21	-0,44	-0,65
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	-0,88	-0,88	5,95	2,59	4,87	23,40	40,74
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,03	-0,09	-0,18	-0,35	-0,89	-1,09
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	0,10	0,10	3,47	4,22	7,17	19,51	32,76
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,62	-0,62	-0,52	-3,14	-3,58	-2,84	-1,77
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	-3,56	-3,56	14,87	8,21	-2,16		
Var. IBOVESPA p.p.	-0,24	-0,24	-7,61	-3,60	-3,31		
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	-3,64	-3,64	21,73	11,61	-4,05	14,63	31,93
Var. IBOVESPA p.p.	-0,32	-0,32	-0,74	-0,21	-5,20	-3,52	-3,59
XP INVESTOR FI DE ACOES	-4,48	-4,48	12,59	1,60	-11,58	24,86	52,32
Var. IBOVESPA p.p.	-1,16	-1,16	-9,88	-10,21	-12,73	6,72	16,81
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	-3,14	-3,14	19,35	8,34	-2,73	31,72	63,12
Var. IBOVESPA p.p.	0,18	0,18	-3,13	-3,47	-3,88	13,58	27,61
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	-3,06	-3,06	17,53	8,32	-8,34	11,24	29,43
Var. IBOVESPA p.p.	0,26	0,26	-4,95	-3,49	-9,49	-6,91	-6,08
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	-4,97	-4,97	22,58	14,23	5,75		
Var. IBOVESPA p.p.	-1,65	-1,65	0,11	2,42	4,60		
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	-8,33	-8,33	10,21	-3,90	-23,56	5,06	31,87
Var. IBOVESPA p.p.	-5,01	-5,01	-12,26	-15,71	-24,71	-13,09	-3,64
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	-2,67	-2,67	14,64	4,51	-6,04	27,57	61,16
Var. IBOVESPA p.p.	0,65	0,65	-7,84	-7,31	-7,19	9,42	25,65
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	-0,35	-0,35	1,05	-9,37	10,45	56,09	
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,07	-1,07	-2,94	-16,73	-0,30	33,74	
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	-3,24	-3,24	22,13	11,59	0,97	17,25	33,70
Var. IBOVESPA p.p.	0,08	0,08	-0,34	-0,22	-0,18	-0,89	-1,81
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-0,16	-0,16	14,05	13,28	11,59	37,59	37,18

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

<b>Fundo</b> <b>Variação da Estratégia</b>	<b>No Mês</b>	<b>No Ano</b>	<b>3 meses</b>	<b>6 meses</b>	<b>12 meses</b>	<b>24 meses</b>	<b>36 meses</b>
% do CDI	-106,48	-106,48	3.026,34	1.410,89	458,78	444,52	241,86
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	-0,58	-0,58	6,06	2,69	2,18	12,11	21,27
% do CDI	-387,49	-387,49	1.306,09	285,94	86,47	143,22	138,38
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5,79	5,79	9,11	20,97	53,70	118,69	138,83
Var. IBOVESPA p.p.	9,11	9,11	-13,36	9,15	52,55	100,54	103,32
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	5,00	5,00	7,75	18,26	50,02	97,61	118,46
Var. IBOVESPA p.p.	8,32	8,32	-14,72	6,45	48,87	79,46	82,95
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	2,89	2,89	5,70	18,48	59,07	128,83	150,87
Var. IBOVESPA p.p.	6,21	6,21	-16,78	6,67	57,92	110,68	115,36
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	4,30	4,30	8,24	27,17	83,37		
Var. IPCA + 6,00% p.p.	3,59	3,59	4,25	19,81	72,62		
SÃO JOSÉ DO RIO PRETO	-0,89	-0,89	7,04	4,14	4,77	21,23	29,10
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,60	-1,60	3,05	-3,22	-5,99	-1,12	-5,43
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 + 6,00%	0,73	0,73	4,18	7,97	11,79	23,62	35,65
IPCA + 6,00%	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
<b>Renda Fixa</b>							
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
<b>Renda Variável</b>							
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
<b>Indicadores Econômicos</b>							
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
<b>Meta Atuarial</b>							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

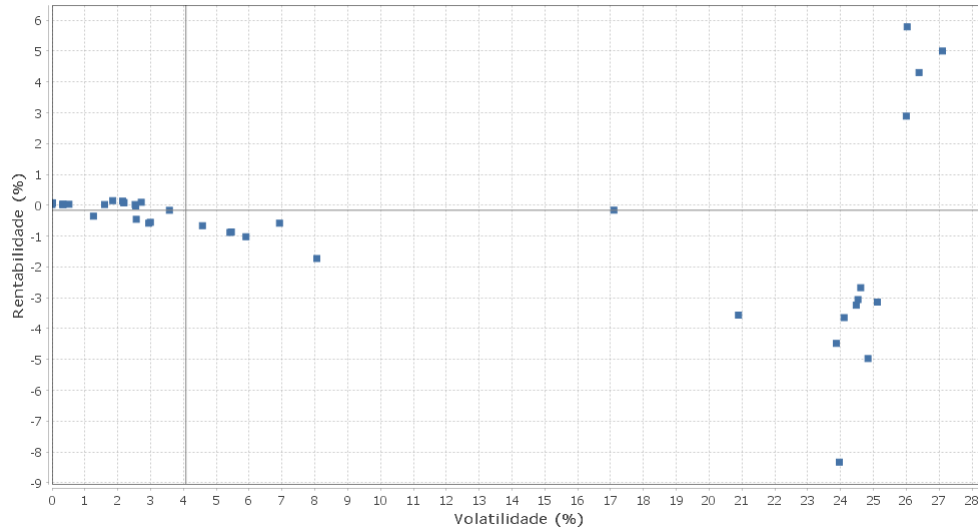
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	04/01/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	378,71	201,25661000	1,8816830000
2	04/01/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	54,20	28,80430500	1,8816830000
3	05/01/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	9.582,05	5.092,06059500	1,8817610000
4	06/01/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	6.951,85	3.694,17424700	1,8818413900
5	07/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.000.000,00	0,00	382.756,95239728	2,6126240000
6	07/01/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.003.571,61	533.271,48276500	1,8819150000
7	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.376.940,33	731.639,84394400	1,8819920000
8	11/01/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	6.089,56	3.235,56676400	1,8820690000
9	12/01/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	4.863,40	0,00	2.583,96532400	1,8821460000
10	13/01/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	61,64	32,74840900	1,8822230000
11	15/01/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.402,21	1.276,15757900	1,8823770000
12	18/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	11.114,10	0,00	5.254,37149100	2,1152101670
13	19/01/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	31,80	16,89213900	1,8825300000
14	20/01/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.665,86	884,86844600	1,8826070000
15	21/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	23.923,08	0,00	11.308,69024500	2,1154598350
16	21/01/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	11.451,46	6.082,51483900	1,8826850000
17	22/01/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.838,29	0,00	976,37938300	1,8827620000
18	25/01/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	142.020,87	75.429,11082900	1,8828390000
19	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.620.000,00	1.385.318,75916769	2,6131170000
20	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	919.414,51	0,00	488.252,70528800	1,8830710000
21	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	2.632.650,78	0,00	1.398.004,50203300	1,8831490000
22	29/01/2021	BRANCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	16.550,66	0,00	10.073,85944416	1,6429314000

**Total**

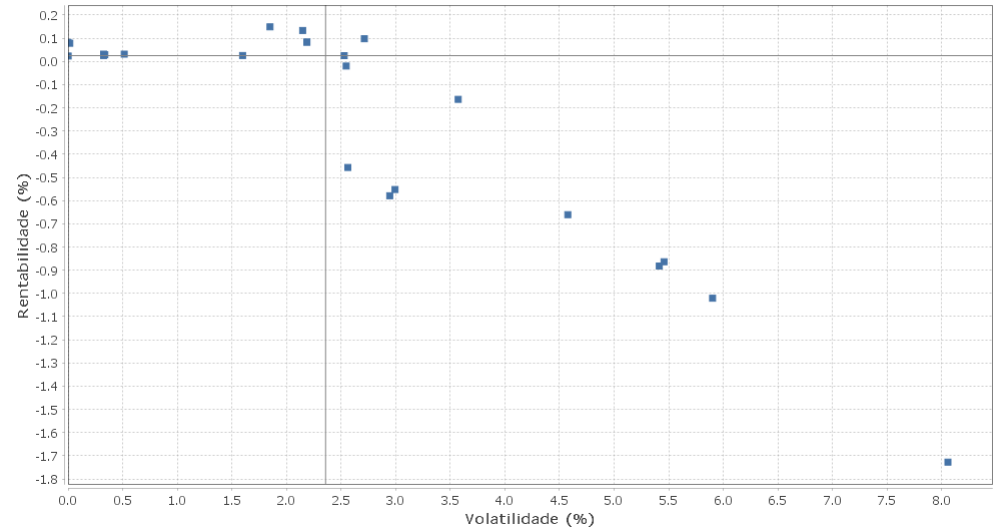
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

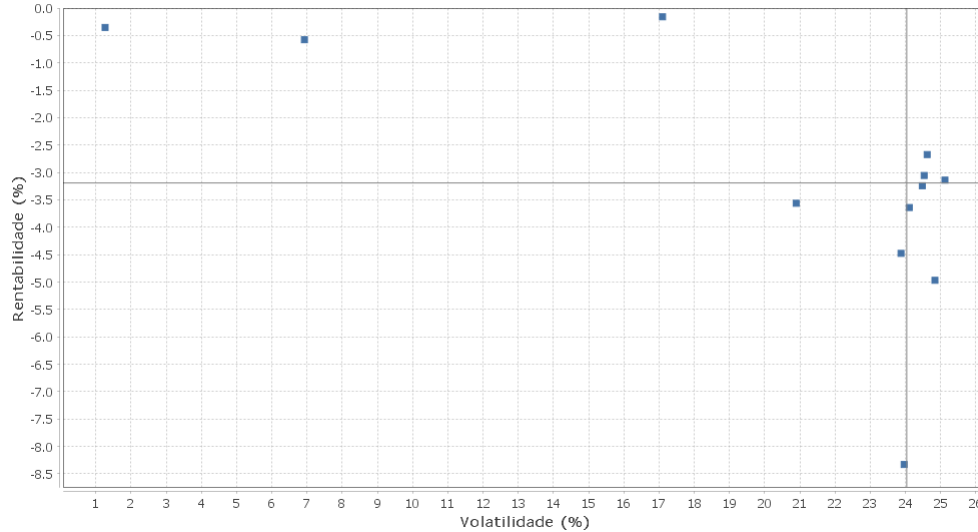
SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - No Mês



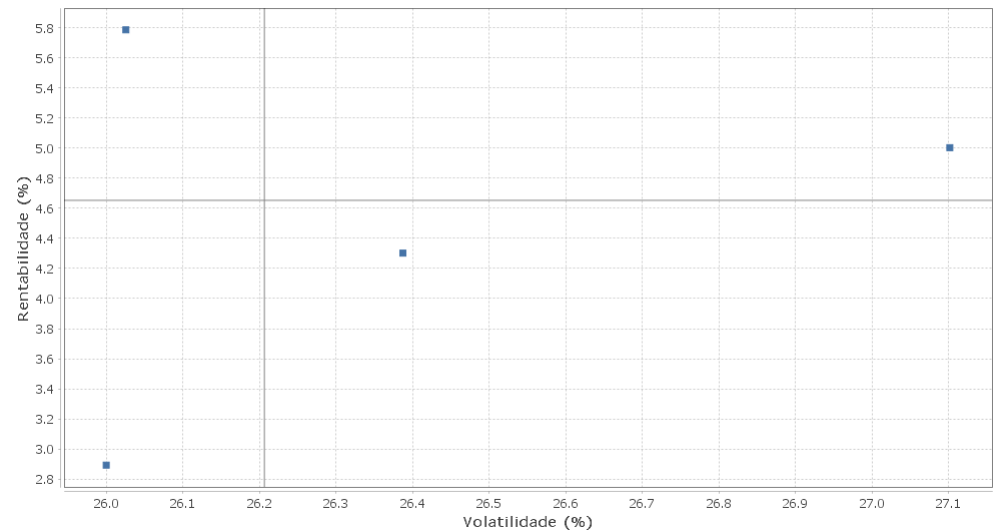
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 12.592.121,11

Value-At-Risk: 3,23%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	-164,63	0,08	3.927.738,90	1,01
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,01	0,00	-106,21	0,02	16.550,66	0,00
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,06	0,00	-4,39	0,08	35.045,85	0,01
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,19	0,00	-0,36	0,03	1.604.965,53	0,41
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,15	0,00	-0,38	0,03	3.365.533,06	0,86
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,34	0,19	0,00	-0,36	0,03	2.761.449,69	0,71
SANTANDER RF ATIVO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,51	0,30	0,00	-0,23	0,03	2.414.682,51	0,62
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	Artigo 8º IV, Alínea a	1,26	0,14	0,00	-0,40	-0,35	6.726.518,34	1,73
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,60	1,03	0,07	-0,08	0,03	39.829.765,53	10,21
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,85	1,09	0,00	-0,00	0,15	1.777.808,83	0,46
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,15	1,17	0,01	-0,01	0,13	3.999.283,74	1,03
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	1,23	0,02	-0,03	0,08	7.635.048,21	1,96
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	1,23	0,03	-0,03	0,08	13.034.359,76	3,34
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	2,53	1,41	0,01	-0,05	0,02	5.075.753,41	1,30
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	2,55	1,37	0,01	-0,07	-0,02	6.589.870,22	1,69
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,56	1,08	0,01	-0,24	-0,46	4.423.078,94	1,13
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	2,71	1,16	0,00	-0,02	0,10	2.365.341,80	0,61
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	2,95	1,43	0,03	-0,25	-0,58	11.882.784,29	3,05
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,99	1,33	0,10	-0,23	-0,55	44.231.747,41	11,34
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	Artigo 7º I, Alínea b	3,57	1,62	0,00	-0,09	-0,16	946.293,40	0,24
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,58	2,16	0,03	-0,18	-0,66	8.969.208,51	2,30
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	5,41	2,56	0,24	-0,19	-0,88	55.219.980,39	14,16
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,46	2,56	0,08	-0,19	-0,86	17.591.693,57	4,51
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	5,90	2,68	0,08	-0,20	-1,02	18.400.751,65	4,72
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	Artigo 8º III	6,92	3,43	0,04	-0,11	-0,58	4.405.332,66	1,13
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	8,06	3,43	0,03	-0,23	-1,73	4.859.330,76	1,25
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	17,10	8,38	0,26	-0,02	-0,16	17.211.460,85	4,41
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	Artigo 8º II, Alínea a	20,89	9,52	0,08	-0,18	-3,56	3.671.244,24	0,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
XP INVESTOR FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	23,87	10,69	0,11	-0,19	-4,48	4.249.253,84	1,09
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	23,96	10,89	0,06	-0,35	-8,33	2.328.709,87	0,60
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,11	10,79	0,59	-0,16	-3,64	22.811.816,69	5,85
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	24,48	11,50	0,12	-0,14	-3,24	4.307.980,93	1,10
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	24,53	11,42	0,16	-0,13	-3,06	5.965.536,23	1,53
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	24,61	10,39	0,41	-0,11	-2,67	16.946.420,57	4,35
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	24,83	12,32	0,06	-0,21	-4,97	2.084.784,31	0,53
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	25,12	9,96	0,43	-0,13	-3,14	18.454.006,66	4,73
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	26,00	11,33	0,09	0,11	2,89	9.083.463,71	2,33
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	26,03	11,89	0,05	0,22	5,79	5.550.999,77	1,42
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	26,39	13,23	0,00	0,16	4,30	3.123.312,31	0,80
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	27,10	12,68	0,02	0,18	5,00	2.054.325,87	0,53