



SÃO JOSÉ DO RIO PRETO
NOVEMBRO 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 30.11.2020.

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

RENDA FIXA

68,50%

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	0,57	0,20	3,15	1.599.456,20	0,42	7.844.641.875,20	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,79	1,99	1,24	16.926.432,39	4,46	5.721.224.105,90	0,30
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,55	0,22	3,34	4.480.470,22	1,18	13.835.706.591,01	0,03
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,57	0,20	3,14	1.360.818,36	0,36	822.612.839,72	0,17
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,53	0,70	2,66	4.351.703,77	1,15	1.160.833.344,04	0,37
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,04	1,29	5,82	12.790.752,20	3,37	19.732.912.783,40	0,06
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	5,06	1,30	5,92	7.493.196,60	1,97	1.163.360.094,10	0,64
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,14	1,22	6,28	3.929.013,83	1,03	10.336.804.140,67	0,04
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,25	1,44	6,72	8.745.231,47	2,30	771.886.825,67	1,13
BB	BB	BB PREV RF IPCA	6,14	1,31	6,56	4.976.504,85	1,31	344.709.100,05	1,44
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,28	0,85	2,65	40.970.307,56	10,78	9.499.641.282,04	0,43
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	0,82	5,27	39.300.665,33	10,34	14.161.450.965,39	0,28
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	8,75	1,55	6,05	924.454,64	0,24	217.844.614,18	0,42
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,19	1,29	5,22	1.746.978,75	0,46	579.143.570,98	0,30
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			5,64	1,04	4,08	149.595.986,17	39,37		

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	12,76	1,95	1,14	52.227.011,49	13,75	2.917.609.578,10	1,79
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,76	1,95	1,14	52.227.011,49	13,75		

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	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,27	0,04	1,91	2.534.751,15	0,67	3.354.440.184,66	0,08
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	13,35	2,01	1,29	17.714.792,32	4,66	2.002.230.156,54	0,88
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	16,82	2,16	1,98	4.644.019,72	1,22	608.037.587,61	0,76
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,23	0,16	2,14	2.411.535,39	0,63	2.405.684.296,02	0,10
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	0,06	0,14	12.619,93	0,00	1.893.436.284,11	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,06	0,08	1,81	8.246.589,98	2,17	625.949.083,71	1,32
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5,41	1,30	5,97	6.476.077,17	1,70	896.937.824,58	0,72
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	0,98	0,14	2,08	2.399.257,53	0,63	970.330.180,33	0,25
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	6,91	0,78	2,13	11.662.809,72	3,07	1.395.017.754,92	0,84
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			8,27	1,26	2,70	56.102.452,91	14,77		

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	4,52	1,46	5,96	2.319.314,32	0,61	614.843.149,22	0,38
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			4,52	1,46	5,96	2.319.314,32	0,61		
Renda Fixa			7,18	1,27	3,37	260.244.764,89	68,50		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

27,29%

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	43,98	15,71	-5,97	4.081.611,32	1,07	121.324.330,95	3,36
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			43,98	15,71	-5,97	4.081.611,32	1,07		

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	43,69	12,66	-12,72	5.718.248,50	1,51	567.071.913,36	1,01
BRAM	BEM	BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	44,16	8,45	-9,67	16.031.758,46	4,22	2.027.456.710,01	0,79
XP	XP	XP INVESTOR FI DE ACOES	49,73	10,20	-10,71	4.158.879,30	1,09	362.664.455,80	1,15
BB	BB	BB ACOES SETOR FINANCEIRO FIC FI	47,64	16,75	-18,43	1.993.414,86	0,52	264.424.328,90	0,75
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	42,03	12,96	-6,14	17.466.711,03	4,60	686.938.519,27	2,54
XP	XP	XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	41,00	11,09	-21,83	2.347.339,60	0,62	248.445.654,17	0,94
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	43,68	15,99	-9,84	21.735.870,42	5,72	425.625.780,02	5,11
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	42,37	11,85	-3,54	3.574.956,30	0,94	270.703.494,73	1,32
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			42,98	12,61	-9,70	73.027.178,47	19,22		

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	13,03	4,02	-0,04	4.320.369,10	1,14	2.249.784.105,03	0,19
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	33,40	10,70	8,71	16.706.094,53	4,40	1.113.802.596,37	1,50
Sub-total Artigo 8º III			28,18	9,26	6,79	21.026.463,63	5,53		

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	50,49	1,16	12,75	5.554.780,78	1,46	177.197.501,77	3,13
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			50,49	1,16	12,75	5.554.780,78	1,46		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	36,14	11,36	-5,49	103.690.034,20	27,29
---	-------	-------	-------	----------------	-------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,21%

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	29,44	2,43	53,70	5.211.191,07	1,37	1.959.218.771,54	0,27
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	29,66	2,96	66,39	8.847.817,89	2,33	2.270.916.927,46	0,39
BB	BB	BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	28,99	2,01	46,20	1.944.905,80	0,51	524.181.055,33	0,37
Sub-total Artigo 9º A, III			28,80	2,67	59,43	16.003.914,76	4,21		
Investimentos no Exterior			28,80	2,67	59,43	16.003.914,76	4,21		
Total			13,65	3,92	2,36	379.938.713,85	100,00		

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
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	149.595.986,17	39,37	10,00	45,40	70,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	52.227.011,49	13,75	0,00	10,00	20,00	70,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	56.102.452,91	14,77	0,00	14,50	40,00	50,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.319.314,32	0,61	0,00	0,60	5,00	15,00
	Total Renda Fixa	260.244.764,89	68,50				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	4.081.611,32	1,07	0,00	1,00	10,00	40,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	73.027.178,47	19,22	5,00	20,00	30,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	21.026.463,63	5,53	0,00	5,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	5.554.780,78	1,46	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	103.690.034,20	27,29				40,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	16.003.914,76	4,21	0,00	2,50	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	16.003.914,76	4,21				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades por Artigo

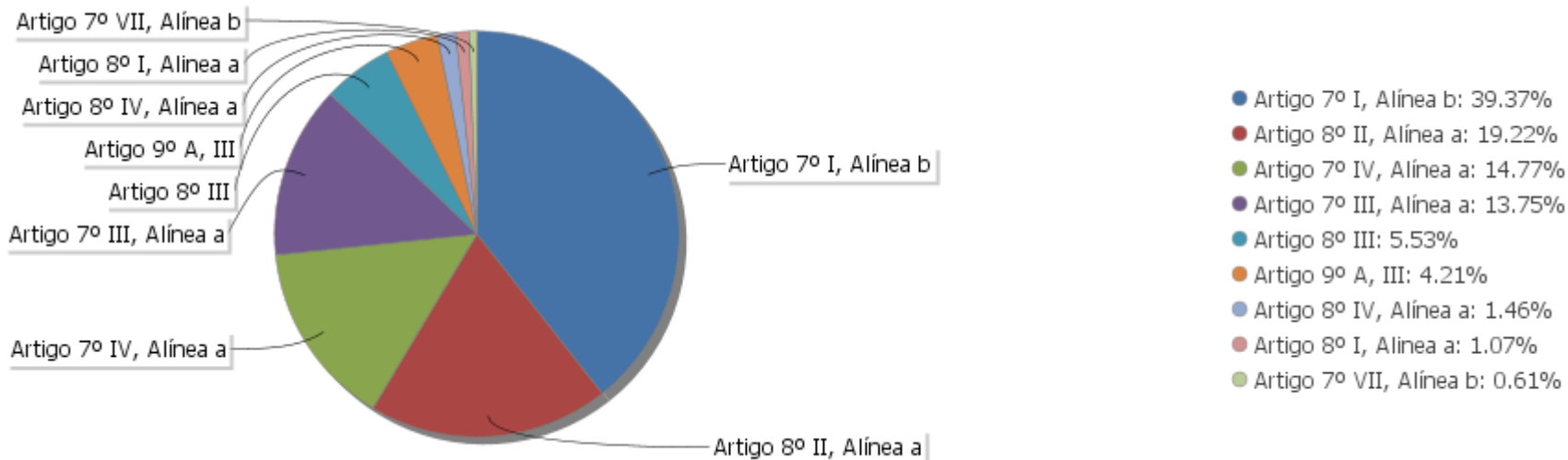
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,04 698,08	4,08 157,42	0,45 97,53	2,44 235,67	5,04 169,34	1.578.709,45	6.509.751,93
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,95 1.302,56	1,14 44,08	0,57 123,80	5,14 496,96	3,16 106,13	986.731,83	646.150,29
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,26 841,41	2,70 104,19	0,19 40,62	3,12 301,72	3,89 130,99	631.090,39	1.133.035,70
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	1,46 975,40	5,96 230,30	1,70 365,37	4,21 406,79	7,13 239,79	33.332,72	130.511,28
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	15,71 -0,19	-5,97 -0,13	9,41 -0,17	24,68 0,09	0,37 -0,24	554.227,05	-259.284,19
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	12,61 -3,29	-9,70 -3,86	5,93 -3,66	20,87 -3,72	-1,04 -1,65	8.176.813,67	-7.694.093,33
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	9,26 -6,65	6,79 12,63	2,56 -7,03	14,62 -9,97	9,49 8,88	1.781.341,00	1.336.427,91
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	1,16 -14,74	12,75 18,58	-2,91 -12,49	-4,24 -28,83	15,81 15,20	63.578,26	949.386,11
Artigo 9º A, III % do CDI	2,67 1.785,06	59,43 2.295,24	-1,15 -247,88	21,69 2.096,82	56,71 1.907,26	415.963,64	5.965.469,08
SÃO JOSÉ DO RIO PRETO (Total)						14.221.788,01	8.717.354,78

Análise de Liquidez

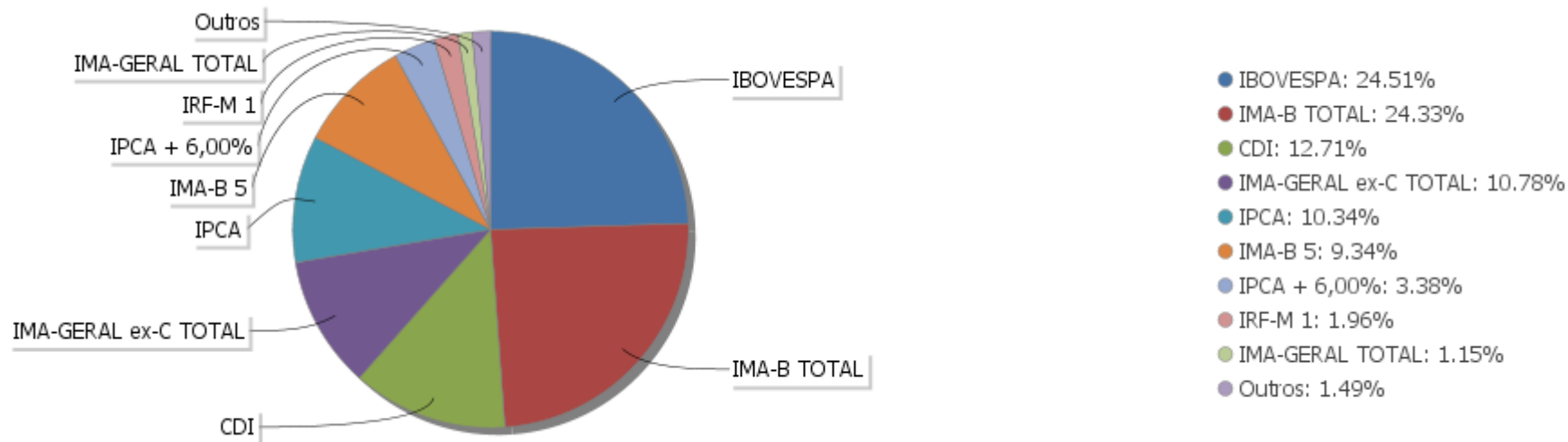
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	346.949.969,48	91,32	346.949.969,48	91,32
de 31 a 365 dias	17.466.711,03	4,60	364.416.680,51	95,91
acima de 365 dias	15.522.033,34	4,09	379.938.713,85	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

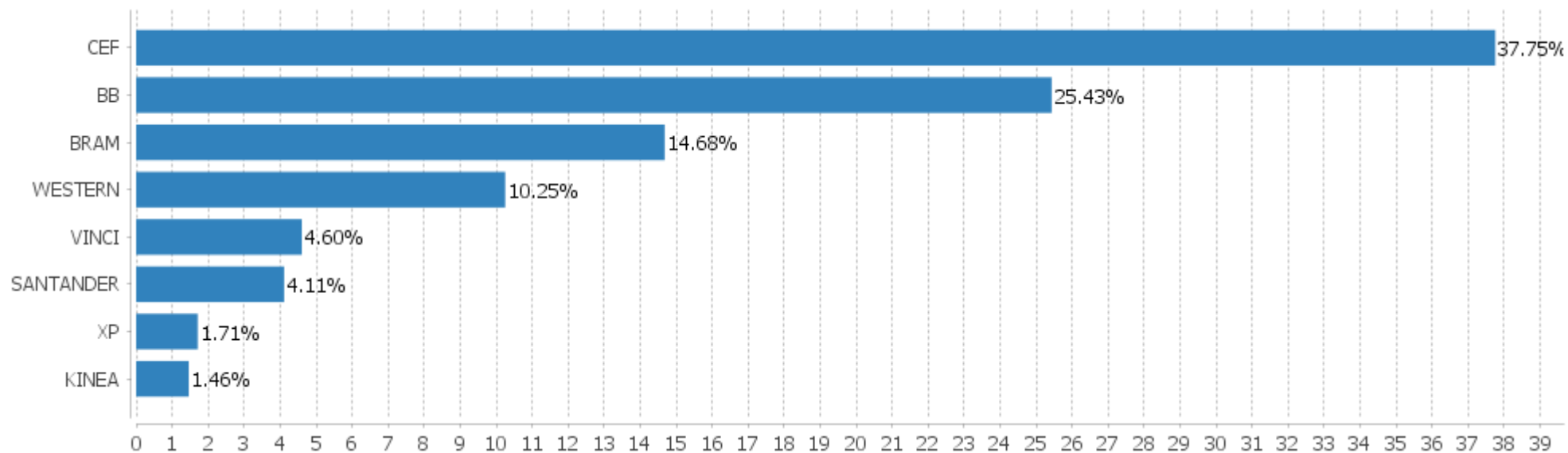


Alocação Por Estratégia



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	-0,52	3,92		2,36
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		8,63
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		-6,27
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

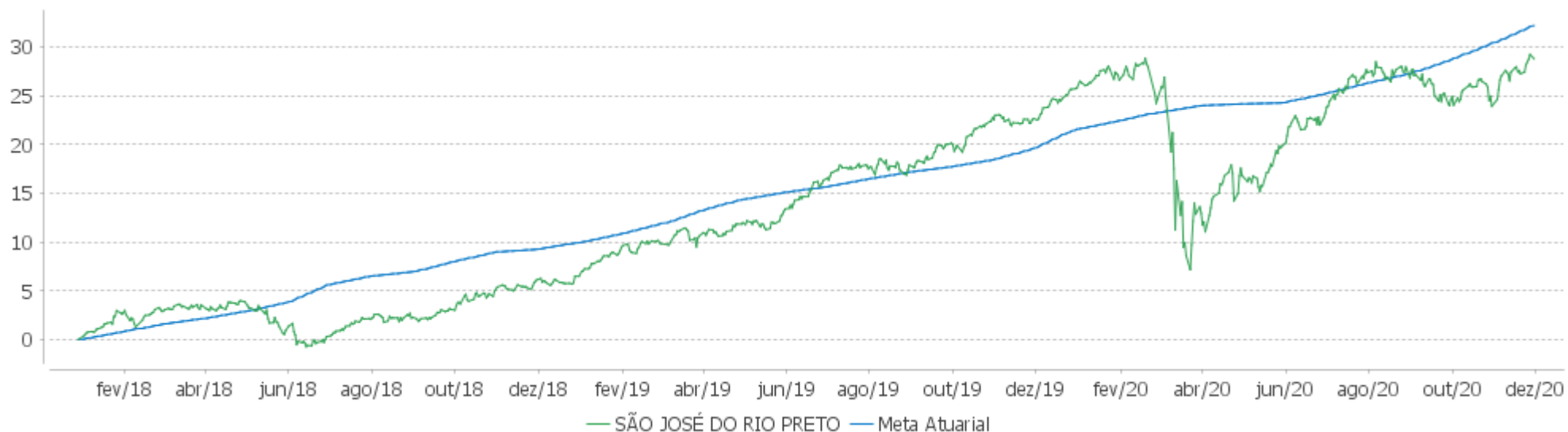
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

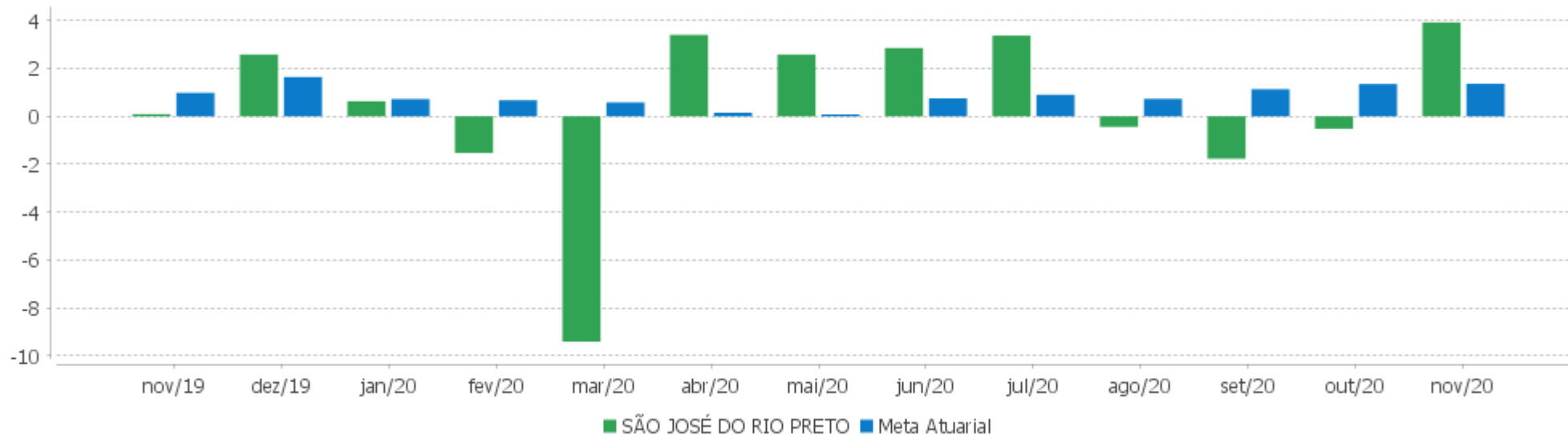
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	18	51,43	03 meses	1,55	3,86	-2,31	7,31
Meses abaixo da Meta Atuarial	17	48,57	06 meses	7,49	6,31	1,18	6,90
			12 meses	5,00	10,41	-5,42	13,65
			24 meses	21,35	20,87	0,48	10,03
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,92	2020-11					
Menor rentabilidade da Carteira	-9,41	2020-03	Desde 29/12/2017	28,77	32,05	-3,28	8,63

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
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,95 -0,05	1,14 -0,34	0,57 -0,10	5,14 -0,17	3,16 -0,36	25,88 -0,95	41,04 -1,19
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,01 0,01	1,29 -0,19	0,47 -0,20	5,20 -0,12	3,33 -0,19	26,56 -0,26	41,64 -0,59
SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI	0,14 91,67	2,08 80,21	-0,09 -18,42	0,43 41,73	2,49 83,68	17,39 188,17	22,67 139,06
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	1,30 -0,02	5,97 -0,13	1,24 -0,16	3,77 -0,21	7,27 -0,13	21,30 -0,39	32,32 -0,74
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,04 26,53	1,91 73,71	0,31 66,04	1,01 97,26	2,28 76,75	8,38 90,65	15,29 93,77
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,16 0,16	1,98 0,50	-0,34 -1,01	4,45 -0,86	4,19 0,67	31,41 4,59	48,52 6,28
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,16 105,63	2,14 82,75	0,34 73,60	1,02 98,87	2,50 84,20	8,51 92,13	15,52 95,17
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,06 39,20	1,54 59,41	0,11 24,63	0,42 40,72	1,83 61,45	6,86 74,29	12,56 77,02
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,08 55,06	1,81 69,89	0,26 55,22	0,61 58,88	2,12 71,33	7,43 80,43	13,44 82,44
BRADERCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINAMICA % do CDI	0,78 523,92	2,13 82,25	-0,49 -104,51	1,30 125,53	2,99 100,71	16,24 175,81	
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	1,44 0,12	6,72 0,63	0,33 -1,07	3,27 -0,72	8,22 0,81	26,37 4,68	39,91 6,85
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,30 -0,02	5,92 -0,18	1,33 -0,06	3,83 -0,15	7,21 -0,20	21,19 -0,51	32,25 -0,81
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,29 -0,03	5,82 -0,28	1,31 -0,09	3,83 -0,16	7,10 -0,31	21,07 -0,62	32,11 -0,96
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,20 -0,03	3,15 -0,38	0,35 -0,19	0,93 -0,25	3,56 -0,40	10,43 -0,70	17,92 -0,98
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,70 -0,04	2,66 -0,59	0,11 -0,11	1,93 -0,42	3,59 -0,59	16,65 -1,20	27,52 -1,79
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6,00% p.p.	1,29 -0,13	5,22 -4,36	1,47 -2,75	3,76 -3,20	6,37 -5,09	20,22 -1,90	40,89 6,89
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	1,55	6,05	0,58	3,37	7,63	26,86	36,62

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.	-0,45	4,57	-0,09	-1,94	4,12	0,03	-5,62
BB PREV RF IPCA	1,31	6,56	0,63	3,60	8,10	25,66	38,55
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,05	-2,18	-3,26	-2,77	-2,42	4,67	5,17
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,20	3,14	0,37	0,95	3,55	10,42	17,85
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,38	-0,17	-0,24	-0,40	-0,72	-1,04
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,85	2,65	0,02	1,84	3,63	17,42	28,71
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,15	-0,02	0,04	-0,02	0,03	0,43	0,61
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,82	5,27	0,20	1,37	5,90	24,20	33,20
Var. IPCA p.p.	-0,07	2,15	-2,20	-1,92	1,59	16,47	21,12
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,22	6,28	1,41	4,27	7,44	19,53	30,28
Var. IDKA 2 p.p.	-0,03	-0,49	0,10	-0,06	-0,61	-1,35	-2,28
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,22	3,34	0,49	1,09	3,75	10,70	18,27
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,01	-0,18	-0,05	-0,09	-0,20	-0,43	-0,63
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,99	1,24	0,60	5,13	3,24	26,17	41,14
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,24	-0,07	-0,18	-0,27	-0,66	-1,09
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	1,46	5,96	1,70	4,21	7,13	20,20	33,29
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,10	-2,77	-2,19	-2,16	-3,39	-0,78	-0,08
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	15,71	-5,97	9,41	24,68	0,37	20,59	49,19
Var. IBOVESPA p.p.	-0,19	-0,13	-0,17	0,09	-0,24	-1,07	-2,11
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	11,85	-3,54	9,87	21,49	6,82		
Var. IBOVESPA p.p.	-4,05	2,30	0,28	-3,10	6,21		
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	15,99	-9,84	9,95	24,64	-2,45	16,74	45,64
Var. IBOVESPA p.p.	0,09	-4,00	0,37	0,06	-3,06	-4,92	-5,66
XP INVESTOR FI DE ACOES	10,20	-10,71	-1,00	18,04	-1,75	36,35	73,78
Var. IBOVESPA p.p.	-5,70	-4,87	-10,58	-6,55	-2,36	14,68	22,48
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	12,96	-6,14	7,73	22,05	5,33	48,18	76,22
Var. IBOVESPA p.p.	-2,94	-0,30	-1,85	-2,54	4,72	26,52	24,92
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	12,66	-12,72	5,74	23,61	-5,90	16,49	40,71
Var. IBOVESPA p.p.	-3,25	-6,88	-3,84	-0,98	-6,51	-5,17	-10,59
BB ACOES SETOR FINANCEIRO FIC FI	16,75	-18,43	8,79	23,29	-14,15	5,10	36,22
Var. IBOVESPA p.p.	0,85	-12,59	-0,79	-1,30	-14,76	-16,56	-15,08
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	11,09	-21,83	1,84	9,65	-16,13	23,96	48,23
Var. IBOVESPA p.p.	-4,81	-15,99	-7,75	-14,94	-16,74	2,30	-3,07
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	8,45	-9,67	0,45	16,10	-0,25	36,82	73,99
Var. IBOVESPA p.p.	-7,45	-3,83	-9,13	-8,49	-0,86	15,16	22,69
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	10,70	8,71	2,83	17,13	11,55	32,21	42,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Varição da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	7.156,35	336,28	610,70	1.655,69	388,47	348,62	262,02
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	4,02	-0,04	1,50	5,85	2,18	13,35	25,40
% do CDI	2.686,88	-1,45	322,51	565,17	73,40	144,53	155,80
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	1,16	12,75	-2,91	-4,24	15,81	44,56	
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,20	4,01	-6,80	-10,61	5,30	23,57	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2,43	53,70	-1,39	20,74	50,99	90,52	137,19
Var. IBOVESPA p.p.	-13,47	59,54	-10,98	-3,84	50,38	68,85	85,89
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	2,01	46,20	-2,36	16,50	43,23	72,39	116,87
Var. IBOVESPA p.p.	-13,89	52,04	-11,94	-8,08	42,62	50,72	65,57
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	2,96	66,39	-0,74	23,47	63,76	109,72	157,01
Var. IBOVESPA p.p.	-12,95	72,23	-10,32	-1,12	63,15	88,06	105,71
SÃO JOSÉ DO RIO PRETO	3,92	2,36	1,55	7,49	5,00	21,35	
Var. IPCA + 6,00% p.p.	2,56	-6,37	-2,34	1,12	-5,52	0,36	
CDI	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
INPC + 6,00%	1,42	9,58	4,22	6,96	11,46	22,12	33,99
IPCA + 6,00%	1,36	8,73	3,89	6,37	10,52	20,99	33,37

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	0,23	3,52	0,54	1,19	3,95	11,13	18,89
IRF-M 1+	0,46	5,24	-1,06	0,29	6,00	22,54	36,94
IRF-M TOTAL	0,36	4,65	-0,53	0,58	5,30	19,04	31,44
IMA-B 5	1,32	6,10	1,40	3,99	7,41	21,69	33,06
IMA-B 5+	2,59	-1,87	0,14	6,53	0,68	30,33	48,80
IMA-B TOTAL	2,00	1,48	0,67	5,31	3,52	26,83	42,23
IMA-C TOTAL	1,94	23,44	7,90	19,17	23,94	48,54	75,37
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,70	2,67	-0,02	1,86	3,60	17,00	28,09
IMA-GERAL TOTAL	0,73	3,25	0,22	2,35	4,17	17,84	29,30
IDKA 2	1,25	6,77	1,31	4,33	8,05	20,89	32,56
IDKA 20	3,37	-8,22	-0,40	9,06	-4,60	35,17	60,63
CDI	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Renda Variável							
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
IBRX 100	15,46	-5,18	9,57	25,07	1,72	24,85	55,25
IBRX 50	16,21	-5,30	10,24	25,90	0,92	19,73	48,77
SMALL CAP	16,64	-7,60	7,78	33,38	4,09	49,24	69,17
IFIX	1,51	-12,17	0,95	5,68	-2,83	22,09	26,91
Índice Consumo - ICON	8,93	-3,98	1,63	18,62	3,72	48,84	43,97
Índice Dividendos - IDIV	14,40	-9,12	9,82	21,30	-0,05	32,77	60,52
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,89	3,13	2,41	3,29	4,31	7,73	12,09
INPC	0,95	3,93	2,73	3,87	5,20	8,74	12,61
IGPM	3,28	21,97	11,24	18,66	24,52	29,46	41,99
SELIC	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
298	03/11/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	830.416,40	442.076,26454700	1,8784460000
299	04/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.375,46	0,00	651,57362700	2,1109816940
300	04/11/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	11.241,67	5.984,31257800	1,8785230000
301	05/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	22.794,49	0,00	10.797,62134100	2,1110658800
302	05/11/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	31.055,23	0,00	16.531,04971700	1,8786000000
303	06/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	4.318,79	0,00	2.045,79004800	2,1110621800
304	06/11/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	90.601,34	0,00	48.226,16566100	1,8786760000
305	09/11/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.323.150,93	704.270,44752500	1,8787540000
306	09/11/2020	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	620.277,87	0,00	165.613,76466800	3,7453280000
307	10/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	113.336,13	53.684,96991200	2,1111333430
308	10/11/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	3.527,20	0,00	1.877,33755700	1,8788310000
309	10/11/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	116.825,30	0,00	78.377,97078100	1,4905374410
310	11/11/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	5.369,27	2.857,65205600	1,8789080000
311	12/11/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	6.863,27	3.652,64219900	1,8789877645
312	13/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	49.902,48	0,00	23.637,15960100	2,1111876740
313	13/11/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	757,78	403,27546400	1,8790620000
314	16/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	125.743,80	0,00	59.558,18773300	2,1112764640
315	16/11/2020	BB PREV RF IPCA	0,00	125.743,80	51.953,97964300	2,4202919750
316	17/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	8.655,13	0,00	4.099,26965600	2,1113834230
317	17/11/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	107,34	57,11777300	1,8792170000
318	18/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	17.039,83	0,00	8.070,13725800	2,1114671850
319	18/11/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	27,42	14,58570300	1,8792940000
320	19/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	35.903,81	0,00	17.003,76218700	2,1115215330
321	19/11/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	18.626,24	0,00	9.910,88512500	1,8793720000
322	20/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	232.489,37	110.101,16621200	2,1115977060
323	20/11/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.273,03	1.209,40970600	1,8794490000
324	20/11/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	240.767,93	0,00	162.289,01862800	1,4835749950
325	24/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	4.338,88	0,00	2.054,62809000	2,1117593110

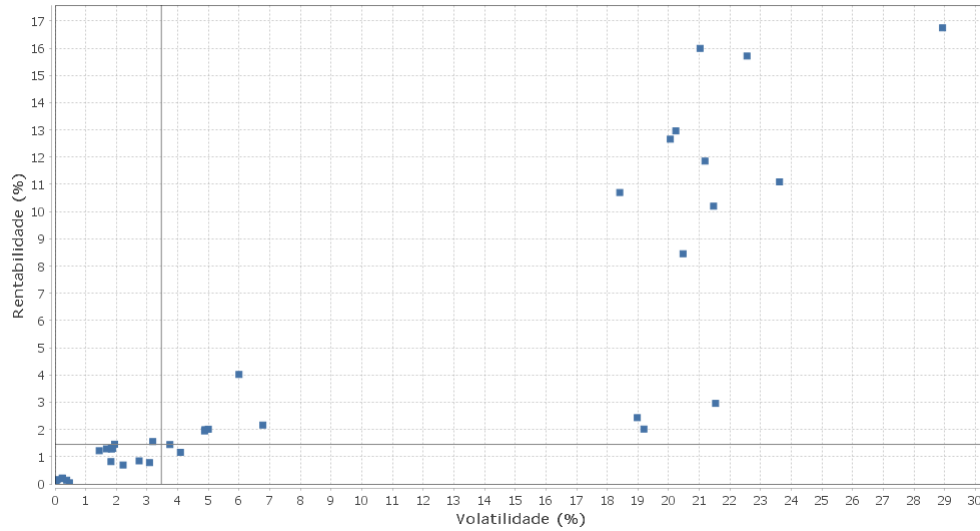
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
326	24/11/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	76,95	40,93798200	1,8796040000
327	25/11/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	100.102,15	53.254,83022000	1,8796820000
328	26/11/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	7.008,41	3.728,35278600	1,8797600000
329	27/11/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	4.004.491,79	0,00	2.130.232,38704600	1,8798380000
330	27/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.350.000,00	1.285.668,17669300	2,6056490000
331	30/11/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	2.485.164,14	0,00	1.321.954,88521800	1,8799160000
Total						

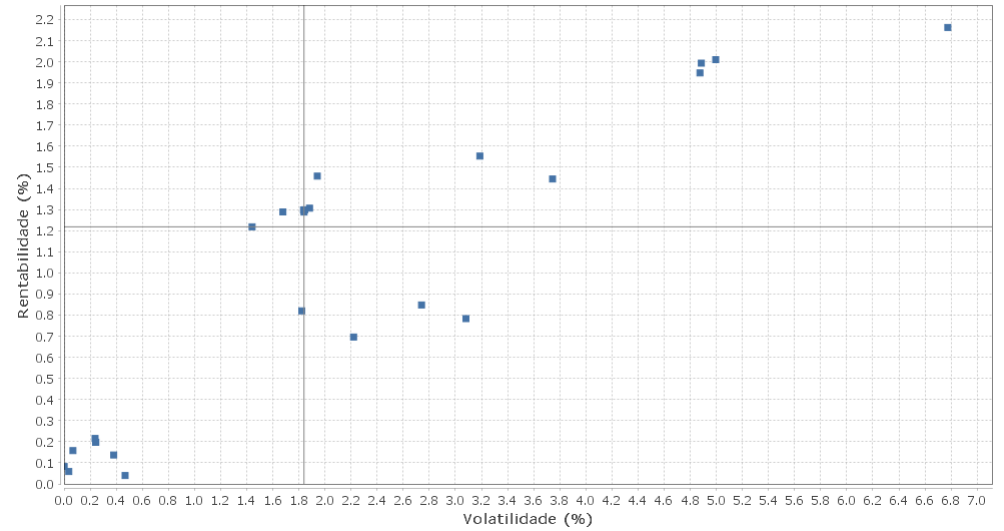
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

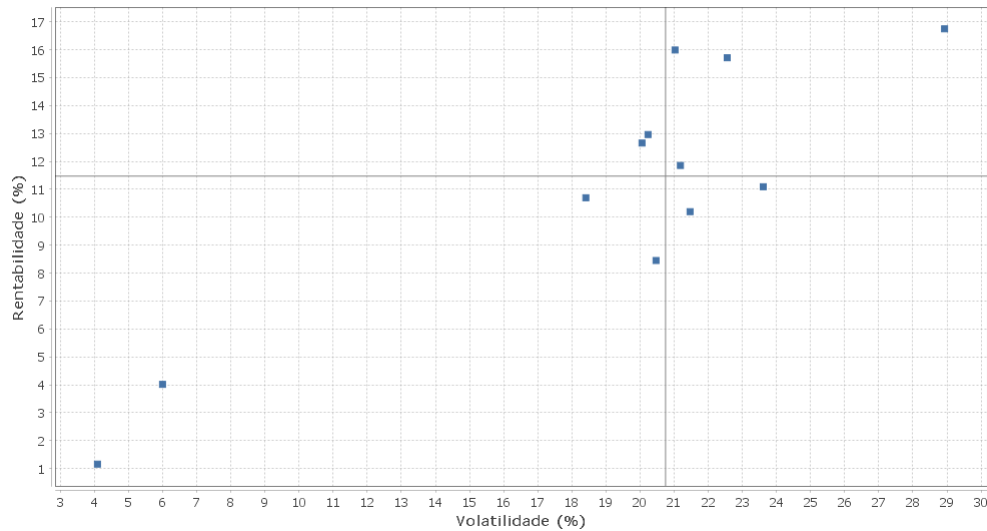
SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - No Mês



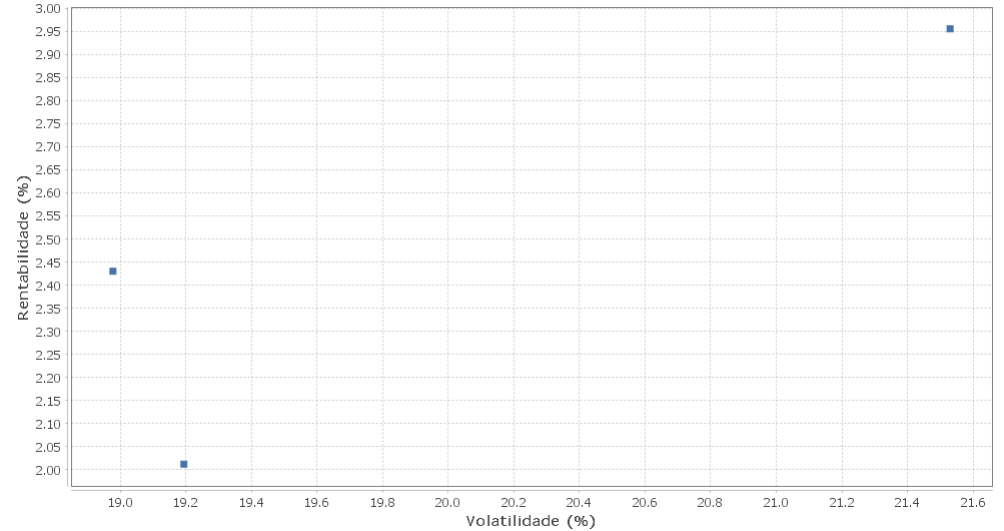
Renda Fixa - No Mês



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\$): 12.710.604,45

Value-At-Risk: 3,35%

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	-123,29	0,08	8.246.589,98	2,17
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,05	0,00	-2,51	0,06	12.619,93	0,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,09	0,00	0,12	0,16	2.411.535,39	0,63
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,24	0,16	0,00	0,28	0,22	4.480.470,22	1,18
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,24	0,18	0,00	0,20	0,20	1.360.818,36	0,36
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,24	0,17	0,00	0,20	0,20	1.599.456,20	0,42
SANTANDER RF ATIVO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,38	0,47	0,00	-0,03	0,14	2.399.257,53	0,63
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,47	0,06	-0,00	-0,23	0,04	2.534.751,15	0,67
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,44	1,07	0,01	0,74	1,22	3.929.013,83	1,03
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,68	1,08	0,00	0,68	1,29	1.746.978,75	0,46
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,82	1,23	0,09	0,37	0,82	39.300.665,33	10,34
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	1,84	1,08	0,01	0,63	1,30	6.476.077,17	1,70
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,84	1,03	0,02	0,62	1,29	12.790.752,20	3,37
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,84	1,02	0,01	0,62	1,30	7.493.196,60	1,97
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	1,88	1,42	0,01	0,61	1,31	4.976.504,85	1,31
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	1,94	0,96	0,00	0,67	1,46	2.319.314,32	0,61
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,22	1,12	0,01	0,25	0,70	4.351.703,77	1,15
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,74	1,33	0,11	0,25	0,85	40.970.307,56	10,78
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	3,08	1,38	0,03	0,21	0,78	11.662.809,72	3,07
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	Artigo 7º I, Alínea b	3,19	1,70	0,00	0,44	1,55	924.454,64	0,24
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,75	1,80	0,03	0,35	1,44	8.745.231,47	2,30
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	Artigo 8º IV, Alínea a	4,09	0,57	0,00	0,25	1,16	5.554.780,78	1,46
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	4,87	2,66	0,27	0,37	1,95	52.227.011,49	13,75
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,89	2,66	0,09	0,38	1,99	16.926.432,39	4,46
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	5,00	2,74	0,09	0,37	2,01	17.714.792,32	4,66
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	Artigo 8º III	6,00	2,97	0,03	0,64	4,02	4.320.369,10	1,14
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	6,77	3,56	0,03	0,30	2,16	4.644.019,72	1,22
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	18,41	8,37	0,25	0,57	10,70	16.706.094,53	4,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	18,98	12,80	0,05	0,12	2,43	5.211.191,07	1,37
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	19,19	12,44	0,02	0,10	2,01	1.944.905,80	0,51
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	20,06	10,16	0,15	0,62	12,66	5.718.248,50	1,51
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	20,23	11,79	0,50	0,63	12,96	17.466.711,03	4,60
BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	20,47	11,01	0,43	0,41	8,45	16.031.758,46	4,22
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,02	10,55	0,57	0,75	15,99	21.735.870,42	5,72
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	Artigo 8º II, Alínea a	21,18	10,57	0,09	0,55	11,85	3.574.956,30	0,94
XP INVESTOR FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	21,47	10,83	0,11	0,47	10,20	4.158.879,30	1,09
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	21,53	11,86	0,10	0,13	2,96	8.847.817,89	2,33
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	22,56	11,31	0,11	0,69	15,71	4.081.611,32	1,07
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	23,61	11,53	0,06	0,46	11,09	2.347.339,60	0,62
BB ACOES SETOR FINANCEIRO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	28,93	12,86	0,06	0,57	16,75	1.993.414,86	0,52