



SÃO JOSÉ DO RIO PRETO
OUTUBRO 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 30.10.2020.

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

RENDA FIXA

70,13%

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	0,56	0,11	2,94	1.596.303,67	0,44	7.887.722.403,08	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,77	0,20	-0,73	16.595.657,18	4,56	5.529.359.748,67	0,30
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,55	0,14	3,11	7.813.557,37	2,15	11.237.812.745,76	0,07
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,57	0,15	2,94	1.358.142,54	0,37	813.096.025,00	0,17
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,52	0,03	1,95	4.321.619,52	1,19	1.166.280.336,00	0,37
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,03	0,18	4,48	12.628.121,28	3,47	18.309.382.329,52	0,07
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	5,05	0,18	4,56	7.397.131,57	2,03	1.143.247.863,60	0,65
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,13	0,15	5,00	3.881.737,92	1,07	9.550.097.040,26	0,04
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,22	-0,29	5,20	8.620.677,98	2,37	727.578.932,77	1,18
BB	BB	BB PREV RF IPCA	6,14	-0,37	5,18	5.036.692,71	1,38	348.878.151,21	1,44
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,26	-0,07	1,78	40.269.681,35	11,06	9.938.464.189,22	0,41
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	-0,11	4,42	38.981.028,01	10,71	13.635.004.724,81	0,29
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	8,73	-0,19	4,43	910.318,39	0,25	214.513.446,45	0,42
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,18	0,29	3,88	1.724.757,80	0,47	571.777.072,59	0,30
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			5,63	-0,01	3,00	151.135.427,29	41,53		

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	12,75	0,20	-0,79	50.620.001,79	13,91	2.817.438.384,20	1,80
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,75	0,20	-0,79	50.620.001,79	13,91		

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	0,23	0,15	1,87	2.533.746,15	0,70	3.539.135.696,53	0,07
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	13,34	0,10	-0,70	17.365.719,21	4,77	1.945.147.907,08	0,89
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	16,78	-0,28	-0,17	4.545.720,37	1,25	587.567.612,49	0,77
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,23	0,16	1,98	2.407.733,50	0,66	2.401.972.433,04	0,10
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	0,05	0,08	88.323,91	0,02	1.611.170.285,08	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,07	0,09	1,73	3.898.551,58	1,07	622.243.810,38	0,63
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5,40	0,13	4,61	6.393.100,44	1,76	789.630.975,77	0,81
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	0,99	0,00	1,94	2.395.974,14	0,66	1.027.601.722,34	0,23
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	6,88	-0,28	1,34	11.572.174,73	3,18	1.350.317.873,00	0,86
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			8,26	-0,01	1,42	51.201.044,03	14,07		

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	4,50	0,31	4,44	2.285.981,60	0,63	606.006.746,86	0,38
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			4,50	0,31	4,44	2.285.981,60	0,63		
Renda Fixa			7,16	0,03	2,07	255.242.454,71	70,13		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

25,58%

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	43,53	-0,80	-18,74	3.527.384,27	0,97	109.890.635,80	3,21
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			43,53	-0,80	-18,74	3.527.384,27	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	43,40	-1,95	-22,52	5.075.800,18	1,39	515.643.080,15	0,98
BRAM	BEM	BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	43,96	-2,46	-16,71	14.782.456,29	4,06	1.939.742.217,75	0,76
XP	XP	XP INVESTOR FI DE ACOES	49,51	-3,72	-18,97	3.773.930,02	1,04	331.245.583,32	1,14
BB	BB	BB ACOES SETOR FINANCEIRO FIC FI	47,03	-0,20	-30,13	1.707.454,61	0,47	225.738.467,05	0,76
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	41,79	-1,78	-16,91	15.462.241,74	4,25	581.510.916,63	2,66
XP	XP	XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	40,52	-3,21	-29,63	2.112.979,41	0,58	226.273.386,62	0,93
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	43,31	-0,86	-22,27	18.739.389,41	5,15	388.213.527,42	4,83
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	42,04	0,71	-13,76	3.196.113,14	0,88	240.500.591,07	1,33
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			42,72	-1,69	-19,81	64.850.364,80	17,82		

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	13,01	-0,38	-3,90	4.153.536,58	1,14	2.234.637.773,86	0,19
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	32,99	-2,34	-1,80	15.091.586,05	4,15	991.427.993,44	1,52
Sub-total Artigo 8º III			27,82	-1,92	-2,26	19.245.122,63	5,29		

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	54,60	-2,03	11,46	5.491.202,52	1,51	175.169.355,21	3,13
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			54,60	-2,03	11,46	5.491.202,52	1,51		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	35,86	-1,73	-15,13	93.114.074,22	25,58
---	-------	-------	--------	---------------	-------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,28%

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	29,24	-1,77	50,05	5.087.557,39	1,40	1.678.449.679,91	0,30
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	29,22	-2,23	61,61	8.593.852,57	2,36	2.068.161.852,01	0,42
BB	BB	BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	28,76	-1,87	43,32	1.906.541,16	0,52	477.332.700,33	0,40
Sub-total Artigo 9º A, III			28,46	-2,04	55,28	15.587.951,12	4,28		
Investimentos no Exterior			28,46	-2,04	55,28	15.587.951,12	4,28		
Total			13,55	-0,52	-1,50	363.944.480,05	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	151.135.427,29	41,53	10,00	45,40	70,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	50.620.001,79	13,91	0,00	10,00	20,00	70,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	51.201.044,03	14,07	0,00	14,50	40,00	50,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.285.981,60	0,63	0,00	0,60	5,00	15,00
	Total Renda Fixa	255.242.454,71	70,13				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	3.527.384,27	0,97	0,00	1,00	10,00	40,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	64.850.364,80	17,82	5,00	20,00	30,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	19.245.122,63	5,29	0,00	5,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	5.491.202,52	1,51	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	93.114.074,22	25,58				40,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	15.587.951,12	4,28	0,00	2,50	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	15.587.951,12	4,28				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

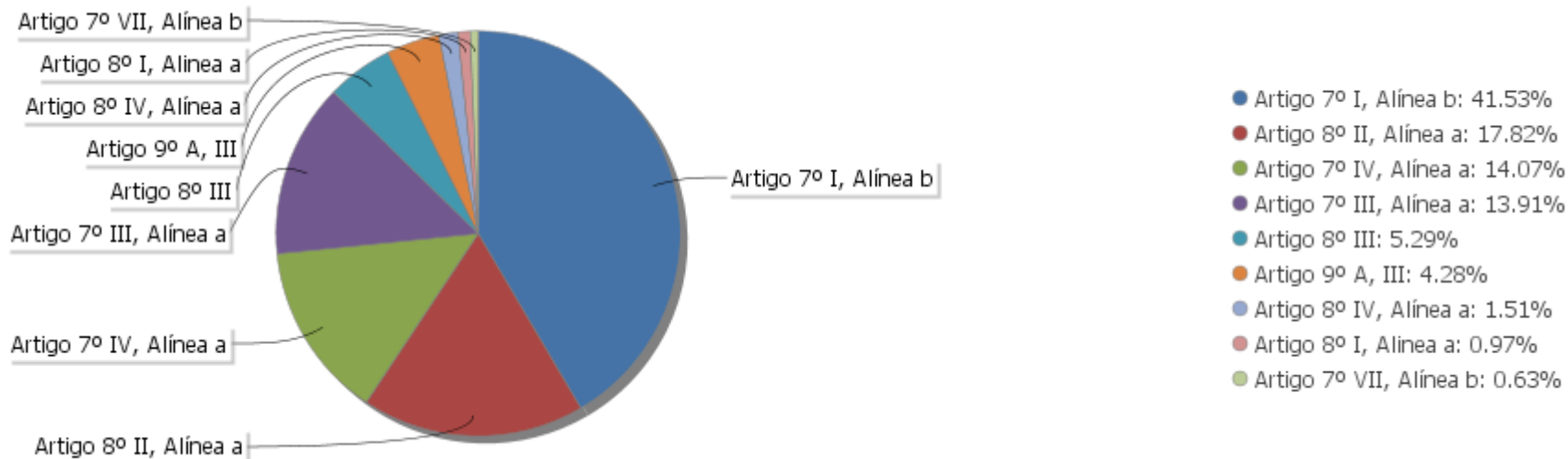
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,01 -8,21	3,00 123,19	-1,07 -225,92	2,81 250,87	3,26 101,65	-17.777,02	4.931.042,48
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,20 124,50	-0,79 -32,45	-3,17 -668,25	4,66 415,96	-1,37 -42,81	100.065,51	-340.581,54
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,01 -5,67	1,42 58,37	-2,09 -441,24	3,30 294,41	1,22 38,08	-10.112,99	501.945,31
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,31 200,27	4,44 182,26	0,73 152,86	4,94 440,67	5,39 167,82	7.163,68	97.178,56
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,80 -0,11	-18,74 0,02	-8,63 0,07	16,20 -0,50	-12,40 -0,02	-28.324,31	-813.511,24
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,69 -1,00	-19,81 -1,05	-8,90 -0,19	14,68 -2,02	-10,33 2,05	-1.115.466,14	-15.870.907,00
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-1,92 -1,24	-2,26 16,50	-1,23 7,48	9,85 -6,85	3,44 15,82	-377.615,20	-444.913,09
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,03 -1,34	11,46 30,21	-10,31 -1,61	-5,39 -22,09	31,81 44,19	-113.958,75	885.807,85
Artigo 9º A, III % do CDI	-2,04 -1.296,79	55,28 2.269,42	11,40 2.402,65	22,63 2.017,65	66,22 2.062,33	-323.898,05	5.549.505,44
SÃO JOSÉ DO RIO PRETO (Total)						-1.879.923,27	-5.504.433,23

Análise de Liquidez

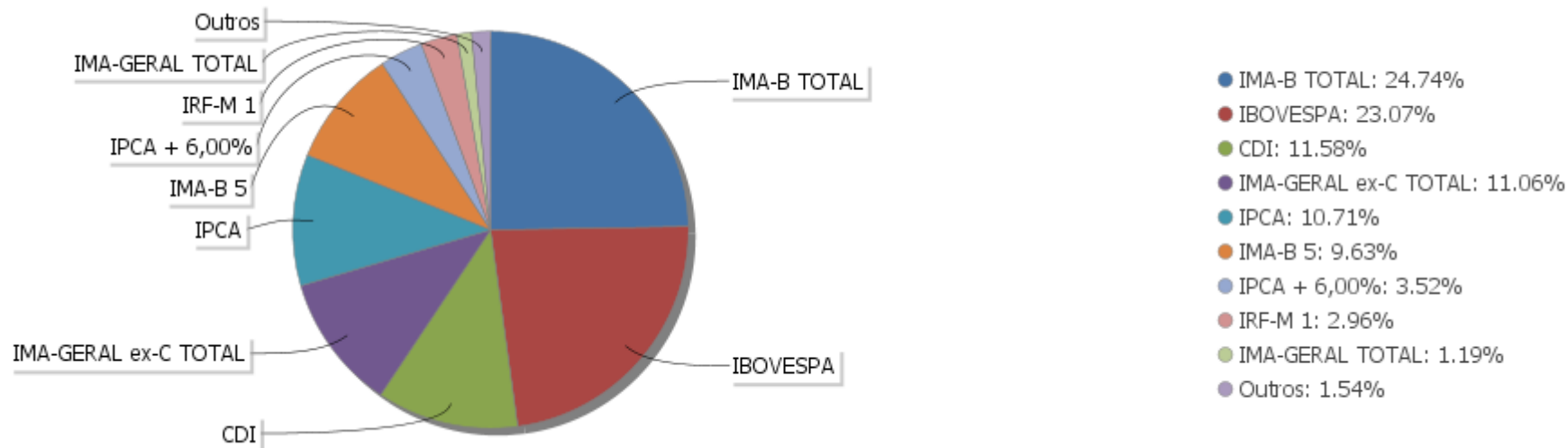
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	333.033.285,29	91,51	333.033.285,29	91,51
de 31 a 365 dias	15.462.241,74	4,25	348.495.527,03	95,76
acima de 365 dias	15.448.953,02	4,24	363.944.480,05	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

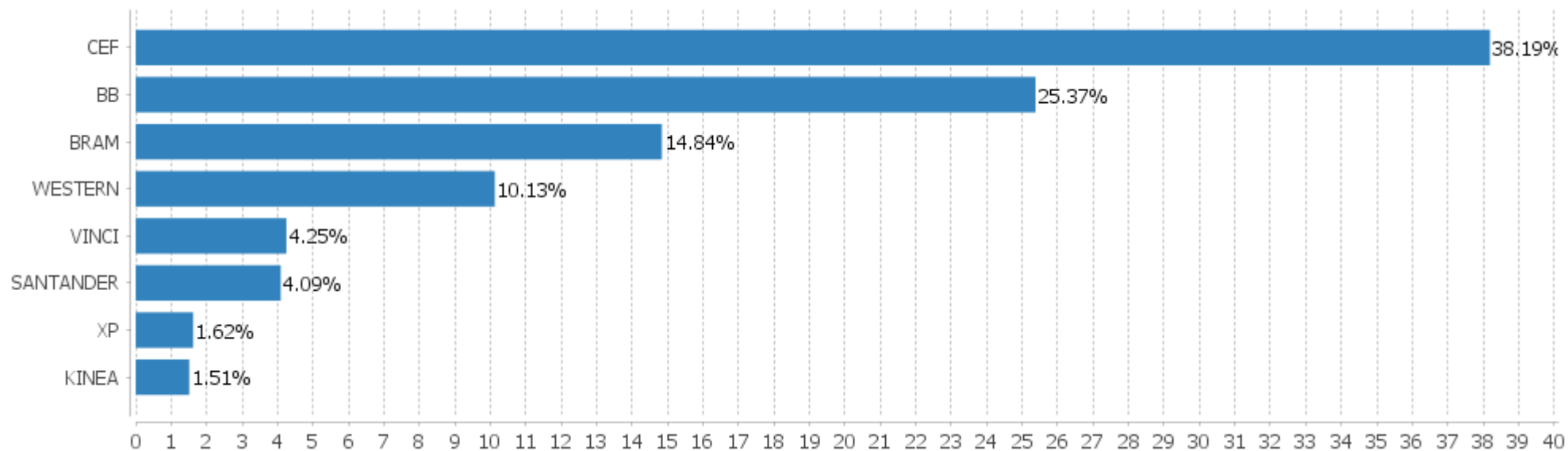


Alocação Por Estratégia



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			-1,50
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34			7,18
p.p. indexador	-0,08	-2,19	-9,98	3,25	2,51	2,11	2,48	-1,16	-2,89	-1,86			-8,68
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

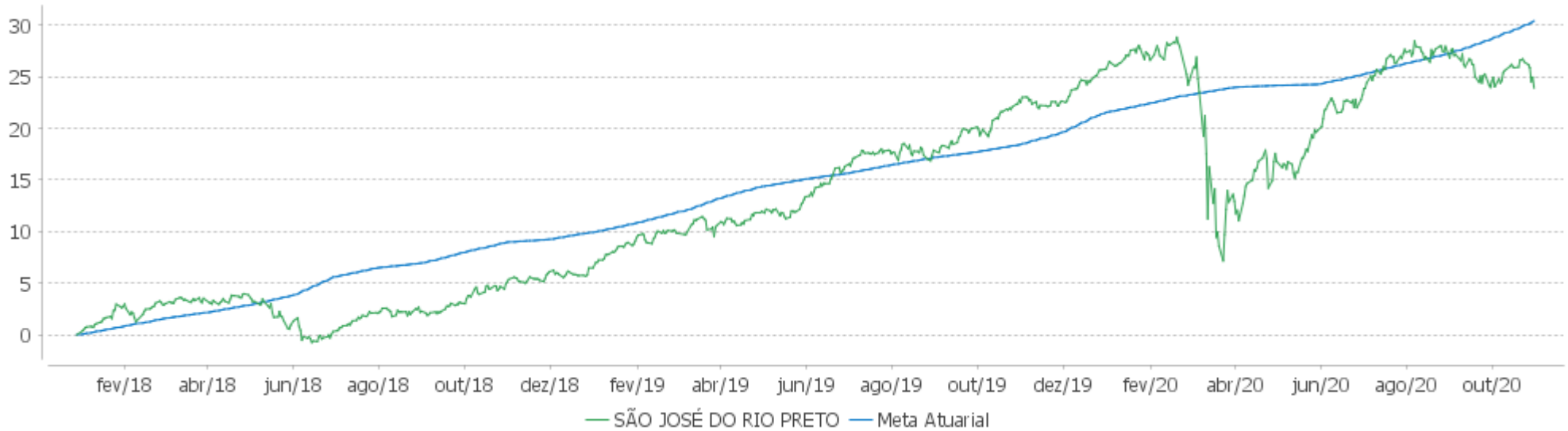
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

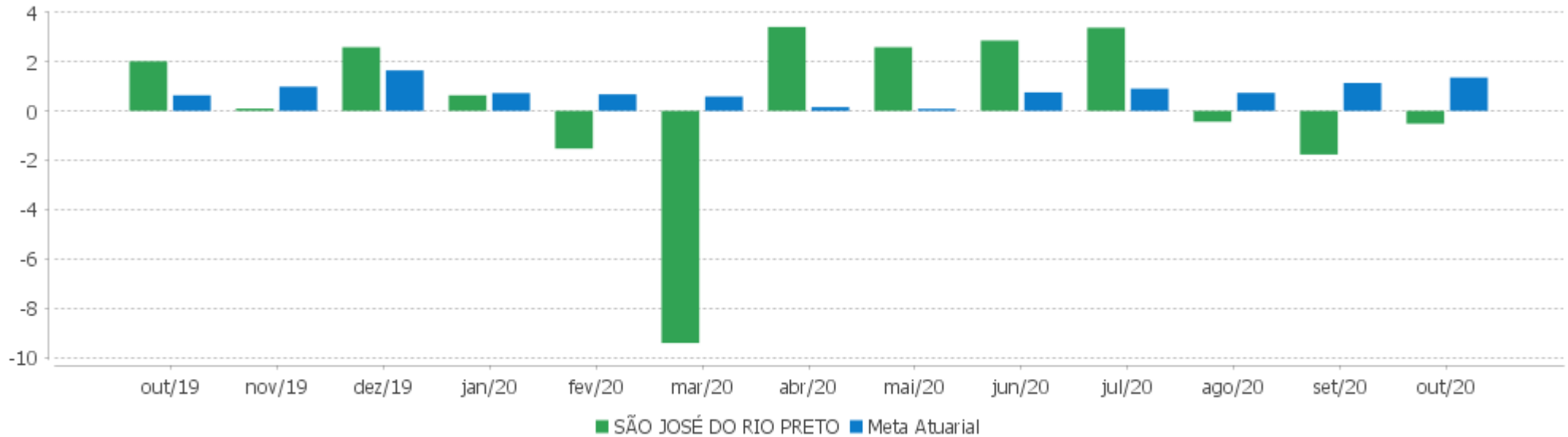
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	17	50,00	03 meses	-2,71	3,22	-5,92	7,32
Meses abaixo da Meta Atuarial	17	50,00	06 meses	6,11	4,98	1,14	7,21
			12 meses	1,13	10,01	-8,88	13,55
			24 meses	17,87	19,56	-1,70	9,96
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,40	2020-04					
Menor rentabilidade da Carteira	-9,41	2020-03	Desde 29/12/2017	23,91	30,29	-6,38	8,68

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
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,31 -1,04	4,44 -2,84	0,73 -2,52	4,94 -0,09	5,39 -4,71	18,87 -0,80	31,58 -0,99
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	-0,29 -0,49	5,20 0,49	-1,39 -1,90	4,75 -0,06	5,61 -0,10	25,17 4,89	37,59 6,12
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,18 -0,02	4,56 -0,16	0,44 -0,07	4,68 -0,13	5,51 -0,20	19,78 -0,49	30,71 -0,76
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,18 -0,02	4,48 -0,24	0,41 -0,09	4,66 -0,15	5,38 -0,33	19,69 -0,58	30,54 -0,92
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,11 -0,05	2,94 -0,34	0,24 -0,19	1,13 -0,25	3,67 -0,39	10,79 -0,70	18,38 -0,98
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,03 -0,06	1,95 -0,55	-1,30 -0,19	2,19 -0,45	2,10 -0,57	16,74 -1,13	26,61 -1,76
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6,00% p.p.	0,29 -1,09	3,88 -4,17	0,61 -3,03	4,32 -1,37	4,97 -6,04	18,91 -1,76	40,24 7,26
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF.. Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,19 -0,40	4,43 4,94	-1,19 1,88	5,00 0,19	4,94 5,94	25,07 -0,40	33,36 -5,02
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,37 -1,72	5,18 -2,09	-0,01 -3,25	4,82 -0,21	5,91 -4,19	24,19 4,53	36,10 3,53
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,15 -0,02	2,94 -0,35	0,27 -0,16	1,15 -0,23	3,67 -0,40	10,78 -0,71	18,35 -1,02
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,07 -0,07	1,78 -0,17	-1,70 -0,31	2,07 -0,07	1,80 -0,37	17,32 0,22	27,46 0,26
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,11 -0,97	4,42 2,20	-1,16 -2,91	1,94 -0,06	4,51 0,59	23,65 17,10	32,48 21,07
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,15 0,12	5,00 -0,45	0,98 -0,11	4,98 0,13	6,16 -0,57	18,25 -1,35	29,01 -2,25
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,14 -0,02	3,11 -0,17	0,37 -0,06	1,27 -0,10	3,85 -0,21	11,05 -0,44	18,71 -0,65
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,20 -0,02	-0,73 -0,23	-3,19 -0,11	4,62 -0,19	-1,29 -0,28	24,83 -0,64	37,31 -1,07
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,10 -0,11	-0,70 -0,19	-3,31 -0,24	4,80 -0,02	-1,30 -0,30	25,25 -0,22	37,72 -0,66
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,13	4,61	0,36	4,66	5,49	19,92	30,73

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 5 p.p.	-0,08	-0,10	-0,14	-0,15	-0,22	-0,35	-0,74
SANTANDER RF ATIVO FIC	0,00	1,94	-0,57	0,78	2,54	18,02	22,49
% do CDI	1,84	79,51	-120,98	69,45	79,05	187,37	133,95
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,15	1,87	0,44	1,29	2,58	8,86	15,89
% do CDI	97,45	76,68	92,45	114,88	80,46	92,13	94,61
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	-0,28	-0,17	-5,01	4,51	-1,21	30,17	43,94
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,49	0,33	-1,93	-0,31	-0,20	4,70	5,56
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,16	1,98	0,36	1,12	2,69	8,87	15,98
% do CDI	101,53	81,34	76,91	100,00	83,84	92,26	95,19
BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	1,48	0,13	0,52	2,07	7,24	13,03
% do CDI	35,66	60,70	27,58	46,41	64,40	75,26	77,62
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,09	1,73	0,26	0,70	2,36	7,80	13,92
% do CDI	55,36	70,85	55,74	62,32	73,40	81,13	82,88
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	-0,28	1,34	-2,11	1,64	1,24	16,26	
% do CDI	-177,06	54,84	-444,10	146,26	38,50	169,09	
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	0,20	-0,79	-3,17	4,66	-1,37	24,61	37,33
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,28	-0,09	-0,15	-0,37	-0,86	-1,06
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	0,71	-13,76	-5,80	19,14	-0,84		
Var. IBOVESPA p.p.	1,40	5,00	2,91	2,44	11,53		
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	-0,86	-22,27	-8,32	15,13	-15,20	2,38	20,30
Var. IBOVESPA p.p.	-0,18	-3,51	0,39	-1,58	-2,83	-5,08	-6,13
XP INVESTOR FI DE ACOES	-3,72	-18,97	-9,76	17,63	-7,57	26,74	49,72
Var. IBOVESPA p.p.	-3,03	-0,21	-1,05	0,93	4,81	19,27	23,29
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	-1,78	-16,91	-9,22	15,64	-4,71	39,27	49,68
Var. IBOVESPA p.p.	-1,10	1,85	-0,52	-1,06	7,66	31,80	23,24
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	-1,95	-22,52	-7,83	16,32	-15,32	5,66	22,89
Var. IBOVESPA p.p.	-1,26	-3,76	0,87	-0,38	-2,95	-1,81	-3,55
BB ACOES SETOR FINANCEIRO FIC FI	-0,20	-30,13	-14,18	10,10	-28,28	-3,75	11,96
Var. IBOVESPA p.p.	0,49	-11,37	-5,48	-6,60	-15,91	-11,22	-14,47
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	-3,21	-29,63	-12,81	1,62	-22,23	18,22	31,15
Var. IBOVESPA p.p.	-2,52	-10,87	-4,10	-15,08	-9,85	10,75	4,71
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	-2,46	-16,71	-8,84	13,66	-5,27	30,39	57,34
Var. IBOVESPA p.p.	-1,78	2,05	-0,13	-3,04	7,10	22,92	30,91
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-2,34	-1,80	-0,68	11,49	4,64	21,68	33,20
% do CDI	-1.492,07	-73,85	-142,48	1.024,61	144,42	225,50	197,74
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	-0,38	-3,90	-3,18	4,29	-0,68	10,17	19,84

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-239,51	-160,00	-669,84	382,42	-21,25	105,74	118,16
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME Var. IPCA + 6,00% p.p.	-2,03 -3,38	11,46 4,18	-10,31 -13,56	-5,39 -10,42	31,81 21,71	204,41 184,74	
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-0,80 -0,11	-18,74 0,02	-8,63 0,07	16,20 -0,50	-12,40 -0,02	6,68 -0,79	24,45 -1,98
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-1,77 -1,08	50,05 68,81	10,87 19,57	21,16 4,46	60,56 72,93	94,90 87,43	135,92 109,48
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-1,87 -1,18	43,32 62,08	9,75 18,46	15,93 -0,77	54,05 66,43	75,70 68,23	119,04 92,61
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-2,23 -1,54	61,61 80,37	12,10 20,80	25,13 8,43	72,86 85,23	116,33 108,86	154,73 128,29
SÃO JOSÉ DO RIO PRETO Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,52 -1,87	-1,50 -8,78	-2,71 -5,95	6,11 1,08	1,13 -8,97	17,87 -1,80	
CDI	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,79
IBOVESPA	-0,69	-18,76	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44
INPC + 6,00%	1,38	8,05	3,63	5,69	11,01	20,67	32,97
IPCA + 6,00%	1,35	7,28	3,24	5,03	10,10	19,67	32,57

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	0,16	3,29	0,43	1,38	4,06	11,49	19,36
IRF-M 1+	-0,61	4,76	-2,63	1,75	4,63	23,41	36,20
IRF-M TOTAL	-0,33	4,27	-1,63	1,64	4,44	19,78	31,08
IMA-B 5	0,20	4,72	0,50	4,81	5,71	20,28	31,47
IMA-B 5+	0,22	-4,35	-5,92	4,90	-5,85	28,98	43,02
IMA-B TOTAL	0,21	-0,51	-3,08	4,81	-1,00	25,47	38,38
IMA-C TOTAL	2,81	21,09	8,08	19,98	20,18	45,58	72,54
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,00	1,96	-1,39	2,13	2,16	17,10	27,20
IMA-GERAL TOTAL	0,09	2,49	-1,11	2,64	2,67	17,87	28,36
IDKA 2	0,04	5,45	1,09	4,85	6,73	19,60	31,26
IDKA 20	0,68	-11,22	-9,64	5,97	-13,27	34,55	50,97
CDI	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,79
Renda Variável							
IBOVESPA	-0,69	-18,76	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44
IBRX 100	-0,55	-17,87	-8,31	17,55	-11,05	11,01	29,92
IBRX 50	-0,54	-18,50	-8,37	18,20	-12,42	5,25	23,91
SMALL CAP	-2,28	-20,78	-8,74	20,16	-6,17	34,08	41,52
IFIX	-1,01	-13,47	1,23	6,27	-0,90	23,38	24,28
Índice Consumo - ICON	-2,86	-11,86	-8,08	17,23	-1,94	42,20	27,52
Índice Dividendos - IDIV	0,65	-20,56	-8,64	11,34	-10,58	24,50	30,96
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,86	2,22	1,75	1,99	3,92	6,55	11,41
INPC	0,89	2,95	2,13	2,63	4,77	7,45	11,75
IGPM	3,23	18,10	10,67	15,22	20,93	24,74	38,21
SELIC	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,80
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
265	01/10/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	832.926,03	443.797,61702700	1,8768150000
266	02/10/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	13.208,61	7.037,48782900	1,8768920000
267	02/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.726,39	0,00	1.293,13441000	2,1083577840
268	05/10/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	3.087,74	1.645,06176500	1,8769700000
269	06/10/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	97.670,50	0,00	52.034,12594300	1,8770470000
270	07/10/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.307.496,21	696.542,27204400	1,8771240000
271	07/10/2020	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	431.424,80	0,00	117.825,11813900	3,6615690000
272	08/10/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.667,71	888,40006700	1,8772020000
273	09/10/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	2.677,65	0,00	1.426,34556300	1,8772800000
274	09/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.056,00	0,00	1.449,27684600	2,1086378410
275	13/10/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.698,16	1.437,20869800	1,8773580000
276	13/10/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	58.879,54	0,00	39.697,65466300	1,4831994610
277	13/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	58.879,54	27.896,26741800	2,1106600920
278	14/10/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	71,07	37,85251500	1,8774390000
279	14/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	5.161,73	0,00	2.445,34597800	2,1108383210
280	15/10/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	64,20	0,00	34,19407900	1,8775180000
281	16/10/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	5.922,09	3.154,08179400	1,8775950000
282	16/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	10.409,79	0,00	4.932,47319500	2,1104605310
283	19/10/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	24.344,21	0,00	12.965,09562600	1,8776730000
284	19/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	23.149,78	0,00	10.970,04305100	2,1102724840
285	20/10/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	9.416,32	5.014,67780500	1,8777510000
286	20/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	25.289,06	0,00	11.982,07454000	2,1105744180
287	21/10/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	564,06	300,37880100	1,8778280000
288	22/10/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	41.786,77	0,00	22.251,79002500	1,8779060000
289	22/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	8.121,86	0,00	3.848,24241900	2,1105375170
290	23/10/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	127.108,69	67.683,69282600	1,8779810000
291	23/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	12.209,00	0,00	5.784,71345000	2,1105626240
292	27/10/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	310.886,07	0,00	165.528,96300900	1,8781370000

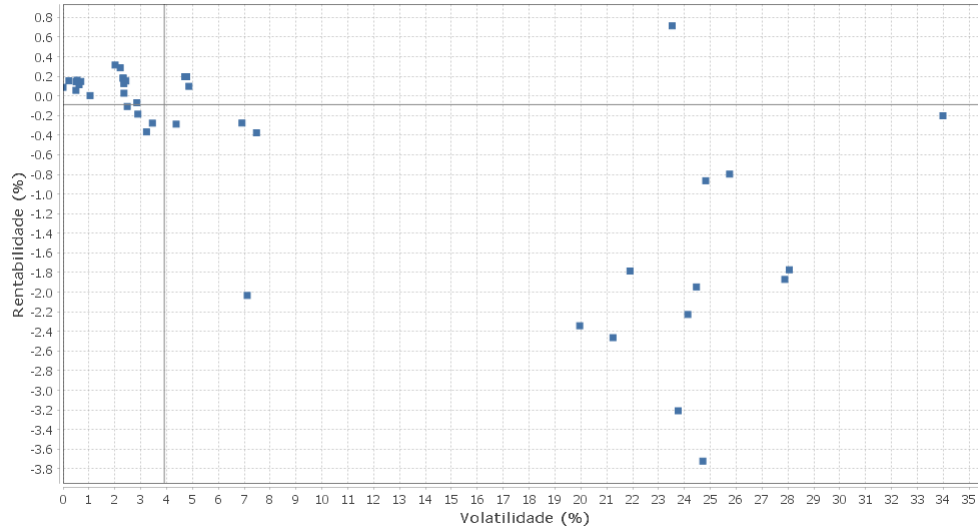
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
293	27/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.050.000,00	788.714,22984500	2,5991670000
294	27/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.000,00	1.923,69318400	2,5991670000
295	27/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.968,66	0,00	1.880,26316000	2,1106939090
296	28/10/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.213.153,95	0,00	645.908,26710900	1,8782140000
297	29/10/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	565.411,90	0,00	301.024,49459400	1,8782920000
Total						

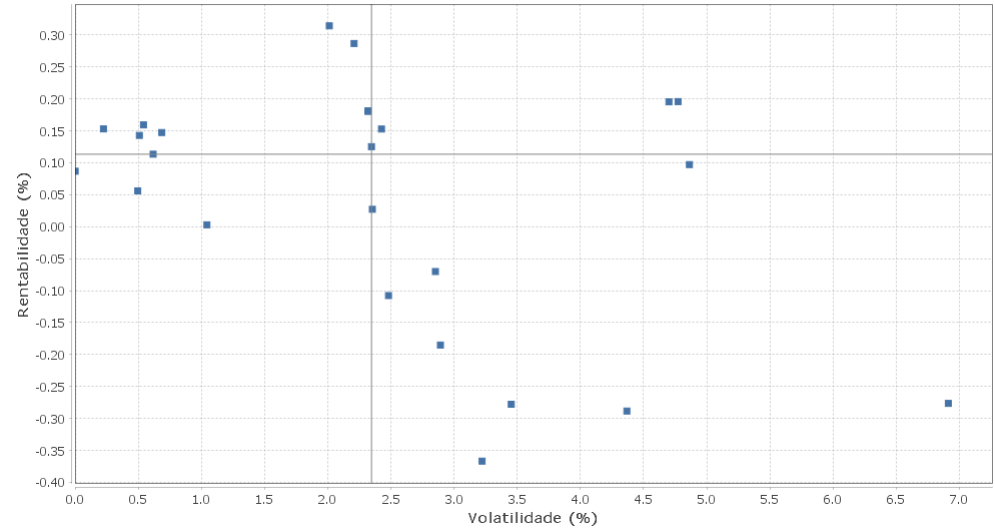
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

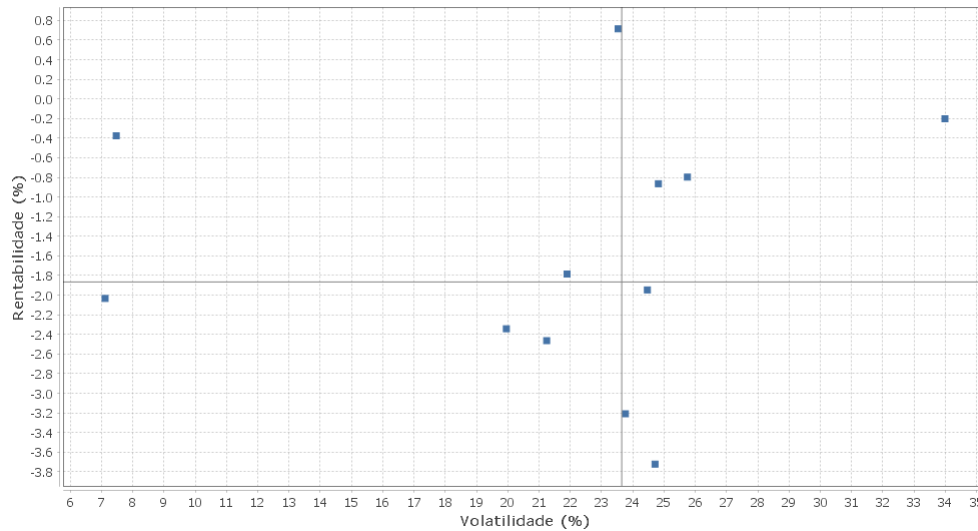
SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - No Mês



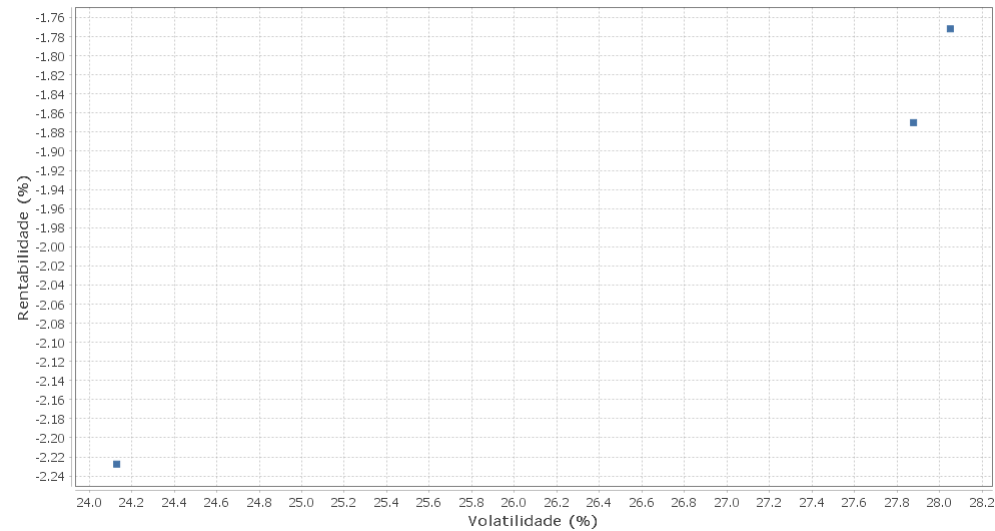
Renda Fixa - No Mês



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\$): 11.897.711,01

Value-At-Risk: 3,27%

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	-71,82	0,09	3.898.551,58	1,07
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,22	0,05	-0,00	-0,02	0,15	2.533.746,15	0,70
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,50	0,06	0,00	-0,20	0,06	88.323,91	0,02
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,51	0,16	0,00	-0,03	0,14	7.813.557,37	2,15
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,54	0,10	0,00	0,00	0,16	2.407.733,50	0,66
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,62	0,17	0,00	-0,07	0,11	1.596.303,67	0,44
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,69	0,17	0,00	-0,01	0,15	1.358.142,54	0,37
SANTANDER RF ATIVO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	1,04	0,47	0,00	-0,15	0,00	2.395.974,14	0,66
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	2,01	0,83	0,00	0,08	0,31	2.285.981,60	0,63
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,21	1,06	0,00	0,06	0,29	1.724.757,80	0,47
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,32	1,02	0,02	0,01	0,18	12.628.121,28	3,47
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,32	1,04	0,01	0,01	0,18	7.397.131,57	2,03
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	2,35	1,07	0,01	-0,01	0,13	6.393.100,44	1,76
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,35	1,16	0,01	-0,06	0,03	4.321.619,52	1,19
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,43	1,08	0,01	-0,00	0,15	3.881.737,92	1,07
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,48	1,21	0,10	-0,11	-0,11	38.981.028,01	10,71
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,85	1,34	0,11	-0,08	-0,07	40.269.681,35	11,06
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	Artigo 7º I, Alínea b	2,89	1,80	0,00	-0,12	-0,19	910.318,39	0,25
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	3,22	1,42	0,01	-0,16	-0,37	5.036.692,71	1,38
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	3,45	1,38	0,03	-0,13	-0,28	11.572.174,73	3,18
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,37	1,87	0,03	-0,10	-0,29	8.620.677,98	2,37
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	4,70	3,15	0,33	0,01	0,20	50.620.001,79	13,91
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,77	3,15	0,11	0,01	0,20	16.595.657,18	4,56
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	4,86	3,28	0,12	-0,01	0,10	17.365.719,21	4,77
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	6,91	3,77	0,04	-0,06	-0,28	4.545.720,37	1,25
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	Artigo 8º IV, Alínea a	7,12	0,25	0,00	-0,31	-2,03	5.491.202,52	1,51
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	Artigo 8º III	7,47	3,05	0,03	-0,07	-0,38	4.153.536,58	1,14
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	19,96	10,49	0,27	-0,13	-2,34	15.091.586,05	4,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,24	9,95	0,37	-0,12	-2,46	14.782.456,29	4,06
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,90	11,78	0,45	-0,09	-1,78	15.462.241,74	4,25
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	Artigo 8º II, Alínea a	23,53	10,44	0,08	0,02	0,71	3.196.113,14	0,88
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	23,76	12,53	0,06	-0,14	-3,21	2.112.979,41	0,58
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	24,13	12,40	0,10	-0,10	-2,23	8.593.852,57	2,36
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	24,47	11,63	0,15	-0,09	-1,95	5.075.800,18	1,39
XP INVESTOR FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	24,71	10,48	0,10	-0,16	-3,72	3.773.930,02	1,04
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,82	10,05	0,48	-0,04	-0,86	18.739.389,41	5,15
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	25,75	10,77	0,10	-0,04	-0,80	3.527.384,27	0,97
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	27,88	12,89	0,02	-0,07	-1,87	1.906.541,16	0,52
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	28,05	13,17	0,05	-0,07	-1,77	5.087.557,39	1,40
BB ACOES SETOR FINANCEIRO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	33,99	13,49	0,05	-0,01	-0,20	1.707.454,61	0,47