



IPAJM - CONSOLIDADO
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 **80,85%**

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830	14,07	-1,41	-1,41	121.254.745,92	2,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822	4,94	0,31	0,31	421.893.329,66	8,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	6,15	0,04	0,04	77.286.451,52	1,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150521	2,11	0,78	0,78	321.506.466,48	6,30
TESOURO NACIONAL	LFT 010324	0,58	0,19	0,19	112.697.554,58	2,21
TESOURO NACIONAL	LFT 010921	0,10	0,16	0,16	248.971.025,13	4,88
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		3,42	0,20	0,20	1.303.609.573,29	25,55

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-M	6,16	-0,80	-0,80	50.304.894,93	0,99	8.385.200.938,98	0,60
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	23,63	-2,48	-2,48	35.553.600,93	0,70	296.079.652,80	12,01
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,58	0,03	0,03	305.940.600,78	6,00	8.572.331.669,58	3,57
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,85	-0,86	-0,86	26.856.662,75	0,53	8.335.200.025,45	0,32
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,90	-0,87	-0,87	14.577.618,55	0,29	6.185.705.380,20	0,24
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,56	0,03	0,03	40.669.509,39	0,80	10.435.150.283,00	0,39
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,06	0,08	0,08	86.297.091,83	1,69	13.518.203.391,91	0,64
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,24	0,18	0,18	43.125.131,85	0,85	9.200.599.633,08	0,47
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,86	-1,70	-1,70	2.981.931,42	0,06	1.607.704.843,41	0,19
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,97	-1,70	-1,70	1.379.820,82	0,03	1.699.071.109,60	0,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	9,18	-1,39	-1,39	21.111.402,04	0,41	2.764.051.643,34	0,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,18	0,13	0,13	34.274.349,59	0,67	10.852.113.121,11	0,32
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,14	-0,77	-0,77	37.057.784,36	0,73	2.465.176.454,79	1,50
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	4,35	-0,43	-0,43	1.417.851,76	0,03	200.293.256,86	0,71
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,33	-0,55	-0,55	674.379.381,86	13,22	9.495.985.226,13	7,10
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	0,03	0,03	707.958.438,60	13,87	14.822.912.413,17	4,78
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			5,20	-0,27	-0,27	2.083.886.071,46	40,84		

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	2.149.295,73	0,04	2.989.640.382,47	0,07
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,82	-0,88	-0,88	2.149.295,73	0,04		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,05	0,04	0,04	0,00	0,00	91.336.133,75	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,94	0,15	0,15	11.202.921,21	0,22	290.796.208,10	3,85
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,02	0,01	0,01	77.009.736,20	1,51	942.069.453,39	8,17
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,37	0,16	0,16	185.584.924,55	3,64	5.006.506.249,23	3,71
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	26,90	-2,89	-2,89	32.967.862,63	0,65	283.601.726,46	11,62
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,22	0,17	0,17	314.758.037,13	6,17	2.962.335.860,83	10,63
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,15	0,08	0,08	6.331.745,16	0,12	2.320.539.431,87	0,27
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,05	0,08	0,08	66,37	0,00	608.020.020,83	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,93	0,21	0,21	100.919.531,19	1,98	1.851.816.706,72	5,45
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,85	-0,82	-0,82	7.288.480,94	0,14	173.596.668,41	4,20
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,30	-0,01	-0,01	736.063.305,38	14,42		

Renda Fixa			3,71	-0,08	-0,08	4.125.708.245,86	80,85		
------------	--	--	------	-------	-------	------------------	-------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

15,12%

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 BRASIL IBX-50	46,39	-2,87	-2,87	167.600.161,99	3,28	1.128.688.996,47	14,85
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	45,64	-2,82	-2,82	153.899.350,59	3,02	1.218.203.539,76	12,63
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	44,32	-3,24	-3,24	10.563.888,22	0,21	120.659.555,57	8,76
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	45,03	-3,32	-3,32	76.075.268,12	1,49	761.516.224,91	9,99
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			45,83	-2,94	-2,94	408.138.668,92	8,00		

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
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	39,53	-4,39	-4,39	135.294.146,61	2,65	998.958.997,80	13,54
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	40,22	-3,76	-3,76	33.882.581,56	0,66	968.458.637,18	3,50
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	48,99	-3,48	-3,48	165.288.844,16	3,24	1.192.287.997,72	13,86
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	46,52	-0,61	-0,61	5.921.275,50	0,12	209.697.528,06	2,82
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			43,61	-3,82	-3,82	340.386.847,83	6,67		

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
CEF	CEF	FIP CAIXA CYRELA	467,04	-7,59	-7,59	12.542,88	0,00	508.639,17	2,47
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			467,04	-7,59	-7,59	12.542,88	0,00		

Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	47,76	-16,16	-16,16	22.822.000,00	0,45	153.168.285,45	14,90
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			47,76	-16,16	-16,16	22.822.000,00	0,45		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			41,95	-3,78	-3,78	771.360.059,63	15,12		
---	--	--	-------	-------	-------	----------------	-------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,04%

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	151.900.033,58	2,98	2.159.778.426,35	7,03
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	29,90	5,00	5,00	54.158.400,63	1,06	609.313.979,93	8,89
Sub-total Artigo 9º A, III			30,17	5,58	5,58	206.058.434,21	4,04		
Investimentos no Exterior			30,17	5,58	5,58	206.058.434,21	4,04		
Total			7,91	-0,45	-0,45	5.103.126.739,70	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos							
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	1.303.609.573,29	25,55	20,00	23,00	60,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	2.083.886.071,46	40,84	15,00	42,00	60,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	2.149.295,73	0,04	0,00	0,01	2,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	736.063.305,38	14,42	5,00	6,00	30,00	40,00
	Total Renda Fixa	4.125.708.245,86	80,85				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	408.138.668,92	8,00	0,00	3,30	10,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	340.386.847,83	6,67	0,00	8,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	12.542,88	0,00	0,00	0,10	2,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	22.822.000,00	0,45	0,00	0,50	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	771.360.059,63	15,12				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	206.058.434,21	4,04	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	206.058.434,21	4,04				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

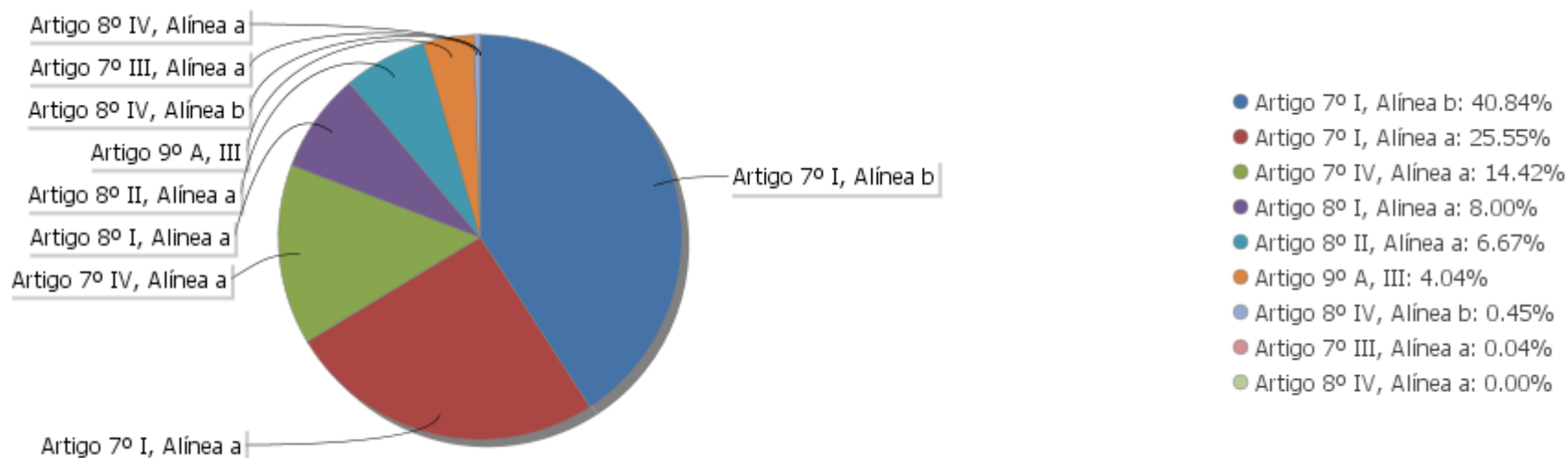
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,20 136,97	0,20 136,97	2,32 499,03	3,20 340,01	5,96 236,00	2.663.737,27	2.663.737,27
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,27 -179,45	-0,27 -179,45	2,30 496,17	1,04 110,58	4,59 181,63	-5.605.325,99	-5.605.325,99
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	-19.123,79	-19.123,79
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,01 -8,04	-0,01 -8,04	0,83 177,92	0,85 90,11	0,90 35,67	20.136,30	20.136,30
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,94 0,37	-2,94 0,37	22,29 -0,19	11,52 -0,30	0,48 -0,67	-12.383.115,14	-12.383.115,14
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,82 -0,50	-3,82 -0,50	18,77 -3,70	7,82 -3,99	-8,18 -9,32	-13.527.273,24	-13.527.273,24
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-7,59 -4,27	-7,59 -4,27	-98,46 -120,94	-98,47 -110,28	-98,69 -99,84	-1.030,19	-1.030,19
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-16,16 -12,84	-16,16 -12,84	-22,19 -44,66	-32,06 -43,87	-29,84 -30,99	-4.408.000,00	-4.408.000,00
Artigo 9º A, III % do CDI	5,58 3.732,70	5,58 3.732,70	8,79 1.894,42	20,39 2.166,49	52,83 2.092,18	10.890.455,77	10.890.455,77
IPAJM - CONSOLIDADO (Total)						-22.369.539,01	-22.369.539,01

Análise de Liquidez

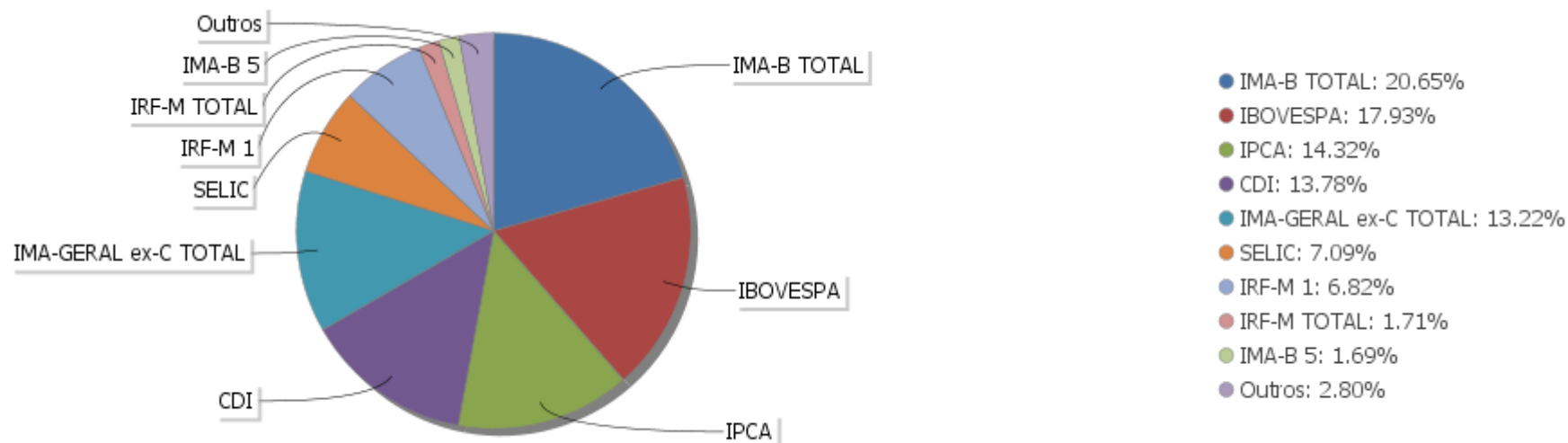
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	3.759.713.309,35	73,67	3.759.713.309,35	73,67
de 31 a 365 dias	610.281.348,67	11,96	4.369.994.658,02	85,63
acima de 365 dias	733.132.081,68	14,37	5.103.126.739,70	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

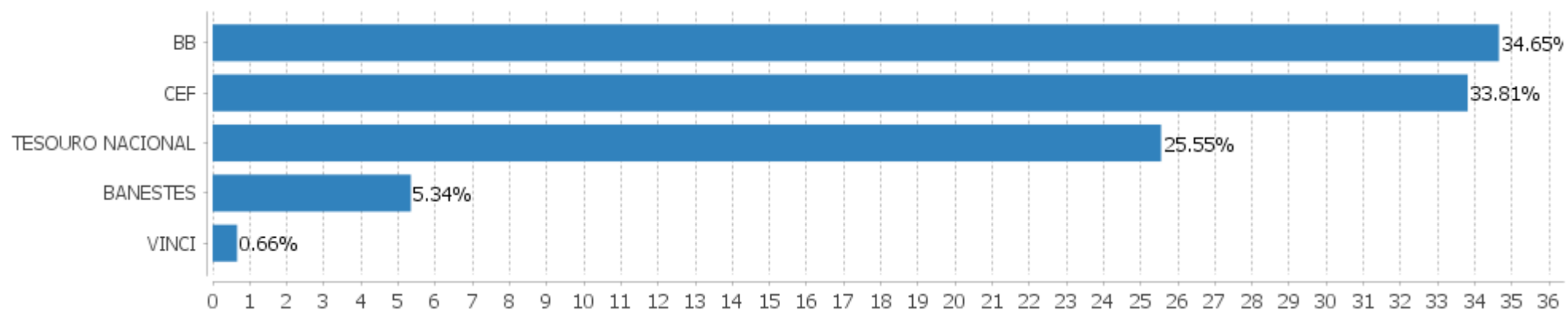


Alocação Por Estratégia



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	-0,45												-0,45
IPCA + 5,00%	0,64												0,64
p.p. indexador	-1,09												-1,09
2020	0,42	-0,92	-5,48	1,81	1,71	1,96	2,00	-0,26	-0,83	-0,22	2,51	2,29	4,80
IPCA + 5,00%	0,64	0,60	0,50	0,08	0,01	0,67	0,81	0,65	1,05	1,27	1,28	1,78	9,72
p.p. indexador	-0,22	-1,52	-5,98	1,74	1,70	1,29	1,19	-0,91	-1,88	-1,49	1,23	0,51	-4,92
2019	1,69	0,49	0,60	0,91	1,51	1,74	1,03	0,23	1,43	1,33	-0,10	1,02	12,53
IPCA + 5,50%	0,79	0,86	1,16	1,02	0,60	0,41	0,68	0,58	0,41	0,59	0,94	1,60	10,07
p.p. indexador	0,90	-0,37	-0,55	-0,11	0,91	1,32	0,35	-0,35	1,03	0,74	-1,04	-0,58	2,46
2018	1,29	0,58	1,11	0,44	-1,02	-0,00	1,12	0,18	0,62	1,87	0,52	0,84	7,80
IPCA + 5,75%	0,78	0,72	0,56	0,69	0,87	1,73	0,82	0,42	0,90	0,94	0,23	0,60	9,66
p.p. indexador	0,51	-0,14	0,56	-0,25	-1,89	-1,73	0,30	-0,24	-0,29	0,92	0,29	0,25	-1,86
2017	1,30	1,89	1,24	0,45	0,35	0,70	2,20	1,13	1,07	0,43	0,19	0,82	12,40
IPCA + 6,00%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	0,41	1,15	0,45	-0,11	-0,47	0,45	1,48	0,40	0,44	-0,48	-0,55	-0,09	3,35
2016	1,92	1,40	1,66	1,65	0,93	1,19	1,45	1,23	1,28	0,82	0,38	1,47	16,48
IPCA + 6,00%	1,74	1,34	0,94	1,08	1,27	0,86	1,01	0,98	0,57	0,72	0,64	0,81	12,64
p.p. indexador	0,18	0,05	0,72	0,57	-0,34	0,33	0,44	0,26	0,71	0,10	-0,26	0,66	3,84
2015	1,51	0,80	0,65	1,24	1,39	0,73	1,09	-0,17	0,72	1,96	0,91	1,67	13,20
IPCA + 6,00%	1,73	1,64	1,84	1,18	1,21	1,28	1,16	0,71	1,03	1,31	1,48	1,47	17,26
p.p. indexador	-0,22	-0,85	-1,19	0,06	0,19	-0,55	-0,07	-0,88	-0,31	0,64	-0,56	0,19	-4,06
2014	-1,15	2,71	0,90	1,75	2,50	0,76	1,06	2,33	-0,76	1,18	0,88	0,18	12,97
IPCA + 6,00%	1,06	1,16	1,36	1,14	0,95	0,87	0,54	0,74	1,08	0,96	0,98	1,29	12,82
p.p. indexador	-2,21	1,56	-0,46	0,61	1,55	-0,11	0,52	1,59	-1,84	0,22	-0,09	-1,12	0,15
2013	0,58	-0,48	-0,65	1,00	-1,62	-1,42	0,81	-0,81	0,75	0,72	-1,14	0,87	-1,43
IPCA + 6,00%	1,37	1,02	0,94	1,06	0,86	0,72	0,56	0,75	0,84	1,11	1,01	1,41	12,29
p.p. indexador	-0,80	-1,50	-1,58	-0,07	-2,48	-2,15	0,25	-1,56	-0,08	-0,38	-2,14	-0,54	-13,72
2012	1,48	1,67	1,59	3,31	1,29	-0,23	2,31	1,35	1,11	2,72	0,68	1,57	20,51
IPCA + 6,00%	1,07	0,89	0,72	1,11	0,87	0,54	0,94	0,95	1,01	1,10	1,07	1,26	12,16
p.p. indexador	0,41	0,78	0,87	2,20	0,42	-0,77	1,37	0,41	0,10	1,61	-0,38	0,31	8,35
2011	0,11	0,67	1,40	0,53	1,40	0,17	0,81	4,20	1,08	1,30	1,60	0,51	14,62
IPCA + 6,00%	1,32	1,27	1,28	1,21	0,98	0,64	0,65	0,91	1,02	0,90	0,99	1,01	12,87
p.p. indexador	-1,21	-0,60	0,12	-0,68	0,42	-0,47	0,17	3,30	0,06	0,40	0,61	-0,51	1,76

PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

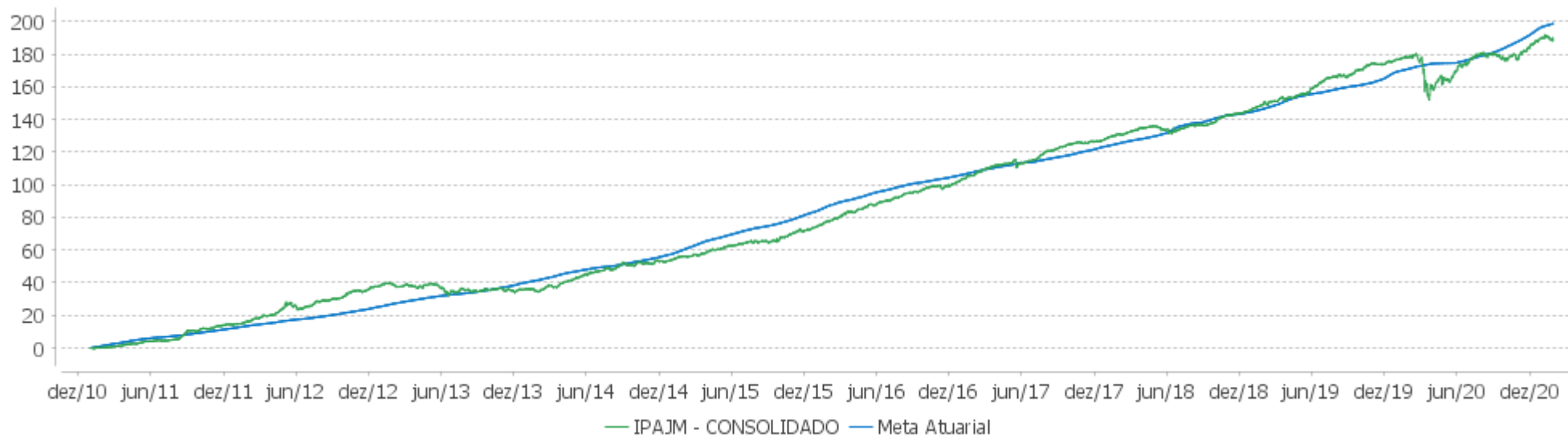
RELATÓRIO TRIMESTRAL

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

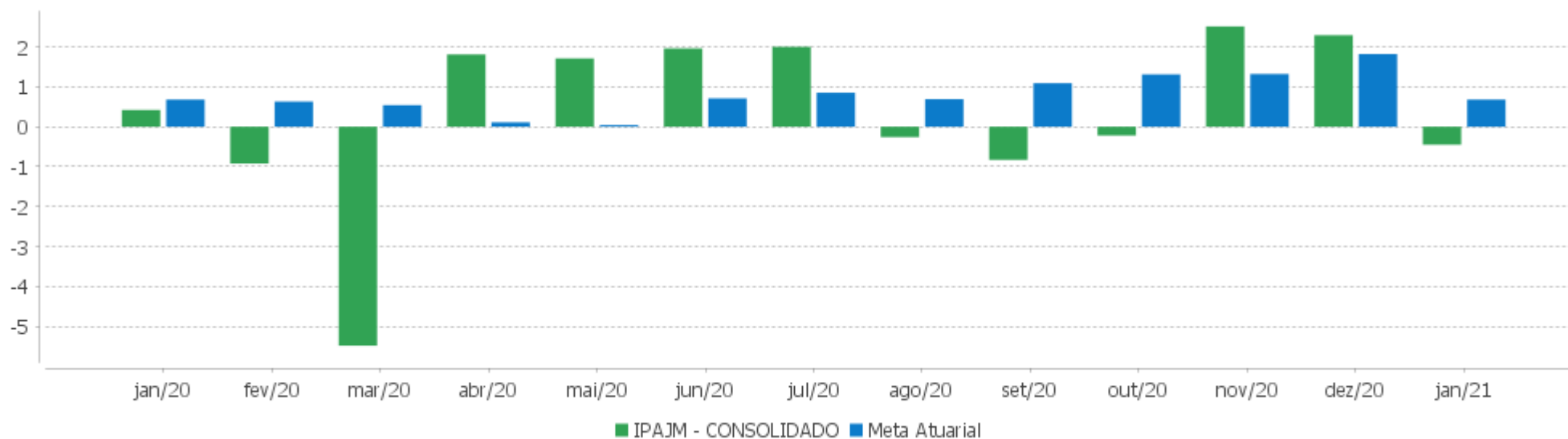
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	63	52,07	03 meses	4,38	3,75	0,64	3,35
Meses abaixo da Meta Atuarial	58	47,93	06 meses	3,02	6,86	-3,83	3,82
			12 meses	3,90	9,72	-5,83	7,91
			24 meses	15,45	20,59	-5,14	5,73
			36 meses	24,94	32,25	-7,31	4,84
			Desde 31/12/2010	188,53	207,87	-19,34	3,67
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	4,20	2011-08					
Menor rentabilidade da Carteira	-5,48	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
LFT 010921 Var. SELIC p.p.	0,16 0,01	0,16 0,01	0,47 0,01	0,91 -0,03	2,49 -0,04	8,43 -0,02	15,35 -0,03
NTN-B 150822 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,31 1,16	0,31 1,16	2,76 -3,28	4,38 1,61	8,19 2,96	22,16 -2,13	35,51 -6,32
LFT 010324 Var. SELIC p.p.	0,19 0,04	0,19 0,04	0,62 0,16	0,65 -0,29	2,20 -0,33	8,14 -0,31	14,97 -0,41
NTN-B 150523 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,04 0,89	0,04 0,89	3,38 -2,66	3,42 0,64	8,17 2,95	23,62 -0,67	37,87 -3,96
NTN-B 150521 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,78 1,63	0,78 1,63	1,99 -4,05	4,48 1,71	6,55 1,32	17,29 -7,00	29,15 -12,68
NTN-B 150830 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,41 -0,56	-1,41 -0,56	6,61 0,57	2,76 -0,02	6,81 1,59	27,09 2,80	45,55 3,72
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,15 102,26	0,15 102,26	0,61 132,45	1,04 110,41	-0,40 -15,90	5,15 60,90	11,70 76,08
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,89 -2,04	-2,89 -2,04	6,68 0,64	-1,33 -4,10	-4,31 -9,54	18,43 -5,86	32,49 -9,34
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,21 137,48	0,21 137,48	0,78 168,11	1,37 145,27	0,02 0,69	5,90 69,71	13,21 85,93
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	-0,82 -551,04	-0,82 -551,04	2,36 508,28	0,33 34,95	0,25 9,74	16,94 200,28	
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,17 110,47	0,17 110,47	0,58 124,04	0,94 100,20	2,21 87,55	7,89 93,26	14,67 95,44
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
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO % do CDI	0,01 9,97	0,01 9,97	0,05 9,89	0,10 10,78	0,38 15,22	3,09 36,50	6,49 42,23
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,16 108,14	0,16 108,14	0,68 146,62	0,95 100,44	2,20 87,20	7,87 93,11	14,55 94,64
FI BANESTES INVEST MONEY RF % do CDI	0,07 43,96	0,07 43,96	0,20 44,12	0,42 44,44	1,48 58,66	6,20 73,32	11,76 76,49
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
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	-0,88	-0,88	5,95	2,59	4,87	23,40	40,74

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.	-0,03	-0,03	-0,09	-0,18	-0,35	-0,89	-1,09
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-0,87	-0,87	5,99	2,66	4,88	23,46	40,68
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,02	-0,05	-0,12	-0,35	-0,82	-1,14
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,08	0,08	3,22	3,64	7,25	19,86	31,74
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,02	-0,07	-0,16	-0,30	-0,66	-0,94
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,03	0,03	0,54	0,79	3,07	9,59	16,98
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,01	-0,01	-0,04	-0,23	-0,36	-0,68	-0,96
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-0,77	-0,77	1,51	-0,25	4,73	16,38	28,81
Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,03	0,03	0,01	-0,10	-0,18	-0,57	-0,80
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-1,70	-1,70	8,45	1,96	3,49	25,98	47,09
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,01	-0,01	0,02	-0,05	-0,19	-0,85	-1,60
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-1,39	-1,39	2,05	-0,70	5,58	19,55	34,26
Var. IRF-M 1+ p.p.	0,00	0,00	-0,04	-0,10	-0,19	-0,57	-0,81
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	-0,43	-0,43	1,00	0,24	5,05	15,64	25,33
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,47	-0,47	0,42	-0,77	1,62	5,37	7,39
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	-2,48	-2,48	7,14	-0,98	-3,05	21,25	38,44
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,63	-1,63	1,10	-3,75	-8,27	-3,04	-3,39
BB PREV RF IDKA2	0,18	0,18	3,07	4,24	7,69	18,77	30,05
Var. IDKA 2 p.p.	0,03	0,03	-0,09	-0,05	-0,51	-1,35	-2,43
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
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
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
BB PREV RF IRF-M	-0,80	-0,80	1,50	-0,29	4,65	16,40	28,76
Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,00	0,00	-0,01	-0,14	-0,26	-0,55	-0,85
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	-1,70	-1,70	8,29	1,74	3,23	26,02	47,40
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,01	-0,01	-0,14	-0,27	-0,45	-0,81	-1,29
FIA BRASIL IBX-50	-2,87	-2,87	22,56	11,72	0,21	15,36	28,15
Var. IBOVESPA p.p.	0,45	0,45	0,08	-0,09	-0,94	-2,79	-7,36
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,26	11,68	1,02	17,63	34,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-0,00	-0,00	-0,21	-0,13	-0,13	-0,51	-1,28
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
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-2,82	-2,82	21,89	11,05	0,49	20,53	39,88
Var. IBOVESPA p.p.	0,50	0,50	-0,59	-0,77	-0,66	2,38	4,37
FIP CAIXA CYRELA	-7,59	-7,59	-98,46	-98,47	-98,69	-98,59	-98,45
Var. IPCA p.p.	-7,84	-7,84	-100,97	-102,77	-103,25	-107,54	-111,50
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	-0,61	-0,61	13,57	7,85	4,97	38,49	67,28
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	4,47	4,47	-4,73	-0,22	9,49	17,22	23,33
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-3,48	-3,48	20,19	8,82	-7,06	31,28	45,15
Var. IBOVESPA p.p.	-0,16	-0,16	-2,28	-2,99	-8,21	13,14	9,64
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-3,76	-3,76	20,27	10,03	-2,32	25,54	47,60
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,32	1,32	1,97	1,95	2,19	4,27	3,65
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-4,39	-4,39	16,96	6,10	-11,60	4,52	20,38
Var. IBOVESPA p.p.	-1,07	-1,07	-5,51	-5,71	-12,75	-13,63	-15,13
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	-16,16	-16,16	-22,19	-32,06	-29,84	31,00	35,60
Var. IPCA p.p.	-16,41	-16,41	-24,70	-36,36	-34,40	22,06	22,54
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 ESG 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
IPAJM - CONSOLIDADO	-0,45	-0,45	4,38	3,02	3,90	15,45	24,94
Var. IPCA + 5,50% p.p.	-1,13	-1,13	0,52	-4,09	-6,34	-5,75	-7,70
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
Renda Fixa							
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
Renda Variável							
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
Indicadores Econômicos							
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
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1232	04/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	17.954,99	0,00	8.492,08925000	2,1143195120
1233	04/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	16.001,68	0,00	7.568,24118000	2,1143195120
1234	06/01/2021	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	8.087,87	0,00	404,61140388	19,9892289800
1235	06/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.651,42	0,00	780,97933886	2,1145501780
1237	07/01/2021	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	38.730,46	0,00	1.937,62299439	19,9886459400
1238	07/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.586,24	0,00	750,12108970	2,1146452510
1239	07/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	664,22	0,00	314,10469424	2,1146452510
1240	07/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	678,46	83,53652817	8,1217165100
1241	11/01/2021	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	3.083,91	154,33855015	19,9814628100
1242	11/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.532,28	0,00	724,52858007	2,1148648130
1243	11/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.001,01	0,00	473,32103397	2,1148648130
1244	12/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	5.746.087,40	0,00	707.481,17146487	8,1218944500
1245	12/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	2.346,22	0,00	1.109,35870883	2,1149335930
1246	12/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	4.071.196,62	501.261,94634307	8,1218944500
1248	12/01/2021	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	1.674.634,46	970.099,32816761	1,7262505100
1249	13/01/2021	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	2.571,37	128,67935044	19,9827710600
1250	13/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	11.190,41	0,00	1.377,79768021	8,1219544500
1251	13/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	408,45	0,00	193,12265894	2,1149770940
1252	13/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	7.983,51	0,00	3.774,75010138	2,1149770940
1253	13/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	3.552,19	0,00	437,35655277	8,1219544500
1254	13/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	11.190,41	1.377,79768021	8,1219544500
1255	13/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	140.000,00	0,00	37.416,74773629	3,7416400000
1256	14/01/2021	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	80.835,09	4.045,10665966	19,9834261000
1257	14/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	77.544,27	0,00	9.547,41824546	8,1220145600
1258	14/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.540,04	0,00	728,13309450	2,1150528820
1259	14/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	45.887,60	0,00	5.649,78056380	8,1220145600
1260	15/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	6.018,05	0,00	2.845,23492859	2,1151328980
1261	15/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	34.596,08	0,00	16.356,45686033	2,1151328980

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1262	15/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.065.803,71	0,00	254.344,33139739	8,1220749000
1263	18/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	25.963,47	3.196,63114198	8,1221351000
1264	18/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	14.948,96	0,00	7.067,36391174	2,1152101670
1265	18/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	12.775,13	0,00	6.039,65043252	2,1152101670
1319	18/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	34.137,68	4.203,04262115	8,1221351000
1267	19/01/2021	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	36.715,28	1.837,10621092	19,9853877700
1268	19/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	101,27	0,00	12,46830410	8,1221952200
1269	19/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	167.154,99	79.022,28209984	2,1152893280
1270	19/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	8.949,02	0,00	4.230,63638697	2,1152893280
1271	19/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	9.022,88	0,00	4.265,55359617	2,1152893280
1272	19/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.829.449,34	225.240,74963074	8,1221952200
1273	19/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	53.365,93	0,00	6.570,38258187	8,1221952200
1274	19/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.724.784,12	0,00	212.354,42799416	8,1221952200
1276	20/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	374,36	0,00	176,96914449	2,1153970150
1277	20/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	15.924,12	1.960,55397106	8,1222553600
1278	20/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	3.900.560,64	0,00	480.231,22484049	8,1222553600
1288	20/01/2021	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	38.286,74	1.915,67401307	19,9860413300
1287	20/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	222.972,07	27.451,98964047	8,1222553600
1280	21/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	334,18	0,00	157,97038283	2,1154598350
1281	21/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	862,90	0,00	106,23817514	8,1223157200
1289	21/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.773.130,73	464.538,79165387	8,1223157200
1283	22/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	41.749,85	19.734,92835767	2,1155308620
1284	22/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.083,99	985,09080507	2,1155308620
1285	22/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.759.724,21	339.768,09455698	8,1223759800
1286	22/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	15.780.385,09	0,00	1.942.828,69062656	8,1223759800
1290	22/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	88.734,68	10.924,71959172	8,1223759800
1291	25/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	21.732,56	10.272,45424842	2,1156151660
1292	25/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	8.012,57	0,00	3.787,34758985	2,1156151660
1293	25/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.463.072,69	303.243,08800557	8,1224363800
1294	25/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.731.404,36	0,00	213.163,17900172	8,1224363800

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1295	25/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	961.106,75	0,00	118.327,39648987	8,1224363800
1296	26/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	8.012,57	0,00	986,46637210	8,1224968500
1297	26/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	153.143.738,67	0,00	18.854.268,76712178	8,1224968500
1298	26/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	8.012,57	986,46637210	8,1224968500
1299	27/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	479.500,62	59.033,20924836	8,1225572200
1300	27/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.156,83	0,00	265,53583331	8,1225572200
1301	27/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	575.573,89	272.040,19008783	2,1157678570
1302	27/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.544,74	1.675,39174408	2,1157678570
1303	27/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	21.803.160,76	2.684.272,96594656	8,1225572200
1305	27/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	87.122,22	10.725,95952731	8,1225572200
1304	27/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	8.107,87	0,00	998,19179852	8,1225572200
1306	27/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	3.826.750,79	0,00	471.126,35668204	8,1225572200
1307	27/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,63	0,00	0,29776424	2,1157678570
1308	28/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	715.079,39	88.035,57487276	8,1226185100
1309	28/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.260.421,14	1.068.344,16128739	2,1158173760
1310	28/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	75.108,32	35.498,48907187	2,1158173760
1311	28/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	132.129.740,20	16.266.889,80127912	8,1226185100
1312	28/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	27.315,67	0,00	3.362,91430730	8,1226185100
1313	28/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	5.222.840,13	642.999,56024895	8,1226185100
1314	29/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	183.728,31	22.619,17642214	8,1226790300
1315	29/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	57.033,29	0,00	7.021,48758918	8,1226790300
1316	29/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	302.260,27	37.211,89386945	8,1226790300
1317	29/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	11.924,69	1.468,07352057	8,1226790300
1318	29/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	8.226,64	0,00	1.012,79885240	8,1226790300
Total						

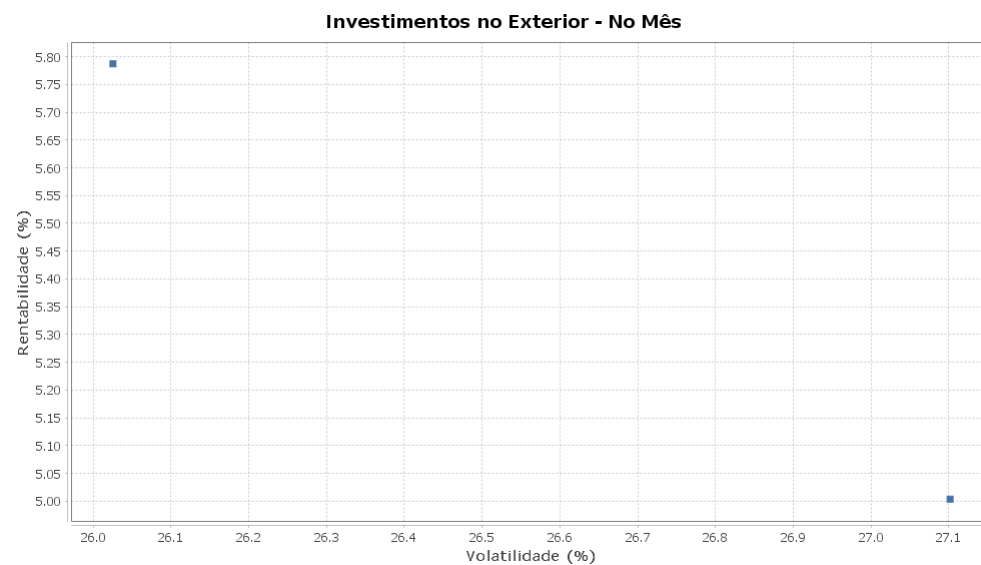
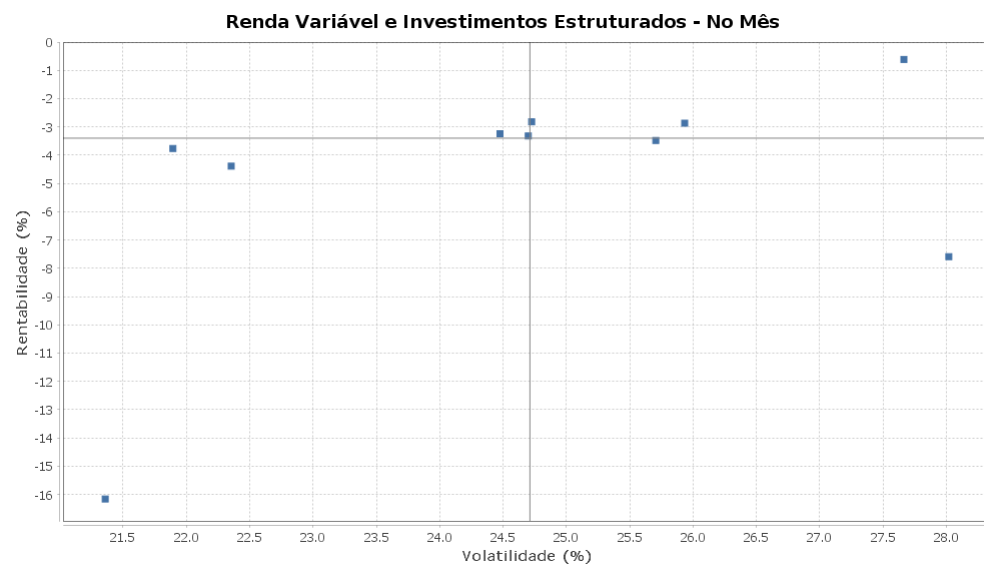
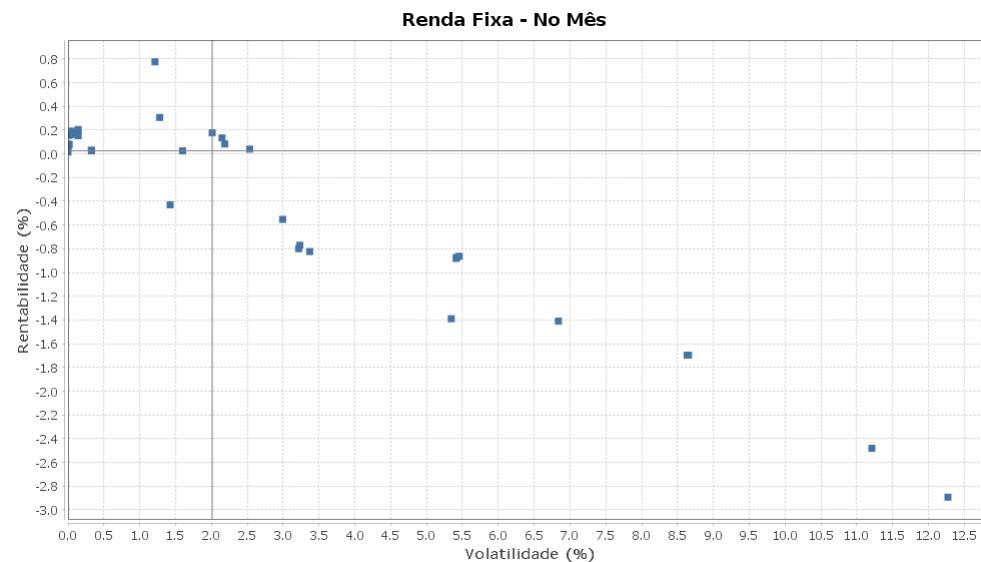
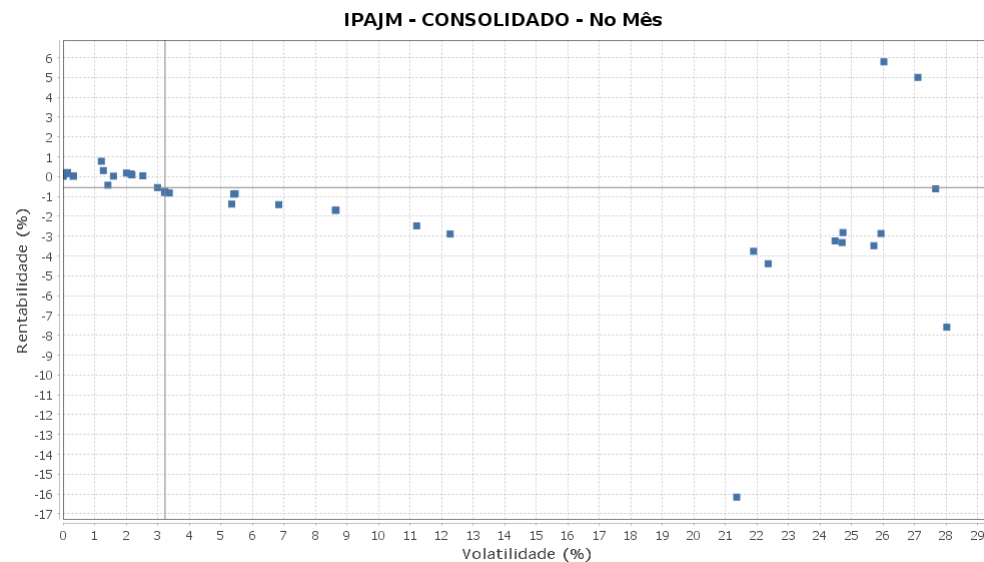
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rendimentos Realizados

Artigo	Ativo	Quantidade	Valor Aplicação	Valor Resgate	Rendimento
Artigo 7º IV, Alínea a	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	21.697.493,622672	176.225.931,12	176.239.543,62	13.612,50
Artigo 7º IV, Alínea a	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	970.099,328168	1.682.977,97	1.674.634,46	-8.343,51
Artigo 7º IV, Alínea a	BB PREV RF FLUXO FIC	1.487.572,987702	3.144.623,30	3.147.369,47	2.746,17
Artigo 7º IV, Alínea a	FI BANESTES INVEST MONEY RF	8.080,905085	161.350,63	161.492,40	141,77

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 109.694.764,00

Value-At-Risk: 2,15%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,00	-0,00	-683,62	0,01	77.009.736,20	1,51
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	-164,63	0,08	66,37	0,00
FI BANESTES INVEST MONEY RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	NaN	0,00	-99,05	0,07	0,00	0,00
LFT 010921	Artigo 7º I, Alínea a	0,01	0,04	0,00	0,45	0,16	248.971.025,13	4,88
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,06	0,00	-4,39	0,08	6.331.745,16	0,12
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,13	0,00	0,28	0,16	185.584.924,55	3,64
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,09	0,00	0,29	0,17	314.758.037,13	6,17
LFT 010324	Artigo 7º I, Alínea a	0,06	0,23	0,00	0,76	0,19	112.697.554,58	2,21
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,14	0,09	-0,00	0,02	0,15	11.202.921,21	0,22
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,14	0,09	-0,00	0,40	0,21	100.919.531,19	1,98
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,19	0,01	-0,36	0,03	305.940.600,78	6,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,15	0,00	-0,38	0,03	40.669.509,39	0,80
NTN-B 150521	Artigo 7º I, Alínea a	1,21	0,41	0,00	0,52	0,78	321.506.466,48	6,30
NTN-B 150822	Artigo 7º I, Alínea a	1,28	1,09	0,05	0,12	0,31	421.893.329,66	8,27
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	1,42	0,77	0,00	-0,41	-0,43	1.417.851,76	0,03
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,60	1,03	0,09	-0,08	0,03	707.958.438,60	13,87
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,08	0,01	0,01	0,18	43.125.131,85	0,85
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,15	1,17	0,00	-0,01	0,13	34.274.349,59	0,67
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	1,23	0,01	-0,03	0,08	86.297.091,83	1,69
NTN-B 150523	Artigo 7º I, Alínea a	2,53	1,41	0,01	-0,04	0,04	77.286.451,52	1,51
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,99	1,33	0,11	-0,23	-0,55	674.379.381,86	13,22
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,22	1,48	0,01	-0,29	-0,80	50.304.894,93	0,99
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,23	1,49	0,01	-0,28	-0,77	37.057.784,36	0,73
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	3,37	1,50	0,00	-0,29	-0,82	7.288.480,94	0,14
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,35	2,39	0,01	-0,29	-1,39	21.111.402,04	0,41
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	5,41	2,56	0,00	-0,19	-0,88	2.149.295,73	0,04
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,42	2,57	0,00	-0,19	-0,87	14.577.618,55	0,29
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,46	2,56	0,01	-0,19	-0,86	26.856.662,75	0,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150830	Artigo 7º I, Alínea a	6,84	3,55	0,05	-0,23	-1,41	121.254.745,92	2,38
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	8,63	4,24	0,00	-0,21	-1,70	2.981.931,42	0,06
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	8,65	4,24	0,00	-0,21	-1,70	1.379.820,82	0,03
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	11,21	5,25	0,00	-0,23	-2,48	35.553.600,93	0,70
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	12,27	5,79	0,00	-0,25	-2,89	32.967.862,63	0,65
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	Artigo 8º IV, Alínea b	21,36	20,70	0,00	-0,76	-16,16	22.822.000,00	0,45
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,89	9,87	0,06	-0,18	-3,76	33.882.581,56	0,66
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	22,35	10,05	0,25	-0,20	-4,39	135.294.146,61	2,65
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	24,48	11,50	0,02	-0,14	-3,24	10.563.888,22	0,21
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	24,70	11,62	0,16	-0,14	-3,32	76.075.268,12	1,49
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	24,73	11,58	0,33	-0,12	-2,82	153.899.350,59	3,02
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	25,71	13,35	0,39	-0,14	-3,48	165.288.844,16	3,24
FIA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	25,93	12,06	0,37	-0,12	-2,87	167.600.161,99	3,28
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	26,03	11,89	0,11	0,22	5,79	151.900.033,58	2,98
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	27,10	12,68	0,04	0,18	5,00	54.158.400,63	1,06
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	27,66	12,98	0,01	-0,03	-0,61	5.921.275,50	0,12
FIP CAIXA CYRELA	Artigo 8º IV, Alínea a	28,02	19,16	0,00	-0,28	-7,59	12.542,88	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de janeiro de 2021, vale observar que:

- O Instituto está com 14,90% do patrimônio líquido do fundo CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII (Art. 8, Inciso IV, Alínea B), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;