



IPAJM - CONSOLIDADO
DEZEMBRO 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 02.02.2021.

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 **80,52%**

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	13,93	5,55	9,61	122.989.023,64	2,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822	4,93	1,23	8,56	420.602.812,96	8,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	6,11	1,99	8,87	77.256.030,86	1,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150521	2,09	-0,00	6,03	319.033.070,82	6,23
TESOURO NACIONAL	LFT 010324	0,57	0,32	2,38	112.481.661,88	2,20
TESOURO NACIONAL	LFT 010921	0,10	0,15	2,71	248.583.235,86	4,86
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		3,41	1,08	6,30	1.300.945.836,02	25,42

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	6,08	1,96	6,40	50.709.949,79	0,99	8.554.614.280,00	0,59
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	23,39	7,94	-0,03	36.458.309,01	0,71	340.132.588,94	10,72
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,57	0,31	3,47	305.844.541,10	5,98	8.522.749.810,66	3,59
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,74	4,84	6,14	27.090.659,22	0,53	8.693.778.987,76	0,31
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,80	4,84	6,06	14.705.925,49	0,29	6.193.173.925,17	0,24
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,55	0,28	3,63	40.659.255,17	0,79	16.753.976.831,37	0,24
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,02	1,82	7,75	86.225.309,38	1,68	20.761.505.098,56	0,42
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,20	1,53	7,92	43.048.939,21	0,84	8.476.640.994,51	0,51
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,70	7,47	5,06	3.033.378,54	0,06	1.615.279.214,02	0,19
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,80	7,56	5,23	1.403.633,82	0,03	1.733.830.686,04	0,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF	9,03	3,04	8,22	21.408.664,33	0,42	2.814.559.159,07	0,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
LONGO PRAZO									
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,13	1,65	8,03	34.228.614,66	0,67	10.655.087.063,09	0,32
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,06	1,96	6,43	37.345.763,26	0,73	3.566.953.490,56	1,05
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	4,31	1,04	6,26	1.423.979,78	0,03	196.396.914,05	0,73
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,27	2,38	5,09	678.125.041,26	13,25	9.568.490.825,39	7,09
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	1,32	6,66	707.779.433,43	13,83	14.722.139.597,34	4,81
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			5,16	1,79	5,47	2.089.491.397,45	40,83		

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	12,72	4,85	6,05	2.168.419,52	0,04	2.989.829.287,39	0,07
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,72	4,85	6,05	2.168.419,52	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	0,06	0,07	0,62	161.436,11	0,00	94.970.642,58	0,17
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,93	0,27	-0,22	11.139.010,35	0,22	292.099.533,77	3,81
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,03	0,02	0,49	64.052.791,13	1,25	979.174.122,86	6,54
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,37	0,36	2,42	185.145.482,36	3,62	4.230.515.183,84	4,38
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	26,62	8,08	-0,74	33.949.962,92	0,66	333.587.129,64	10,18
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,23	0,25	2,40	314.239.111,63	6,14	2.596.482.307,62	12,10
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	0,10	1,64	9.324.215,50	0,18	2.452.222.466,54	0,38
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,06	0,11	1,16	66,32	0,00	910.358.895,05	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,93	0,32	0,21	102.386.614,75	2,00	1.787.791.268,75	5,73
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,76	2,59	1,70	7.349.018,76	0,14	182.273.194,76	4,03
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,28	0,62	1,29	727.747.709,83	14,22		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

3,68

1,35

4,95

4.120.353.362,82

80,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

15,67%

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	46,06	9,07	1,51	172.551.056,55	3,37	1.155.616.982,05	14,93
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	45,32	8,75	2,28	158.364.764,04	3,09	1.245.394.762,64	12,72
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	44,01	9,08	2,57	10.917.918,99	0,21	132.435.308,61	8,24
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	44,73	9,24	2,75	78.688.044,48	1,54	771.177.429,34	10,20
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			45,51	9,00	1,92	420.521.784,06	8,22		

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	39,21	7,67	-7,93	141.502.483,64	2,77	1.054.907.075,55	13,41
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,92	9,37	3,05	35.207.304,25	0,69	1.002.176.394,28	3,51
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	48,61	7,60	-3,23	171.246.474,48	3,35	1.388.354.610,95	12,33
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	45,87	5,18	7,76	5.957.858,70	0,12	191.546.487,48	3,11
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			43,27	7,76	-4,07	353.914.121,07	6,92		

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	465,18	-8,79	-98,51	13.573,07	0,00	508.639,17	2,67
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			465,18	-8,79	-98,51	13.573,07	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	49,86	-4,46	0,96	27.370.000,00	0,53	153.040.983,83	17,88
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			49,86	-4,46	0,96	27.370.000,00	0,53		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			41,58	7,90	-0,44	801.819.478,20	15,67		
---	--	--	-------	------	-------	----------------	-------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,81%

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	29,55	0,69	54,76	143.590.384,58	2,81	1.987.917.698,76	7,22
BB	BB	BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	29,10	0,59	47,07	51.577.593,86	1,01	528.483.255,80	9,76
Sub-total Artigo 9º A, III			29,37	0,68	53,21	195.167.978,44	3,81		
Investimentos no Exterior			29,37	0,68	53,21	195.167.978,44	3,81		
Total			7,82	2,29	4,80	5.117.340.819,46	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	1.300.945.836,02	25,42	20,00	27,00	60,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	2.089.491.397,45	40,83	15,00	36,30	60,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	2.168.419,52	0,04	0,00	0,10	2,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	727.747.709,83	14,22	5,00	10,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	4.120.353.362,82	80,52				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	420.521.784,06	8,22	0,00	6,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	353.914.121,07	6,92	0,00	5,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	13.573,07	0,00	0,00	0,10	2,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	27.370.000,00	0,53	0,00	0,50	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	801.819.478,20	15,67				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	195.167.978,44	3,81	0,00	4,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	195.167.978,44	3,81				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

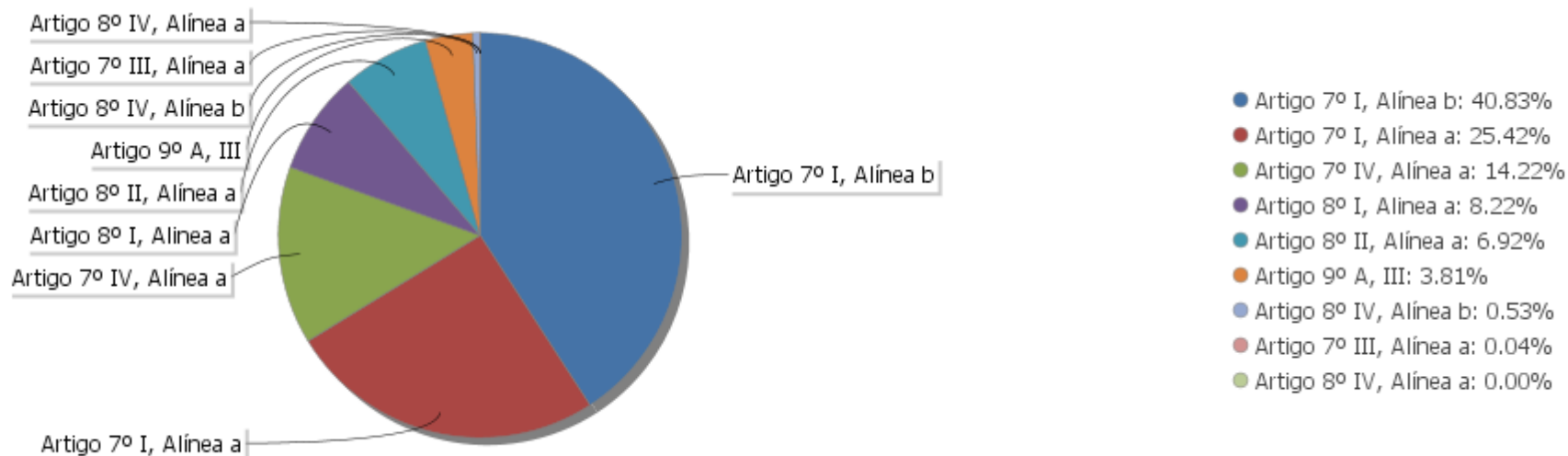
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,08 653,71	6,30 228,27	2,55 541,40	3,84 389,30	6,30 228,27	13.836.897,36	79.216.669,85
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,79 1.086,82	5,47 198,17	2,55 540,67	2,66 269,85	5,47 198,17	36.304.821,89	109.989.192,10
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	4,85 2.951,47	6,05 219,39	7,10 1.506,28	8,06 816,90	6,05 219,39	100.377,72	123.714,00
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,62 376,30	1,29 46,84	0,97 206,48	1,46 148,03	1,29 46,84	4.491.576,66	10.045.302,63
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	9,00 -0,30	1,92 -0,99	24,96 -0,85	24,39 -0,81	1,92 -0,99	32.806.296,06	7.199.907,56
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	7,76 -1,54	-4,07 -6,99	21,31 -4,50	21,23 -3,97	-4,07 -6,99	25.481.860,54	-16.825.459,48
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-8,79 -18,09	-98,51 -101,43	-98,34 -124,15	-98,40 -123,61	-98,51 -101,43	-1.308,24	-401.257,57
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-4,46 -13,75	0,96 -1,96	-24,91 -50,72	-8,97 -34,17	0,96 -1,96	-1.290.000,00	403.000,00
Artigo 9º A, III % do CDI	0,68 410,95	53,21 1.929,43	1,20 254,30	15,96 1.618,20	53,21 1.929,43	1.427.923,96	42.564.446,86
IPAJM - CONSOLIDADO (Total)						113.158.445,95	232.315.515,95

Análise de Liquidez

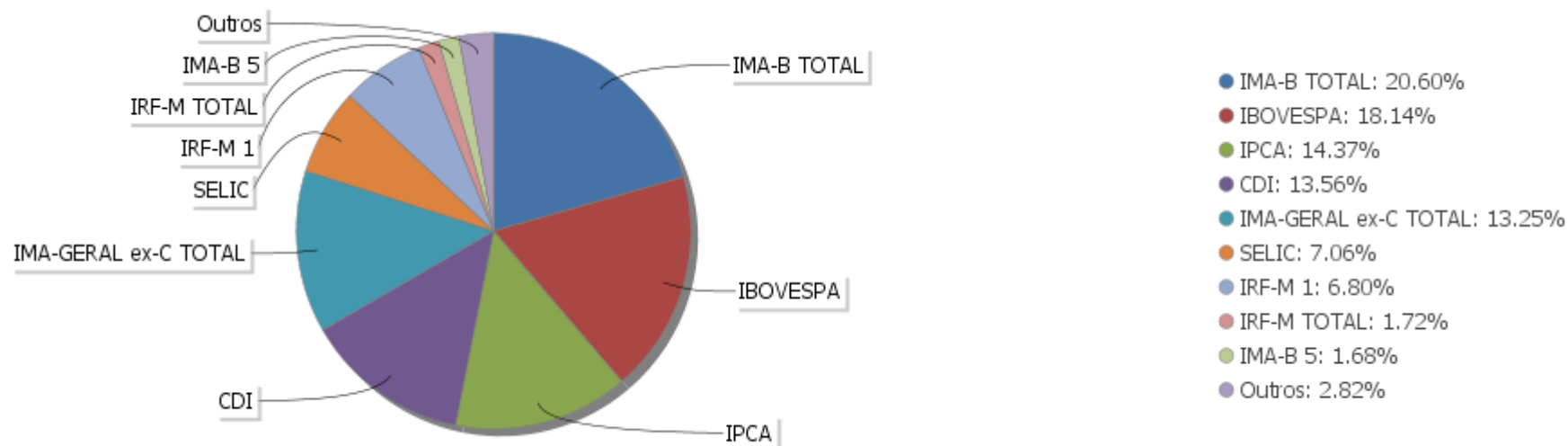
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	3.775.229.820,49	73,77	3.775.229.820,49	73,77
de 31 a 365 dias	608.781.469,63	11,90	4.384.011.290,12	85,67
acima de 365 dias	733.329.529,34	14,33	5.117.340.819,46	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

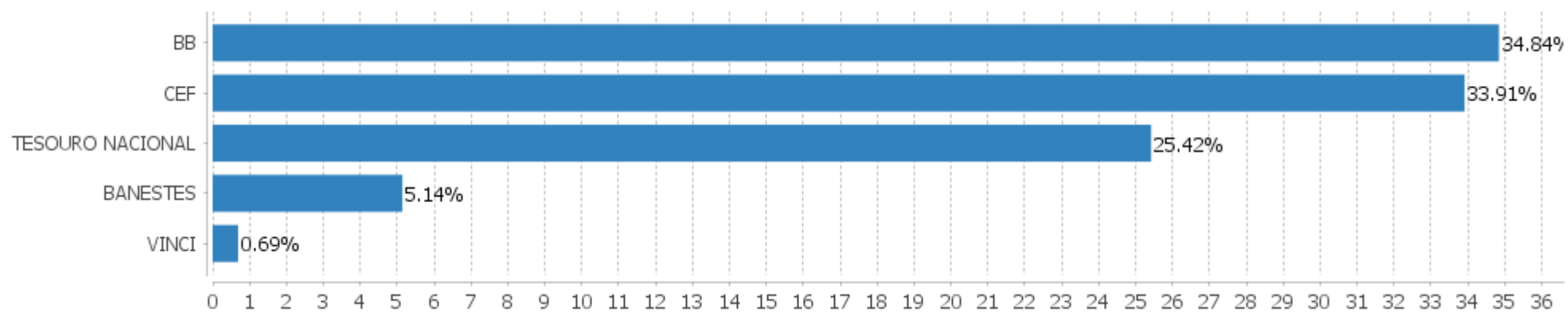


Alocação Por Estratégia



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	0,42	-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%	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 + 5,5%	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%	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%	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%	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%	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%	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%	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%	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

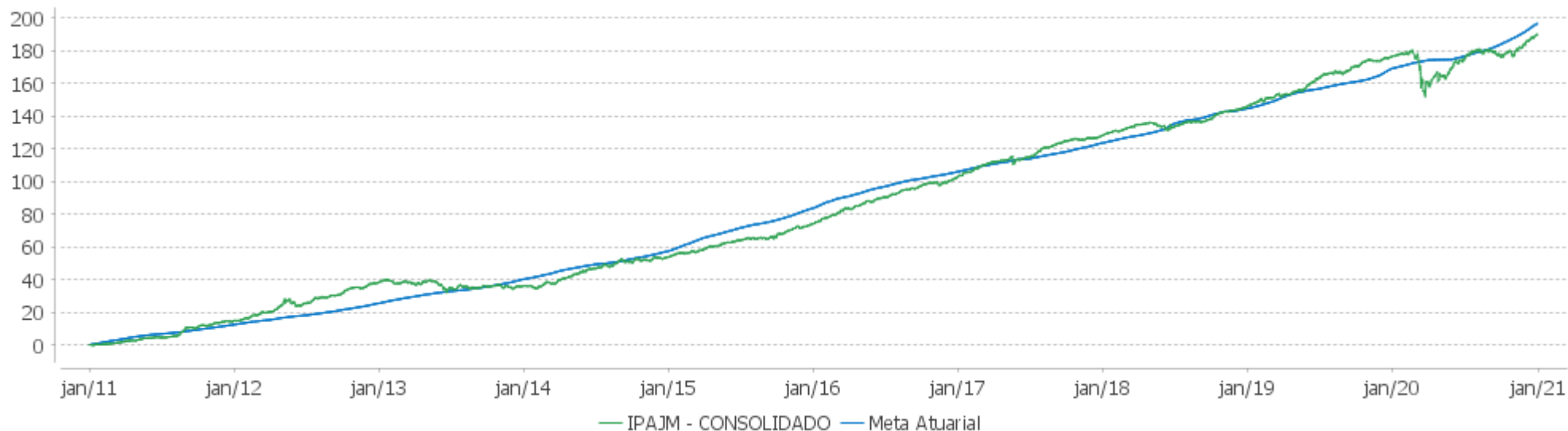
RELATÓRIO TRIMESTRAL

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

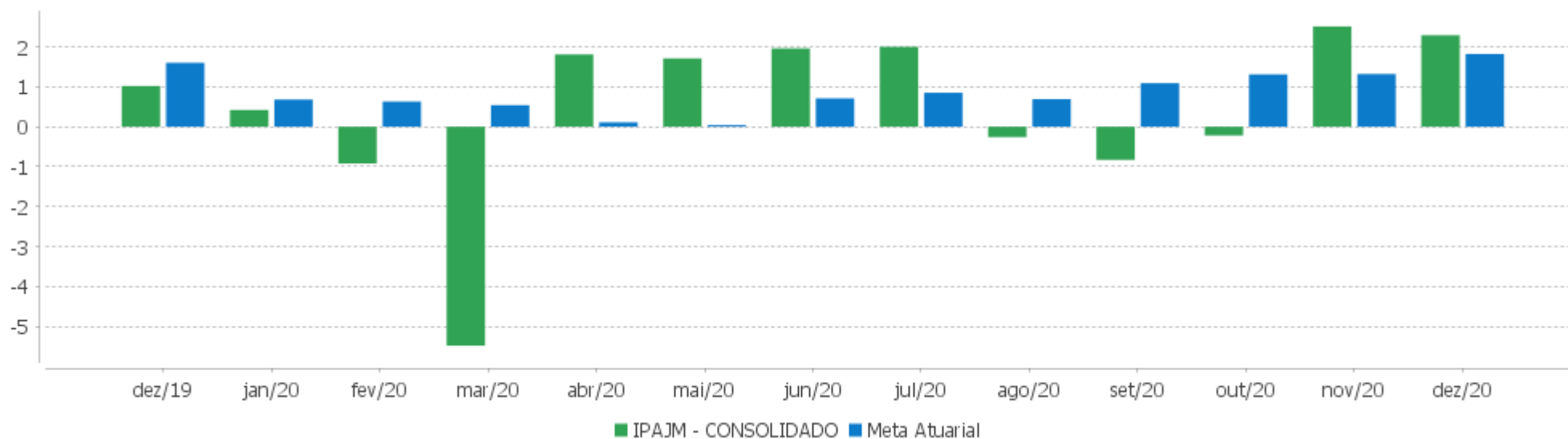
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	63	52,50	03 meses	4,62	4,40	0,22	3,56
Meses abaixo da Meta Atuarial	57	47,50	06 meses	5,56	7,03	-1,48	3,71
			12 meses	4,80	9,72	-4,92	7,82
			24 meses	17,93	20,77	-2,84	5,68
			36 meses	27,13	32,44	-5,31	4,80
			Desde 31/12/2010	189,83	205,92	-16,09	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
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,84 -0,01	6,06 -0,34	7,13 -0,04	8,09 -0,12	6,06 -0,34	30,02 -0,81	46,71 -1,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,82 -0,01	7,75 -0,29	3,32 -0,06	4,57 -0,15	7,75 -0,29	21,60 -0,65	33,35 -0,96
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,31 0,00	3,47 -0,37	0,63 -0,08	0,99 -0,22	3,47 -0,37	10,19 -0,67	17,63 -0,96
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,96 0,01	6,43 -0,26	1,93 -0,06	1,62 -0,12	6,43 -0,26	18,87 -0,67	31,59 -0,76
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	7,56 0,05	5,23 -0,26	10,56 0,03	11,28 -0,08	5,23 -0,26	36,52 -1,01	56,97 -1,75
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO Var. IRF-M 1+ p.p.	3,04 -0,01	8,22 -0,24	2,90 0,01	2,21 -0,08	8,22 -0,24	23,25 -0,65	38,41 -0,69
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	7,94 3,09	-0,03 -6,44	10,87 3,70	9,15 0,95	-0,03 -6,44	30,99 0,17	48,59 0,68
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	1,04 0,73	6,26 2,42	1,09 0,39	1,35 0,14	6,26 2,42	17,13 6,27	26,78 8,18
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,53 -0,21	7,92 -0,70	3,22 0,18	4,89 -0,21	7,92 -0,70	20,01 -1,46	31,07 -2,24
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	2,38 0,26	5,09 0,24	3,17 0,34	3,28 0,19	5,09 0,24	18,83 0,74	30,59 0,94
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,32 -0,03	6,66 2,15	2,04 -1,09	1,95 -2,47	6,66 2,15	24,19 15,17	33,90 20,80
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,65 -0,08	8,03 -0,59	3,05 0,00	4,76 -0,34	8,03 -0,59	20,12 -1,34	31,29 -2,02
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,28 -0,03	3,63 -0,21	0,64 -0,06	1,12 -0,09	3,63 -0,21	10,42 -0,44	17,94 -0,66
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,96 0,01	6,40 -0,30	1,99 0,00	1,64 -0,11	6,40 -0,30	18,94 -0,59	31,47 -0,89
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,84 -0,02	6,14 -0,27	7,13 -0,04	8,03 -0,18	6,14 -0,27	30,17 -0,66	46,78 -1,13
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	7,47 -0,04	5,06 -0,44	10,38 -0,15	11,03 -0,33	5,06 -0,44	36,63 -0,90	57,32 -1,41
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,27	-0,22	0,44	1,44	-0,22	5,55	12,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	161,18	-7,80	93,15	145,86	-7,80	62,49	76,69
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	8,08 3,23	-0,74 -7,14	10,95 3,77	8,31 0,10	-0,74 -7,14	27,78 -3,05	42,31 -5,60
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,32 197,00	0,21 7,48	0,61 128,41	1,78 180,13	0,21 7,48	6,30 70,95	13,70 86,29
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	2,59 1.573,55	1,70 61,66	3,39 718,02	3,05 309,12	1,70 61,66	20,06 225,83	
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,25 153,00	2,40 87,00	0,57 120,84	1,01 102,85	2,40 87,00	8,28 93,21	15,14 95,36
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,10 62,57	1,64 59,56	0,22 46,14	0,39 40,05	1,64 59,56	6,54 73,64	12,17 76,68
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO % do CDI	0,02 9,86	0,49 17,67	0,05 9,90	0,10 10,51	0,49 17,67	3,36 37,86	6,82 42,97
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,36 220,55	2,42 87,59	0,64 135,47	1,03 104,71	2,42 87,59	8,27 93,10	15,01 94,59
FI BANESTES INVEST MONEY RF % do CDI	0,07 44,17	1,70 61,72	0,21 44,34	0,45 45,90	1,70 61,72	6,60 74,35	12,23 77,03
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,09 54,66	1,90 68,94	0,26 54,98	0,55 56,20	1,90 68,94	7,07 79,61	13,01 81,96
LFT 010921 Var. SELIC p.p.	0,15 -0,01	2,71 -0,04	0,49 0,02	0,95 -0,03	2,71 -0,04	8,85 -0,03	15,85 -0,04
NTN-B 150822 Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,23 -3,62	8,56 2,16	2,97 -4,21	4,90 -3,30	8,56 2,16	24,16 -6,66	37,58 -10,33
LFT 010324 Var. SELIC p.p.	0,32 0,16	2,38 -0,37	0,59 0,12	0,66 -0,33	2,38 -0,37	8,52 -0,36	
NTN-B 150523 Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,99 -2,86	8,87 2,46	2,97 -4,20	4,55 -3,65	8,87 2,46	26,23 -4,60	40,84 -7,07
NTN-B 150521 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,00 -4,86	6,03 -0,38	2,14 -5,04	4,01 -4,20	6,03 -0,38	17,86 -12,97	29,87 -18,04
NTN-B 150830 Var. IMA-B TOTAL p.p.	5,55 0,70	9,61 3,21	8,32 1,14	8,65 0,44	9,61 3,21	35,38 4,56	54,24 6,33
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,85 0,00	6,05 -0,36	7,10 -0,07	8,06 -0,15	6,05 -0,36	29,87 -0,95	46,68 -1,23
FIP CAIXA CYRELA Var. IPCA p.p.	-8,79 -10,14	-98,51 -103,03	-98,34 -101,47	-98,40 -102,81	-98,51 -103,03	-98,48 -107,50	-98,32 -111,42
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	9,24	2,75	25,53	24,92	2,75	34,60	54,15

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.	-0,05	-0,17	-0,28	-0,29	-0,17	-0,82	-1,63
FIA BRASIL IBX-50	9,07	1,51	25,08	24,45	1,51	31,39	47,69
Var. IBOVESPA p.p.	-0,23	-1,41	-0,72	-0,76	-1,41	-4,03	-8,09
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	9,08	2,57	25,22	24,65	2,57	33,93	53,25
Var. IBOVESPA p.p.	-0,21	-0,35	-0,59	-0,56	-0,35	-1,49	-2,52
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	8,75	2,28	24,40	23,91	2,28	36,95	55,64
Var. IBOVESPA p.p.	-0,55	-0,64	-1,41	-1,29	-0,64	1,53	-0,14
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	5,18	7,76	12,31	17,59	7,76	49,95	81,31
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-3,76	8,76	-13,13	-3,70	8,76	6,24	14,67
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7,60	-3,23	21,53	23,20	-3,23	49,75	57,25
Var. IBOVESPA p.p.	-1,70	-6,15	-4,28	-2,01	-6,15	14,33	1,48
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	9,37	3,05	25,03	23,84	3,05	46,40	65,37
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,43	4,05	-0,40	2,55	4,05	2,69	-1,26
BB AÇÕES DIVIDENDOS	7,67	-7,93	20,55	18,48	-7,93	18,36	38,53
Var. IBOVESPA p.p.	-1,63	-10,84	-5,26	-6,73	-10,84	-17,06	-17,24
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	-4,46	0,96	-24,91	-8,97	0,96	63,32	63,36
Var. IPCA p.p.	-5,81	-3,56	-28,04	-13,38	-3,56	54,30	50,26
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,69	54,76	1,31	16,49	54,76	108,09	129,28
Var. IBOVESPA p.p.	-8,60	51,85	-24,49	-8,72	51,85	72,67	73,50
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	0,59	47,07	0,70	13,73	47,07	91,49	110,89
Var. IBOVESPA p.p.	-8,70	44,15	-25,11	-11,48	44,15	56,07	55,11
IPAJM - CONSOLIDADO	2,29	4,80	4,62	5,56	4,80	17,93	27,13
Var. IPCA + 5,5% p.p.	0,46	-5,44	0,10	-1,74	-5,44	-3,41	-5,63
CDI	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
INPC + 6%	1,98	11,75	4,85	8,23	11,75	23,79	35,66
IPCA + 6%	1,87	10,76	4,64	7,55	10,76	22,49	34,64

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	0,31	3,84	0,70	1,21	3,84	10,86	18,59
IRF-M 1+	3,05	8,45	2,90	2,29	8,45	23,90	39,09
IRF-M TOTAL	1,95	6,69	1,99	1,75	6,69	19,53	32,36
IMA-B 5	1,83	8,04	3,38	4,72	8,04	22,25	34,31
IMA-B 5+	7,51	5,50	10,53	11,36	5,50	37,54	58,72
IMA-B TOTAL	4,85	6,41	7,18	8,21	6,41	30,83	47,91
IMA-C TOTAL	-1,12	22,07	3,64	13,59	22,07	45,76	72,56
IMA-GERAL ex-C TOTAL	2,12	4,85	2,83	3,09	4,85	18,09	29,65
IMA-GERAL TOTAL	2,02	5,34	2,86	3,40	5,34	18,84	30,77
IDKA 2	1,73	8,62	3,05	5,10	8,62	21,46	33,31
IDKA 20	11,36	2,20	15,90	16,58	2,20	47,44	77,53
CDI	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87
Renda Variável							
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
IBRX 100	9,15	3,50	25,34	25,28	3,50	38,06	59,35
IBRX 50	9,42	3,62	26,47	26,00	3,62	33,83	53,28
SMALL CAP	7,52	-0,65	22,54	25,33	-0,65	57,16	69,94
IFIX	2,19	-10,24	2,69	2,28	-10,24	22,05	28,91
Índice Consumo - ICON							
Índice Dividendos - IDIV	8,94	-1,00	25,44	21,29	-1,00	43,71	66,63
Indicadores Econômicos							
IPCA	1,35	4,52	3,13	4,42	4,52	9,02	13,10
INPC	1,46	5,45	3,34	5,07	5,45	10,17	13,96
IGPM	0,96	23,14	7,64	17,96	23,14	32,13	42,09
SELIC	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,88
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1021	01/12/2020	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	187.109,61	9.386,98960619	19,9328664300
1025	01/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.305,90	0,00	1.091,70976197	2,1121914270
1030	01/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	39.578,58	4.874,08280152	8,1202108400
1037	01/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	644,88	0,00	305,31323618	2,1121914270
1022	02/12/2020	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	16.996,49	852,51132585	19,9369668000
1026	02/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	4.905,78	0,00	2.322,52179879	2,1122643510
1039	02/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.779,58	0,00	1.315,92430592	2,1122643510
1056	02/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	839.000,00	0,00	103.321,68707040	8,1202700400
1023	03/12/2020	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	73.565,35	3.689,35794981	19,9398787000
1027	03/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.785,36	0,00	845,19742042	2,1123585530
1031	03/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	5.039.893,74	620.651,37067274	8,1203296700
1041	03/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.200,52	0,00	1.041,73602387	2,1123585530
1058	03/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	14.650.000,00	0,00	1.804.113,94553640	8,1203296700
1060	03/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	10.208,77	1.257,18664326	8,1203296700
1028	04/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	10.631,90	0,00	5.033,02290312	2,1124282970
1043	04/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	5.636,74	0,00	2.668,36986041	2,1124282970
1047	04/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	13.454.876,50	1.656.925,08918360	8,1203891400
1024	07/12/2020	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	99.144,18	4.970,35574752	19,9470993700
1035	07/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.500.000,00	3.264.444,36740743	2,2974813340
1045	07/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	9.438,78	0,00	4.468,01850589	2,1125203460
1048	07/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	13.357.668,99	1.644.942,24986536	8,1204486000
1049	07/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	7.700.000,00	0,00	948.223,47622519	8,1204486000
1231	07/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	56.783,52	0,00	26.879,51389700	2,1125203460
1050	08/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	12.734,84	0,00	6.027,83781166	2,1126713090
1062	08/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.680.745,10	206.975,36002476	8,1205081600
1064	08/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	4.071.256,09	501.354,84255212	8,1205081600
1066	08/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	83.612,94	0,00	39.576,88053215	2,1126713090
1068	08/12/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	5.700.000,00	0,00	285.472,45877484	19,9668998700

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1052	09/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.740,28	0,00	1.770,32903909	2,1127597850
1070	09/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	7.825.791,21	0,00	963.700,06075351	8,1205673100
1072	09/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	4.757,38	0,00	2.251,73729346	2,1127597850
1054	10/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	684,16	0,00	323,80810095	2,1128563430
1074	10/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	438,52	0,00	207,54842205	2,1128563430
1076	10/12/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	292.839,92	14.665,29046470	19,9682318400
1078	10/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.936,92	484,80493664	8,1206268800
1080	10/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.000.000,00	0,00	3.480.970,73414887	2,2982094970
1082	10/12/2020	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	80.000.000,00	46.452.782,76411303	1,7221788500
1084	10/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	140.000,00	0,00	37.502,17311700	3,7331170000
1098	11/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	9.062,65	0,00	4.289,06012386	2,1129687480
1100	11/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	7.530,80	0,00	3.564,08489578	2,1129687480
1151	11/12/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	438,78	21,97317214	19,9688964900
1197	11/12/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	50.000.000,00	0,00	15.610.150,84400964	3,2030440000
1199	11/12/2020	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	10.000.000,00	3.639.672,42948135	2,7475000000
1102	14/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	8.440,50	0,00	3.994,49334353	2,1130339380
1104	14/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	8.615,32	0,00	4.077,22746193	2,1130339380
1106	14/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	165.253,36	78.206,67573206	2,1130339380
1168	14/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	3.477.716,74	0,00	428.250,88571879	8,1207461700
1170	14/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.042.001,95	251.454,96574485	8,1207461700
1230	14/12/2020	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	40.000.000,00	0,00	13.188.278,49585700	3,0329963090
1090	15/12/2020	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	5.000.000,00	1.427.320,47841428	3,5030675140
1092	15/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.545.873,60	672.376,15150851	2,2991202120
1108	15/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.574,66	0,00	1.218,40690997	2,1131364070
1110	15/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.347,44	0,00	1.584,10975691	2,1131364070
1153	15/12/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	3.081,16	154,28768136	19,9702268700
1172	15/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	180.710,67	0,00	22.252,80052353	8,1208057300
1112	16/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	450.677,60	0,00	213.260,15250241	2,1132761780
1114	16/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	7.197,83	0,00	3.406,00536500	2,1132761780
1154	16/12/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	130.206,65	6.519,83548295	19,9708490100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1174	16/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	6.580.685,13	0,00	810.342,92363571	8,1208645600
1229	16/12/2020	BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	5.000.000,00	0,00	2.441.342,07178900	2,0480538380
1116	17/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.963,12	0,00	928,92077009	2,1133341650
1118	17/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	122,86	0,00	58,13562381	2,1133341650
1157	17/12/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	847.511,50	42.436,01876455	19,9715129900
1176	17/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	156.026.000,00	0,00	19.212.837,11180214	8,1209245200
1120	18/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	8.629,56	0,00	4.083,19866040	2,1134313360
1122	18/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.426,56	0,00	1.148,16126678	2,1134313360
1124	18/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	65.365,81	30.928,75973142	2,1134313360
1126	18/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.711,31	1.756,05894395	2,1134313360
1160	18/12/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	90.051,02	4.508,82324205	19,9721779200
1179	18/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.101.702,74	258.798,99489138	8,1209849400
1094	21/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.464.764,80	1.071.633,08343894	2,3000081260
1128	21/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	15.454,51	0,00	7.312,13761360	2,1135420060
1130	21/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	21.732,56	10.282,53043389	2,1135420060
1132	21/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	77.719,72	36.772,26181423	2,1135420060
1162	21/12/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	4.103.839,61	205.471,00488512	19,9728405100
1181	21/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	115.002.264,96	14.161.017,36852746	8,1210454000
1183	21/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	4.291.945,51	528.496,67728738	8,1210454000
1193	21/12/2020	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	1.000.000,00	50.079,82676811	19,9681201900
1096	22/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	581.127,10	252.623,44912053	2,3003687980
1134	22/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	8.302,78	0,00	3.928,14020659	2,1136669170
1137	22/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	51.236,27	0,00	24.240,46550945	2,1136669170
1139	22/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.544,74	1.677,05704787	2,1136669170
1164	22/12/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	72.654,94	3.637,56675777	19,9735001000
1185	22/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	7.173.827,21	0,00	883.356,01653473	8,1211052800
1187	22/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	39.618.588,94	4.878.472,51993758	8,1211052800
1141	23/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	11.473,14	0,00	5.427,72771218	2,1138016880
1143	23/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	12.177,91	0,00	5.761,14120314	2,1138016880
1189	23/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	14.490.000,00	0,00	1.784.226,71110103	8,1211652700

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1191	23/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	24.174.000,00	0,00	2.976.666,42609774	8,1211652700
1195	23/12/2020	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	312.510,09	15.645,80953774	19,9740441200
1145	24/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.998,30	0,00	945,30929244	2,1139113050
1147	28/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	10.347,53	0,00	4.894,91751169	2,1139334780
1149	28/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	5.922,14	0,00	2.801,47888362	2,1139334780
1166	28/12/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	9.591,11	480,14392478	19,9754896500
1201	29/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	4.019,14	0,00	1.901,13086072	2,1140785640
1203	29/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	644,88	0,00	305,04069763	2,1140785640
1211	29/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	3.482.872,71	0,00	428.854,08155032	8,1213467700
1213	29/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	52.000.000,00	6.402.878,91561118	8,1213467700
1220	29/12/2020	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	4.342.719,43	2.517.401,52759046	1,7250801600
1205	30/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.789,35	0,00	1.792,35823381	2,1141699960
1207	30/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	8.491.340,67	0,00	4.016.394,46499836	2,1141699960
1209	30/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	15.003,32	0,00	7.096,55327073	2,1141699960
1215	30/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	328,65	0,00	40,46712292	8,1214076100
1217	30/12/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	138,80	0,00	17,09063338	8,1214076100
1222	30/12/2020	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	10.144,95	0,00	507,66324828	19,9836211000
1224	30/12/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	52.000.000,00	0,00	13.906.978,36127655	3,7391300000
1226	31/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	6.792,50	0,00	3.212,73363640	2,1142431240
1228	31/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	18.334,12	0,00	8.671,71792680	2,1142431240
Total						

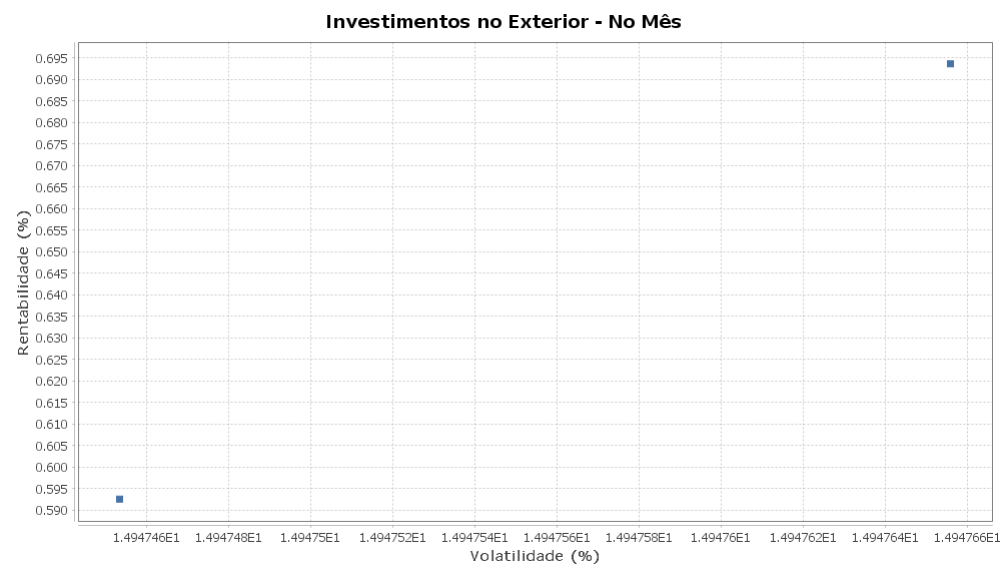
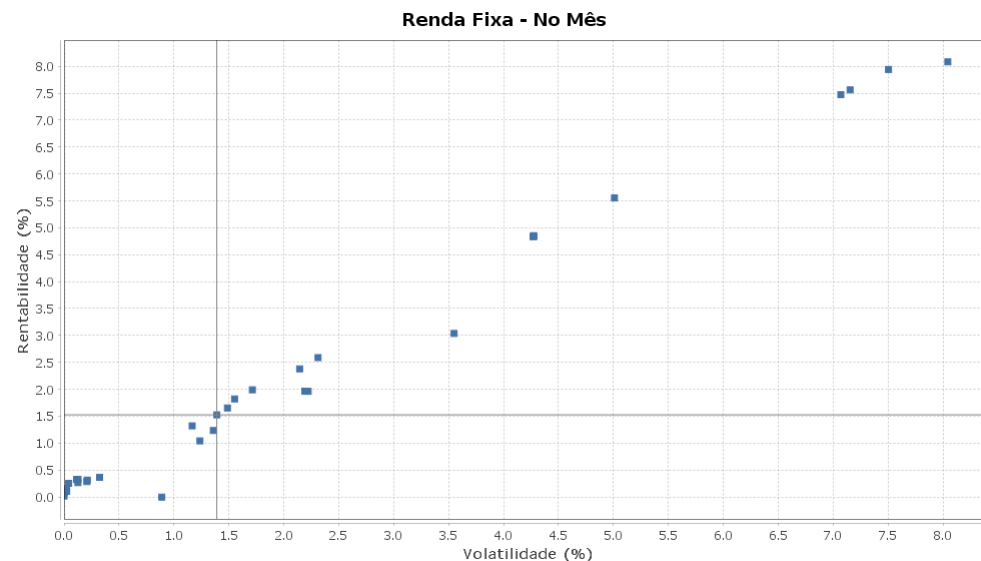
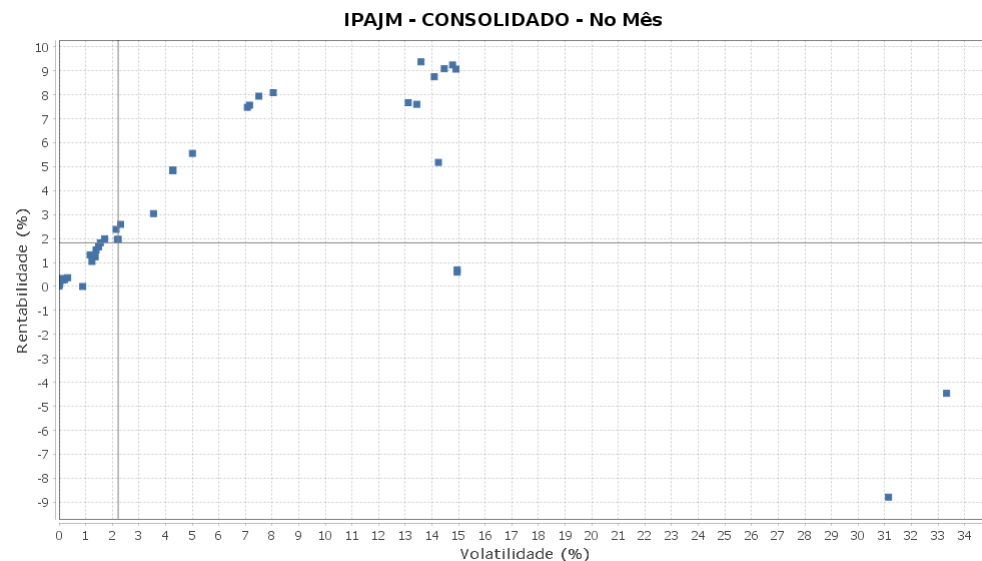
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rendimentos Realizados

Artigo	Ativo	Quantidade	Valor Aplicação	Valor Resgate	Rendimento
Artigo 7º IV, Alínea a	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	31.118.584,428680	252.701.375,28	252.714.668,79	13.293,51
Artigo 7º IV, Alínea a	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	48.970.184,291703	84.880.355,52	84.342.719,43	-537.636,09
Artigo 7º IV, Alínea a	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	84.624,850935	1.665.378,61	1.689.325,72	23.947,11
Artigo 7º IV, Alínea a	BB PREV RF FLUXO FIC	159.623,343703	336.993,50	337.327,49	333,99
Artigo 7º I, Alínea b	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	1.427.320,478414	3.066.866,30	5.000.000,00	1.933.133,70
Artigo 7º IV, Alínea a	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.261.077,051475	11.434.817,45	12.091.765,50	656.948,05
Artigo 7º IV, Alínea a	FI BANESTES INVEST MONEY RF	277.894,944375	5.548.695,66	5.550.214,69	1.519,03
Artigo 7º I, Alínea b	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.639.672,429481	7.842.278,43	10.000.000,00	2.157.721,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 106.416.833,56

Value-At-Risk: 2,08%

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	-1.362,26	0,02	64.052.791,13	1,25
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	-87,26	0,09	66,32	0,00
FI BANESTES INVEST MONEY RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,00	-0,00	-69,01	0,07	161.436,11	0,00
LFT 010921	Artigo 7º I, Alínea a	0,02	0,04	0,00	-0,51	0,15	248.583.235,86	4,86
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,06	0,00	-2,62	0,10	9.324.215,50	0,18
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,09	0,00	2,04	0,25	314.239.111,63	6,14
LFT 010324	Artigo 7º I, Alínea a	0,11	0,23	0,00	1,40	0,32	112.481.661,88	2,20
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,13	0,09	-0,00	0,79	0,27	11.139.010,35	0,22
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,13	0,09	-0,00	1,25	0,32	102.386.614,75	2,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,21	0,15	0,00	0,58	0,28	40.659.255,17	0,79
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,21	0,17	0,01	0,70	0,31	305.844.541,10	5,98
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,32	0,13	0,00	0,61	0,36	185.145.482,36	3,62
NTN-B 150521	Artigo 7º I, Alínea a	0,89	0,41	0,00	-0,19	-0,00	319.033.070,82	6,23
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,17	1,25	0,13	0,99	1,32	707.779.433,43	13,83
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	1,24	0,75	0,00	0,71	1,04	1.423.979,78	0,03
NTN-B 150822	Artigo 7º I, Alínea a	1,36	1,12	0,05	0,79	1,23	420.602.812,96	8,22
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,39	0,94	0,00	0,98	1,53	43.048.939,21	0,84
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,49	1,10	0,00	1,00	1,65	34.228.614,66	0,67
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,55	1,06	0,01	1,07	1,82	86.225.309,38	1,68
NTN-B 150523	Artigo 7º I, Alínea a	1,71	1,45	0,01	1,06	1,99	77.256.030,86	1,51
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,14	1,33	0,13	1,03	2,38	678.125.041,26	13,25
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	1,39	0,01	0,82	1,96	50.709.949,79	0,99
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,22	1,38	0,01	0,81	1,96	37.345.763,26	0,73
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	2,31	1,30	0,00	1,05	2,59	7.349.018,76	0,14
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	3,55	2,09	0,01	0,81	3,04	21.408.664,33	0,42
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,27	2,56	0,01	1,09	4,84	27.090.659,22	0,53
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	4,27	2,56	0,00	1,10	4,85	2.168.419,52	0,04
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,28	2,57	0,01	1,09	4,84	14.705.925,49	0,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150830	Artigo 7º I, Alínea a	5,01	2,83	0,05	1,08	5,55	122.989.023,64	2,40
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,07	4,56	0,00	1,03	7,47	3.033.378,54	0,06
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,15	4,57	0,00	1,03	7,56	1.403.633,82	0,03
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	7,50	4,72	0,00	1,04	7,94	36.458.309,01	0,71
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	8,04	4,68	0,00	0,98	8,08	33.949.962,92	0,66
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	13,11	9,98	0,26	0,57	7,67	141.502.483,64	2,77
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	13,43	10,55	0,31	0,55	7,60	171.246.474,48	3,35
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	13,59	9,81	0,06	0,68	9,37	35.207.304,25	0,69
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	14,09	10,65	0,31	0,61	8,75	158.364.764,04	3,09
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	14,25	10,20	0,01	0,35	5,18	5.957.858,70	0,12
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	14,47	11,36	0,02	0,62	9,08	10.917.918,99	0,21
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	14,78	10,82	0,16	0,61	9,24	78.688.044,48	1,54
FIA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	14,90	11,04	0,35	0,60	9,07	172.551.056,55	3,37
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	14,95	12,38	0,03	0,03	0,59	51.577.593,86	1,01
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	14,95	12,70	0,10	0,04	0,69	143.590.384,58	2,81
FIP CAIXA CYRELA	Artigo 8º IV, Alínea a	31,14	18,80	0,00	-0,29	-8,79	13.573,07	0,00
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	Artigo 8º IV, Alínea b	33,32	24,89	0,01	-0,14	-4,46	27.370.000,00	0,53