



**LDB**  
EMPRESAS

**IPREMAR**  
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

89,13%

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-M	6,16	-0,80	-0,80	4.718.222,79	4,99	8.385.200.938,98	0,06
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,58	0,03	0,03	363.189,87	0,38	8.572.331.669,58	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,85	-0,86	-0,86	4.856.429,36	5,14	8.335.200.025,45	0,06
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	12,85	-0,89	-0,89	805.799,05	0,85	735.043.145,99	0,11
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,90	-0,87	-0,87	8.123.064,62	8,59	6.185.705.380,20	0,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,56	0,03	0,03	3.189.315,44	3,37	10.435.150.283,00	0,03
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,06	0,08	0,08	10.983.723,01	11,62	13.518.203.391,91	0,08
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,24	0,18	0,18	5.321.855,86	5,63	9.200.599.633,08	0,06
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,86	-1,70	-1,70	15.562.269,58	16,46	1.607.704.843,41	0,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	9,18	-1,39	-1,39	3.247.046,58	3,43	2.764.051.643,34	0,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,18	0,13	0,13	2.812.619,15	2,97	10.852.113.121,11	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	5,04	0,10	0,10	2.324.775,35	2,46	5.043.806.710,80	0,05
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>10,42</b>	<b>-0,72</b>	<b>-0,72</b>	<b>62.308.310,66</b>	<b>65,90</b>		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANRISUL	BANRISUL	BANRISUL PREVIDENCIA MUNICIPAL II FI RF LP	5,90	-0,48	-0,48	1.069.890,47	1,13	189.126.312,11	0,57
CEF	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	12,82	-0,88	-0,88	6.538.985,84	6,92	2.989.640.382,47	0,22
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>11,80</b>	<b>-0,83</b>	<b>-0,83</b>	<b>7.608.876,31</b>	<b>8,05</b>		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	14,66	-1,05	-1,05	1.202.108,49	1,27	641.898.631,44	0,19
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	6,04	-0,25	-0,25	658.312,02	0,70	763.158.290,49	0,09
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	12,85	-0,86	-0,86	11.009.797,35	11,64	1.371.288.426,53	0,80
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,15	0,08	0,08	947.574,80	1,00	2.320.539.431,87	0,04
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,05	0,08	0,08	514.069,33	0,54	608.020.020,83	0,08
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>11,72</b>	<b>-0,74</b>	<b>-0,74</b>	<b>14.331.861,99</b>	<b>15,16</b>		

Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado")

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ICLA TRUST	MACROINVEST	SANTOS CREDIT YIELD	40,89	-1,41	-1,94	21.614,00	0,02	45.852.516,11	0,05
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>40,89</b>	<b>-1,41</b>	<b>-1,41</b>	<b>21.614,00</b>	<b>0,02</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>10,76</b>	<b>-0,74</b>	<b>-0,74</b>	<b>84.270.662,96</b>	<b>89,13</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

10,87%

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
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	45,64	-2,82	-2,82	3.522.654,28	3,73	1.218.203.539,76	0,29
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b>			<b>45,64</b>	<b>-2,82</b>	<b>-2,82</b>	<b>3.522.654,28</b>	<b>3,73</b>		

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações )

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	40,28	-6,19	-6,19	1.937.920,25	2,05	304.359.841,80	0,64
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	40,22	-3,76	-3,76	4.814.176,56	5,09	968.458.637,18	0,50
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>39,84</b>	<b>-4,47</b>	<b>-4,47</b>	<b>6.752.096,81</b>	<b>7,14</b>		
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>			<b>41,52</b>	<b>-3,91</b>	<b>-3,91</b>	<b>10.274.751,09</b>	<b>10,87</b>		
<b>Total</b>			<b>13,15</b>	<b>-1,09</b>	<b>-1,09</b>	<b>94.545.414,05</b>	<b>100,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	62.308.310,66	65,90	0,00	36,77	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	7.608.876,31	8,05	0,00	8,49	60,00	0,00	65,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	14.331.861,99	15,16	0,00	19,16	40,00	0,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	21.614,00	0,02	0,00	0,02	5,00	0,00	10,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>84.270.662,96</b>	<b>89,13</b>					100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	3.522.654,28	3,73	0,00	0,00	30,00	0,00	35,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	6.752.096,81	7,14	0,00	15,56	20,00	0,00	25,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>10.274.751,09</b>	<b>10,87</b>					35,00

**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	-0,72 -483,59	-0,72 -483,59	4,72 1.016,20	2,20 233,68	4,89 193,57	-446.260,22	-446.260,22
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,83 -551,90	-0,83 -551,90	5,42 1.167,54	2,34 248,44	4,67 185,05	-63.298,10	-63.298,10
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,74 -498,23	-0,74 -498,23	5,15 1.110,59	2,34 248,97	3,99 158,11	-104.251,83	-104.251,83
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-1,41 -944,81	-1,41 -944,81	-0,33 -71,98	-1,07 -114,20	64,48 2.553,29	-309,65	-309,65
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,82 0,50	-2,82 0,50	21,89 -0,59	11,05 -0,77	0,49 -0,66	-102.210,36	-102.210,36
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,47 -1,15	-4,47 -1,15	19,41 -3,06	8,80 -3,01	-6,02 -7,17	-316.173,42	-316.173,42
<b>IPREMAR (Total)</b>						<b>-1.032.503,58</b>	<b>-1.032.503,58</b>

**RESULTADO POR ATIVO**

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IDKA2	5.312.453,31	0,00	0,00	0,00	5.321.855,86	9.402,55	9.402,55
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2.071.866,46	250.000,00	0,00	0,00	2.324.775,35	2.908,89	2.908,89
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.898.742,41	0,00	0,00	0,00	4.856.429,36	-42.313,05	-42.313,05
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	15.830.764,65	0,00	0,00	0,00	15.562.269,58	-268.495,07	-268.495,07
BB PREV RF IRF-M	4.756.213,91	0,00	0,00	0,00	4.718.222,79	-37.991,12	-37.991,12
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	375.072,07	0,00	-12.000,00	0,00	363.189,87	117,80	117,80
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	812.999,66	0,00	0,00	0,00	805.799,05	-7.200,61	-7.200,61
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.808.866,04	0,00	0,00	0,00	2.812.619,15	3.753,11	3.753,11
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.673.753,07	300.000,00	0,00	0,00	10.983.723,01	9.969,94	9.969,94
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8.194.560,89	0,00	0,00	0,00	8.123.064,62	-71.496,27	-71.496,27
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.188.511,31	0,00	0,00	0,00	3.189.315,44	804,13	804,13
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	3.292.767,10	0,00	0,00	0,00	3.247.046,58	-45.720,52	-45.720,52

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					62.308.310,66	0,00	0,00
Artigo 7º III, Alínea a							
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANRISUL PREVIDENCIA MUNICIPAL II FI RF LP	1.075.006,61	0,00	0,00	0,00	1.069.890,47	-5.116,14	-5.116,14
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	6.597.167,80	0,00	0,00	0,00	6.538.985,84	-58.181,96	-58.181,96
					7.608.876,31	0,00	0,00
Artigo 7º IV, Alínea a							
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	946.831,04	0,00	0,00	0,00	947.574,80	743,76	743,76
BB PREV RF IMA-B	11.105.175,71	0,00	0,00	0,00	11.009.797,35	-95.378,36	-95.378,36
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	659.949,16	0,00	0,00	0,00	658.312,02	-1.637,14	-1.637,14
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	513.648,12	0,00	0,00	0,00	514.069,33	421,21	421,21
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	910.509,79	300.000,00	0,00	0,00	1.202.108,49	-8.401,30	-8.401,30
					14.331.861,99	0,00	0,00
Artigo 7º VII, Alínea b							
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTOS CREDIT YIELD	21.923,65	0,00	0,00	0,00	21.614,00	-309,65	-309,65
					21.614,00	0,00	0,00
Artigo 8º I, Alínea a							
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	3.624.864,64	0,00	0,00	0,00	3.522.654,28	-102.210,36	-102.210,36
					3.522.654,28	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA DIVIDENDOS	2.065.871,61	0,00	0,00	0,00	1.937.920,25	-127.951,36	-127.951,36
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.002.398,62	0,00	0,00	0,00	4.814.176,56	-188.222,06	-188.222,06
					6.752.096,81	0,00	0,00

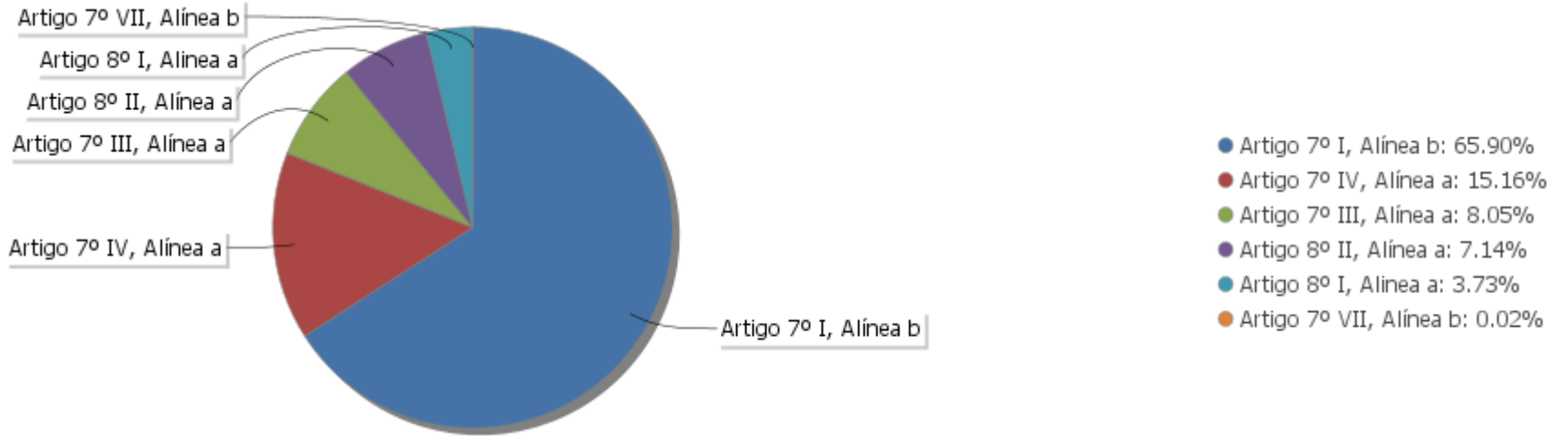
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

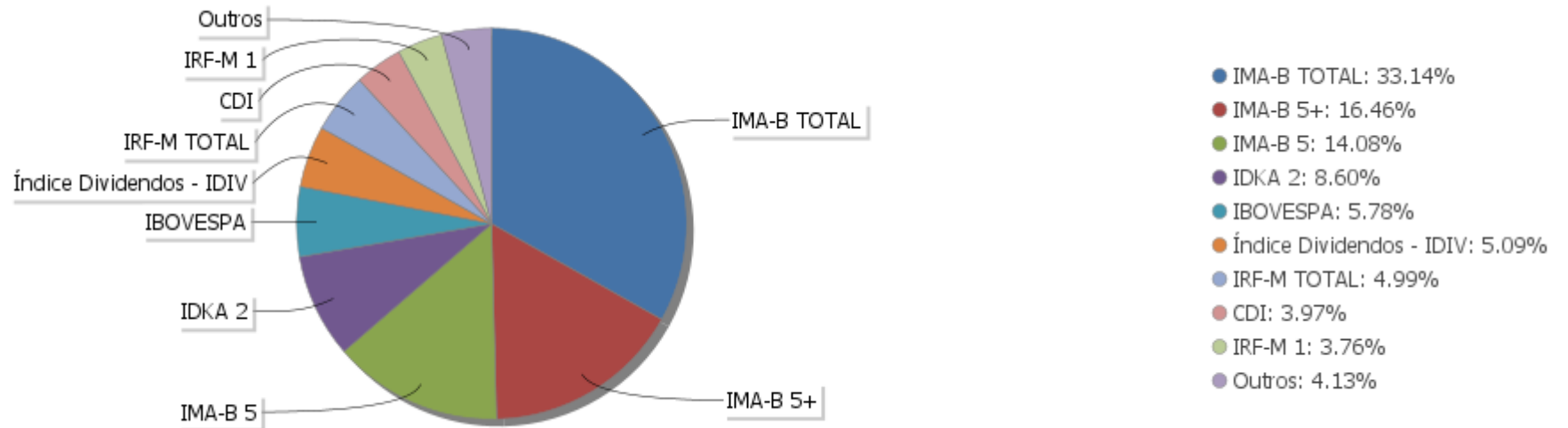
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	89.731.237,49	94,91	89.731.237,49	94,91
de 31 a 365 dias	4.814.176,56	5,09	94.545.414,05	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	94.545.414,05	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

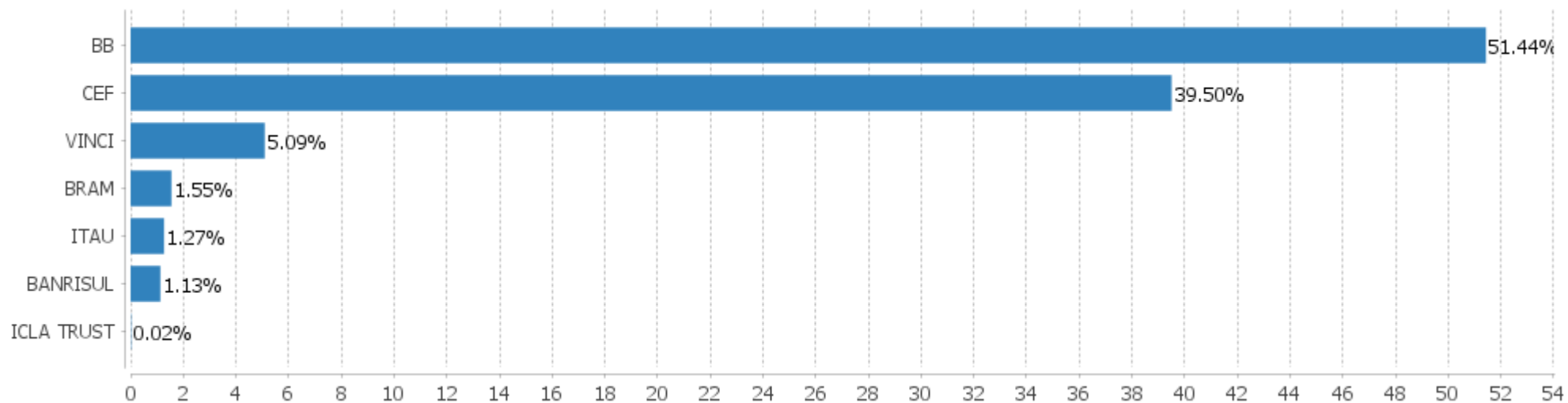


Alocação Por Estratégia



## 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
2021	-1,09												-1,09
INPC + 5,43%	0,69												0,69
p.p. indexador	-1,78												-1,78
2020	0,34	-0,51	-8,23	1,90	1,99	2,11	3,91	-1,72	-1,58	0,10	2,92	4,51	5,22
INPC + 6,00%	0,70	0,59	0,69	0,23	0,21	0,79	0,98	0,85	1,36	1,38	1,42	1,98	11,75
p.p. indexador	-0,36	-1,10	-8,92	1,66	1,78	1,33	2,94	-2,56	-2,94	-1,28	1,51	2,53	-6,53
2019	3,51	0,40	0,47	1,27	2,74	3,16	1,19	-0,11	2,37	2,86	-1,69	2,40	20,09
INPC + 6,00%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,44	0,57	1,01	1,71	10,78
p.p. indexador	2,64	-0,61	-0,74	0,18	2,08	2,71	0,56	-0,74	1,93	2,29	-2,69	0,68	9,31
2018	2,43	0,58	0,89	0,09	-2,37	-0,26	1,91	-0,36	0,27	5,21	0,92	1,41	11,04
INPC + 6,00%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	0,74	0,91	0,21	0,60	9,59
p.p. indexador	1,68	-0,02	0,33	-0,60	-3,28	-2,19	1,15	-0,89	-0,47	4,29	0,70	0,80	1,45

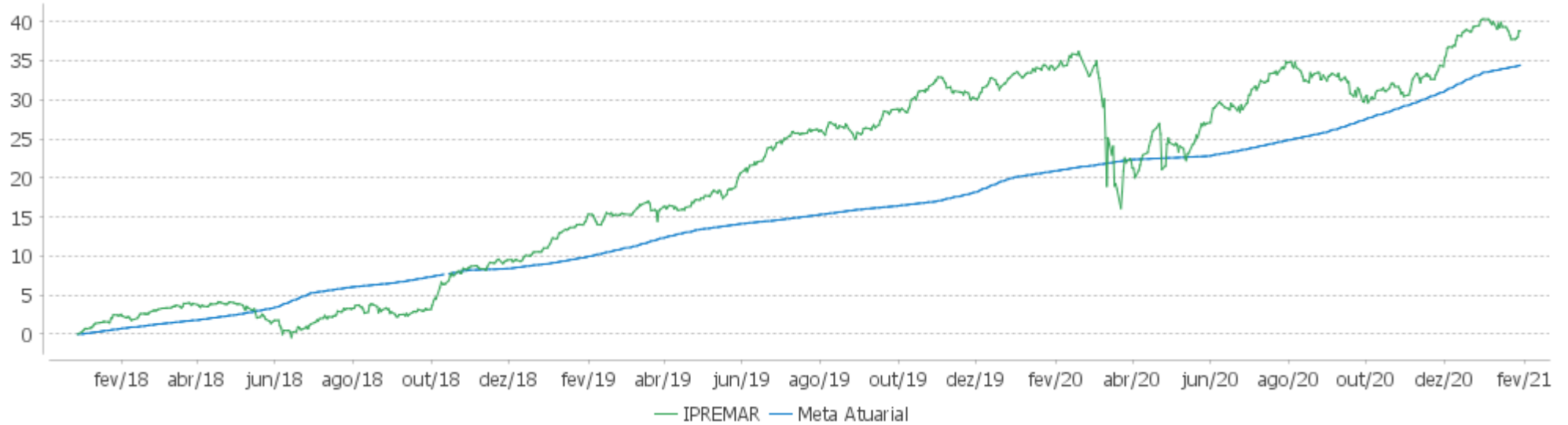
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

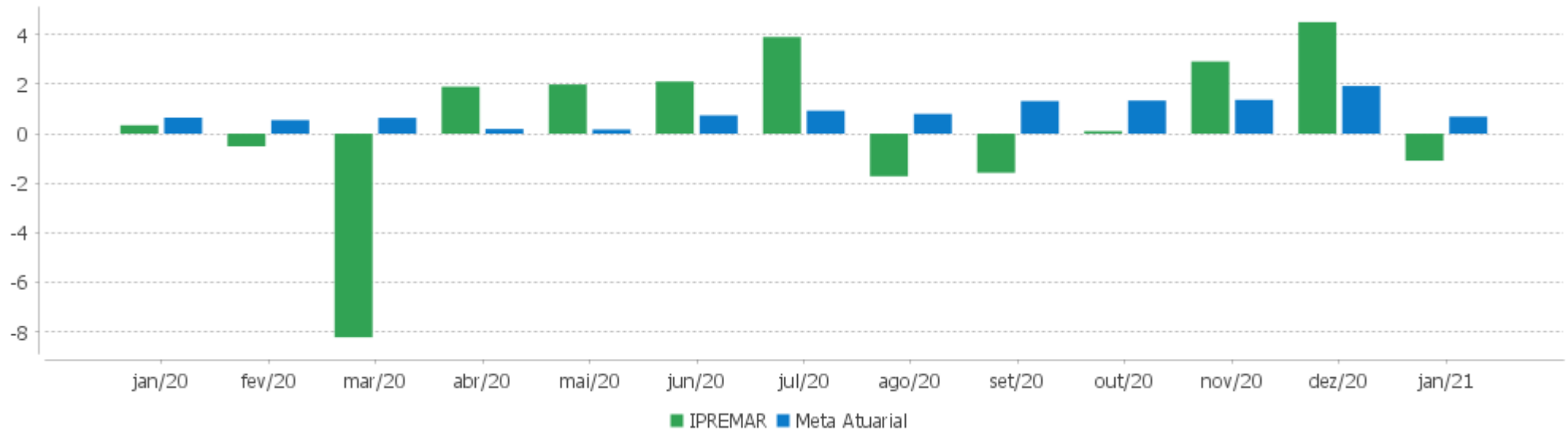
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	20	54,05	03 meses	6,39	4,14	2,25	4,99
Meses abaixo - Meta Atuarial	17	45,95	06 meses	3,01	7,92	-4,91	5,90
			12 meses	3,72	11,74	-8,02	13,15
			24 meses	20,74	23,57	-2,83	9,73
Maior rentabilidade da Carteira	5,21	2018-10	36 meses	35,49	35,59	-0,10	8,29
Menor rentabilidade da Carteira	-8,23	2020-03	Desde 29/12/2017	38,78	36,60	2,18	8,18

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
SANTOS CREDIT YIELD % do CDI	-1,94 -1.295,28	-1,94 -1.295,28	-0,86 -186,09	-1,60 -170,07	63,60 2.518,34	148,63 1.757,72	277,46 1.804,71
BANRISUL PREVIDENCIA MUNICIPAL II FI RF LP % do CDI	-0,48 -318,36	-0,48 -318,36	2,27 489,29	0,81 85,77	3,46 136,96	14,39 170,23	25,54 166,16
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,88 -0,03	-0,88 -0,03	5,95 -0,09	2,59 -0,18	4,87 -0,35	23,40 -0,89	40,74 -1,09
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,86 -0,01	-0,86 -0,01	5,93 -0,11	2,59 -0,19	4,73 -0,50	23,34 -0,95	40,50 -1,32
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	-1,05 -705,19	-1,05 -705,19	5,99 1.290,45	2,22 236,39	6,18 244,63	26,80 316,92	44,28 288,00
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,08 52,55	0,08 52,55	0,24 51,76	0,37 39,48	1,43 56,73	6,15 72,72	11,72 76,21
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,25 -0,00	-0,25 -0,00	2,69 0,17	1,62 0,23	4,98 0,48	16,92 0,59	28,83 0,64
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
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	-1,39 0,00	-1,39 0,00	2,05 -0,04	-0,70 -0,10	5,58 -0,19	19,55 -0,57	34,26 -0,81
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,87 -0,02	-0,87 -0,02	5,99 -0,05	2,66 -0,12	4,88 -0,35	23,46 -0,82	40,68 -1,14
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,08 -0,02	0,08 -0,02	3,22 -0,07	3,64 -0,16	7,25 -0,30	19,86 -0,66	31,74 -0,94
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,18 0,03	0,18 0,03	3,07 -0,09	4,24 -0,05	7,69 -0,51	18,77 -1,35	30,05 -2,43
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,03 -0,01	0,03 -0,01	0,54 -0,04	0,79 -0,23	3,07 -0,36	9,59 -0,68	16,98 -0,96
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,10 -0,01	0,10 -0,01	3,24 -0,04	3,66 -0,15	7,29 -0,27	19,97 -0,56	31,81 -0,87
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,13 -0,01	0,13 -0,01	3,03 -0,13	4,04 -0,24	7,68 -0,52	18,78 -1,35	30,23 -2,26
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,80 0,00	-0,80 0,00	1,50 -0,01	-0,29 -0,14	4,65 -0,26	16,40 -0,55	28,76 -0,85
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,03	0,03	0,53	0,90	3,22	9,83	17,30

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-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
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	-0,89	-0,89	5,95	2,61	4,86	23,44	40,37
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,03	-0,09	-0,16	-0,36	-0,84	-1,46
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
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
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
FIA CAIXA DIVIDENDOS	-6,19	-6,19	17,34	5,87	-13,99	9,17	28,84
Var. IBOVESPA p.p.	-2,87	-2,87	-5,14	-5,94	-15,14	-8,97	-6,67
IPREMAR	-1,09	-1,09	6,39	3,01	3,72	20,74	35,49
Var. INPC + 5,43% p.p.	-1,78	-1,78	2,35	-4,67	-7,48	-1,56	2,01
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**

**Renda Fixa**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,04	0,04	0,58	1,02	3,43	10,27	17,95	30,16	48,79
IRF-M 1+	-1,39	-1,39	2,09	-0,60	5,77	20,12	35,07	55,88	99,88
IRF-M TOTAL	-0,80	-0,80	1,50	-0,15	4,92	16,95	29,61	47,87	81,53
IMA-B 5	0,11	0,11	3,28	3,80	7,55	20,52	32,68	49,63	69,75
IMA-B 5+	-1,69	-1,69	8,43	2,01	3,68	26,83	48,69	72,09	127,80
IMA-B TOTAL	-0,85	-0,85	6,04	2,78	5,22	24,29	41,83	62,38	102,58
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,44	-0,44	2,38	0,96	3,87	15,36	26,95	43,19	72,95
IMA-GERAL TOTAL	-0,24	-0,24	2,52	1,39	4,50	16,33	28,20	44,56	74,55
IDKA 2	0,15	0,15	3,16	4,28	8,20	20,12	32,49	50,04	68,42
IDKA 20	-2,81	-2,81	11,88	1,09	0,71	29,02	58,93	87,07	199,14
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,37	26,20	43,91

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51	77,93	184,79
IBRX 100	-3,03	-3,03	22,21	12,06	1,64	20,92	39,53	83,84	187,39
IBRX 50	-2,78	-2,78	23,61	13,27	2,67	17,81	33,39	76,40	176,44
SMALL CAP	-3,43	-3,43	21,10	10,52	-4,50	38,71	57,28	119,97	253,04
IFIX	0,32	0,32	4,07	5,35	-6,43	19,49	26,00	48,83	117,65
Índice Consumo - ICON	-1,28	-1,28	12,91	3,78	-3,99	37,57	37,84	80,08	121,08
Índice Dividendos - IDIV	-5,08	-5,08	18,30	8,08	-4,52	21,27	43,95	82,51	251,58

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,25	0,25	2,51	4,30	4,56	8,94	13,06	16,28	22,51
INPC	0,27	0,27	2,70	4,89	5,53	10,07	14,00	16,14	22,45
IGPM	2,58	2,58	6,95	18,36	25,71	35,53	44,66	44,07	53,65
SELIC	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,38	26,22	43,96

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	4,20	4,20	7,76	19,50	47,69	105,96	127,76	185,42	159,29
MSCI ACWI	4,82	4,82	10,70	22,59	47,61	96,26	105,52	159,93	132,20
MSCI World	4,26	4,26	10,13	21,53	45,74	96,75	108,24	160,05	130,78

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,56	0,56	3,50	6,35	8,69	17,79	27,09	35,89	48,91
IPCA + 5,00%	0,64	0,64	3,75	6,86	9,72	20,06	30,78	41,15	56,18
IPCA + 5,50%	0,68	0,68	3,87	7,11	10,24	21,20	32,64	43,84	59,91
IPCA + 5,89%	0,71	0,71	3,96	7,30	10,64	22,10	34,11	45,97	62,87
IPCA + 6,00%	0,71	0,71	3,99	7,36	10,76	22,35	34,53	46,57	63,72
INPC + 4,00%	0,58	0,58	3,70	6,95	9,70	19,02	28,16	35,72	48,84
INPC + 6,00%	0,73	0,73	4,18	7,97	11,79	23,62	35,65	46,38	63,64

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

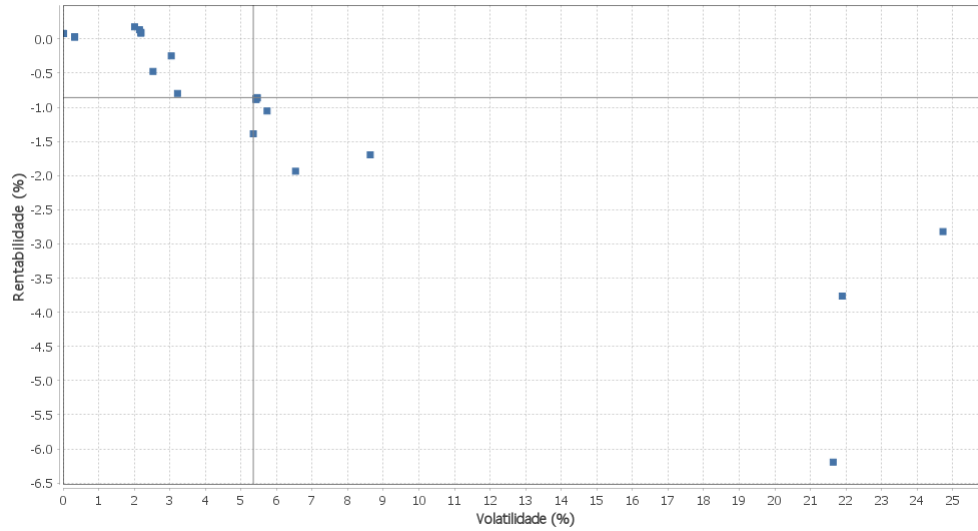
## Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
65	27/01/2021	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	250.000,00	0,00	12.141,65784200	20,5902689100
66	27/01/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	300.000,00	0,00	93.170,97152700	3,2198870000
67	28/01/2021	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	300.000,00	0,00	26.268,89258755	11,4203520000
64	29/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	12.000,00	4.402,08265700	2,7259824350
<b>Total</b>						

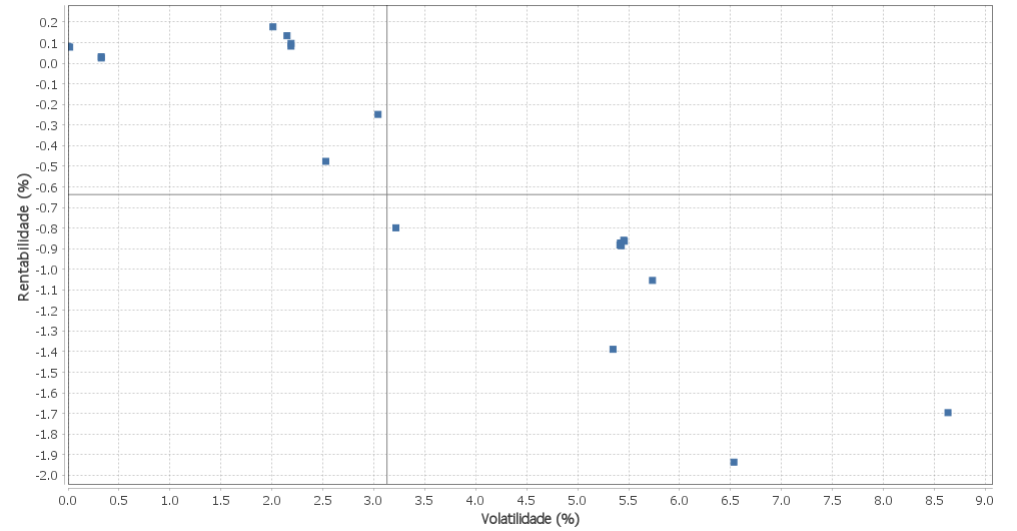
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

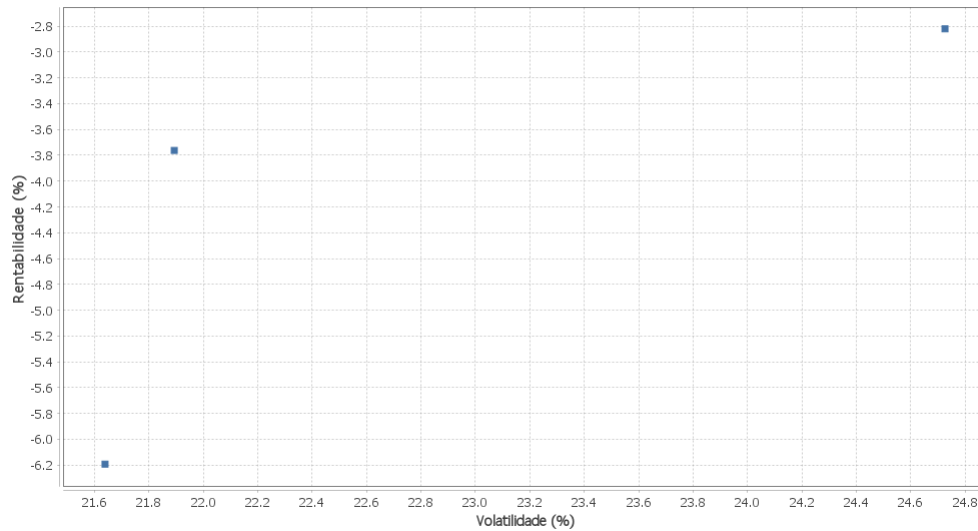
IPREMAR - No Mês



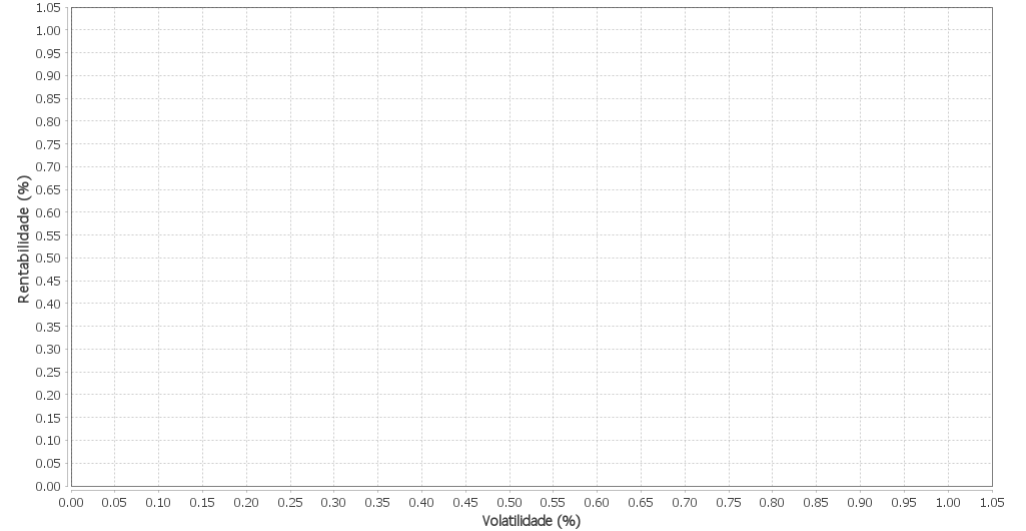
Renda Fixa - No Mês



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\$): 2.553.489,17

Value-At-Risk: 2,70%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	-164,63	0,08	514.069,33	0,54
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,06	0,00	-4,39	0,08	947.574,80	1,00
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,19	0,00	-0,36	0,03	363.189,87	0,38
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,15	0,00	-0,38	0,03	3.189.315,44	3,37
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,08	0,05	0,01	0,18	5.321.855,86	5,63
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,15	1,17	0,03	-0,01	0,13	2.812.619,15	2,97
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	1,23	0,12	-0,03	0,08	10.983.723,01	11,62
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	1,22	0,03	-0,02	0,10	2.324.775,35	2,46
BANRISUL PREVIDENCIA MUNICIPAL II FI RF LP	Artigo 7º III, Alínea a	2,53	1,08	0,01	-0,25	-0,48	1.069.890,47	1,13
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	Artigo 7º IV, Alínea a	3,04	1,21	0,01	-0,13	-0,25	658.312,02	0,70
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,22	1,48	0,06	-0,29	-0,80	4.718.222,79	4,99
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,35	2,39	0,07	-0,29	-1,39	3.247.046,58	3,43
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	5,41	2,56	0,16	-0,19	-0,88	6.538.985,84	6,92
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,42	2,57	0,21	-0,19	-0,87	8.123.064,62	8,59
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	5,43	2,57	0,02	-0,19	-0,89	805.799,05	0,85
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	5,45	2,60	0,28	-0,18	-0,86	11.009.797,35	11,64
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,46	2,56	0,12	-0,19	-0,86	4.856.429,36	5,14
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	5,73	2,78	0,03	-0,21	-1,05	1.202.108,49	1,27
SANTOS CREDIT YIELD	Artigo 7º VII, Alínea b	6,53	1,21	0,00	-0,32	-1,94	21.614,00	0,02
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	8,63	4,24	0,64	-0,21	-1,70	15.562.269,58	16,46
FIA CAIXA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	21,64	9,70	0,15	-0,29	-6,19	1.937.920,25	2,05
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,89	9,87	0,38	-0,18	-3,76	4.814.176,56	5,09
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	24,73	11,58	0,33	-0,12	-2,82	3.522.654,28	3,73