



LDB
EMPRESAS

GUARAPARI - 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 31.12.2020.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **63,91%**

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 150850 (3,650000%)	0,45	1,47	8,22	12.591.666,52	5,97
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,45	1,47	8,22	12.591.666,52	5,97

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	181.549,46	0,09	8.554.614.280,00	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	23,39	7,94	-0,03	3.577.557,80	1,70	340.132.588,94	1,05
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,74	4,84	6,14	6.554.512,32	3,11	8.693.778.987,76	0,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,80	4,84	6,06	5.992.949,37	2,84	6.193.173.925,17	0,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,55	0,28	3,63	18.113.571,55	8,59	16.753.976.831,37	0,11
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,80	7,56	5,23	9.802.668,47	4,65	1.733.830.686,04	0,57
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9,03	2,12	6,10	0,00	0,00	2.814.559.159,07	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,13	1,65	8,03	10.706.584,55	5,08	10.655.087.063,09	0,10
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,27	2,38	5,09	14.312.086,17	6,79	9.568.490.825,39	0,15
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	1,32	6,66	35.459.935,39	16,82	14.722.139.597,34	0,24
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,67	2,50	5,80	104.701.415,08	49,66		

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	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,76	2,59	1,70	14.629.912,77	6,94	182.273.194,76	8,03
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,76	2,59	1,70	14.629.912,77	6,94		

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

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 IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	8,17	1,78	7,59	2.812.323,00	1,33	199.070.839,42	1,41
		Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b	8,17	1,78	7,59	2.812.323,00	1,33		
		Renda Fixa	5,68	2,40	5,75	134.735.317,37	63,91		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

29,34%

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	45,32	8,75	2,28	6.155.270,90	2,92	1.245.394.762,64	0,49
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVSPA	44,01	9,08	2,57	11.882.149,44	5,64	132.435.308,61	8,97
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			44,35	8,97	2,43	18.037.420,34	8,56		

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 ENERGIA FI	37,06	7,28	1,64	6.124.205,72	2,90	480.379.636,09	1,27
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	39,21	7,67	-7,93	1.646.389,81	0,78	1.054.907.075,55	0,16
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	61,87	4,44	-25,50	356.419,04	0,17	520.897.190,09	0,07
CEF	CEF	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	47,74	8,33	-1,91	448.099,94	0,21	571.375.619,27	0,08
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	41,94	9,08	2,38	9.286.712,02	4,40	756.510.912,48	1,23
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	46,28	4,89	-5,07	430.187,72	0,20	773.737.678,54	0,06
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	45,87	5,18	7,76	10.653.514,04	5,05	191.546.487,48	5,56
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	43,70	8,92	-1,80	2.526.170,42	1,20	476.437.296,22	0,53
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	42,17	10,72	5,98	6.403.765,70	3,04	1.169.052.019,30	0,55
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,92	9,37	3,05	4.364.727,86	2,07	1.002.176.394,28	0,44
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			41,14	8,02	2,24	42.240.192,27	20,04		

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	CXCE11B	23,50	-2,55	-0,48	1.042.200,00	0,49	138.737.491,56	0,75
RIO BRAVO	VOTORANTIM	RBRD11	63,55	-6,38	-6,25	532.461,78	0,25	147.686.865,84	0,36
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			145,45	-3,88	-3,10	1.574.661,78	0,75		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

38,22

7,95

2,94

61.852.274,39

29,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,75%

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	8.859.489,53	4,20	1.987.917.698,76	0,45
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	29,10	0,59	47,07	5.376.848,41	2,55	528.483.255,80	1,02
Sub-total Artigo 9º A, III			29,23	0,66	51,76	14.236.337,94	6,75		
Investimentos no Exterior			29,23	0,66	51,76	14.236.337,94	6,75		
Total			13,54	3,83	7,06	210.823.929,70	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			ALM	Limite Legal
				Mínimo	Objetivo	Máximo		
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	12.591.666,52	5,97	0,00	6,69	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	104.701.415,08	49,66	0,00	38,65	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	14.629.912,77	6,94	0,00	18,65	40,00	0,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.812.323,00	1,33	0,00	1,39	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	134.735.317,37	63,91					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	18.037.420,34	8,56	0,00	2,39	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	42.240.192,27	20,04	0,00	18,97	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.574.661,78	0,75	0,00	0,74	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	61.852.274,39	29,34					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	14.236.337,94	6,75	0,00	5,14	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	14.236.337,94	6,75					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	1,47 896,65	8,22 298,05	3,72 788,31	5,71 579,28	8,22 298,05	182.973,47	967.765,73
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	2,50 1.523,19	5,80 210,30	3,67 778,48	4,02 407,35	5,80 210,30	2.593.768,86	5.943.791,00
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	2,59 1.573,55	1,70 61,66	3,39 718,02	3,05 309,12	1,70 61,66	369.034,15	317.696,17
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	1,78 1.081,67	7,59 275,09	2,87 609,39	3,90 395,30	7,59 275,09	49.152,00	198.309,00
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,97 -0,33	2,43 -0,49	24,94 -0,87	24,37 -0,84	2,43 -0,49	1.484.594,78	563.779,35
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,02 -1,28	2,24 -0,67	20,96 -4,85	20,76 -4,44	2,24 -0,67	3.115.778,93	1.296.022,06
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,00 -9,30	0,91 -2,01	-0,50 -26,31	-0,87 -26,08	0,91 -2,01	0,00	25.991,63
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-3,88 -13,17	-3,10 -6,02	9,27 -16,53	3,62 -21,59	-3,10 -6,02	-63.463,40	-74.736,94
Artigo 9º A, III % do CDI	0,66 398,54	51,76 1.877,00	1,08 228,94	15,43 1.564,90	51,76 1.877,00	92.697,96	4.855.771,64
GUARAPARI - CONSOLIDADO (Total)						7.824.536,75	14.094.389,64

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150850 (3,650000%)	12.408.693,05	0,00	0,00	0,00	12.591.666,52	182.973,47	967.765,73
					12.591.666,52	0,00	0,00

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	3.314.356,94	0,00	0,00	0,00	3.577.557,80	263.200,86	117.593,25
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	13.979.509,34	0,00	0,00	0,00	14.312.086,17	332.576,83	693.186,82

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	7.203.400,75	0,00	-972.050,00	0,00	6.554.512,32	323.161,57	416.169,52
BB PREV RF IRF-M	178.051,75	0,00	0,00	0,00	181.549,46	3.497,71	128.652,47
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.532.517,53	0,00	0,00	0,00	10.706.584,55	174.067,02	795.992,73
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.113.422,21	0,00	0,00	0,00	9.802.668,47	689.246,26	487.486,32
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.716.256,84	0,00	0,00	0,00	5.992.949,37	276.692,53	342.521,64
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.202.710,15	0,00	-140.813,35	0,00	18.113.571,55	51.674,75	618.964,72
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	494.036,82	0,00	-504.515,66	0,00	0,00	10.478,84	29.515,66
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	35.785.767,11	0,00	-795.004,21	0,00	35.459.935,39	469.172,49	2.311.807,64
					104.701.415,08	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	14.260.878,62	0,00	0,00	0,00	14.629.912,77	369.034,15	317.696,17
					14.629.912,77	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	2.763.171,00	0,00	0,00	0,00	2.812.323,00	49.152,00	198.309,00
					2.812.323,00	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	5.660.093,70	0,00	0,00	0,00	6.155.270,90	495.177,20	266.322,11
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVSPA	10.892.731,86	0,00	0,00	0,00	11.882.149,44	989.417,58	297.457,24
					18.037.420,34	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\$)
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	9.074.417,69	1.075.811,49	0,00	0,00	10.653.514,04	503.284,86	948.364,63
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	2.319.376,18	0,00	0,00	0,00	2.526.170,42	206.794,24	-46.362,98
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1.529.146,42	0,00	0,00	0,00	1.646.389,81	117.243,39	-141.777,18
BB AÇÕES ENERGIA FI	5.708.731,58	0,00	0,00	0,00	6.124.205,72	415.474,14	98.926,55
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	5.783.805,13	0,00	0,00	0,00	6.403.765,70	619.960,57	361.346,92
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	996.609,57	0,00	-691.792,94	0,00	356.419,04	51.602,41	-308.053,89
FIA CAIXA CONSUMO	410.146,94	0,00	0,00	0,00	430.187,72	20.040,78	10.187,72
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	413.631,71	0,00	0,00	0,00	448.099,94	34.468,23	28.099,94
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	3.990.697,65	0,00	0,00	0,00	4.364.727,86	374.030,21	129.118,65
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	8.513.831,92	0,00	0,00	0,00	9.286.712,02	772.880,10	216.171,70
					42.240.192,27	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CXCE11B	1.078.500,00	0,00	0,00	0,00	9.148,30	1.042.200,00	-27.151,70	-13.411,07
RBRD11	569.092,56	0,00	0,00	0,00	319,08	532.461,78	-36.311,70	-61.325,87
						1.574.661,78	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	5.345.173,20	0,00	0,00	0,00	5.376.848,41	31.675,21	1.720.838,73
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	8.798.466,78	0,00	0,00	0,00	8.859.489,53	61.022,75	3.134.932,91
					14.236.337,94	0,00	0,00

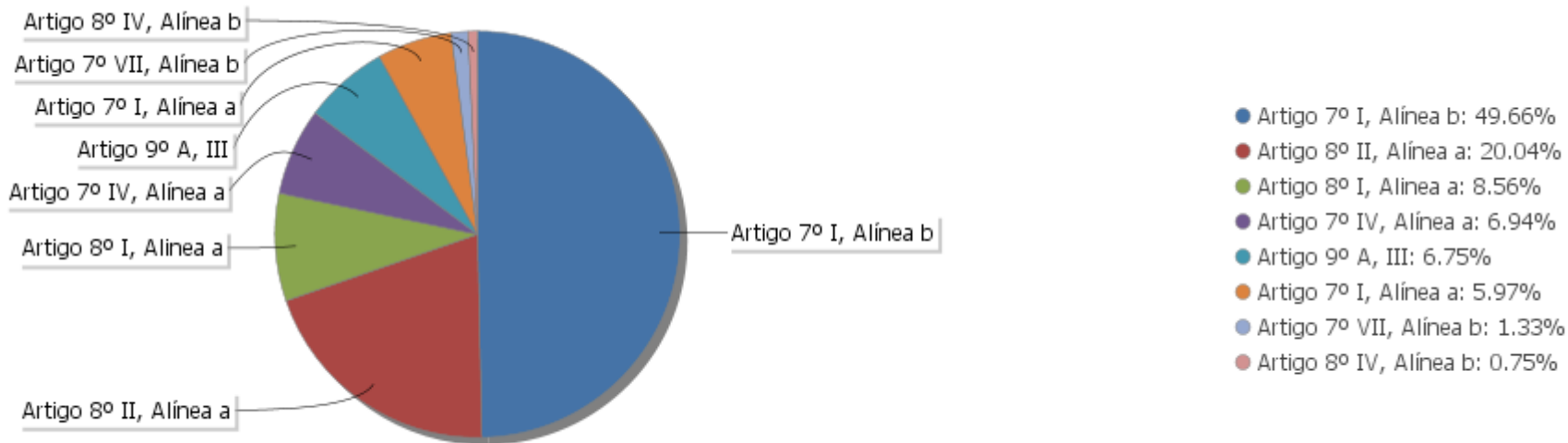
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

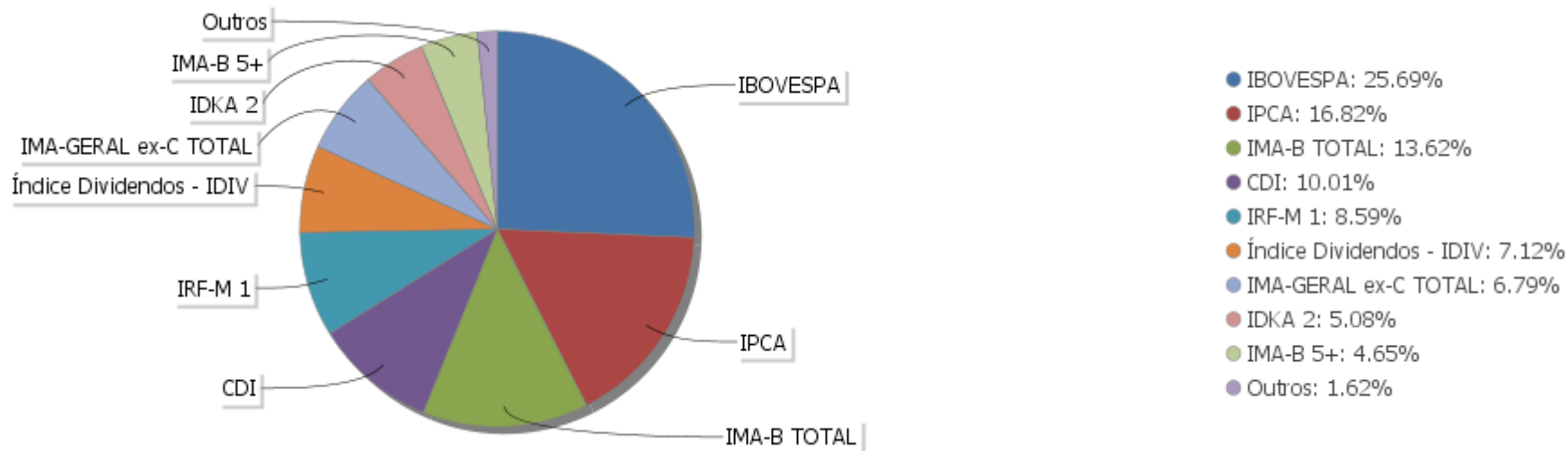
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	167.523.543,56	79,46	167.523.543,56	79,46
de 31 a 365 dias	30.708.719,62	14,57	198.232.263,18	94,03
acima de 365 dias	12.591.666,52	5,97	210.823.929,70	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

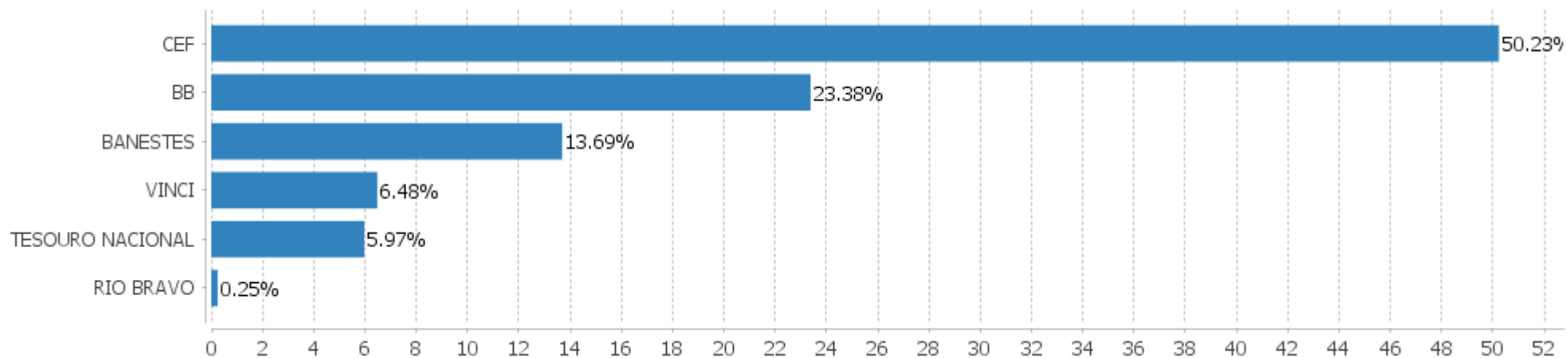


Alocação Por Estratégia



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
2020	0,77	-2,12	-9,27	3,74	2,00	3,51	3,38	-0,51	-1,76	-0,15	4,27	3,83	7,06
INPC + 5,87%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,96	0,84	1,35	1,37	1,41	1,97	11,61
p.p. indexador	0,08	-2,70	-9,95	3,52	1,79	2,73	2,41	-1,35	-3,12	-1,52	2,86	1,87	-4,56
2019	2,55	0,43	0,66	1,14	1,49	2,59	1,23	0,29	2,11	1,83	0,00	3,04	18,74
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	1,68	-0,58	-0,56	0,05	0,83	2,14	0,60	-0,34	1,67	1,25	-1,00	1,32	7,97
2018	1,29	0,58	1,16	0,41	-1,31	0,30	1,07	-0,09	0,62	2,66	1,08	0,41	8,45
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	0,55	-0,02	0,61	-0,29	-2,22	-1,62	0,30	-0,63	-0,12	1,75	0,86	-0,19	-1,14
2017	1,21	1,17	1,22	0,80	-0,24	1,39	1,86	1,05	1,01	0,45	0,10	0,85	11,41
INPC + 6,00%	0,93	0,66	0,85	0,50	0,87	0,19	0,66	0,50	0,44	0,86	0,64	0,72	8,12
p.p. indexador	0,28	0,51	0,36	0,30	-1,11	1,21	1,20	0,55	0,56	-0,41	-0,54	0,13	3,30

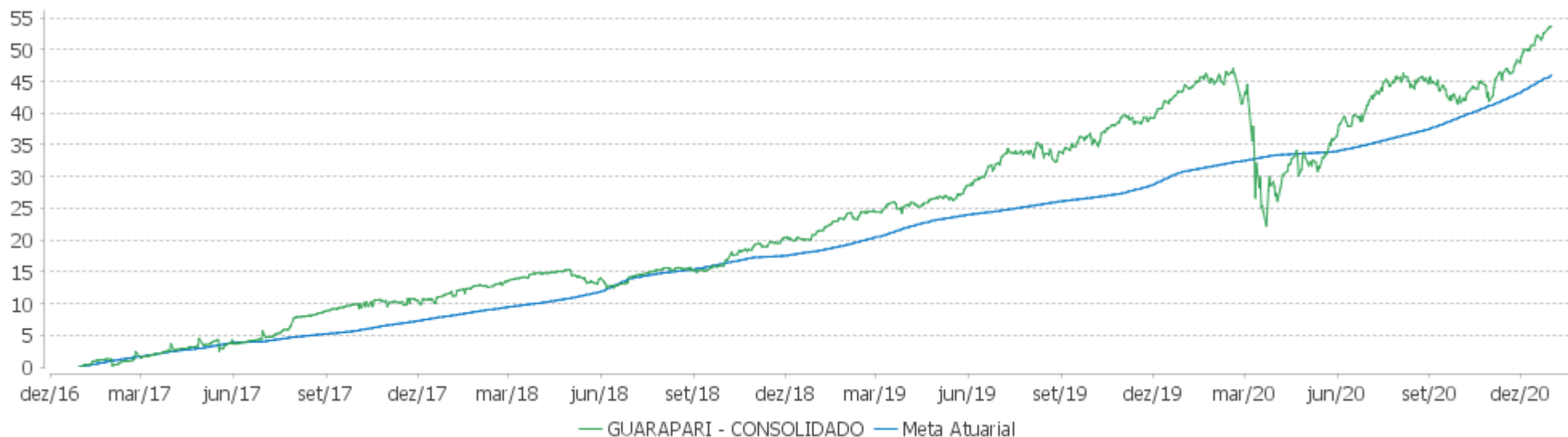
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

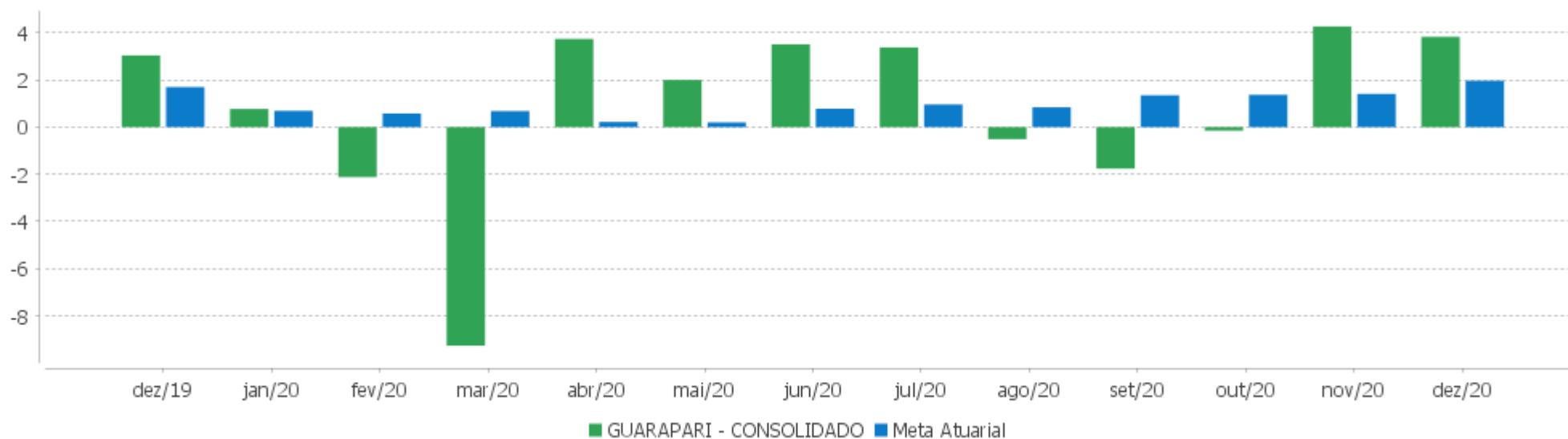
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	29	60,42	03 meses	8,10	4,82	3,28	6,23
Meses abaixo - Meta Atuarial	19	39,58	06 meses	9,22	8,16	1,06	6,52
			12 meses	7,06	11,61	-4,56	13,54
			24 meses	27,12	23,64	3,48	10,04
Maior rentabilidade da Carteira	4,27	2020-11	36 meses	37,86	35,50	2,37	8,37
Menor rentabilidade da Carteira	-9,27	2020-03	48 meses	53,59	46,49	7,10	7,67
			Desde 30/12/2016	53,59	46,49	7,10	7,67

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
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	
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,78 -0,09	7,59 -3,18	2,87 -1,77	3,90 -3,65	7,59 -3,18	25,32 2,83	35,01 0,37
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP 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
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
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
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 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 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
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
NTN-B 150850 (3,650000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,47 -3,38	8,22 1,81	3,72 -3,46	5,71 -2,49	8,22 1,81	11,74 -19,08	
CXCE11B Var. IBOVESPA p.p.	-2,55 -11,84	-0,48 -3,40	5,25 -20,56	8,36 -16,85	-0,48 -3,40	28,79 -6,63	35,87 -19,91
RBRD11 Var. IBOVESPA p.p.	-6,38 -15,68	-6,25 -9,17	18,26 -7,55	-5,34 -30,55	-6,25 -9,17	17,30 -18,12	44,23 -11,55
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	5,18 -3,76	7,76 8,76	12,31 -13,13	17,59 -3,70	7,76 8,76	49,95 6,24	81,31 14,67
BB AÇÕES ENERGIA FI	7,28	1,64	20,72	15,93	1,64	52,37	107,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	4.425,53	59,53	4.392,80	1.615,82	59,53	589,62	676,49
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	4,89 -0,11	-0,57 -1,38	10,55 -0,56	12,11 -1,03	-0,57 -1,38	54,54 -1,97	35,14 -6,38
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA Var. IBOVESPA p.p.	8,33 -0,96	0,56 -2,36	20,94 -4,87	19,91 -5,30	0,56 -2,36	55,18 19,76	73,78 18,00
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,92 -0,38	-1,80 -4,72	25,24 -0,57	24,47 -0,74	-1,80 -4,72	29,58 -5,84	50,56 -5,21
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	9,08 -0,22	2,38 -0,53	21,02 -4,79	21,77 -3,44	2,38 -0,53	54,11 18,69	78,18 22,40
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	9,37 0,43	3,05 4,05	25,03 -0,40	23,84 2,55	3,05 4,05	46,40 2,69	62,13 -4,50
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL % do CDI	4,44 2.699,58	-25,50 -924,62	18,21 3.861,88	6,89 698,27	-25,50 -924,62	24,73 278,40	30,83 194,22
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	7,67 -1,63	-7,93 -10,84	20,55 -5,26	18,48 -6,73	-7,93 -10,84	18,36 -17,06	38,53 -17,24
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	10,72 1,42	5,98 3,06	32,39 6,59	29,35 4,14	5,98 3,06	49,89 14,47	
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	9,08 -0,21	2,57 -0,35	25,22 -0,59	24,65 -0,56	2,57 -0,35	33,93 -1,49	53,25 -2,52
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	8,75 -0,55	2,28 -0,64	24,40 -1,41	23,91 -1,29	2,28 -0,64	36,95 1,53	55,64 -0,14
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	0,69 -8,60	54,76 51,85	1,31 -24,49	16,49 -8,72	54,76 51,85	108,09 72,67	129,28 73,50
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	0,59 -8,70	47,07 44,15	0,70 -25,11	13,73 -11,48	47,07 44,15	91,49 56,07	110,89 55,11
GUARAPARI - CONSOLIDADO Var. INPC + 5,87% p.p.	3,83 1,87	7,06 -4,56	8,10 3,28	9,22 1,06	7,06 -4,56	27,12 3,63	37,86 2,70
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 + 6,00%	1,98	11,75	4,85	8,23	11,75	23,79	35,66
IPCA + 6,00%	1,87	10,76	4,64	7,55	10,76	22,49	34,64

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	0,31	3,84	0,70	1,21	3,84	10,86	18,59	31,78	51,17
IRF-M 1+	3,05	8,45	2,90	2,29	8,45	23,90	39,09	62,28	110,38
IRF-M TOTAL	1,95	6,69	1,99	1,75	6,69	19,53	32,36	52,47	88,11
IMA-B 5	1,83	8,04	3,38	4,72	8,04	22,25	34,31	51,20	74,61
IMA-B 5+	7,51	5,50	10,53	11,36	5,50	37,54	58,72	78,96	134,51
IMA-B TOTAL	4,85	6,41	7,18	8,21	6,41	30,83	47,91	66,83	108,23
IMA-GERAL ex-C TOTAL	2,12	4,85	2,83	3,09	4,85	18,09	29,65	46,36	77,22
IMA-GERAL TOTAL	2,02	5,34	2,86	3,40	5,34	18,84	30,77	47,53	78,50
IDKA 2	1,73	8,62	3,05	5,10	8,62	21,46	33,31	51,45	74,50
IDKA 20	11,36	2,20	15,90	16,58	2,20	47,44	77,53	99,14	205,07
CDI	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87	27,37	45,21

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78	97,61	174,56
IBRX 100	9,15	3,50	25,34	25,28	3,50	38,06	59,35	103,24	177,83
IBRX 50	9,42	3,62	26,47	26,00	3,62	33,83	53,28	94,38	165,96
SMALL CAP	7,52	-0,65	22,54	25,33	-0,65	57,16	69,94	153,81	234,41
IFIX	2,19	-10,24	2,69	2,28	-10,24	22,05	28,91	53,93	103,70
Índice Consumo - ICON	5,00	0,81	11,11	13,14	0,81	56,51	41,53	88,43	113,36
Índice Dividendos - IDIV	8,94	-1,00	25,44	21,29	-1,00	43,71	66,63	108,79	235,09

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	1,35	4,52	3,13	4,42	4,52	9,02	13,10	16,43	23,76
INPC	1,46	5,45	3,34	5,07	5,45	10,17	13,96	16,31	23,97
IGPM	0,96	23,14	7,64	17,96	23,14	32,13	42,09	41,35	51,49
SELIC	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,88	27,40	45,26

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,70	8,68	4,15	6,52	8,68	17,91	27,18	36,11	50,43
IPCA + 5,00%	1,78	9,72	4,40	7,03	9,72	20,19	30,88	41,39	57,76
IPCA + 5,50%	1,82	10,24	4,52	7,29	10,24	21,34	32,75	44,09	61,54
IPCA + 5,89%	1,86	10,65	4,62	7,49	10,65	22,24	34,23	46,22	64,53
IPCA + 6,00%	1,87	10,76	4,64	7,55	10,76	22,49	34,64	46,83	65,38
INPC + 4,00%	1,81	9,65	4,35	7,18	9,65	19,16	28,15	35,96	50,68
INPC + 6,00%	1,98	11,75	4,85	8,23	11,75	23,79	35,66	46,67	65,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

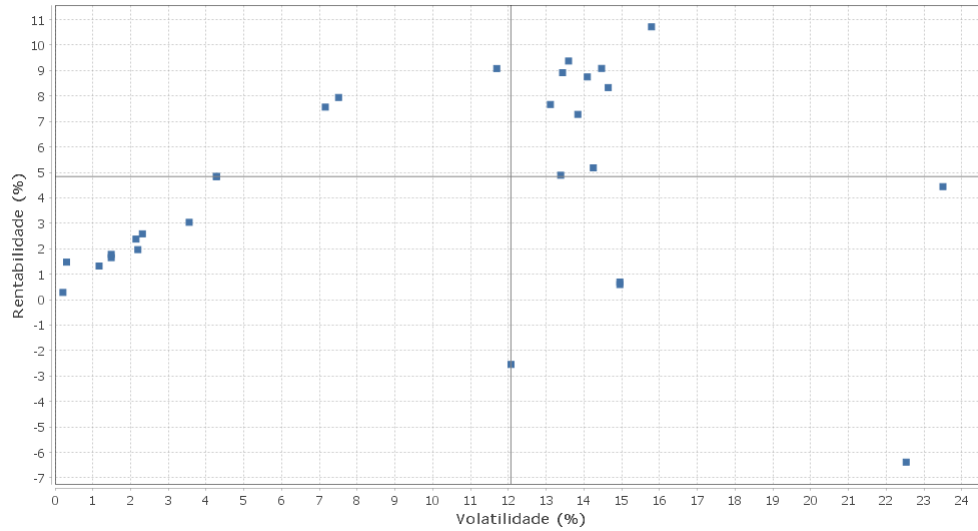
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
124	01/12/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	30.000,00	20.025,28526019	1,4981060000
128	01/12/2020	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	487.000,00	77.462,80276400	6,2868884500
155	02/12/2020	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	0,00	363.277,75	208.245,69660200	1,7444670000
156	02/12/2020	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	0,00	328.515,19	188.318,37460955	1,7444670000
127	04/12/2020	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	1.075.811,49	0,00	424.973,66923581	2,5314779900
126	15/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	140.813,35	53.948,27127125	2,6101550000
125	16/12/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	765.004,21	507.218,85146393	1,5082330000
132	16/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	504.515,66	196.604,88515825	2,5661400000
129	21/12/2020	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	485.050,00	74.986,76380000	6,4684749070
Total						

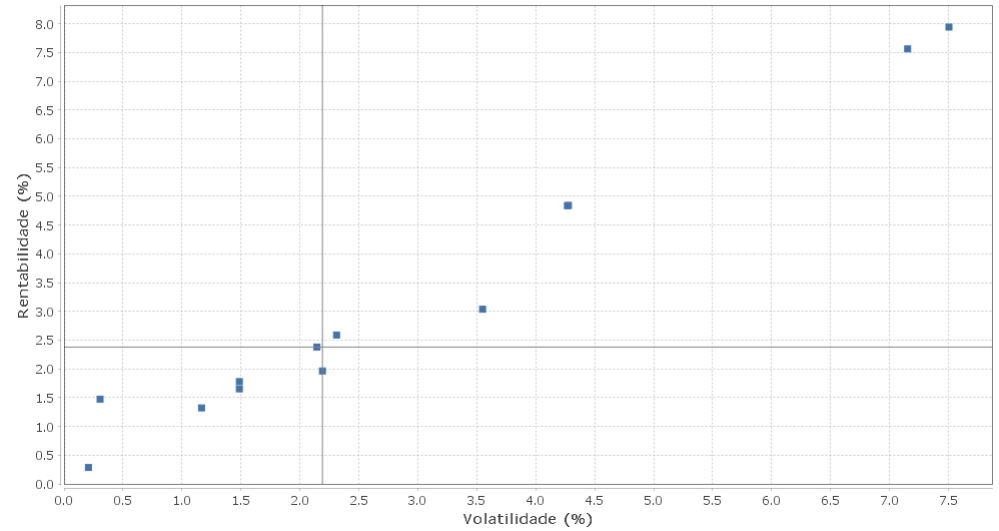
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

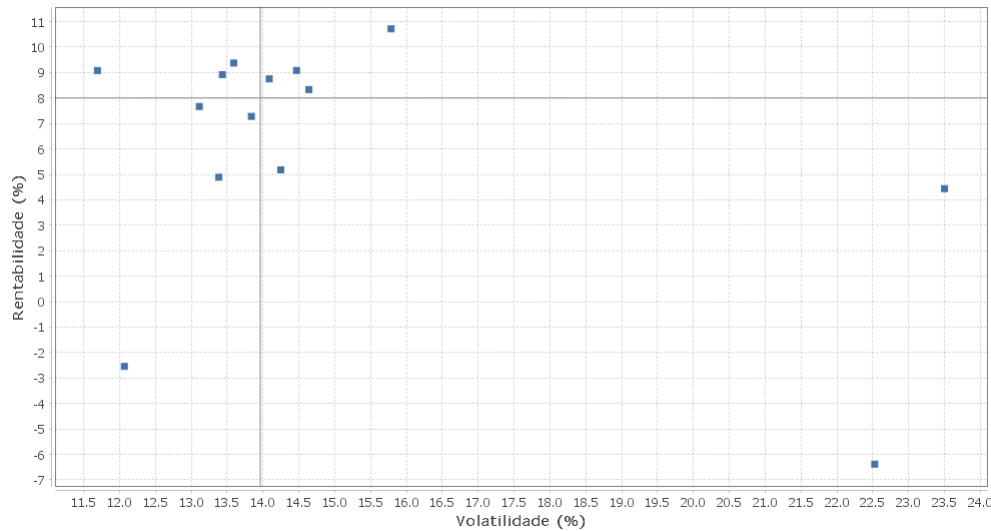
GUARAPARI - CONSOLIDADO - No Mês



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\$): 7.552.418,50

Value-At-Risk: 3,58%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,21	0,15	0,01	0,58	0,28	18.113.571,55	8,59
NTN-B 150850 (3,650000%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,31	0,19	0,00	4,28	1,47	12.591.666,52	5,97
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,17	1,25	0,14	0,99	1,32	35.459.935,39	16,82
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	Artigo 7º VII, Alínea b	1,49	1,75	0,01	1,09	1,78	2.812.323,00	1,33
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,49	1,10	0,03	1,00	1,65	10.706.584,55	5,08
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,14	1,33	0,06	1,03	2,38	14.312.086,17	6,79
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	1,39	0,00	0,82	1,96	181.549,46	0,09
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	2,31	1,30	0,02	1,05	2,59	14.629.912,77	6,94
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,55	NaN	0,00	0,81	3,04	0,00	0,00
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,27	2,56	0,05	1,09	4,84	6.554.512,32	3,11
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,28	2,57	0,05	1,09	4,84	5.992.949,37	2,84
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,15	4,57	0,14	1,03	7,56	9.802.668,47	4,65
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	7,50	4,72	0,01	1,04	7,94	3.577.557,80	1,70
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	11,69	12,04	0,49	0,76	9,08	9.286.712,02	4,40
CXCE11B	Artigo 8º IV, Alínea b	12,07	3,34	-0,00	-0,22	-2,55	1.042.200,00	0,49
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	13,11	9,98	0,07	0,57	7,67	1.646.389,81	0,78
FIA CAIXA CONSUMO	Artigo 8º II, Alínea a	13,38	9,90	0,02	0,35	4,89	430.187,72	0,20
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	13,43	10,84	0,12	0,65	8,92	2.526.170,42	1,20
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	13,59	9,81	0,19	0,68	9,37	4.364.727,86	2,07
BB AÇÕES ENERGIA FI	Artigo 8º II, Alínea a	13,84	9,02	0,22	0,51	7,28	6.124.205,72	2,90
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	14,09	10,65	0,30	0,61	8,75	6.155.270,90	2,92
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	14,25	10,20	0,47	0,35	5,18	10.653.514,04	5,05
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	14,47	11,36	0,61	0,62	9,08	11.882.149,44	5,64
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	Artigo 8º II, Alínea a	14,64	12,08	0,02	0,56	8,33	448.099,94	0,21
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	14,95	12,38	0,09	0,03	0,59	5.376.848,41	2,55
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	14,95	12,70	0,16	0,04	0,69	8.859.489,53	4,20
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,79	10,09	0,28	0,67	10,72	6.403.765,70	3,04
RBRD11	Artigo 8º IV, Alínea b	22,53	0,29	-0,00	-0,29	-6,38	532.461,78	0,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	Artigo 8º II, Alínea a	23,50	17,67	0,02	0,18	4,44	356.419,04	0,17