



LDB
EMPRESAS

LINHARES - PLANO PREVIDENCIÁRIO
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

RENTA FIXA 88,14%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (3,200000%)	1,98	0,07	1,44	8,16	977.265,91	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,410000%)	34,94	0,07	1,54	0,25	959.179,66	0,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		18,00	0,07	1,49	4,08	1.936.445,57	0,62

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	23,39	0,15	7,94	-0,03	35.086.585,79	11,26	340.132.588,94	10,32
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,57	0,01	0,31	3,47	14.448.693,17	4,64	8.522.749.810,66	0,17
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,74	0,06	4,84	6,14	17.822.680,82	5,72	8.693.778.987,76	0,21
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,80	0,06	4,84	6,06	18.129.626,38	5,82	6.193.173.925,17	0,29
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,55	0,01	0,28	3,63	27.005.674,61	8,66	16.753.976.831,37	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,02	0,06	1,82	7,75	9.814.244,20	3,15	20.761.505.098,56	0,05
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,20	0,05	1,53	7,92	6.463.127,22	2,07	8.476.640.994,51	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	9,03	0,02	3,04	8,22	2.294.905,68	0,74	2.814.559.159,07	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,13	0,06	1,65	8,03	9.580.788,76	3,07	10.655.087.063,09	0,09
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,23	0,05	3,24	3,70	46.978,99	0,02	941.494.565,53	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,99	0,05	1,81	7,78	6.613.072,85	2,12	4.987.516.426,31	0,13
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	4,31	0,01	1,04	6,26	16.545.889,57	5,31	196.396.914,05	8,42
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	5,22	0,06	1,82	7,48	3.111.518,12	1,00	436.337.264,96	0,71
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,27	0,03	2,38	5,09	12.925.045,63	4,15	9.568.490.825,39	0,14
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	0,03	1,32	6,66	2.449.208,03	0,79	14.722.139.597,34	0,02
BANCO DO	SANTANDER	BNB IMA-B FI RF	11,82	0,06	4,18	5,34	1.053.434,81	0,34	274.936.213,33	0,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
NORDESTE										
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,32	0,06	3,14	4,55	183.391.474,63	58,83		
Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)										
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	5,90	0,04	2,70	4,23	5.774.235,17	1,85	2.667.113.282,02	0,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,50	0,01	0,25	2,46	1.141.667,79	0,37	3.745.587.728,16	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,37	0,01	0,36	2,42	10.260.201,62	3,29	4.230.515.183,84	0,24
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	26,62	0,22	8,08	-0,74	16.265.765,77	5,22	333.587.129,64	4,88
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,23	0,01	0,25	2,40	24.636.214,07	7,90	2.596.482.307,62	0,95
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,93	0,01	0,27	-0,22	19.071.200,64	6,12	292.099.533,77	6,53
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,76	0,07	2,59	1,70	11.765.240,19	3,77	182.273.194,76	6,45
BANCO DO NORDESTE	SANTANDER	BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,48	0,01	0,33	0,34	501.695,18	0,16	999.931.680,61	0,05
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			4,74	0,06	2,08	1,32	89.416.220,43	28,68		
Renda Fixa			5,44	0,06	2,78	3,47	274.744.140,63	88,14		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

11,86%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	46,26	-0,01	10,42	21,39	3.367.371,46	1,08	589.515.875,21	0,57
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	40,03	-0,01	7,66	-6,94	1.826.072,29	0,59	330.464.053,69	0,55
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,92	-0,01	9,37	3,05	17.793.885,55	5,71	1.002.176.394,28	1,78
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	45,87	-0,01	5,18	7,76	8.060.620,15	2,59	191.546.487,48	4,21
BANESTES	BANESTES	BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	20,48	-0,01	5,93	8,38	1.033.663,87	0,33	18.466.612,62	5,60
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			40,68	-0,01	8,20	3,62	32.081.613,32	10,29		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO	3,52	0,01	1,34	0,60	2.011.968,43	0,65	112.070.807,63	1,80
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	13,02	0,01	2,56	2,52	2.884.044,63	0,93	2.230.099.214,70	0,13
Sub-total Artigo 8º III			12,82	0,01	2,05	1,32	4.896.013,06	1,57		

Renda Variável

37,37 -0,01 7,31 2,79 36.977.626,38 11,86

Total

6,58 0,05 3,27 3,46 311.721.767,01 100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	1.936.445,57	0,62	0,00	3,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	183.391.474,63	58,83	0,00	53,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	89.416.220,43	28,68	0,00	20,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	274.744.140,63	88,14					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	32.081.613,32	10,29	0,00	14,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	4.896.013,06	1,57	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável	36.977.626,38	11,86					30,00
Total		311.721.767,01	100,00					

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	1,49 904,31	4,08 147,36	3,75 796,13	0,07 7,20	4,08 147,36	28.376,05	75.956,80
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	3,14 1.907,38	4,55 164,34	4,54 962,57	4,83 488,90	4,55 164,34	5.577.532,71	7.974.811,20
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	2,08 1.262,58	1,32 47,65	2,87 607,87	2,77 280,80	1,32 47,65	1.818.813,81	1.235.378,43
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,20 -1,10	3,62 0,70	21,68 -4,13	21,83 -3,38	3,62 0,70	2.277.137,22	1.189.836,69
Artigo 8º III % do CDI	2,05 1.245,55	1,32 47,83	4,46 945,24	4,57 462,85	1,32 47,83	96.807,27	81.086,27
LINHARES - PLANO PREVIDENCIÁRIO (Total)						9.798.667,06	10.557.069,39

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (3,200000%)	963.431,13	0,00	0,00	0,00	977.265,91	13.834,78	75.435,53
NTN-B 150535 (4,410000%)	944.638,39	0,00	0,00	0,00	959.179,66	14.541,27	521,27
					1.936.445,57	0,00	

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	32.505.266,39	0,00	0,00	0,00	35.086.585,79	2.581.319,40	11.123,70
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	16.375.522,01	0,00	0,00	0,00	16.545.889,57	170.367,56	928.946,14
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	12.624.700,13	0,00	0,00	0,00	12.925.045,63	300.345,50	621.240,70
BB PREV RF IDKA2	6.366.005,66	0,00	0,00	0,00	6.463.127,22	97.121,56	474.081,48
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	17.000.562,12	0,00	0,00	0,00	17.822.680,82	822.118,70	1.031.066,31
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	6.495.702,73	0,00	0,00	0,00	6.613.072,85	117.370,12	477.400,32
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	14.403.617,89	0,00	0,00	0,00	14.448.693,17	45.075,28	478.006,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	3.055.865,19	0,00	0,00	0,00	3.111.518,12	55.652,93	257.149,68
BNB IMA-B FI RF	1.011.213,79	0,00	0,00	0,00	1.053.434,81	42.221,02	53.434,81
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.425.024,86	0,00	0,00	0,00	9.580.788,76	155.763,90	712.294,21
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.638.837,10	0,00	0,00	0,00	9.814.244,20	175.407,10	705.643,66
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	17.292.587,39	0,00	0,00	0,00	18.129.626,38	837.038,99	993.351,91
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.928.998,83	0,00	0,00	0,00	27.005.674,61	76.675,78	944.770,35
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	2.227.250,76	0,00	0,00	0,00	2.294.905,68	67.654,92	174.224,05
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2.417.283,86	0,00	0,00	0,00	2.449.208,03	31.924,17	102.847,21
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	45.503,21	0,00	0,00	0,00	46.978,99	1.475,78	1.674,79
					183.391.474,63	0,00	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	11.468.466,33	0,00	0,00	0,00	11.765.240,19	296.773,86	233.855,80
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	15.049.219,66	0,00	0,00	0,00	16.265.765,77	1.216.546,11	-120.463,21
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	19.020.782,81	0,00	0,00	0,00	19.071.200,64	50.417,83	-38.684,49
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	5.622.621,28	0,00	0,00	0,00	5.774.235,17	151.613,89	216.594,30
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	24.574.383,99	0,00	0,00	0,00	24.636.214,07	61.830,08	640.478,01
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	500.038,41	0,00	0,00	0,00	501.695,18	1.656,77	1.695,18
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.223.121,95	0,00	0,00	0,00	10.260.201,62	37.079,67	274.530,71
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.138.772,19	0,00	0,00	0,00	1.141.667,79	2.895,60	27.372,13
					89.416.220,43	0,00	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	975.813,82	0,00	0,00	0,00	1.033.663,87	57.850,05	79.944,95
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	6.653.152,65	1.043.993,50	0,00	0,00	8.060.620,15	363.474,00	522.224,50
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	1.803.835,86	1.362.490,62	0,00	0,00	3.367.371,46	201.044,98	353.834,38
FIA CAIXA DIVIDENDOS	1.696.130,18	0,00	0,00	0,00	1.826.072,29	129.942,11	-136.123,77

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	16.269.059,47	0,00	0,00	0,00	17.793.885,55	1.524.826,08	369.956,63
					32.081.613,32	0,00	

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	2.740.972,68	72.925,37	0,00	0,00	2.884.044,63	70.146,58	69.117,84
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO	1.985.307,74	0,00	0,00	0,00	2.011.968,43	26.660,69	11.968,43
					4.896.013,06	0,00	

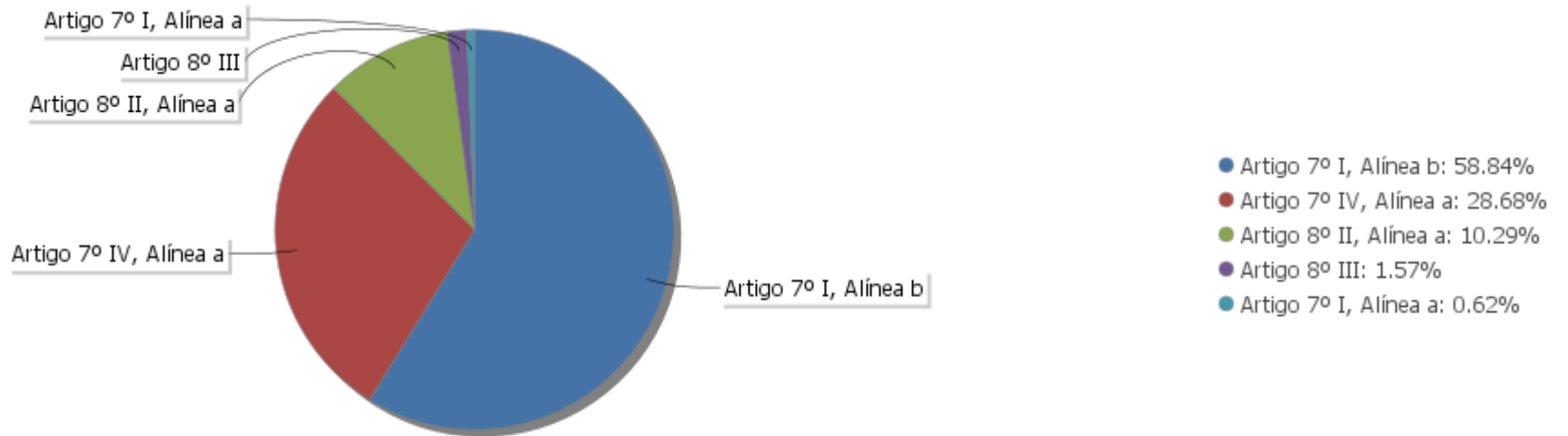
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

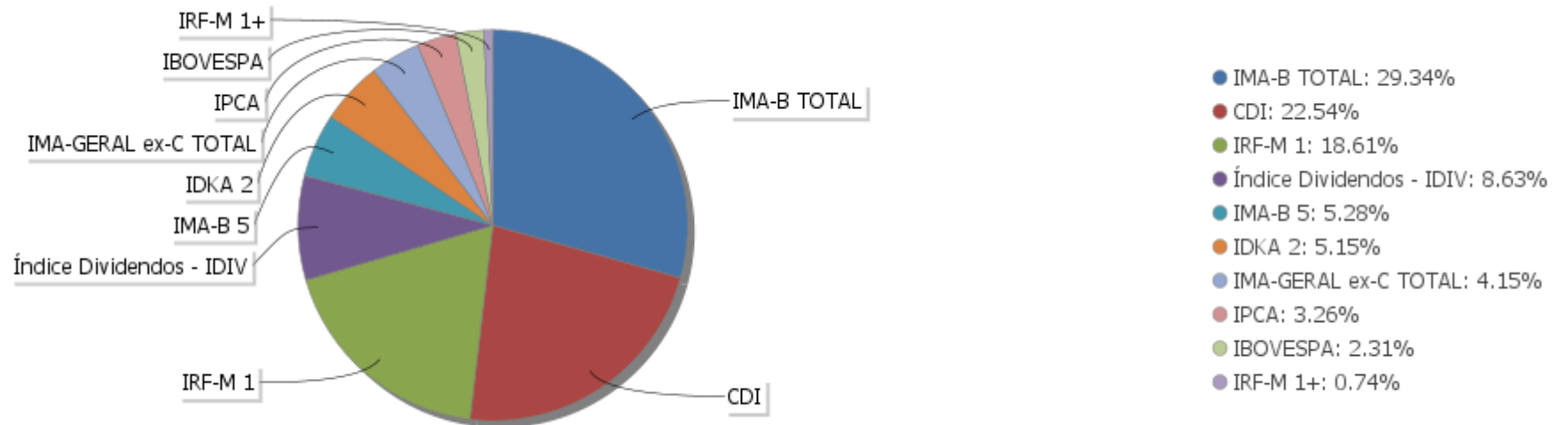
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	280.819.297,62	90,09	280.819.297,62	90,09	
de 31 dias a 365 dias	25.854.505,70	8,29	306.673.803,32	98,38	
acima de 365 dias	5.047.963,69	1,62	311.721.767,01	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

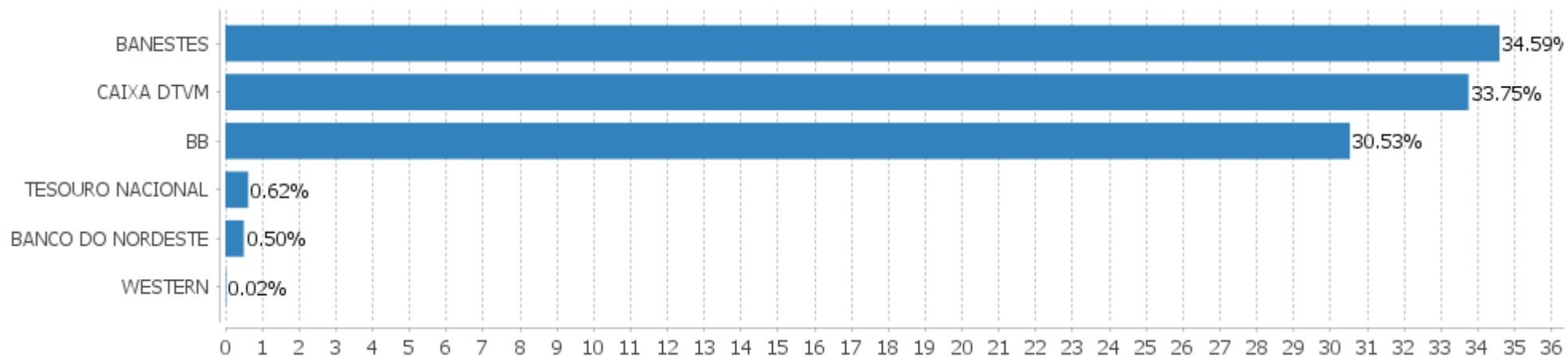


Alocação Por Estratégia



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	0,49	-0,30	-6,00	1,19	1,40	1,41	2,77	-1,09	-1,53	0,16	1,96	3,27	3,46
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	-0,21	-0,89	-6,69	0,96	1,19	0,63	1,79	-1,94	-2,89	-1,22	0,55	1,29	-8,29
2019	2,03	0,57	0,45	0,98	2,17	2,28	1,23	-0,12	1,94	2,06	-1,14	1,47	14,79
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	1,15	-0,43	-0,77	-0,11	1,51	1,83	0,60	-0,75	1,50	1,49	-2,14	-0,25	4,02
2018	3,06	0,59	0,52	0,09	-2,34	-0,08	1,29	0,01	0,40	3,08	0,67	1,06	8,56
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	2,32	-0,01	-0,04	-0,60	-3,25	-2,00	0,53	-0,53	-0,34	2,17	0,46	0,46	-1,03

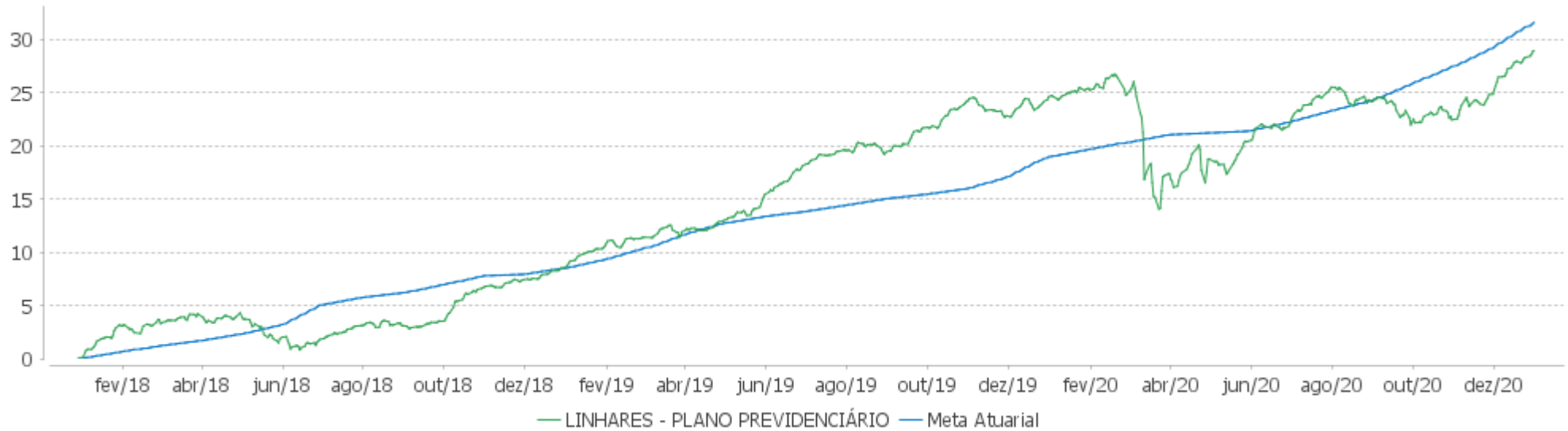
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

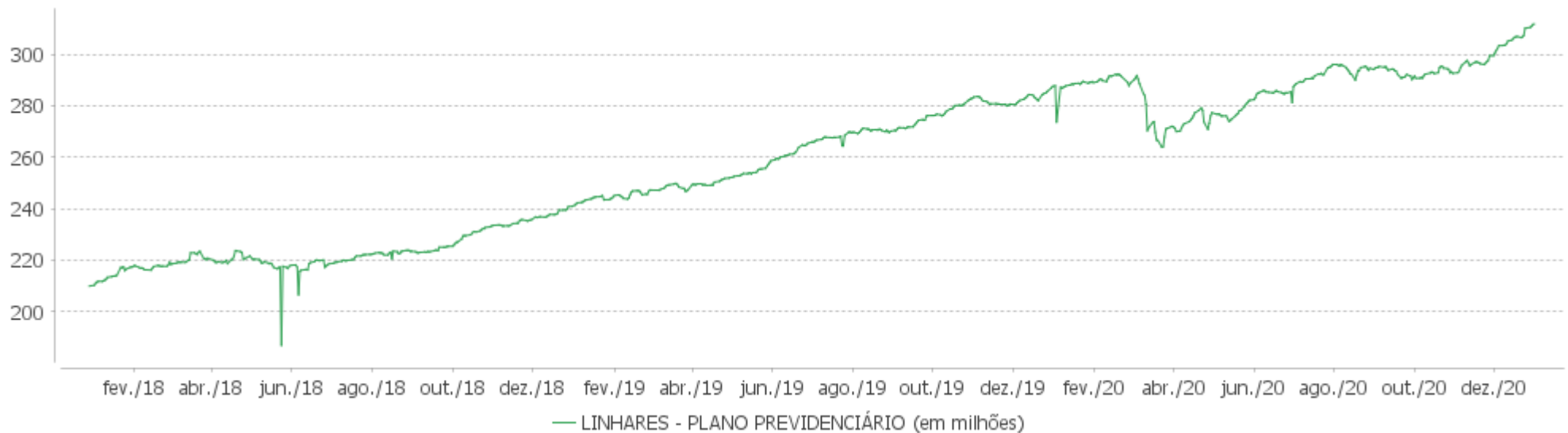
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	17	47,22	03 meses	5,47	4,85	0,62	3,06
Meses abaixo - Meta Atuarial	19	52,78	06 meses	5,57	8,23	-2,66	3,31
			12 meses	3,46	11,75	-8,29	6,58
			24 meses	18,76	23,79	-5,03	4,88
			36 meses	28,93	35,66	-6,73	4,25
Maior rentabilidade da Carteira	3,27	2020-12	Desde 29/12/2017	28,93	35,66	-6,73	4,25
Menor rentabilidade da Carteira	-6,00	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

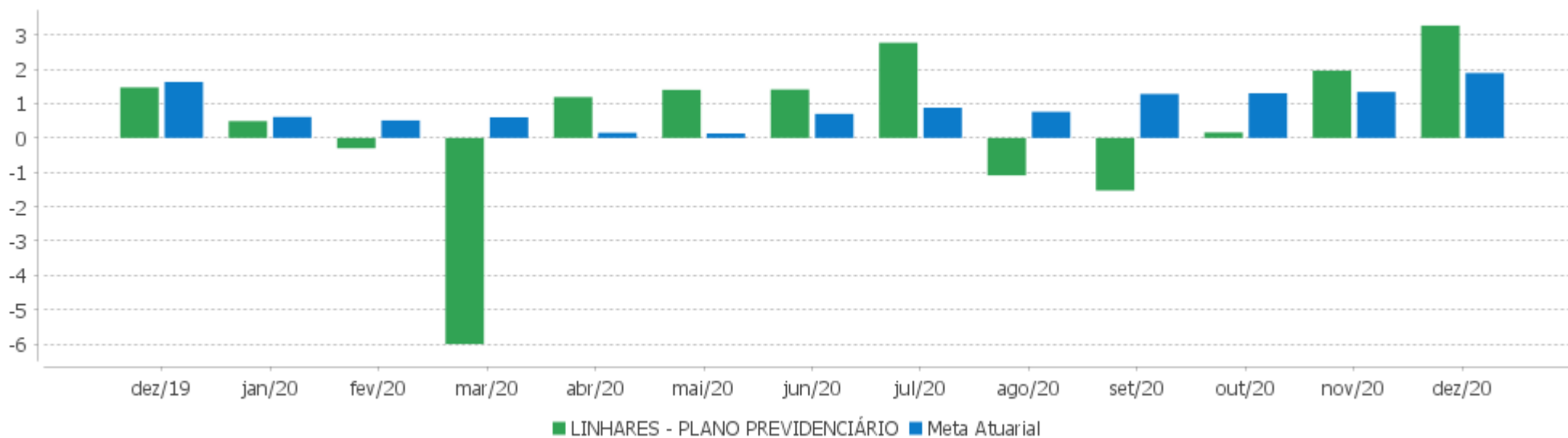


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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
NTN-B 150535 (4,410000%) Var. IPCA p.p.	1,54 0,19	0,25 -4,27	3,91 0,78	-3,98 -8,39	0,25 -4,27	18,12 9,11	
NTN-B 150535 (3,200000%) Var. IPCA p.p.	1,44 0,09	8,16 3,64	3,61 0,47	4,41 -0,01	8,16 3,64	10,47 1,45	
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
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	3,24 1,41	10,18 2,15	4,43 1,05	5,13 0,41	10,18 2,15	27,76 5,51	42,78 8,47
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
BNB IMA-B FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,18 -0,68	5,19 -1,22	6,20 -0,98	7,01 -1,20	5,19 -1,22	27,31 -3,52	42,19 -5,72
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
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,81 -0,02	7,78 -0,26	3,34 -0,05	4,56 -0,16	7,78 -0,26	21,67 -0,58	33,42 -0,90
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,82 -3,03	7,48 1,07	3,38 -3,80	4,45 -3,75	7,48 1,07	22,37 -8,46	35,35 -12,56
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS 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
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
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 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
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,84	6,14	7,13	8,03	6,14	30,17	46,78

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,27	-0,04	-0,18	-0,27	-0,66	-1,13
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,28	3,63	0,64	1,12	3,63	10,42	17,94
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,21	-0,06	-0,09	-0,21	-0,44	-0,66
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,27	-0,22	0,44	1,44	-0,22	5,55	12,17
% do CDI	161,18	-7,78	93,15	145,72	-7,78	62,36	76,58
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	8,08	-0,74	10,95	8,31	-0,74	27,78	42,31
Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,23	-7,14	3,77	0,10	-7,14	-3,05	-5,60
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,59	1,70	3,39	3,05	1,70	20,06	
% do CDI	1.573,55	61,44	718,02	308,81	61,44	225,36	
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,25	2,40	0,57	1,01	2,40	8,28	15,14
% do CDI	153,00	86,69	120,84	102,75	86,69	93,01	95,23
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,70	6,65	3,66	3,62			
Var. IPCA p.p.	1,35	2,65	0,53	-0,79			
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,25	2,46	0,46	0,62	2,46	8,52	15,22
% do CDI	154,62	88,75	98,53	62,44	88,75	95,67	95,73
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,36	2,42	0,64	1,03	2,42	8,27	15,01
% do CDI	220,55	87,27	135,47	104,61	87,27	92,90	94,46
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,33	2,29	0,59	0,73	2,29	8,21	14,66
% do CDI	201,47	82,75	125,57	74,03	82,75	92,28	92,24
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO	1,34	0,62	2,02				
Var. IBOVESPA p.p.	-7,95	-18,88	-23,79				
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	2,56	2,52	6,28	5,81	2,52	16,57	26,02
% do CDI	1.557,09	91,13	1.331,30	588,14	91,13	186,18	163,68
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 DIVIDENDOS	7,66	-6,94	25,11	17,91	-6,94	31,92	43,97
Var. IBOVESPA p.p.	-1,64	-9,85	-0,69	-7,30	-9,85	-3,50	-11,81
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	10,42	14,03	28,14	31,99	14,03		
Var. IBOVESPA p.p.	1,13	11,11	2,33	6,79	11,11		
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI 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
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	5,93	8,60	16,90				
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-3,01	-5,26	-8,54				
LINHARES - PLANO PREVIDENCIÁRIO	3,27	3,46	5,47	5,57	3,46	18,76	28,93
Var. INPC + 4,93% p.p.	1,29	-8,29	0,62	-2,66	-8,29	-5,03	-6,73
CDI	0,16	2,77	0,47	0,99	2,77	8,90	15,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
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

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du		0,50
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	D+1 du	D+0	D+30	D+34		0,00
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,15
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BNB IMA-B FI RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
FIA CAIXA DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO	D+0	D+0		D+2		
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40

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 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	2,77	0,47	0,99	2,77	8,90	15,90	27,43	45,27

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
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
Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	1,09	49,89	2,90	14,97	49,89	100,95	120,70	167,51	144,57

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	2,19	-10,24	2,69	2,28	-10,24	22,05	28,91	53,93	103,70

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	1,88	47,41	5,35	16,84	47,41	90,22	97,90	144,28	115,36

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	2,77	0,47	0,99	2,77	8,90	15,90	27,45	45,32

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
63	24/12/2020	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	1.362.490,62	0,00	514.481,25687300	2,6482803830
64	24/12/2020	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	1.043.993,50	0,00	407.247,33283908	2,5635367400
65	29/12/2020	FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	72.925,37	0,00	9.166,94057359	7,9552572000
Total			2.479.409,49	0,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.377.445,14

Value-At-Risk: 1,73%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LINHARES - PLANO PREVIDENCIÁRIO		1,73	1,73			311.721.767,01	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,18%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (3,200000%)		0,19	0,00	0,16			977.265,91	0,31
NTN-B 150535 (4,410000%)		0,19	0,00	0,16			959.179,66	0,31
Sub-total	0,31	0,19	0,00		4,32	1,49	1.936.445,57	0,62

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B		4,72	0,29	5,27			35.086.585,79	11,26
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,17	0,00	0,05			14.448.693,17	4,64
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,56	0,10	0,04			17.822.680,82	5,72
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,57	0,11	0,02			18.129.626,38	5,82
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,15	0,01	0,02			27.005.674,61	8,66
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,06	0,02	0,01			9.814.244,20	3,15
BB PREV RF IDKA2		0,94	0,01	0,37			6.463.127,22	2,07
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		2,09	0,01	0,05			2.294.905,68	0,74
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,10	0,02	0,19			9.580.788,76	3,07
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF		1,87	0,00	0,92			46.978,99	0,02
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,05	0,02	0,05			6.613.072,85	2,12
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1		0,75	0,03	0,61			16.545.889,57	5,31
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI		1,19	0,01	1,70			3.111.518,12	1,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,33	0,04	0,30			12.925.045,63	4,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,25	0,01	1,23			2.449.208,03	0,79
BNB IMA-B FI RF		2,18	0,01	0,40			1.053.434,81	0,34
Sub-total	1,90	1,33	0,69		1,57	3,14	183.391.474,63	58,83

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		1,49	0,02	1,47			5.774.235,17	1,85
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,18	0,00	0,18			1.141.667,79	0,37
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,13	0,00	0,13			10.260.201,62	3,29
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF		4,68	0,13	5,27			16.265.765,77	5,22
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,09	0,00	0,09			24.636.214,07	7,90
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI		0,09	0,00	0,09			19.071.200,64	6,12
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF		1,30	0,03	1,30			11.765.240,19	3,77
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO		0,20	0,00	0,20			501.695,18	0,16
Sub-total	1,73	1,05	0,19		1,11	2,08	89.416.220,43	28,68

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,61%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI		11,34	0,10	2,60			3.367.371,46	1,08
FIA CAIXA DIVIDENDOS		9,82	0,05	4,79			1.826.072,29	0,59
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		9,81	0,46	2,86			17.793.885,55	5,71
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL		10,20	0,19	6,30			8.060.620,15	2,59
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA		10,09	0,03	4,11			1.033.663,87	0,33
Sub-total	12,33	9,58	0,82		0,65	8,20	32.081.613,32	10,29

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III		1,90	0,01	9,66			2.011.968,43	0,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MULTIMERCADO								
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO		3,04	0,02	3,04			2.884.044,63	0,93
Sub-total	2,44	2,43	0,03		0,77	2,05	4.896.013,06	1,57