



PATO BRANCO
4º TRIMESTRE 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 08.01.2021.

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

RENTA FIXA **77,83%**

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	6,08	1,96	1,99	443.999,21	0,84	8.554.614.280,00	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,02	1,82	3,32	6.255.407,22	11,77	20.749.654.166,95	0,03
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,20	1,53	3,22	8.186.969,99	15,41	8.476.640.994,51	0,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	9,03	3,04	2,90	1.282.863,80	2,41	2.814.107.691,06	0,05
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,06	1,96	1,93	418.962,14	0,79	3.566.529.273,20	0,01
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,99	1,81	3,34	7.896.119,06	14,86	4.987.516.426,31	0,16
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,27	2,38	3,17	6.431.290,47	12,10	9.568.490.825,39	0,07
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	1,32	2,04	5.510.613,35	10,37	14.717.510.150,97	0,04
BB	BB	BB PREV IRF-M 1+	9,08	3,09	2,98	595.301,94	1,12	416.015.594,27	0,14
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,01	1,95	2,88	37.021.527,18	69,66		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	0,10	0,21	0,00	0,00	2.452.222.466,54	0,00
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,66	0,20	0,38	3.124.900,90	5,88	3.882.685.363,65	0,08
CEF	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	4,09	1,00	1,57	1.217.312,51	2,29	787.283.906,54	0,15
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,69	0,42	0,73	4.342.213,41	8,17		

Renda Fixa			5,37	1,75	2,59	41.363.740,59	77,83		
-------------------	--	--	-------------	-------------	-------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

22,17%

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	45,32	8,75	24,40	2.351.629,48	4,43	1.245.394.762,64	0,19
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	44,73	9,24	25,53	702.536,48	1,32	771.192.657,10	0,09
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			45,15	8,86	24,66	3.054.165,96	5,75		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES ENERGIA FI	37,06	7,28	20,72	2.273.998,66	4,28	480.379.636,09	0,47
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	46,28	4,90	10,61	741.623,75	1,40	429.163.439,50	0,17
CEF	CEF	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	47,74	8,33	20,94	2.078.631,00	3,91	571.375.619,27	0,36
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	44,19	6,30	19,94	572.559,21	1,08	3.595.641.284,57	0,02
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	44,68	7,99	20,38	704.028,77	1,32	1.427.692.857,60	0,05
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			41,52	7,32	19,37	6.370.841,39	11,99		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	7,86	1,70	4,23	870.289,77	1,64	4.935.289.077,51	0,02
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	1,73	1,42	1,96	1.484.171,61	2,79	74.547.462,29	1,99
Sub-total Artigo 8º III			7,73	1,56	3,23	2.354.461,38	4,43		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			40,42	6,84	18,11	11.779.468,73	22,17		
--	--	--	--------------	-------------	--------------	----------------------	--------------	--	--

Total			10,21	2,95	6,00	53.143.209,32	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 b	Fundos 100% Títulos Públicos	37.021.527,18	69,66	0,00	65,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	4.342.213,41	8,17	0,00	5,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	41.363.740,59	77,83				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alinea a	Fundos de Ações Referenciados	3.054.165,96	5,75	0,00	15,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	6.370.841,39	11,99	0,00	13,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	2.354.461,38	4,43	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	11.779.468,73	22,17				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

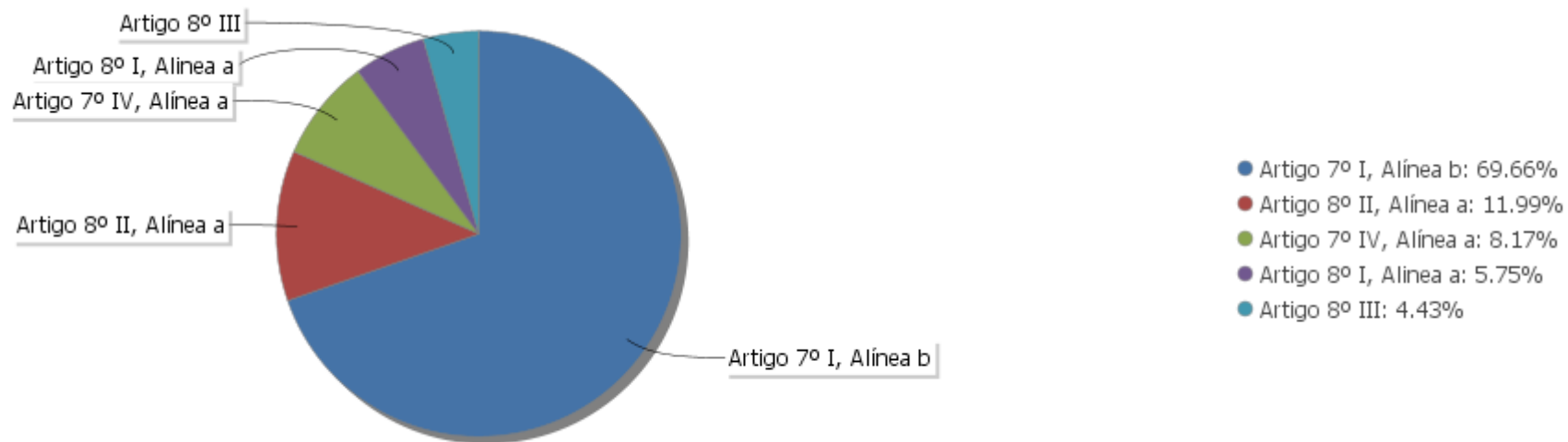
Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,95 1.183,79	2,88 610,63	2,88 610,63	3,17 321,85	6,82 247,40	569.662,95	824.488,87
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,42 256,12	0,73 154,14	0,73 154,14	0,88 89,70	3,15 114,14	18.443,16	31.773,78
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,86 -0,44	24,66 -1,15	24,66 -1,15	24,15 -1,06	2,43 -0,49	248.619,35	604.126,90
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	7,32 -1,97	19,37 -6,44	19,37 -6,44	17,62 -7,58	-2,62 -5,54	434.808,32	990.093,73
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	1,56 -7,73	3,23 -22,57	3,23 -22,57	3,72 -21,49	2,65 -0,27	25.576,91	49.830,80
PATO BRANCO CONSOLIDADO (Total)						1.297.110,69	2.500.314,08

Análise de Liquidez

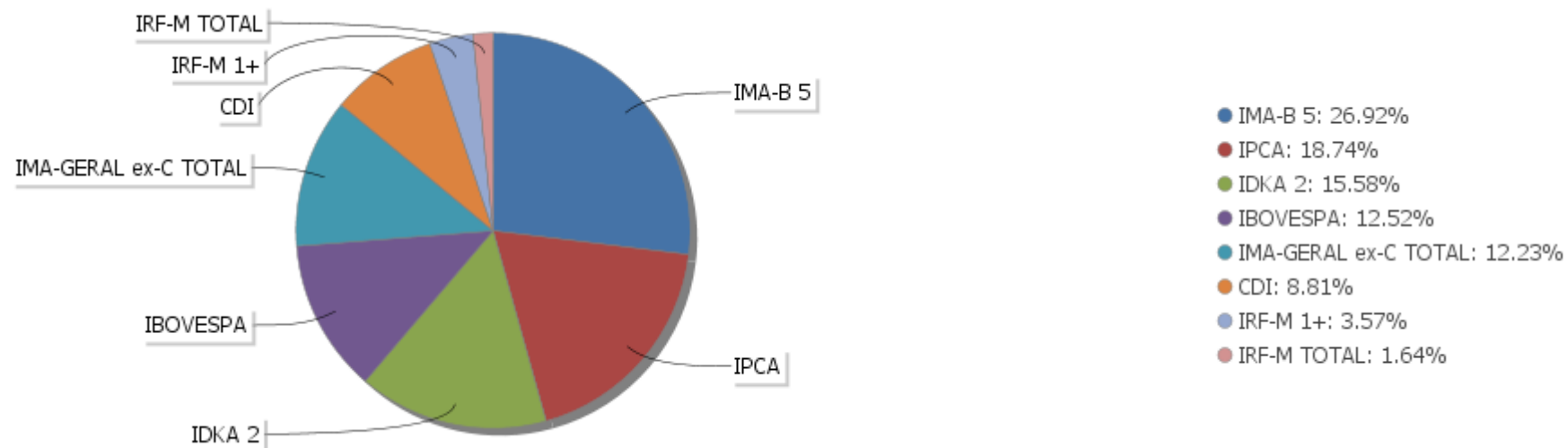
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	52.570.650,11	98,92	52.570.650,11	98,92
de 31 a 364 dias	572.559,21	1,08	53.143.209,32	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	53.143.209,32	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

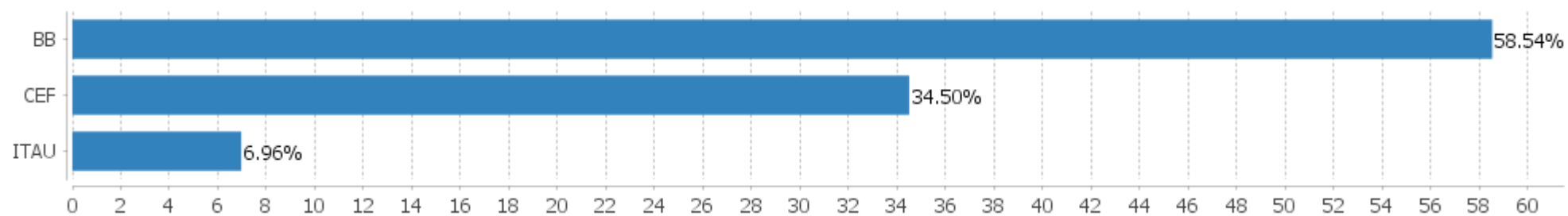


Alocação Por Estratégia



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	0,47	-0,63	-5,97	2,01	2,51	1,89	2,32	-0,99	-1,37	-0,16	3,13	2,95	5,94
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,16	9,89
p.p. indexador	-0,25	-1,29	-6,54	1,87	2,44	1,15	1,43	-1,71	-2,49	-1,50	1,78	1,78	-3,95
2019	1,43	0,31	0,54	0,84	1,61	1,98	1,00	0,11	1,77	1,74	-0,36	1,55	13,24
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	0,60	-0,58	-0,66	-0,22	0,97	1,53	0,28	-0,51	1,32	1,11	-1,33	-0,09	2,65

PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

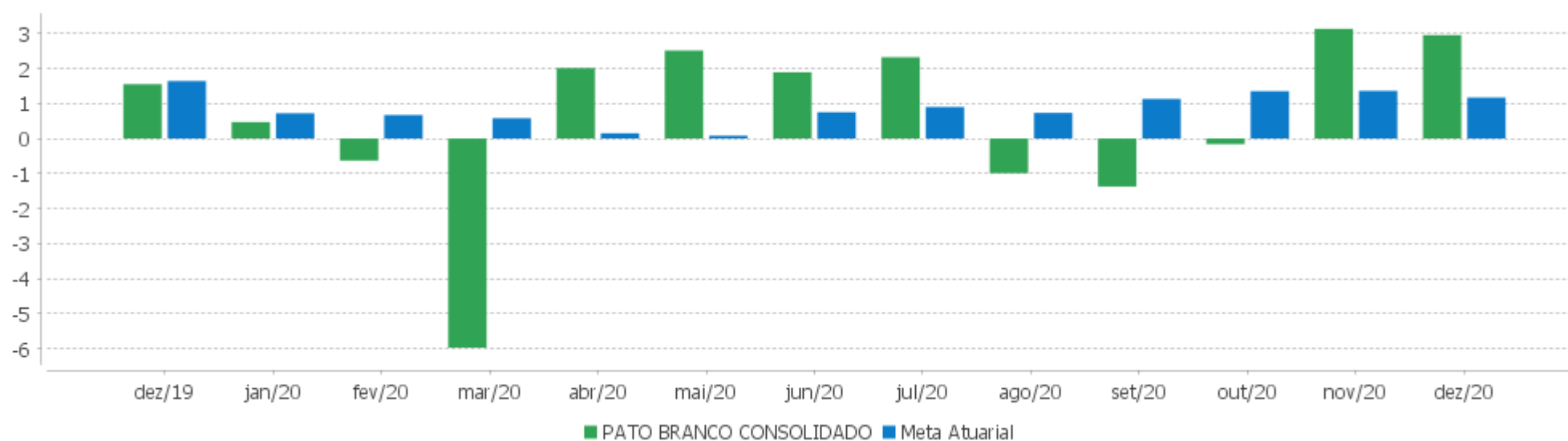
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	12	50,00	03 meses	6,00	3,91	2,09	4,69
Meses abaixo da Meta Atuarial	12	50,00	06 meses	5,92	6,76	-0,85	5,18
			12 meses	5,94	9,89	-3,95	10,21
			24 meses	19,98	21,53	-1,56	7,41
			36 meses				
Desde 31/12/2018				19,98	21,53	-1,56	7,41
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	3,13	2020-11					
Menor rentabilidade da Carteira	-5,97	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 Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,10 62,57	0,22 46,14	0,22 46,14	0,39 40,05	1,64 59,56	6,54 73,64	12,17 76,68
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,20 -0,46	0,38 -2,04	0,38 -2,04	0,58 -3,12	2,86 -0,94	15,12 6,84	24,58 12,24
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	1,00 0,34	1,57 -0,86	1,57 -0,86	1,56 -2,15			
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO Var. IRF-M 1+ p.p.	3,04 -0,01	2,90 0,01	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 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,82 -0,01	3,32 -0,06	3,32 -0,06	4,57 -0,15	7,75 -0,29	21,60 -0,65	33,35 -0,96
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,53 -0,21	3,22 0,18	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	3,17 0,34	3,17 0,34	3,28 0,19	5,09 0,24	18,83 0,74	30,59 0,94
BB PREV IRF-M 1+ Var. IRF-M 1+ p.p.	3,09 0,04	2,98 0,08	2,98 0,08	2,09 -0,19	7,81 -0,64		
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,32 0,66	2,04 -0,39	2,04 -0,39	1,95 -1,76	6,66 2,86	24,19 15,92	33,90 21,57
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,81 -0,02	3,34 -0,05	3,34 -0,05	4,56 -0,16	7,78 -0,26	21,67 -0,58	33,42 -0,90
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,96 0,01	1,99 0,00	1,99 0,00	1,64 -0,11	6,40 -0,30	18,94 -0,59	31,47 -0,89
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,96 0,01	1,93 -0,06	1,93 -0,06	1,62 -0,12	6,43 -0,26	18,87 -0,67	31,59 -0,76
BB AÇÕES ENERGIA FI % do CDI	7,28 4.425,53	20,72 4.392,80	20,72 4.392,80	15,93 1.615,82	1,64 59,53	52,37 589,62	107,38 676,49
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA Var. IBOVESPA p.p.	8,33 -0,96	20,94 -4,87	20,94 -4,87	19,91 -5,30	0,56 -2,36	55,18 19,76	73,78 18,00
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	6,30	19,94	19,94	22,34	-4,87	38,19	69,25
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	4,90 -4,39	10,61 -15,19	10,61 -15,19	11,96 -13,24	0,88 -2,04	54,61 19,19	38,37 -17,40
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	7,99 -1,31	20,38 -5,43	20,38 -5,43	18,70 -6,51	-3,46 -6,38	44,17 8,75	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI % do CDI	1,42 863,29	1,96 415,44	1,96 415,44	2,40 243,68			
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	1,70 1.034,09	4,23 897,66	4,23 897,66	4,60 465,96	3,52 127,49	22,23 250,32	33,68 212,20
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	9,24 -0,05	25,53 -0,28	25,53 -0,28	24,92 -0,29	2,75 -0,17	34,60 -0,82	54,15 -1,63
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	8,75 -0,55	24,40 -1,41	24,40 -1,41	23,91 -1,29	2,28 -0,64	36,95 1,53	55,64 -0,14
PATO BRANCO CONSOLIDADO Var. IPCA + 6% p.p.	2,95 1,77	6,00 2,07	6,00 2,07	5,92 -0,90	5,94 -4,06	19,98 -1,68	
CDI	0,16	0,47	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87
IBOVESPA	9,30	25,81	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
INPC + 6%	1,11	3,96	3,96	7,31	10,80	22,74	34,51
IPCA + 6%	1,17	3,93	3,93	6,82	10,01	21,66	33,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,31	0,70	0,70	1,21	3,84	10,86	18,59
IRF-M 1+	3,05	2,90	2,90	2,29	8,45	23,90	39,09
IRF-M TOTAL	1,95	1,99	1,99	1,75	6,69	19,53	32,36
IMA-B 5	1,83	3,38	3,38	4,72	8,04	22,25	34,31
IMA-B 5+	7,51	10,53	10,53	11,36	5,50	37,54	58,72
IMA-B TOTAL	4,85	7,18	7,18	8,21	6,41	30,83	47,91
IMA-C TOTAL	-1,12	3,64	3,64	13,59	22,07	45,76	72,56
IMA-GERAL ex-C TOTAL	2,12	2,83	2,83	3,09	4,85	18,09	29,65
IMA-GERAL TOTAL	2,02	2,86	2,86	3,40	5,34	18,84	30,77
IDKA 2	1,73	3,05	3,05	5,10	8,62	21,46	33,31
IDKA 20	11,36	15,90	15,90	16,58	2,20	47,44	77,53
CDI	0,16	0,47	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87
Renda Variável							
IBOVESPA	9,30	25,81	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
IBRX 100	9,15	25,34	25,34	25,28	3,50	38,06	59,35
IBRX 50	9,42	26,47	26,47	26,00	3,62	33,83	53,28
SMALL CAP	7,52	22,54	22,54	25,33	-0,65	57,16	69,94
IFIX	2,19	2,69	2,69	2,28	-10,24	22,05	28,91
Índice Consumo - ICON							
Índice Dividendos - IDIV	8,94	25,44	25,44	21,29	-1,00	43,71	66,63
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,66	2,43	2,43	3,70	3,81	8,28	12,33
INPC	0,60	2,46	2,46	4,18	4,55	9,24	12,99
IGPM	0,96	7,64	7,64	17,96	23,14	32,13	42,09
SELIC	0,16	0,47	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
118	01/10/2020	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	34.893,35	0,00	1.746,03910700	19,9842889230
123	09/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	22.566,63	10.701,99422600	2,1086378410
119	16/10/2020	BB PREV RF IDKA2	846.973,13	0,00	302.211,79527200	2,8025813130
127	16/10/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	500.000,00	0,00	491,09189400	1.018,1393870000
124	16/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3,13	1,48308900	2,1104605310
122	19/10/2020	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	400.000,00	0,00	391.850,00423800	1,0207987640
125	20/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.572,49	745,05309400	2,1105744180
121	28/10/2020	BB PREV IRF-M 1+	0,00	690.363,48	597.093,30053200	1,1562070440
120	30/10/2020	BB PREV RF IDKA2	21.369,93	0,00	7.604,48224700	2,8101755390
126	30/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.845,57	2.295,57240500	2,1108330060
132	04/11/2020	BB PREV RF IDKA2	34.312,37	0,00	12.197,04192200	2,8131714410
135	06/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	49.997,96	0,00	23.683,79315000	2,1110621800
136	09/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2,04	0,00	0,96631300	2,1111171420
137	10/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	22.820,78	10.809,72932200	2,1111333430
133	20/11/2020	BB PREV RF IDKA2	768.756,34	0,00	271.169,83665000	2,8349625810
131	20/11/2020	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	250.000,00	0,00	12.383,79161500	20,1876781970
129	20/11/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	250.000,00	0,00	79.188,60190900	3,1570200000
138	20/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.853,13	877,59614200	2,1115977060
130	23/11/2020	BB AÇÕES ENERGIA FI	500.000,00	0,00	32.429,07453300	15,4182630000
128	26/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	0,00	693.634,99	276.354,54849100	2,5099460000
134	30/11/2020	BB PREV RF IDKA2	21.543,24	0,00	7.564,78293200	2,8478332020
139	30/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.777,09	2.735,27413300	2,1120698400
142	02/12/2020	BB PREV RF IDKA2	33.318,79	0,00	11.661,33131000	2,8572029310
154	10/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	44.772,15	0,00	21.190,34270700	2,1128563430
155	16/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	25.000,00	0,00	11.829,97293900	2,1132761780
150	18/12/2020	BB PREV RF IDKA2	1.196.008,02	0,00	415.665,72413300	2,8773313520
143	18/12/2020	BB PREV RF IDKA2	17.518,89	0,00	6.088,58968800	2,8773313520
156	18/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	29.346,15	13.885,54693000	2,1134313360

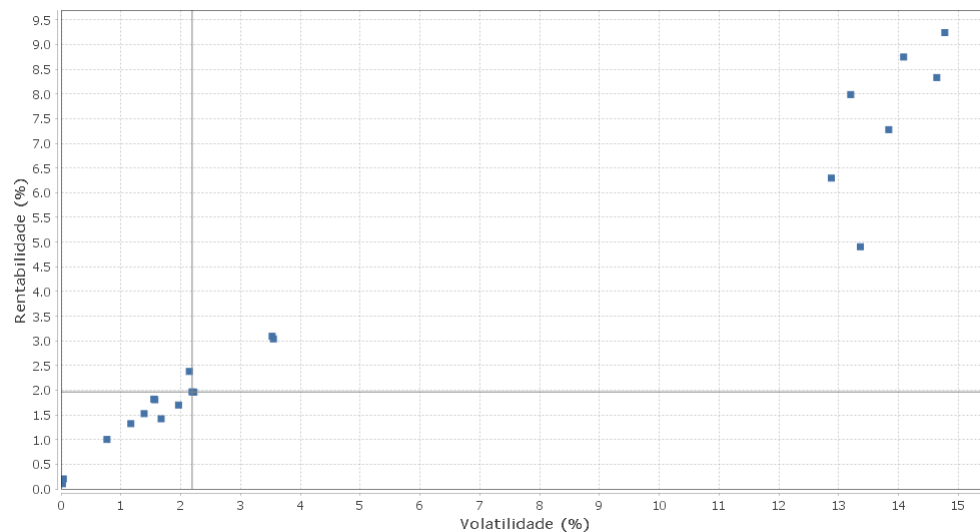
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
144	21/12/2020	BB PREV RF IDKA2	960.000,00	0,00	333.564,62437900	2,8780030310
140	21/12/2020	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	800.000,00	0,00	38.952,66182200	20,5377492210
151	21/12/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	800.000,00	0,00	249.100,04823100	3,2115610000
157	21/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3,13	1,48092600	2,1135420060
153	23/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	0,00	881.750,15	341.737,13004400	2,5802000000
145	28/12/2020	BB PREV RF IDKA2	47.875,22	0,00	16.611,26092600	2,8820942740
147	29/12/2020	BB PREV RF IDKA2	34.931,61	0,00	12.103,45873800	2,8860849410
146	29/12/2020	BB PREV RF IDKA2	1.216.399,82	0,00	421.470,55435500	2,8860849410
152	29/12/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.216.399,83	0,00	377.454,92509800	3,2226360000
158	29/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.395,60	4.444,30030200	2,1140785640
141	30/12/2020	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	700.000,00	0,00	673.676,82775700	1,0390738870
148	30/12/2020	BB PREV RF IDKA2	2.929.298,13	0,00	1.013.673,52927500	2,8897845760
159	30/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	62.648,70	29.632,76554800	2,1141699960
149	31/12/2020	BB PREV RF IDKA2	36,50	0,00	12,62416400	2,8912805380
Total						

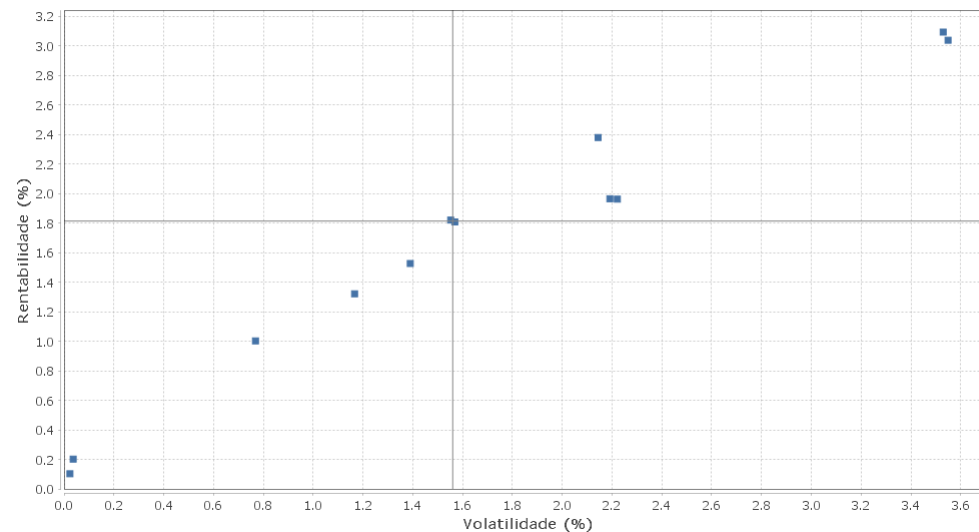
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

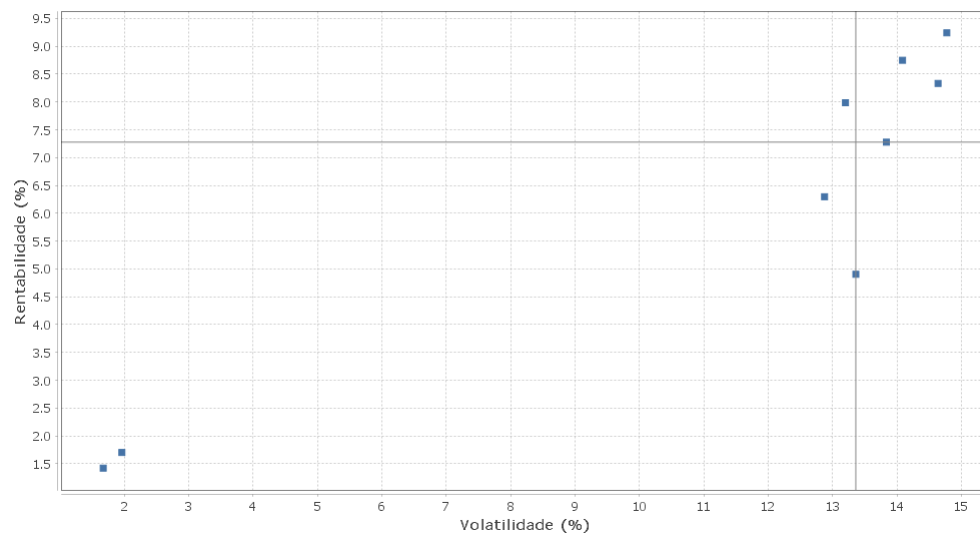
PATO BRANCO CONSOLIDADO - No Mês



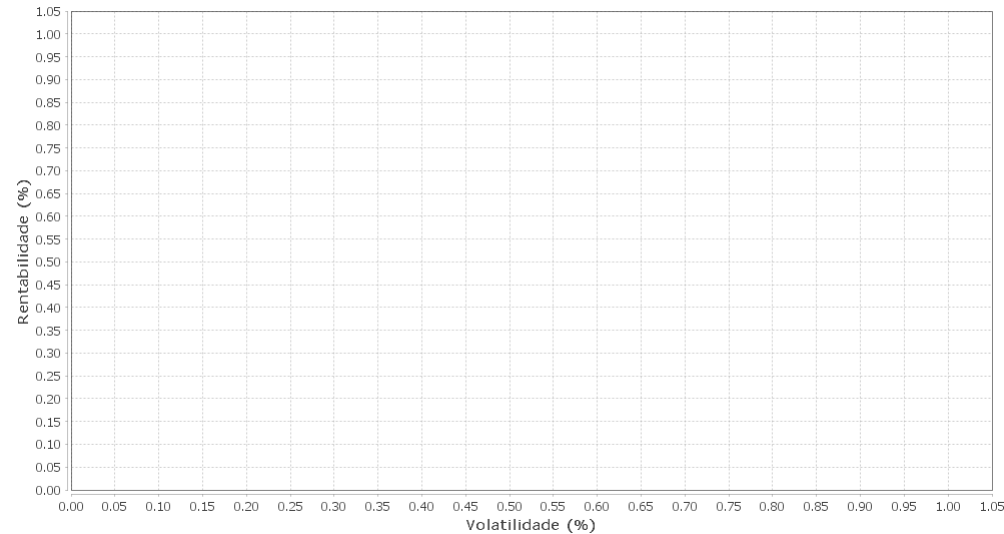
Renda Fixa - No Mês



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\$): 1.269.964,96

Value-At-Risk: 2,39%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	NaN	0,00	-2,62	0,10	0,00	0,00
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,26	0,01	1,02	0,20	3.124.900,90	5,88
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,77	1,10	0,02	1,09	1,00	1.217.312,51	2,29
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,17	1,25	0,11	0,99	1,32	5.510.613,35	10,37
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,39	0,94	0,10	0,98	1,53	8.186.969,99	15,41
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,55	1,06	0,09	1,07	1,82	6.255.407,22	11,77
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,57	1,05	0,12	1,05	1,81	7.896.119,06	14,86
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	Artigo 8º III	1,67	1,04	0,02	0,75	1,42	1.484.171,61	2,79
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	1,96	1,82	0,03	0,78	1,70	870.289,77	1,64
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,14	1,33	0,13	1,03	2,38	6.431.290,47	12,10
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	1,39	0,01	0,82	1,96	443.999,21	0,84
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,22	1,38	0,01	0,81	1,96	418.962,14	0,79
BB PREV IRF-M 1+	Artigo 7º I, Alínea b	3,53	2,18	0,02	0,83	3,09	595.301,94	1,12
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	3,55	2,09	0,04	0,81	3,04	1.282.863,80	2,41
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	12,88	10,36	0,10	0,48	6,30	572.559,21	1,08
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	13,20	9,83	0,12	0,59	7,99	704.028,77	1,32
BB AÇÕES CONSUMO FIC	Artigo 8º II, Alínea a	13,36	9,95	0,12	0,35	4,90	741.623,75	1,40
BB AÇÕES ENERGIA FI	Artigo 8º II, Alínea a	13,84	9,02	0,34	0,51	7,28	2.273.998,66	4,28
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	14,09	10,65	0,44	0,61	8,75	2.351.629,48	4,43
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	Artigo 8º II, Alínea a	14,64	12,08	0,44	0,56	8,33	2.078.631,00	3,91
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	14,78	10,82	0,13	0,61	9,24	702.536,48	1,32