



LDB
EMPRESAS

VILA VELHA
JULHO 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 12.11.2020.

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 85,30%

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 150545 (3,680000%) ..	0,37	0,65	3,05	6.282.028,53	1,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,290000%) ..	0,37	0,70	3,40	318.739,92	0,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,100000%) ..	0,37	0,77	3,87	12.318.563,83	3,34
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,37	0,73	3,59	18.919.332,28	5,13

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
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	22,79	7,49	-1,55	26.469.885,03	7,18	336.367.162,90	7,87
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,54	0,23	2,69	12.454.449,05	3,38	7.835.713.656,67	0,16
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,47	4,36	2,54	37.764.428,03	10,25	5.823.784.558,48	0,65
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,11	0,81	3,71	18.036.726,55	4,89	6.099.396.938,17	0,30
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,32	7,29	1,46	12.389.420,55	3,36	2.059.270.796,72	0,60
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	8,70	1,50	7,47	5.777.645,34	1,57	3.049.933.927,01	0,19
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,02	0,83	3,97	23.484.456,96	6,37	7.954.778.997,85	0,30
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,85	1,09	5,87	2.717.310,77	0,74	15.544.114.121,31	0,02
BB	BB	BB PREV RF IPCA	6,05	1,12	5,19	4.125.777,60	1,12	348.918.824,86	1,18
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	6,10	1,12	4,69	2.465.085,46	0,67	292.180.623,88	0,84
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	4,17	0,67	5,55	11.798.572,23	3,20	179.782.214,33	6,56
BB	BB	BB PREV RF VII	2,29	0,32	1,97	4.390.945,63	1,19	685.876.947,75	0,64
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	5,12	0,96	3,89	7.330.245,93	1,99	565.461.999,50	1,30
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	4,97	0,78	4,17	6.560.565,13	1,78	200.811.673,97	3,27

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,08	1,77	3,55	17.006.334,50	4,61	10.799.663.748,52	0,16
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	0,98	5,65	7.219.825,14	1,96	12.451.209.797,34	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,19	0,07	0,80	3.783.086,86	1,03	257.824.754,60	1,47
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,60	1,77	5,71	20.279.253,15	5,50	1.455.492.374,11	1,39
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,19	0,07	0,81	12.902.703,47	3,50	1.000.769.936,56	1,29
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	27,40	1,77	5,70	15.232.873,50	4,13	467.928.646,41	3,26
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,41	0,69	3,73	3.994.588,35	1,08	532.594.941,61	0,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,73	0,86	4,40	6.469.775,70	1,76	83.678.080,03	7,73
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,57	2,39	3,03	262.653.954,93	71,26		
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 INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,06	0,02	0,40	284.700,74	0,08	824.188.882,05	0,03
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	25,96	6,59	-2,31	12.732.226,74	3,45	311.642.335,02	4,09
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,07	0,10	1,35	5.343.759,21	1,45	1.725.378.039,09	0,31
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,07	0,12	1,46	1.020.239,00	0,28	506.083.614,11	0,20
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,54	1,86	0,53	5.374.808,38	1,46	182.307.109,20	2,95
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			12,05	3,77	-0,99	24.755.734,07	6,72		
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
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4,46	0,98	3,69	6.794.784,17	1,84	606.599.266,38	1,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF	8,13	1,86	5,47	1.286.618,90	0,35	184.385.326,60	0,70
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			5,01	1,12	3,97	8.081.403,07	2,19		
Renda Fixa			6,03	2,36	2,76	314.410.424,35	85,30		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

12,10%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVSPA	43,54	8,14	-11,05	14.474.604,80	3,93	692.799.908,03	2,09
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			43,54	8,14	-11,05	14.474.604,80	3,93		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	38,20	6,77	-17,03	11.849.095,34	3,21	972.576.793,16	1,22
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,01	8,32	-9,87	7.247.220,75	1,97	862.156.434,48	0,84
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	45,00	8,36	-0,70	10.032.039,46	2,72	154.315.606,33	6,50
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			39,78	7,70	-10,48	29.128.355,55	7,90		

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
RIO BRAVO	CEF	JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII	1,36	-0,01	-0,59	999.137,89	0,27	125.308.277,56	0,80
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			1,36	-0,01	-0,59	999.137,89	0,27		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			39,72	7,66	-10,49	44.602.098,24	12,10		
--	--	--	--------------	-------------	---------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,60%

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	26,66	1,88	35,34	9.574.485,12	2,60	1.279.266.331,34	0,75
Sub-total Artigo 9º A, III			26,66	1,88	35,34	9.574.485,12	2,60		
Investimentos no Exterior			26,66	1,88	35,34	9.574.485,12	2,60		
Total			8,49	2,94	1,23	368.587.007,71	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	18.919.332,28	5,13	0,00	47,50	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	262.653.954,93	71,26	0,00	20,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	24.755.734,07	6,72	0,00	5,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	8.081.403,07	2,19	0,00	2,50	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	314.410.424,35	85,30				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	14.474.604,80	3,93	0,00	10,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	29.128.355,55	7,90	0,00	13,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	999.137,89	0,27	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	44.602.098,24	12,10				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	9.574.485,12	2,60	0,00	1,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	9.574.485,12	2,60				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

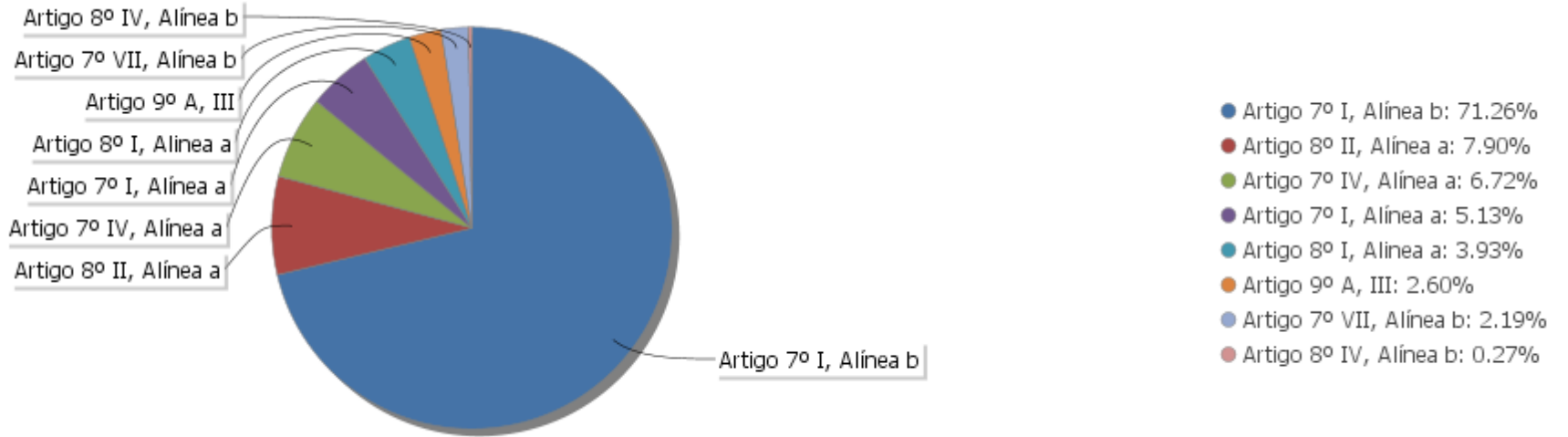
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,73 376,53	3,59 183,75	1,02 157,90	2,37 151,02	6,95 164,79	137.437,37	666.483,29
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	2,39 1.228,01	3,03 155,32	5,37 834,06	2,53 161,17	7,53 178,64	6.105.534,87	7.868.225,48
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	3,77 1.942,27	-0,99 -50,81	6,01 933,15	-1,49 -95,14	3,19 75,60	891.320,18	-220.336,67
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	1,12 577,18	3,97 203,24	4,48 695,54	3,11 198,26	8,51 201,84	89.642,41	308.398,66
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,14 -0,12	-11,05 -0,04	27,43 -0,41	-9,54 -0,01	0,90 -0,18	1.089.813,50	-1.798.472,54
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	7,70 -0,57	-10,48 0,53	23,66 -4,17	-11,18 -1,65	1,52 0,44	1.996.552,76	-3.386.691,00
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-0,01 -8,27	-0,59 10,43	-0,15 -27,98	-1,23 8,31	-0,10 -1,19	-65,80	-5.883,66
Artigo 9º A, III % do CDI	1,88 964,81	35,34 1.810,52	9,28 1.441,94	27,06 1.724,07	55,47 1.316,13	176.218,21	1.530.143,67
						10.486.453,50	4.961.867,23

Análise de Liquidez

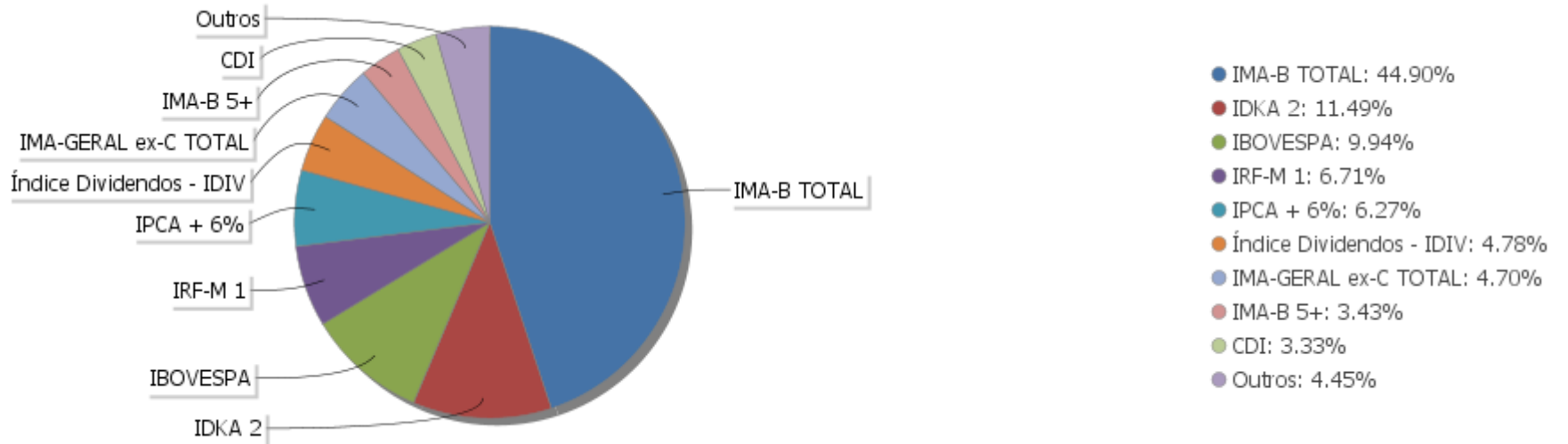
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	253.745.382,71	68,84	253.745.382,71	68,84
de 31 a 364 dias	18.278.398,10	4,96	272.023.780,81	73,80
acima de 365 dias	96.563.226,90	26,20	368.587.007,71	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

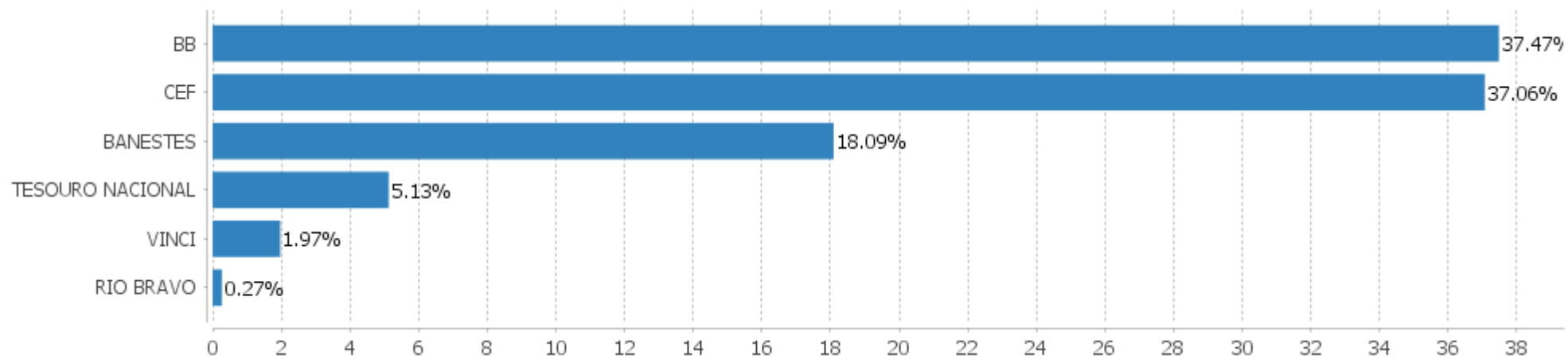


Alocação Por Estratégia



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	-0,79	-6,98	1,89	2,02	2,02	2,94						1,23
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88						3,83
p.p. indexador	-0,22	-1,45	-7,55	1,75	1,95	1,28	2,06						-2,60
2019	2,66	0,46	0,52	1,25	2,07	2,43	1,16	-0,08	2,05	2,10	-0,88	2,10	16,97
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	1,83	-0,43	-0,68	0,19	1,43	1,98	0,44	-0,70	1,60	1,47	-1,85	0,46	6,38
2018								0,28	0,40	3,39	0,72	1,12	6,02
IPCA + 6%								0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	3,23
p.p. indexador								-0,17	-0,52	2,42	0,47	0,51	2,78

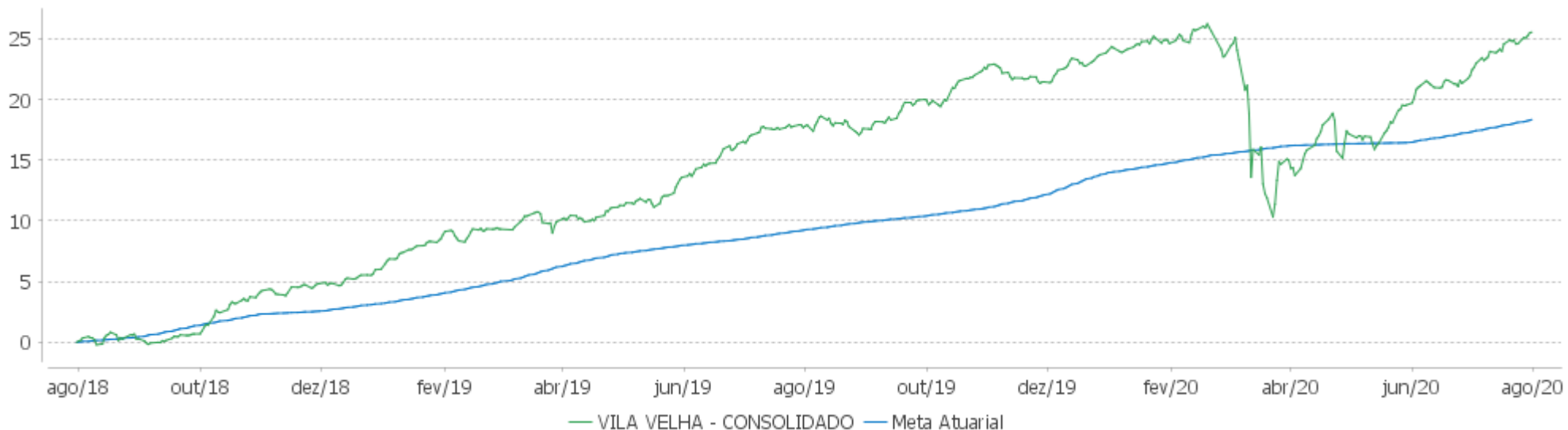
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

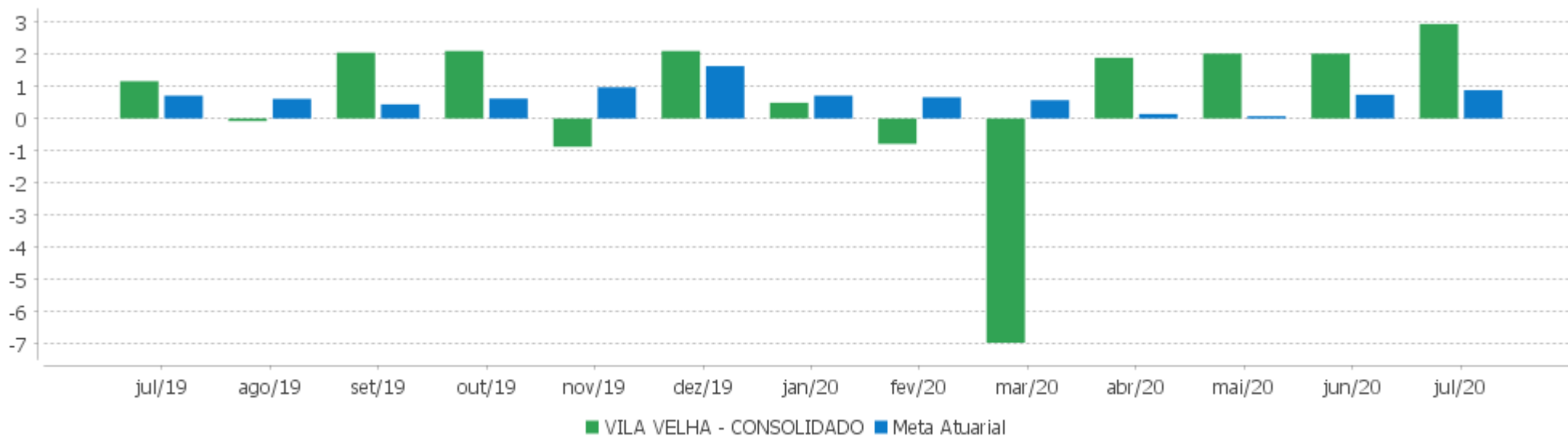
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	15	62,50	03 meses	7,14	1,70	5,44	4,03
Meses abaixo da Meta Atuarial	9	37,50	06 meses	0,74	3,10	-2,36	11,72
			12 meses	6,66	8,39	-1,73	8,49
			24 meses	25,54	18,54	6,99	6,37
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,39	2018-10	Desde 31/07/2018	25,54	18,54	6,99	6,37
Menor rentabilidade da Carteira	-6,98	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,12 -3,27	4,69 2,04	4,84 -3,30	3,97 1,59	9,53 1,38	28,55 -9,31	38,72 -8,03
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	0,78 -0,21	4,17 -0,02	4,11 -0,18	3,52 -0,10	8,70 -0,13	26,28 2,12	36,36 1,93
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,23 -0,01	2,69 -0,15	0,88 -0,06	2,26 -0,13	5,22 -0,29	12,65 -0,54	20,70 -0,86
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6% p.p.	0,69 -0,21	3,73 -0,18	3,80 2,07	3,16 0,00	8,11 -0,36	24,59 5,96	43,70 12,38
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,09 0,01	5,87 -0,13	3,29 -0,04	4,99 -0,08	9,54 -0,27	25,97 -0,62	35,83 -0,95
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	7,29 -0,03	1,46 -0,22	11,43 -0,08	1,50 -0,14	7,35 -0,46	47,92 -1,45	54,33 -1,86
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,96 -3,42	3,89 1,24	4,30 -3,84	3,34 0,96	8,45 0,30	25,43 -12,44	35,39 -11,36
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,77 -2,62	5,70 3,05	6,28 -1,86	4,86 2,48	11,17 3,01	33,17 -4,69	39,06 -7,70
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,07 -4,32	0,81 -1,84	1,77 -6,37	0,84 -1,54	4,20 -3,95	14,12 -23,74	20,80 -25,96
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO Var. IRF-M 1+ p.p.	1,50 0,03	7,47 -0,12	4,47 -0,03	6,32 -0,08	11,77 -0,24	32,19 -0,62	42,77 -1,01
FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,07 -4,32	0,80 -1,85	1,77 -6,38	0,83 -1,55	4,18 -3,97	14,08 -23,78	20,75 -26,00
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IPCA + 6% p.p.	0,86 -0,04	4,40 0,49	1,37 -0,37	3,05 -0,11	5,51 -2,96	15,56 -3,06	24,43 -6,89
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	7,49 3,11	-1,55 -4,20	10,74 2,60	-2,09 -4,47	4,08 -4,07	44,21 6,35	49,90 3,15
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,67 0,44	5,55 2,71	1,97 1,03	4,80 2,41	8,68 3,18	21,03 7,83	30,55 8,99
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,32 -4,07	1,97 -0,68	2,58 -5,56	1,77 -0,61	5,74 -2,41	18,19 -19,68	27,84 -18,91
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,81 -0,13	3,71 -0,60	4,07 0,35	3,32 -0,44	7,99 -0,69	20,62 -1,75	30,76 -2,60
BB PREV RF IPCA	1,12	5,19	4,83	4,50	10,22	30,34	40,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 6% p.p.	0,22	1,29	3,10	1,33	1,75	11,71	8,83
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	1,77	3,55	3,83	3,05	7,10	23,78	32,81
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,11	0,15	0,26	0,17	0,02	0,51	0,56
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,77	5,71	6,28	4,87	11,18	33,18	39,04
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,62	3,06	-1,86	2,49	3,02	-4,69	-7,71
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,98	5,65	3,14	4,79	9,68	28,24	37,15
Var. IPCA p.p.	0,62	5,19	2,90	4,54	7,38	22,64	26,81
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,83	3,97	3,96	3,50	8,10	20,93	31,10
Var. IDKA 2 p.p.	-0,11	-0,34	0,24	-0,26	-0,58	-1,44	-2,25
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,36	2,54	8,07	2,27	7,94	37,20	45,69
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,11	-0,07	-0,11	-0,22	-0,66	-1,07
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	0,98	3,69	4,19	2,83	8,10	22,05	34,67
Var. IPCA + 6% p.p.	0,09	-0,22	2,45	-0,33	-0,37	3,42	3,35
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF	1,86	5,47	6,05	4,62	10,69	28,48	35,88
Var. IPCA + 6% p.p.	0,96	1,56	4,31	1,46	2,22	9,86	4,56
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	0,77	3,87	1,14	2,60	7,45	16,64	
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-3,61	1,22	-7,01	0,22	-0,71	-21,22	
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	0,70	3,40	0,94	2,21	6,61	12,23	
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-3,68	0,75	-7,20	-0,17	-1,54	-25,63	
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	0,65	3,05	0,79	1,92	5,99	11,14	
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-3,74	0,40	-7,35	-0,46	-2,17	-26,72	
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	6,59	-2,31	10,55	-3,03	2,22	38,94	44,06
Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,20	-4,96	2,41	-5,41	-5,94	1,08	-2,69
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	1,86	0,53	2,86	-0,08	6,90	26,22	
% do CDI	959,39	27,26	443,55	-5,26	163,77	242,12	
BB PREV RF FLUXO FIC	0,10	1,35	0,39	1,06	3,12	8,50	14,95
% do CDI	52,46	68,95	60,44	67,36	74,14	78,50	80,06
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,02	0,40	0,07	0,28	1,35	4,66	8,85
% do CDI	8,80	20,52	10,81	18,01	32,10	43,07	47,38
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,12	1,46	0,43	1,15	3,35	8,99	15,76
% do CDI	59,89	74,66	67,29	73,37	79,38	83,04	84,38
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	8,36	-0,70	27,26	-2,67	12,67	62,04	86,72
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,83	12,35	5,40	8,98	9,17	15,55	23,54
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	8,32	-9,87	21,78	-11,23	4,70	50,50	62,91
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,79	3,18	-0,08	0,43	1,20	4,00	-0,28
BB AÇÕES DIVIDENDOS	6,77	-17,03	19,26	-16,68	-7,01	24,01	35,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-1,50	-6,02	-8,57	-7,15	-8,09	-5,90	-20,61
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	8,14	-11,05	27,43	-9,54	0,90	29,08	54,06
Var. IBOVESPA p.p.	-0,12	-0,04	-0,41	-0,01	-0,18	-0,83	-2,06
JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII	-0,01	-0,59	-0,15	-1,23	-0,10	-0,55	-0,01
Var. IFIX p.p.	2,60	13,94	-5,13	9,96	-2,87	-27,41	-32,29
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1,88	35,34	9,28	27,06	55,47	69,34	132,22
Var. IBOVESPA p.p.	-6,39	46,35	-18,55	36,60	54,39	39,44	76,11
CDI	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,68
IBOVESPA	8,27	-11,01	27,83	-9,54	1,08	29,91	56,12
INPC + 6%	0,98	4,26	1,99	3,54	8,88	19,01	30,64
IPCA + 6%	0,90	3,91	1,73	3,16	8,47	18,63	31,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,24	2,84	0,94	2,39	5,51	13,20	21,56
IRF-M 1+	1,47	7,59	4,50	6,40	12,02	32,81	43,78
IRF-M TOTAL	1,08	6,00	3,32	5,08	9,81	26,59	36,79
IMA-B 5	0,99	4,19	4,28	3,61	8,83	24,16	34,43
IMA-B 5+	7,32	1,68	11,51	1,64	7,81	49,37	56,19
IMA-B TOTAL	4,39	2,65	8,14	2,38	8,16	37,86	46,75
IMA-C TOTAL	4,26	12,04	11,01	9,27	15,97	43,97	64,91
IMA-GERAL ex-C TOTAL	1,66	3,39	3,57	2,88	7,07	23,27	32,25
IMA-GERAL TOTAL	1,74	3,64	3,79	3,07	7,33	23,84	33,11
IDKA 2	0,94	4,31	3,72	3,76	8,68	22,37	33,35
IDKA 20	12,08	-1,74	17,28	-0,38	4,95	69,37	71,28
CDI	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,68
Renda Variável							
IBOVESPA	8,27	-11,01	27,83	-9,54	1,08	29,91	56,12
IBRX 100	8,41	-10,43	28,20	-9,30	2,17	33,69	59,04
IBRX 50	8,15	-11,06	29,00	-9,35	0,23	26,69	52,24
SMALL CAP	9,50	-13,20	31,66	-13,59	7,86	55,28	71,97
IFIX	-2,61	-14,53	4,97	-11,18	2,77	26,86	32,28
Índice Consumo - ICON	7,62	-4,11	27,54	-7,49	12,15	54,44	58,02
Índice Dividendos - IDIV	6,53	-13,05	21,87	-11,65	3,50	46,49	63,19
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,36	0,46	0,24	0,25	2,31	5,60	10,34
INPC	0,44	0,80	0,49	0,61	2,69	5,94	9,76
IGPM	2,23	6,71	4,11	6,21	9,27	16,26	25,84
SELIC	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,69
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
290	02/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	327,00	155,26040800	2,1061389930
286	03/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	35.801,86	0,00	16.998,06710900	2,1062312420
316	06/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	224,73	0,00	27,69891577	8,1133139600
291	07/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	114,95	0,00	54,57156800	2,1064082240
318	07/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	201,96	0,00	24,89222416	8,1133770400
280	08/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	93.374,27	0,00	44.326,76752000	2,1064985160
292	09/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	23.976,68	11.381,75604400	2,1065888170
255	09/07/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	65.254,21	34.859,93620375	1,8718970000
293	13/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	132,65	62,96340800	2,1067792320
287	13/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	28.564,52	0,00	13.558,38313100	2,1067792320
281	13/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	122,65	0,00	58,21682600	2,1067792320
313	16/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	14.665,10	1.807,42868856	8,1137917600
275	17/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	499.074,40	0,00	61.508,94119299	8,1138512600
273	17/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	171.067,59	21.083,40226094	8,1138512600
320	17/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.910.278,06	0,00	358.680,23294280	8,1138512600
317	20/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	224,75	27,69934307	8,1139108400
321	20/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.195.215,41	270.549,60958876	8,1139108400
314	20/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	52.973,56	6.528,73331302	8,1139108400
315	20/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	738,08	90,96476589	8,1139108400
319	20/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	201,97	24,89181900	8,1139108400
259	20/07/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1.125.000,00	0,00	754.478,07889091	1,4910970000
282	21/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	742,72	0,00	352,44556000	2,1073325440
260	21/07/2020	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	1.125.000,00	0,00	468.522,00352786	2,4011679100
325	22/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	737,99	0,00	90,95233811	8,1140300000
294	23/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.709,00	810,90604500	2,1075191270
295	24/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.074,68	3.831,19964100	2,1076113900
256	27/07/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.283.284,07	0,00	685.136,92497676	1,8730330000
326	27/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	13.615,87	0,00	1.678,02787792	8,1142096500

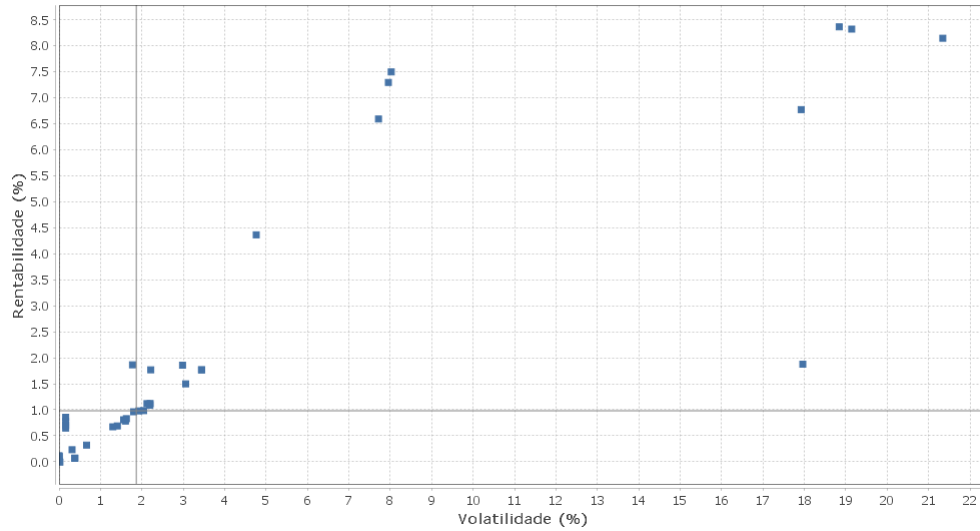
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
277	28/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	5.292.730,20	0,00	652.274,40187877	8,1142693700
296	29/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	130.467,16	61.894,59369900	2,1078926640
322	29/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.045,00	128,78451347	8,1143296800
297	30/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	381.440,11	0,00	180.951,43683000	2,1079695010
276	30/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	499.107,55	61.508,94093553	8,1143902400
274	30/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	29.155,26	3.593,03153258	8,1143902400
278	30/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	4.491.028,86	553.464,73698805	8,1143902400
283	30/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.033,02	2.862,00535400	2,1079695010
257	30/07/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	332.952,09	177.733,88714570	1,8733180000
323	30/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	624.038,61	76.905,17605670	8,1143902400
298	31/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	58.452,56	27.727,95216300	2,1080734580
288	31/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.172,26	0,00	1.504,81473400	2,1080734580
289	31/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	67.538,64	32.038,08850900	2,1080734580
284	31/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	562.809,95	0,00	266.978,33885400	2,1080734580
285	31/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	562.809,95	266.978,33885300	2,1080734580
279	31/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	601.830,43	74.167,73925244	8,1144502457
258	31/07/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	22.979,07	0,00	12.265,87929844	1,8734140000
324	31/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	19.652,56	2.421,92131382	8,1144502457

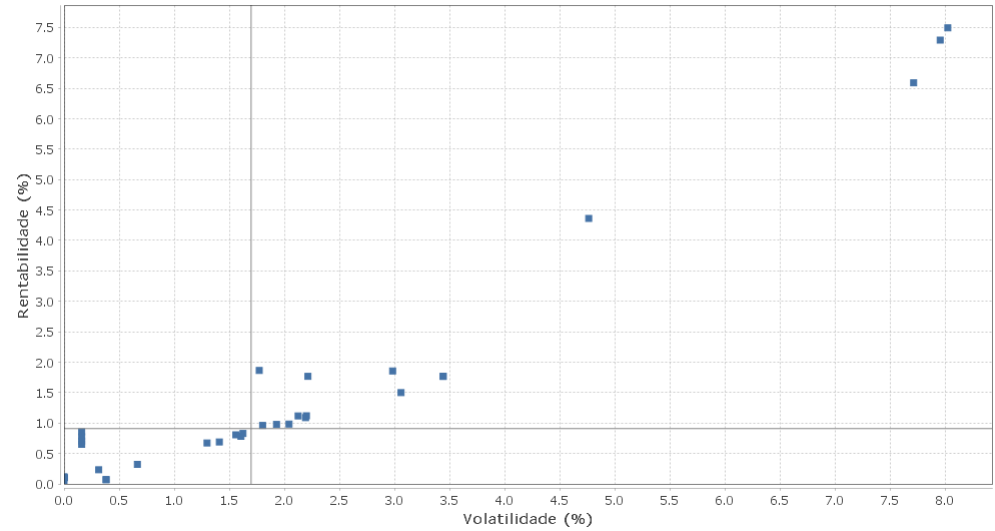
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

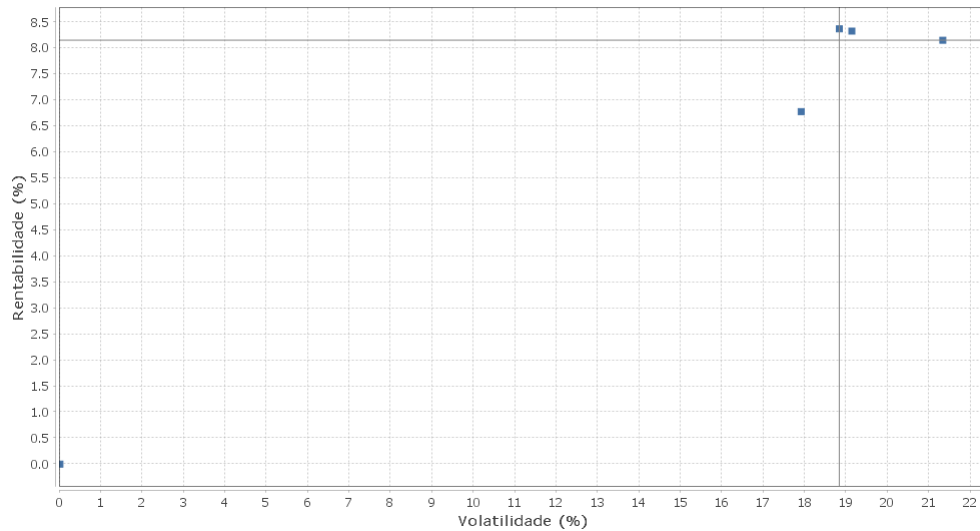
VILA VELHA - CONSOLIDADO - No Mês



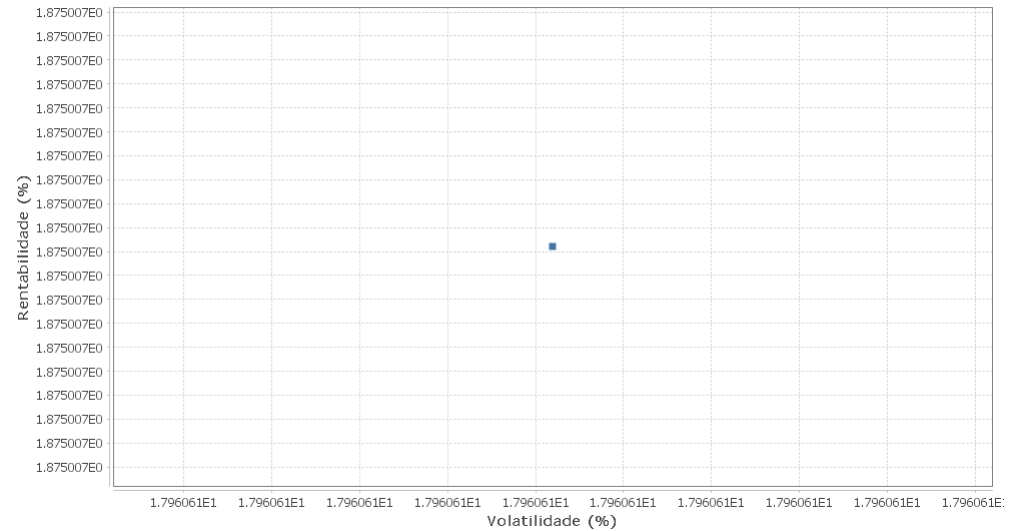
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,01	-0,00	-456,63	0,02	284.700,74	0,08
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,02	-0,00	-169,13	0,12	1.020.239,00	0,28
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,02	-0,00	-19,25	0,10	5.343.759,21	1,45
JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII	Artigo 8º IV, Alínea b	0,02	0,03	0,00	-9,22	-0,01	999.137,89	0,27
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,16	0,10	-0,00	4,13	0,86	6.469.775,70	1,76
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,16	0,10	-0,00	3,61	0,77	12.318.563,83	3,34
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,16	0,10	-0,00	3,17	0,70	318.739,92	0,09
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,16	0,10	-0,00	2,84	0,65	6.282.028,53	1,70
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,31	0,34	0,01	0,12	0,23	12.454.449,05	3,38
FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,38	0,59	0,00	-0,33	0,07	3.783.086,86	1,03
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,38	0,59	0,01	-0,32	0,07	12.902.703,47	3,50
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	0,67	1,02	0,01	0,19	0,32	4.390.945,63	1,19
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	1,30	2,37	0,06	0,37	0,67	11.798.572,23	3,20
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,41	2,40	0,02	0,35	0,69	3.994.588,35	1,08
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,56	2,12	0,09	0,39	0,81	18.036.726,55	4,89
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	Artigo 7º I, Alínea b	1,61	2,74	0,04	0,37	0,78	6.560.565,13	1,78
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,62	2,28	0,13	0,39	0,83	23.484.456,96	6,37
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	1,77	1,03	0,00	0,94	1,86	5.374.808,38	1,46
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	2,27	0,04	0,43	0,96	7.330.245,93	1,99
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,93	2,83	0,05	0,41	0,98	7.219.825,14	1,96
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	2,04	1,97	0,03	0,39	0,98	6.794.784,17	1,84
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,13	2,68	0,02	0,43	1,12	2.465.085,46	0,67
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	2,84	0,02	0,41	1,09	2.717.310,77	0,74
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	2,20	3,74	0,04	0,42	1,12	4.125.777,60	1,12
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,21	3,09	0,13	0,71	1,77	17.006.334,50	4,61
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF	Artigo 7º VII, Alínea b	2,98	3,98	0,01	0,56	1,86	1.286.618,90	0,35
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	3,06	4,49	0,06	0,43	1,50	5.777.645,34	1,57
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,44	4,65	0,17	0,46	1,77	15.232.873,50	4,13
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,44	4,65	0,23	0,46	1,77	20.279.253,15	5,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,76	5,98	0,54	0,87	4,36	37.764.428,03	10,25
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	7,71	23,47	0,22	0,83	6,59	12.732.226,74	3,45
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,95	9,28	0,27	0,89	7,29	12.389.420,55	3,36
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	8,02	18,50	0,38	0,91	7,49	26.469.885,03	7,18
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	17,92	27,75	0,76	0,37	6,77	11.849.095,34	3,21
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	17,96	15,75	0,18	0,09	1,88	9.574.485,12	2,60
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	18,84	29,84	0,66	0,43	8,36	10.032.039,46	2,72
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	19,14	26,52	0,45	0,42	8,32	7.247.220,75	1,97
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	21,34	26,19	0,84	0,37	8,14	14.474.604,80	3,93