



LDB
EMPRESAS

VILA VELHA
FEVEREIRO 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 85,86%

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%) ..	0,36	0,36	1,47	6.319.163,21	1,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,290000%) ..	0,36	0,40	1,57	320.446,08	0,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,100000%) ..	0,36	0,46	1,69	12.377.390,10	3,51
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,36	0,42	1,62	19.016.999,39	5,40

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	7,95	0,08	0,63	27.055.993,73	7,68	297.383.588,49	9,10
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,26	0,35	0,77	9.902.653,21	2,81	7.492.585.716,79	0,13
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,90	0,44	0,70	37.086.787,25	10,53	6.284.654.664,10	0,59
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	1,50	0,63	1,02	15.375.698,75	4,37	6.830.764.502,36	0,23
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,29	0,29	0,25	12.241.985,38	3,48	2.293.876.669,47	0,53
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	2,93	0,78	1,86	5.476.278,90	1,55	2.655.596.398,85	0,21
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,51	0,60	1,06	22.826.374,78	6,48	8.419.154.798,69	0,27
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,09	0,63	1,48	2.604.439,91	0,74	15.973.064.296,15	0,02
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,75	0,77	1,44	4.080.356,58	1,16	345.077.548,96	1,18
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	2,61	0,72	1,41	2.387.895,31	0,68	283.031.462,08	0,84
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1,36	0,71	1,44	9.191.929,27	2,61	202.735.948,95	4,53
BB	BB	BB PREV RF VII	1,19	0,41	0,61	4.332.504,39	1,23	676.748.275,25	0,64
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,18	0,60	1,13	7.135.802,16	2,03	550.462.426,56	1,30
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	2,29	0,72	1,36	6.383.718,10	1,81	195.398.581,16	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	2,33	0,46	0,94	16.578.520,07	4,71	10.908.803.618,87	0,15
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,44	0,62	1,44	5.845.749,18	1,66	10.626.779.468,55	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,80	0,25	0,21	3.761.043,95	1,07	256.322.456,81	1,47
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,39	0,70	1,51	19.473.629,91	5,53	1.397.669.964,29	1,39
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,80	0,25	0,21	12.826.426,90	3,64	994.853.758,21	1,29
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	26,35	0,70	1,51	14.628.110,40	4,15	449.351.413,77	3,26
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	2,05	0,66	1,21	3.897.674,10	1,11	519.673.450,30	0,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,75	0,52	1,83	6.310.681,53	1,79	81.620.410,32	7,73
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,69	0,47	0,97	249.404.253,76	70,81		

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	0,05	0,08	0,20	414.124,28	0,12	571.609.197,48	0,07
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	7,55	0,20	0,93	13.171.089,11	3,74	329.955.502,48	3,99
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,05	0,22	0,50	5.152.542,19	1,46	1.376.949.540,95	0,37
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,05	0,23	0,53	850.848,68	0,24	455.022.894,33	0,19
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,10	0,29	0,69	1.139.469,49	0,32	2.995.405.175,98	0,04
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,60	0,42	1,04	5.402.040,86	1,53	238.856.359,80	2,26
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			3,47	0,37	0,88	26.130.114,61	7,42		

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	1,74	0,32	1,15	6.628.711,69	1,88	591.773.269,86	1,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF	3,29	0,74	1,55	1.238.810,30	0,35	186.525.894,64	0,66
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			1,95	0,38	1,22	7.867.521,99	2,23		
Renda Fixa			2,40	0,45	1,00	302.418.889,75	85,86		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

12,72%

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	19,17	-8,30	-9,83	14.673.627,60	4,17	613.653.165,94	2,39
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			19,17	-8,30	-9,83	14.673.627,60	4,17		

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	17,97	-8,73	-9,11	12.980.567,23	3,69	1.122.348.597,47	1,16
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,49	-6,37	-4,94	7.643.776,20	2,17	909.648.393,83	0,84
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	17,97	-7,11	-5,23	8.498.780,44	2,41	151.383.918,69	5,61
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			17,33	-7,65	-6,92	29.123.123,87	8,27		

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	1,38	-0,95	-0,31	1.001.947,23	0,28	125.660.614,57	0,80
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			1,38	-0,95	-0,31	1.001.947,23	0,28		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			17,26	-7,72	-7,79	44.798.698,70	12,72		
--	--	--	--------------	--------------	--------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,42%

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	16,34	-5,69	0,46	5.018.931,38	1,42	866.229.995,42	0,58
Sub-total Artigo 9º A, III			16,34	-5,69	0,46	5.018.931,38	1,42		
Investimentos no Exterior			16,34	-5,69	0,46	5.018.931,38	1,42		
Total			3,45	-0,79	-0,31	352.236.519,83	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	19.016.999,39	5,40	0,00	47,50	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	249.404.253,76	70,81	0,00	20,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	26.130.114,61	7,42	0,00	5,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	7.867.521,99	2,23	0,00	2,50	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	302.418.889,75	85,86				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	14.673.627,60	4,17	0,00	10,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	29.123.123,87	8,27	0,00	13,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.001.947,23	0,28	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	44.798.698,70	12,72				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	5.018.931,38	1,42	0,00	1,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	5.018.931,38	1,42				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades por Artigo

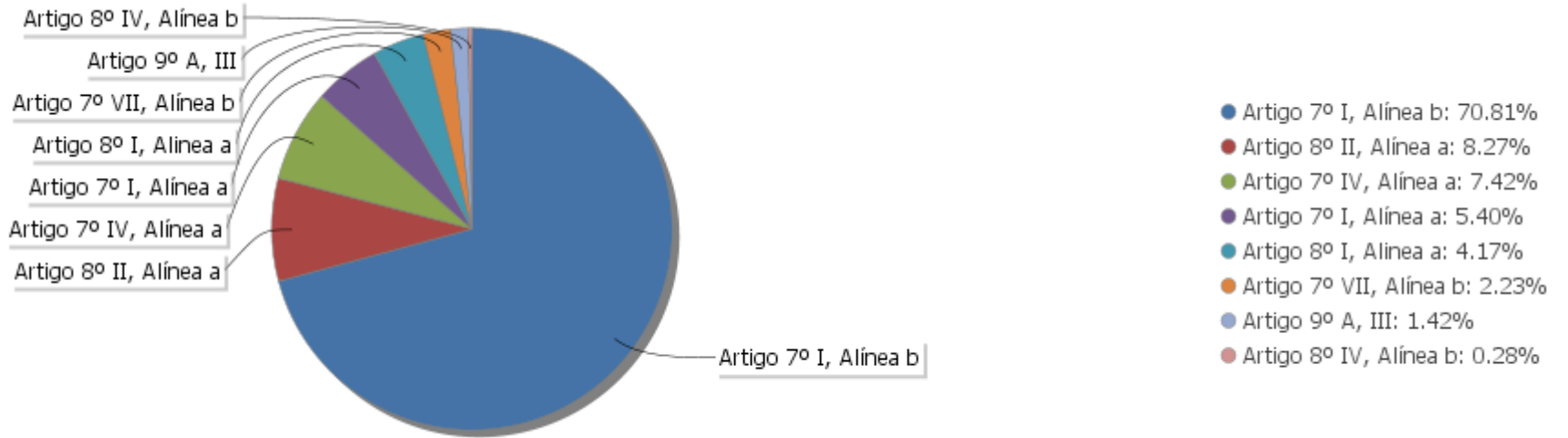
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,42 144,45	1,62 240,95	2,86 273,04	4,35 182,03	9,05 162,28	80.348,56	302.774,57
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,47 161,63	0,97 144,02	2,40 228,54	5,67 236,95	13,62 244,26	1.182.018,38	2.391.198,58
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,37 126,45	0,88 131,43	2,68 255,19	5,64 235,86	12,73 228,38	64.832,62	215.943,09
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,38 130,38	1,22 181,09	2,39 227,80	5,53 231,13	11,86 212,76	30.015,29	94.517,58
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-8,30 0,13	-9,83 0,09	-3,66 0,09	3,01 0,00	8,77 -0,21	-1.328.217,94	-1.599.449,74
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-7,65 0,78	-6,92 3,00	0,54 4,29	4,18 1,18	16,42 7,43	-2.411.512,30	-2.266.922,68
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-0,95 7,48	-0,31 9,62	0,10 3,86	-0,01 -3,01	0,34 -8,64	-9.604,83	-3.074,32
Artigo 9º A, III % do CDI	-5,69 -1.935,50	0,46 68,96	-1,30 -124,40	8,85 369,86	26,84 481,52	-472.280,53	-294.044,24
						-2.864.400,75	-1.159.057,16

Análise de Liquidez

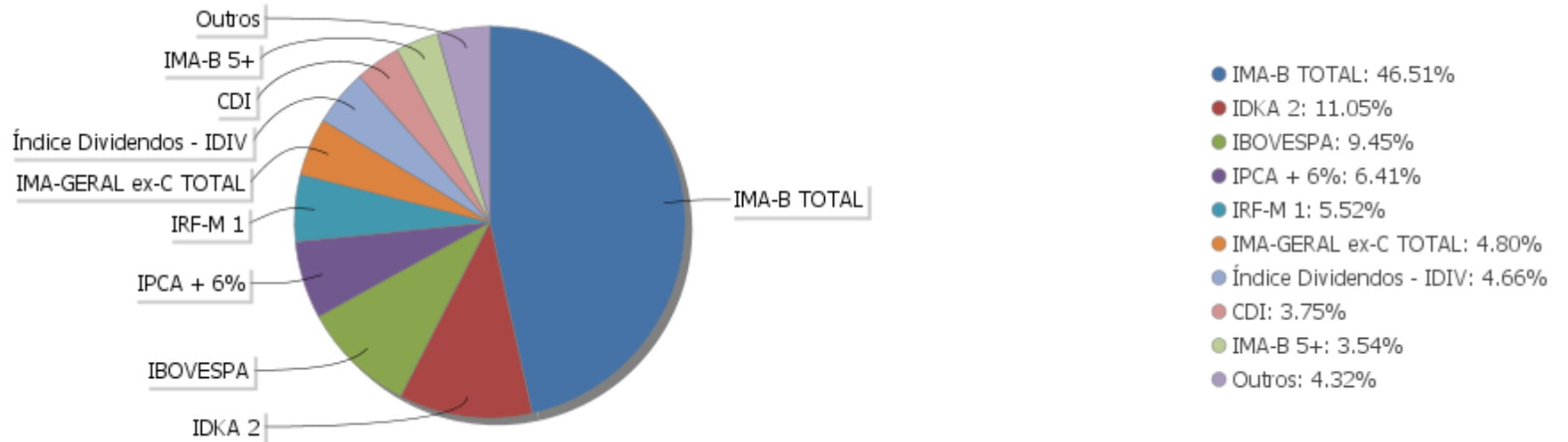
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	240.815.932,40	68,37	240.815.932,40	68,37
de 31 a 364 dias	16.142.556,64	4,58	256.958.489,04	72,95
acima de 365 dias	95.278.030,79	27,05	352.236.519,83	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

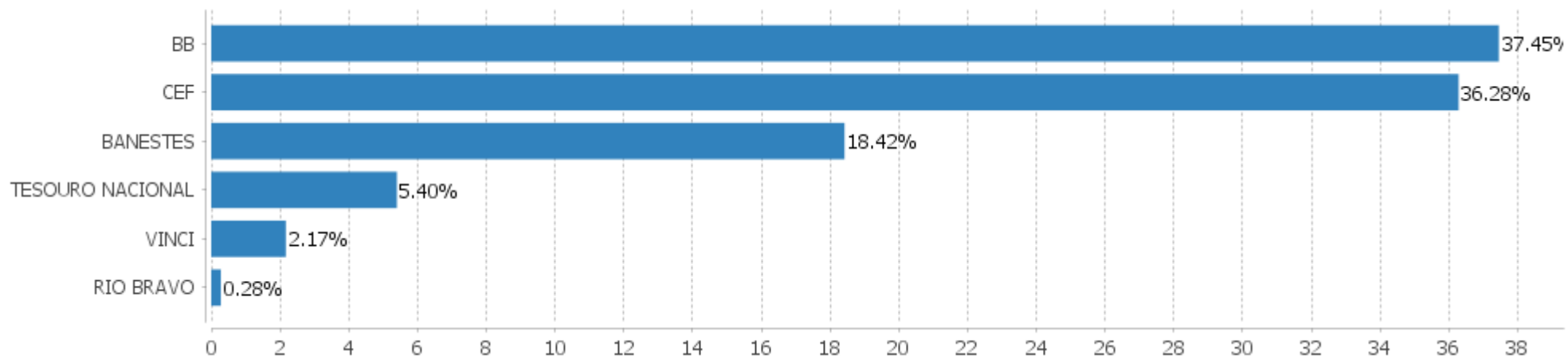


Alocação Por Estratégia



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											-0,31
IPCA + 5,87%	0,71	0,66											1,37
p.p. indexador	-0,22	-1,45											-1,68
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

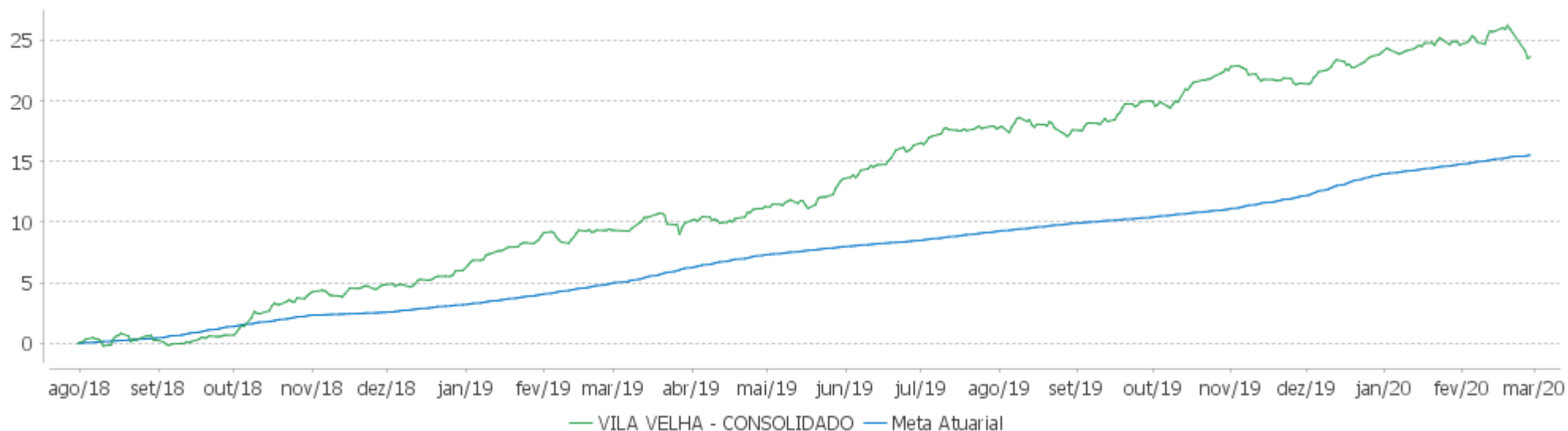
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

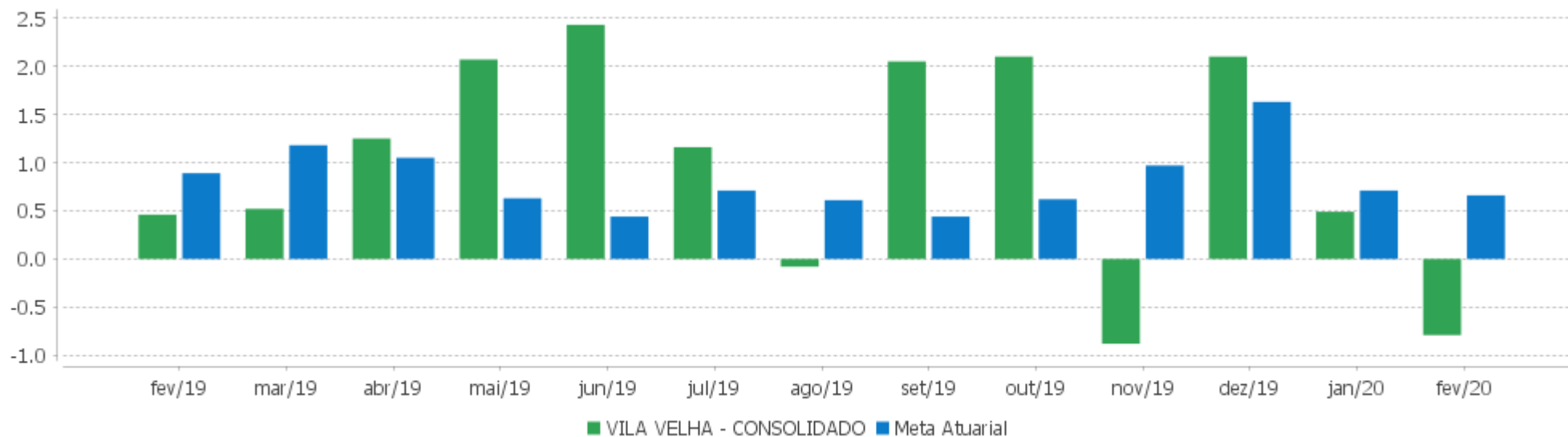
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	11	57,89	03 meses	1,79	3,04	-1,25	3,99
Meses abaixo da Meta Atuarial	8	42,11	06 meses	5,13	5,17	-0,04	3,56
			12 meses	13,06	10,20	2,86	3,45
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,39	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-0,88	2019-11	Desde 31/07/2018	23,63	15,73	7,89	3,21

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
NTN-B 150545 (5,100000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,46 0,01	1,69 0,98	2,98 0,25	4,60 -1,95	9,36 -8,64		
NTN-B 150545 (4,290000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,40 -0,05	1,57 0,86	2,79 0,05	4,19 -2,35	8,52 -9,48		
NTN-B 150545 (3,680000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,36 -0,09	1,47 0,76	2,64 -0,09	3,89 -2,65	7,89 -10,11		
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,20 -0,25	0,93 0,22	3,33 0,60	7,69 1,14	22,29 4,29	37,68 3,03	51,75 2,48
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,29 100,18	0,69 102,80	1,09 104,36	2,22 92,94	5,62 100,90	12,94 104,90	23,83 106,41
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	0,42 144,27	1,04 155,12	2,19 209,01	6,79 283,69	16,16 289,87		
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,22 73,69	0,50 74,86	0,79 75,23	1,85 77,44	4,45 79,85	9,95 80,64	18,58 82,98
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO % do CDI	0,08 28,07	0,20 29,79	0,33 31,42	0,90 37,81	2,51 45,07	5,90 47,83	12,09 53,97
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,23 78,51	0,53 79,49	0,84 80,23	1,97 82,21	4,70 84,24	10,48 84,92	19,40 86,63
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6% p.p.	0,32 -0,35	1,15 -0,24	2,27 -0,79	5,33 0,14	11,18 0,96	23,55 2,17	39,64 7,41
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF Var. IPCA + 6% p.p.	0,74 0,07	1,55 0,16	3,04 -0,02	6,60 1,40	15,62 5,40	25,66 4,28	36,87 4,64
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,72 0,27	1,41 0,70	2,71 -0,02	6,06 -0,49	13,94 -4,06	26,48 -8,17	41,88 -7,39
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	0,72 0,08	1,36 0,16	2,56 0,10	5,71 0,06	12,89 0,72	24,94 1,45	40,31 2,35
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6% p.p.	0,66 -0,01	1,21 -0,18	2,35 -0,71	5,40 0,21	12,11 1,89	32,72 11,35	44,68 12,46
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,35 -0,03	0,77 -0,05	1,17 -0,07	2,72 -0,15	6,24 -0,28	13,31 -0,55	24,21 -0,86
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,63 -0,02	1,48 -0,06	2,09 -0,07	4,79 -0,12	11,51 -0,35	22,34 -0,65	37,98 -1,08
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,29	0,25	2,82	6,92	21,46	41,77	56,76

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 5+ p.p.	-0,03	-0,10	-0,15	-0,32	-0,58	-1,29	-1,73
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,60 0,15	1,13 0,42	2,33 -0,40	5,48 -1,06	12,52 -5,48	24,18 -10,47	39,12 -10,15
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,70 0,25	1,51 0,79	3,02 0,29	6,73 0,19	16,05 -1,95	28,77 -5,88	40,07 -9,20
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,25 -0,20	0,21 -0,50	1,00 -1,73	3,34 -3,20	7,18 -10,82	16,82 -17,83	27,29 -21,98
FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,25 -0,20	0,21 -0,50	0,99 -1,74	3,34 -3,21	7,17 -10,84	16,78 -17,87	27,24 -22,02
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO Var. IRF-M 1+ p.p.	0,78 -0,02	1,86 -0,06	2,58 -0,08	5,89 -0,11	13,88 -0,34	26,38 -0,68	43,90 -1,22
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IPCA + 6% p.p.	0,52 -0,15	1,83 0,44	3,20 0,14	5,06 -0,13	7,39 -2,83	18,21 -3,17	25,22 -7,01
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,71 0,33	1,44 0,61	1,89 0,64	3,96 1,09	10,48 3,96	19,23 5,38	31,51 6,45
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,08 -0,37	0,63 -0,09	3,21 0,48	8,70 2,15	23,37 5,36	41,76 7,10	56,38 7,11
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,41 -0,04	0,61 -0,10	1,53 -1,20	4,15 -2,39	9,09 -8,91	20,06 -14,60	33,19 -16,08
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,63 -0,06	1,02 -0,21	2,18 -0,26	5,12 -0,25	10,31 -0,88	20,84 -1,68	34,64 -3,12
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,46 0,01	0,94 -0,00	1,91 0,05	4,31 -0,05	11,46 0,39	22,39 0,50	35,25 -0,19
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6% p.p.	0,77 0,10	1,44 0,05	2,92 -0,14	6,35 1,16	14,56 4,34	27,12 5,74	42,44 10,21
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,62 0,37	1,44 0,98	2,04 0,43	5,45 3,26	14,23 10,23	25,27 17,21	37,87 26,74
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,70 0,25	1,51 0,80	3,02 0,29	6,73 0,19	16,03 -1,97	28,78 -5,87	40,06 -9,21
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,60 -0,08	1,06 -0,16	2,17 -0,27	4,96 -0,41	10,35 -0,84	20,98 -1,54	34,79 -2,98
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,44 -0,01	0,70 -0,01	2,69 -0,05	6,44 -0,10	17,76 -0,24	33,99 -0,66	48,16 -1,11
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-7,11 -0,94	-5,23 2,43	1,58 0,02	5,50 -2,02	24,87 3,23	47,72 5,41	86,40 18,79
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-6,37	-4,94	3,17	8,42	19,87	41,01	75,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Varição da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,19	2,72	1,61	0,89	-1,76	-1,30	7,68
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-8,73	-9,11	-1,64	1,17	10,05	23,89	46,59
Var. IBOVESPA p.p.	-0,30	0,81	2,12	-1,84	1,07	1,84	-9,68
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	-8,30	-9,83	-3,66	3,01	8,77	21,22	54,13
Var. IBOVESPA p.p.	0,13	0,09	0,09	0,00	-0,21	-0,83	-2,14
JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII	-0,95	-0,31	0,10	-0,01	0,34	-0,10	-0,19
Var. IFIX p.p.	2,74	7,00	-2,44	-11,57	-21,40	-28,33	-46,28
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-5,69	0,46	-1,30	8,85	26,84	48,66	81,60
Var. IBOVESPA p.p.	2,74	10,38	2,45	5,84	17,86	26,61	25,33
CDI	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,34	22,39
IBOVESPA	-8,43	-9,92	-3,75	3,00	8,98	22,05	56,27
INPC + 6%	0,59	1,29	3,03	5,12	10,13	21,34	30,86
IPCA + 6%	0,67	1,39	3,06	5,19	10,22	21,38	32,23

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	0,38	0,82	1,25	2,87	6,52	13,85	25,06
IRF-M 1+	0,80	1,92	2,66	6,01	14,22	27,05	45,12
IRF-M TOTAL	0,65	1,53	2,17	4,91	11,86	22,99	39,06
IMA-B 5	0,64	1,20	2,45	5,66	12,17	23,49	37,96
IMA-B 5+	0,32	0,35	2,96	7,23	22,04	43,07	58,49
IMA-B TOTAL	0,45	0,71	2,73	6,54	18,00	34,65	49,27
IMA-C TOTAL	0,63	3,18	3,59	6,91	18,59	39,02	52,96
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,44	0,95	1,87	4,36	11,07	21,89	35,44
IMA-GERAL TOTAL	0,45	1,01	1,91	4,43	11,28	22,36	35,89
IDKA 2	0,69	1,22	2,44	5,37	11,19	22,52	37,76
IDKA 20	-0,09	-1,46	2,43	6,69	27,19	57,08	70,16
CDI	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,34	22,39
Renda Variável							
IBOVESPA	-8,43	-9,92	-3,75	3,00	8,98	22,05	56,27
IBRX 100	-8,22	-9,37	-2,78	3,55	11,15	25,47	60,69
IBRX 50	-8,66	-10,38	-4,50	2,05	6,61	18,16	52,61
SMALL CAP	-8,27	-7,86	3,80	13,95	35,70	51,63	99,83
IFIX	-3,69	-7,31	2,54	11,56	21,74	28,23	46,08
Índice Consumo - ICON	-10,00	-6,70	0,78	4,44	34,77	34,01	67,27
Índice Dividendos - IDIV	-6,18	-7,66	1,56	7,52	21,63	42,31	67,61
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,25	0,46	1,62	2,20	4,00	8,05	11,13
INPC	0,17	0,36	1,58	2,12	3,92	8,02	9,97
IGPM	-0,04	0,44	2,54	3,53	6,82	14,94	14,46
SELIC	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,35	22,41
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
45	03/02/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	249,86	119,76079900	2,0863254190
72	06/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.395,40	172,41435138	8,0932937900
55	06/02/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	63.078,83	34.039,51544300	1,8531060000
59	06/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	373,07	0,00	46,09618896	8,0932937900
42	07/02/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	29.755,14	0,00	14.254,79626100	2,0873774310
60	07/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	201,96	0,00	24,95290727	8,0936460700
43	13/02/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	28.120,48	0,00	13.465,21757600	2,0883791770
73	17/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.078,14	133,17331224	8,0957662000
37	17/02/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	9.080,55	0,00	4.347,11350200	2,0888688540
50	17/02/2020	BB PREV RF VII	0,00	116.423,16	66.510,76533000	1,7504408410
48	17/02/2020	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	0,00	100.141,45	46.432,60078700	2,1567055970
49	17/02/2020	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	0,00	59.556,32	26.902,83672000	2,2137561410
51	17/02/2020	BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUB X FI	0,00	182.015,12	98.580,37635700	1,8463626000
52	17/02/2020	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	0,00	161.730,44	100.040,87406700	1,6166436120
70	18/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	488.954,60	0,00	60.393,69217647	8,0961203500
61	18/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	628.616,34	0,00	77.644,14474281	8,0961203500
58	18/02/2020	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	1.125.000,00	0,00	262.997,05378553	4,2776144600
53	18/02/2020	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	639.970,11	0,00	101.910,27447700	6,2797408140
74	19/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	167.364,94	20.671,33533199	8,0964745300
38	19/02/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	140.314,15	0,00	67.156,18923300	2,0893703410
62	19/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	13.351,60	1.649,06342283	8,0964745300
57	20/02/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2.578.767,86	0,00	666.818,33085441	3,8672720000
47	21/02/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	251.105,25	0,00	120.156,82707700	2,0898125900
75	21/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	167.029,30	20.628,07468396	8,0971832100
39	21/02/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	742,72	0,00	355,40028900	2,0898125900
64	21/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	738,70	91,22913370	8,0971832100
65	21/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	373,25	46,09618896	8,0971832100
66	21/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	202,05	24,95290727	8,0971832100

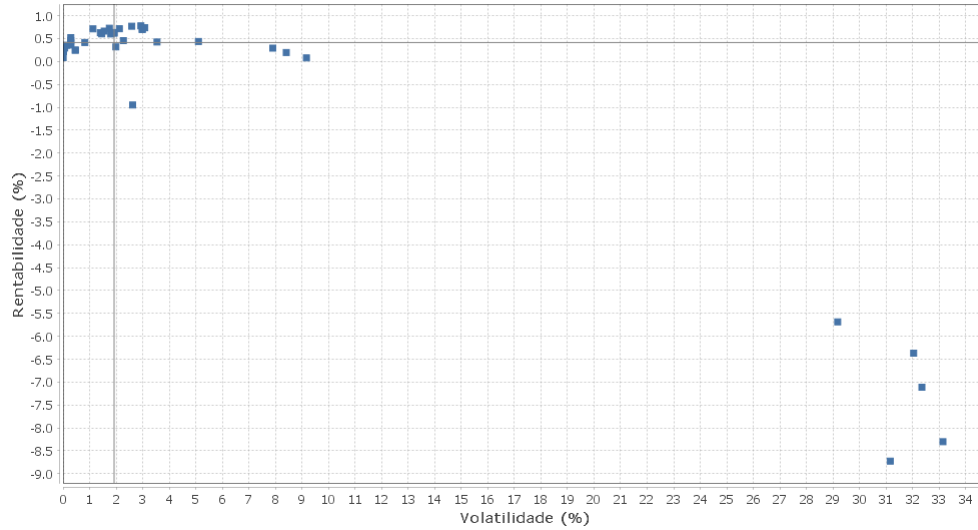
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
63	21/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.953,87	241,30217141	8,0971832100
67	21/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	225.994,20	27.910,22434831	8,0971832100
71	26/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.968.994,85	0,00	366.654,03526217	8,0975376400
40	26/02/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	95.219,90	0,00	45.558,60477500	2,0900530310
77	27/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	489.061,62	60.393,69217647	8,0978924600
78	27/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.975.777,08	243.986,57912516	8,0978924600
76	27/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	64.292,16	7.939,36983616	8,0978924600
41	27/02/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	7.245,23	0,00	3.466,10572200	2,0903084270
54	27/02/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	377.410,30	0,00	203.332,81073800	1,8561210000
68	27/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	371.431,69	45.867,69850664	8,0978924600
46	28/02/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	54.210,75	25.931,55327700	2,0905323110
79	28/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	589.096,45	72.743,69675870	8,0982473600
44	28/02/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	58.248,61	27.863,05176600	2,0905323110
56	28/02/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	308.541,81	166.208,23221100	1,8563570000
69	28/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	21.480,29	2.652,46152562	8,0982473600

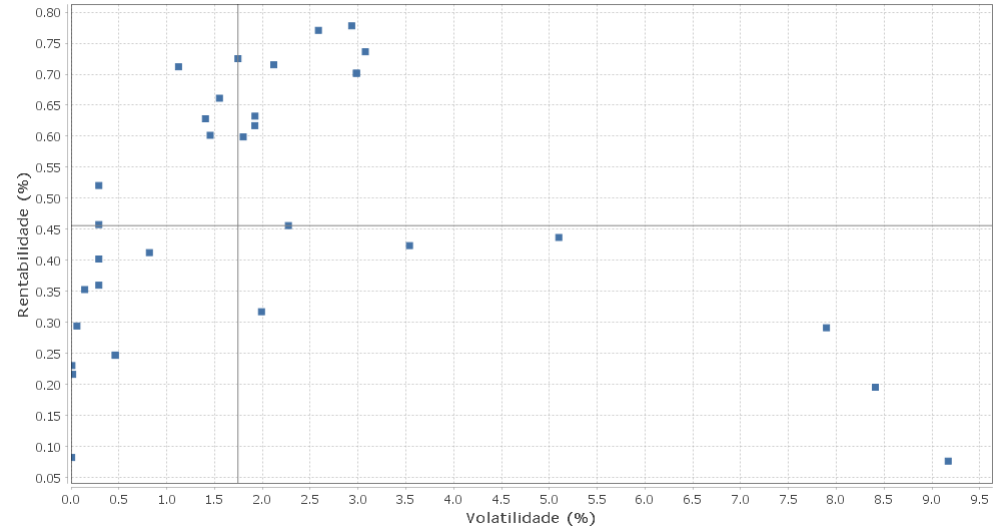
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

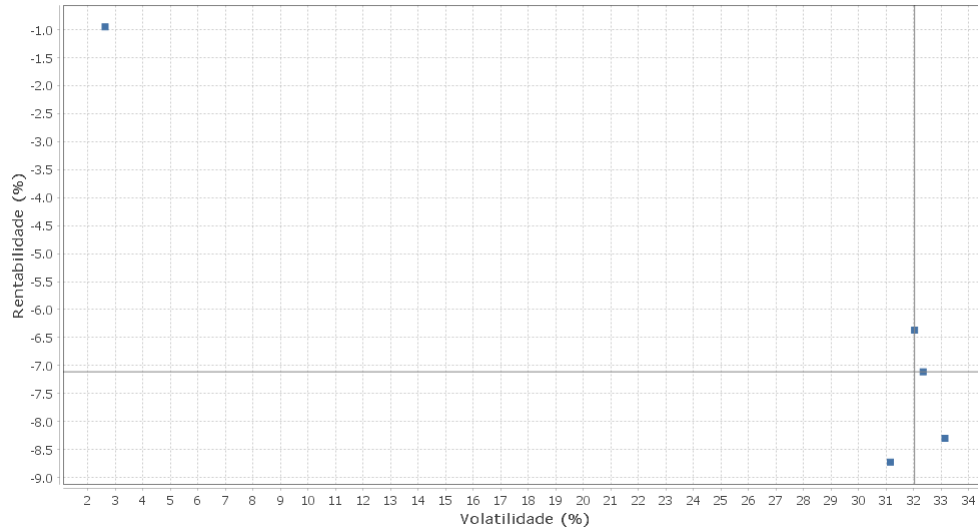
VILA VELHA - CONSOLIDADO - No Mês



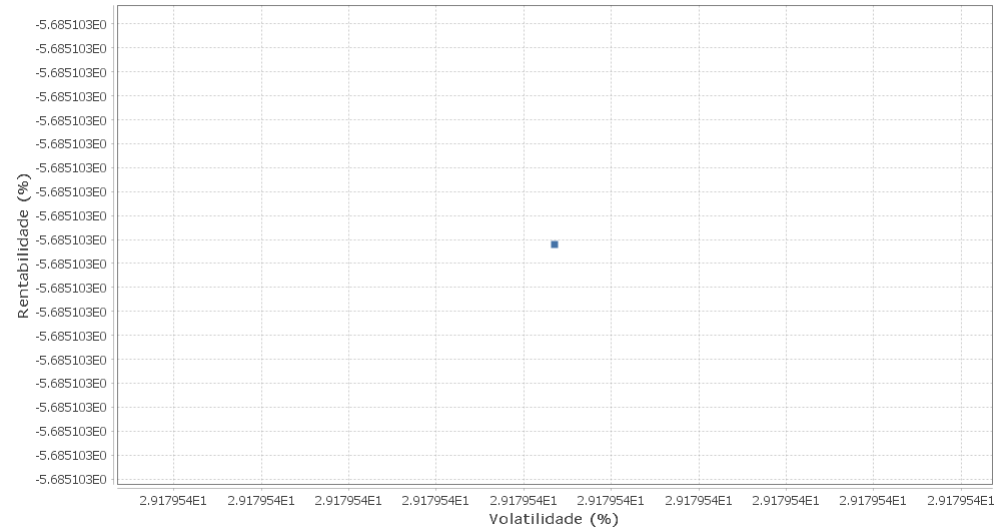
Renda Fixa - No Mês



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	0,01	0,01	0,00	-33,33	0,08	414.124,28	0,12
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,01	0,00	-7,36	0,23	850.848,68	0,24
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,00	-4,58	0,22	5.152.542,19	1,46
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,04	0,00	0,01	0,29	1.139.469,49	0,32
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,14	0,09	0,00	0,41	0,35	9.902.653,21	2,81
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,29	0,17	0,00	0,78	0,52	6.310.681,53	1,79
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,17	0,00	0,56	0,46	12.377.390,10	3,51
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,17	0,00	0,37	0,40	320.446,08	0,09
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,17	0,00	0,23	0,36	6.319.163,21	1,79
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,46	0,34	0,00	-0,10	0,25	12.826.426,90	3,64
FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,46	0,34	0,00	-0,10	0,25	3.761.043,95	1,07
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	0,82	0,45	0,00	0,15	0,41	4.332.504,39	1,23
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	1,12	0,50	0,01	0,37	0,71	9.191.929,27	2,61
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,41	0,76	0,02	0,24	0,63	15.375.698,75	4,37
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,46	0,74	0,03	0,21	0,60	22.826.374,78	6,48
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,55	0,90	0,01	0,24	0,66	3.897.674,10	1,11
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	Artigo 7º I, Alínea b	1,74	1,03	0,01	0,25	0,72	6.383.718,10	1,81
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	0,94	0,01	0,17	0,60	7.135.802,16	2,03
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,92	0,99	0,01	0,17	0,62	5.845.749,18	1,66
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,92	0,99	0,00	0,18	0,63	2.604.439,91	0,74
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	1,99	0,83	0,01	0,01	0,32	6.628.711,69	1,88
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,12	1,09	0,00	0,20	0,72	2.387.895,31	0,68
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,27	1,04	0,03	0,07	0,46	16.578.520,07	4,71
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	2,59	1,16	0,01	0,18	0,77	4.080.356,58	1,16
JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII	Artigo 8º IV, Alínea b	2,62	0,00	-0,00	-0,47	-0,95	1.001.947,23	0,28
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	2,93	1,45	0,01	0,17	0,78	5.476.278,90	1,55
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,98	1,35	0,05	0,14	0,70	19.473.629,91	5,53
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,98	1,38	0,00	0,14	0,70	14.628.110,40	4,15
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF	Artigo 7º VII, Alínea b	3,08	1,32	0,00	0,14	0,74	1.238.810,30	0,35

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	3,54	1,47	0,01	0,04	0,42	5.402.040,86	1,53
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,10	2,26	0,17	0,03	0,44	37.086.787,25	10,53
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,90	3,61	0,09	-0,00	0,29	12.241.985,38	3,48
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	8,41	3,93	0,07	-0,01	0,20	13.171.089,11	3,74
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	9,17	4,05	0,15	-0,02	0,08	27.055.993,73	7,68
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	29,18	7,55	0,04	-0,20	-5,69	5.018.931,38	1,42
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	31,16	9,10	0,28	-0,29	-8,73	12.980.567,23	3,69
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	32,04	8,19	0,14	-0,21	-6,37	7.643.776,20	2,17
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	32,35	7,49	0,15	-0,23	-7,11	8.498.780,44	2,41
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	33,14	7,70	0,26	-0,26	-8,30	14.673.627,60	4,17