



**LDB**  
EMPRESAS

**VILA VELHA**  
MARÇO 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

88,74%

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                | 0,57            | 2,05            | 6.354.936,56         | 1,93        |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150545 (4,290000%) .. | 0,36                | 0,62            | 2,20            | 322.425,24           | 0,10        |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150545 (5,100000%) .. | 0,36                | 0,69            | 2,39            | 12.462.250,58        | 3,78        |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b> |                             | <b>0,36</b>         | <b>0,64</b>     | <b>2,27</b>     | <b>19.139.612,38</b> | <b>5,80</b> |

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                      | 20,16               | -13,12          | -12,58          | 23.505.134,64 | 7,12       | 244.950.986,31    | 9,60    |
| BB       | BB       | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                | 0,45                | 0,60            | 1,38            | 12.186.708,49 | 3,69       | 6.969.533.398,64  | 0,17    |
| BB       | BB       | BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI                     | 11,10               | -6,98           | -6,33           | 34.497.023,20 | 10,45      | 5.743.378.118,49  | 0,60    |
| BB       | BB       | BB PREV RF IDKA2   | 3,77                | -1,66           | -0,66           | 15.120.055,24 | 4,58       | 6.723.745.548,10  | 0,22    |
| CEF      | CEF      | FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP          | 16,90               | -10,91          | -10,68          | 10.906.554,91 | 3,30       | 1.935.373.241,51  | 0,56    |
| CEF      | CEF      | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO | 7,48                | -0,45           | 1,41            | 5.451.856,36  | 1,65       | 2.758.205.111,21  | 0,20    |
| CEF      | CEF      | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP      | 3,65                | -1,45           | -0,41           | 22.494.549,73 | 6,82       | 8.199.299.170,30  | 0,27    |
| CEF      | CEF      | FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP             | 5,02                | -0,11           | 1,36            | 2.601.491,57  | 0,79       | 15.907.113.181,36 | 0,02    |
| BB       | BB       | BB PREV RF IPCA  | 5,54                | -1,89           | -0,47           | 4.003.307,94  | 1,21       | 338.561.511,94    | 1,18    |
| BB       | BB       | BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI                   | 5,68                | -2,06           | -0,68           | 2.338.713,39  | 0,71       | 277.202.048,31    | 0,84    |
| BANESTES | BANESTES | BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1                        | 3,98                | 1,11            | 2,57            | 9.294.410,53  | 2,82       | 145.422.021,85    | 6,39    |
| BB       | BB       | BB PREV RF VII   | 2,22                | -1,34           | -0,74           | 4.274.393,26  | 1,30       | 667.671.168,60    | 0,64    |
| BB       | BB       | BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI                        | 4,78                | -1,93           | -0,82           | 6.998.326,89  | 2,12       | 539.857.456,12    | 1,30    |
| BB       | BB       | BB PREVIDENCIÁRIO XI TP                                  | 4,70                | -1,73           | -0,39           | 6.273.012,61  | 1,90       | 192.010.008,06    | 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               | 5,33                | -2,10           | -1,18           | 16.230.163,84         | 4,92         | 10.536.452.770,12 | 0,15    |
| CEF                                    | CEF    | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF   | 5,32                | -0,13           | 1,31            | 5.838.110,23          | 1,77         | 11.020.077.699,37 | 0,05    |
| CEF                                    | CEF    | FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF     | 1,13                | -1,13           | -0,92           | 3.718.400,92          | 1,13         | 253.416.222,89    | 1,47    |
| CEF                                    | CEF    | FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF    | 7,84                | -2,69           | -1,23           | 18.949.276,39         | 5,74         | 1.360.035.773,21  | 1,39    |
| CEF                                    | CEF    | FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF    | 1,13                | -1,13           | -0,92           | 12.681.150,76         | 3,84         | 983.585.151,09    | 1,29    |
| CEF                                    | CEF    | FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF     | 27,13               | -2,69           | -1,23           | 14.234.157,00         | 4,31         | 437.249.635,23    | 3,26    |
| BB                                     | BB     | BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI | 4,19                | -1,65           | -0,46           | 3.833.203,63          | 1,16         | 511.077.659,07    | 0,75    |
| CEF                                    | CEF    | FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF     | 2,73                | 0,76            | 2,61            | 6.358.827,80          | 1,93         | 82.243.125,27     | 7,73    |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b> |        |  | <b>5,86</b>         | <b>-3,97</b>    | <b>-3,05</b>    | <b>241.788.829,33</b> | <b>73,26</b> |                   |         |

## 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            | 0,28            | 173.435,81           | 0,05        | 653.242.969,82   | 0,03    |
| BANESTES                                | BANESTES | BANESTES INSTITUCIONAL FI RF                     | 22,83               | -14,22          | -13,42          | 11.284.633,94        | 3,42        | 196.839.318,27   | 5,73    |
| BB                                      | BB       | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 0,05                | 0,25            | 0,75            | 5.503.130,74         | 1,67        | 1.561.401.900,27 | 0,35    |
| CEF                                     | CEF      | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF              | 0,05                | 0,26            | 0,80            | 855.826,89           | 0,26        | 579.404.055,27   | 0,15    |
| BANESTES                                | BANESTES | BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI          | 0,57                | -1,31           | -0,63           | 1.124.516,54         | 0,34        | 2.377.431.261,25 | 0,05    |
| BANESTES                                | BANESTES | BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF                 | 2,55                | -1,74           | -0,72           | 5.307.876,94         | 1,61        | 221.275.689,72   | 2,40    |
| <b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b> |          |  | <b>10,56</b>        | <b>-7,70</b>    | <b>-6,89</b>    | <b>24.249.420,86</b> | <b>7,35</b> |                  |         |

## 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 | 4,08                | -2,03           | -0,90           | 6.493.827,81          | 1,97         | 579.731.612,89 | 1,12    |
| CEF                                      | CEF    | FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF            | 7,37                | -2,91           | -1,40           | 1.202.768,00          | 0,36         | 181.127.004,20 | 0,66    |
| <b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b> |        |  | <b>4,57</b>         | <b>-2,17</b>    | <b>-0,98</b>    | <b>7.696.595,81</b>   | <b>2,33</b>  |                |         |
| <b>Renda Fixa</b>                        |        |  | <b>5,33</b>         | <b>-3,95</b>    | <b>-2,98</b>    | <b>292.874.458,38</b> | <b>88,74</b> |                |         |

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS**

**9,65%**

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 | 40,32               | -29,71          | -36,62          | 10.313.617,10        | 3,12        | 477.022.607,99 | 2,16    |
| <b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b> |        |                          | <b>40,32</b>        | <b>-29,71</b>   | <b>-36,62</b>   | <b>10.313.617,10</b> | <b>3,12</b> |                |         |

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                                    | 34,90               | -29,38          | -35,81          | 9.167.280,60         | 2,78        | 751.642.834,81 | 1,22    |
| VINCI                                   | CEF      | FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS         | 35,44               | -27,40          | -30,98          | 5.549.317,31         | 1,68        | 668.247.605,13 | 0,83    |
| BANESTES                                | BANESTES | BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL | 41,55               | -31,64          | -35,22          | 5.809.534,17         | 1,76        | 109.237.299,41 | 5,32    |
| <b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b> |          |  | <b>36,53</b>        | <b>-29,52</b>   | <b>-34,40</b>   | <b>20.526.132,08</b> | <b>6,22</b> |                |         |

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 | 1,44                | -0,36           | -0,66           | 998.362,93        | 0,30        | 125.211.085,03 | 0,80    |
| <b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b> |        |   | <b>1,44</b>         | <b>-0,36</b>    | <b>-0,66</b>    | <b>998.362,93</b> | <b>0,30</b> |                |         |

**Renda Variável e Investimentos Estruturados**      **36,58**      **-28,93**      **-34,47**      **31.838.112,11**      **9,65**

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,62%

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 | 23,76               | 6,30            | 6,80            | 5.335.318,35          | 1,62          | 876.229.505,18 | 0,61    |
| <b>Sub-total Artigo 9º A, III</b> |        |                                     | <b>23,76</b>        | <b>6,30</b>     | <b>6,80</b>     | <b>5.335.318,35</b>   | <b>1,62</b>   |                |         |
| Investimentos no Exterior         |        |                                     | 23,76               | 6,30            | 6,80            | 5.335.318,35          | 1,62          |                |         |
| <b>Total</b>                      |        |                                     | <b>7,77</b>         | <b>-6,98</b>    | <b>-7,27</b>    | <b>330.047.888,84</b> | <b>100,00</b> |                |         |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Enquadramento da Carteira

| Artigo   | Tipo de Ativo  | Valor(R\$)            | % Carteira   | Política de Investimentos |          |        |              |
|--|--|-----------------------|--------------|---------------------------|----------|--------|--------------|
|  |  |                       |              | Mínimo                    | Objetivo | Máximo | Limite Legal |
| <b>Renda Fixa</b>                                  |  |                       |              |                           |          |        |              |
| Artigo 7º I, Alínea a                              | Títulos do Tesouro Nacional                              | 19.139.612,38         | 5,80         | 0,00                      | 47,50    | 100,00 | 100,00       |
| Artigo 7º I, Alínea b                              | Fundos 100% Títulos Públicos                             | 241.788.829,33        | 73,26        | 0,00                      | 20,00    | 100,00 | 100,00       |
| Artigo 7º IV, Alínea a                             | Fundos de Renda Fixa                                     | 24.249.420,86         | 7,35         | 0,00                      | 5,00     | 40,00  | 40,00        |
| Artigo 7º VII, Alínea b                            | Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"                      | 7.696.595,81          | 2,33         | 0,00                      | 2,50     | 5,00   | 5,00         |
|  | <b>Total Renda Fixa</b>                                  | <b>292.874.458,38</b> | <b>88,74</b> |                           |          |        |              |
| <b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b> |  |                       |              |                           |          |        |              |
| Artigo 8º I, Alínea a                              | Fundos de Ações Referenciados                            | 10.313.617,10         | 3,12         | 0,00                      | 10,00    | 30,00  | 30,00        |
| Artigo 8º II, Alínea a                             | Fundos de Ações  | 20.526.132,08         | 6,22         | 0,00                      | 13,00    | 20,00  | 20,00        |
| Artigo 8º IV, Alínea b                             | Fundos de Investimentos Imobiliários                     | 998.362,93            | 0,30         | 0,00                      | 1,00     | 5,00   | 5,00         |
|  | <b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b> | <b>31.838.112,11</b>  | <b>9,65</b>  |                           |          |        |              |
| <b>Investimentos no Exterior</b>                   |  |                       |              |                           |          |        |              |
| Artigo 9º A, III                                   | Ações - BDR Nível I                                      | 5.335.318,35          | 1,62         | 0,00                      | 1,00     | 10,00  | 10,00        |
|  | <b>Total Investimentos no Exterior</b>                   | <b>5.335.318,35</b>   | <b>1,62</b>  |                           |          |        |              |



## 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<br>% do CDI            | 0,64<br>190,55     | 2,27<br>224,59   | 2,27<br>224,59   | 4,57<br>201,89   | 8,75<br>161,02  | 122.612,99     | 425.387,56     |
| Artigo 7º I, Alínea b<br>% do CDI            | -3,97<br>-1.174,61 | -3,05<br>-300,95 | -3,05<br>-300,95 | -0,65<br>-28,63  | 8,46<br>155,66  | -9.835.424,43  | -7.444.225,85  |
| Artigo 7º IV, Alínea a<br>% do CDI           | -7,70<br>-2.276,40 | -6,89<br>-680,58 | -6,89<br>-680,58 | -4,95<br>-218,67 | 3,55<br>65,26   | -1.965.454,95  | -1.749.511,86  |
| Artigo 7º VII, Alínea b<br>% do CDI          | -2,17<br>-642,06   | -0,98<br>-97,12  | -0,98<br>-97,12  | 1,46<br>64,42    | 8,54<br>157,09  | -170.926,18    | -76.408,60     |
| Artigo 8º I, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p.  | -29,71<br>0,19     | -36,62<br>0,24   | -36,62<br>0,24   | -30,06<br>0,23   | -23,40<br>0,08  | -4.360.010,50  | -5.959.460,24  |
| Artigo 8º II, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p. | -29,52<br>0,38     | -34,40<br>2,46   | -34,40<br>2,46   | -27,63<br>2,66   | -16,89<br>6,58  | -8.596.991,79  | -10.863.914,47 |
| Artigo 8º IV, Alínea b<br>Var. IBOVESPA p.p. | -0,36<br>29,55     | -0,66<br>36,20   | -0,66<br>36,20   | -0,27<br>30,02   | -0,59<br>22,88  | -3.584,30      | -6.658,62      |
| Artigo 9º A, III<br>% do CDI                 | 6,30<br>1.863,01   | 6,80<br>671,49   | 6,80<br>671,49   | 12,71<br>561,33  | 27,06<br>497,76 | 316.386,97     | 22.342,73      |
|  |                    |                  |                  |                  |                 | -24.493.392,19 | -25.652.449,35 |

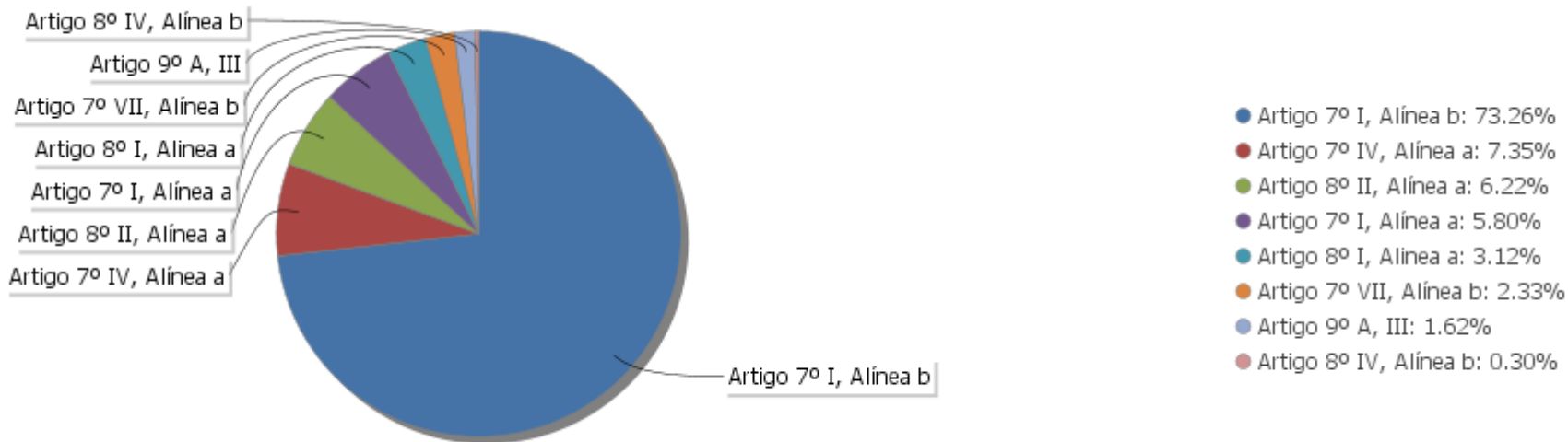
## Análise de Liquidez

| Período           | Valor (R\$)    | (%)   | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 224.794.015,33 | 68,11 | 224.794.015,33        | 68,11     |
| de 31 a 364 dias  | 11.358.851,48  | 3,44  | 236.152.866,81        | 71,55     |
| acima de 365 dias | 93.895.022,03  | 28,45 | 330.047.888,84        | 100,00    |

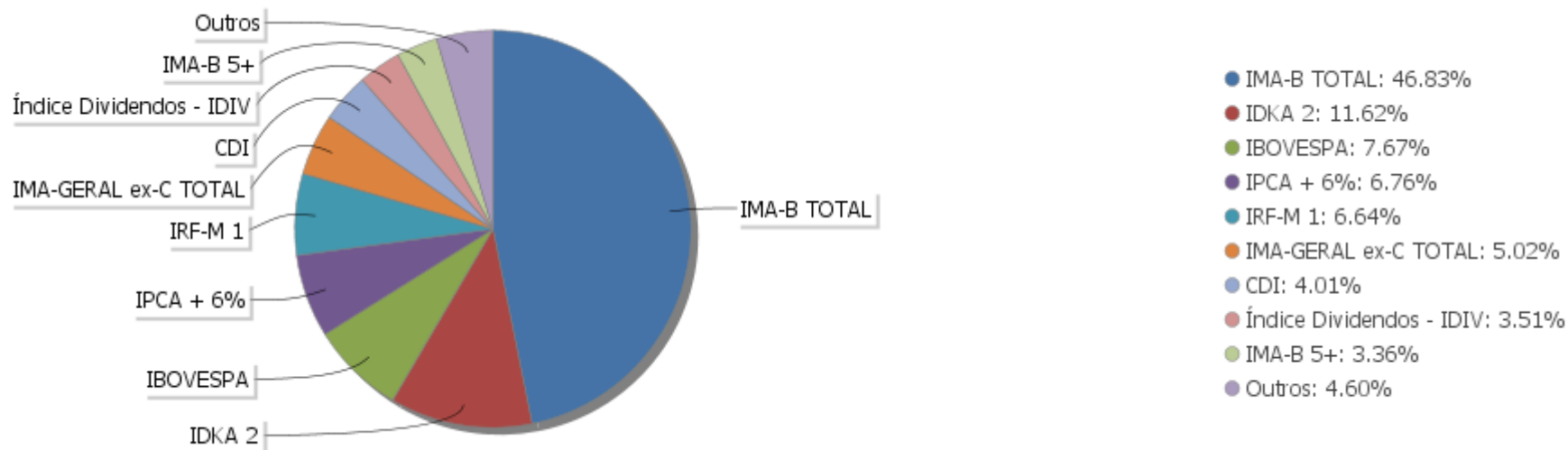


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

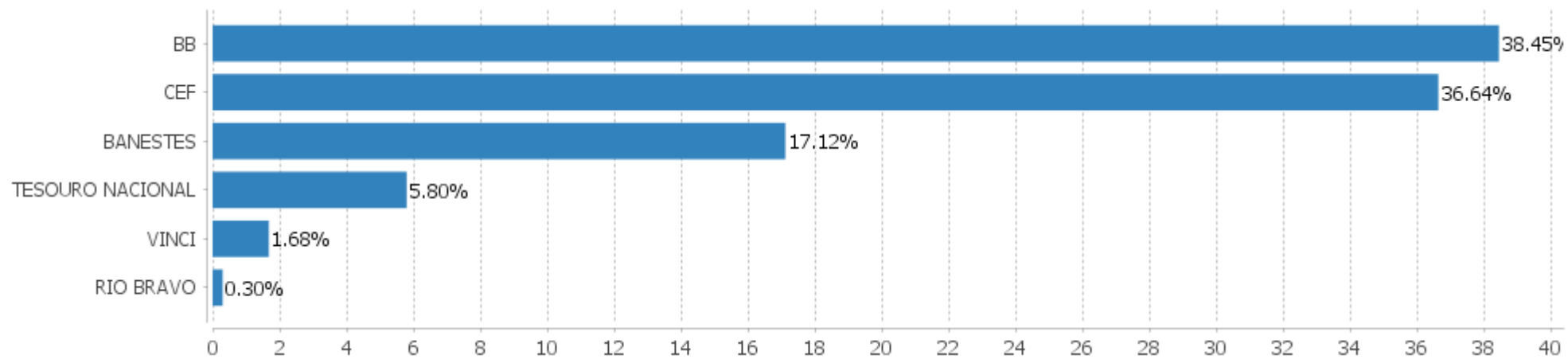


Alocação Por Estratégia



## 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 |      |      |      |      |       |       |      |       |      | -7,27     |
| IPCA + 5,87%   | 0,71  | 0,66  | 0,57  |      |      |      |      |       |       |      |       |      | 1,95      |
| p.p. indexador | -0,22 | -1,45 | -7,55 |      |      |      |      |       |       |      |       |      | -9,22     |
| 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      |

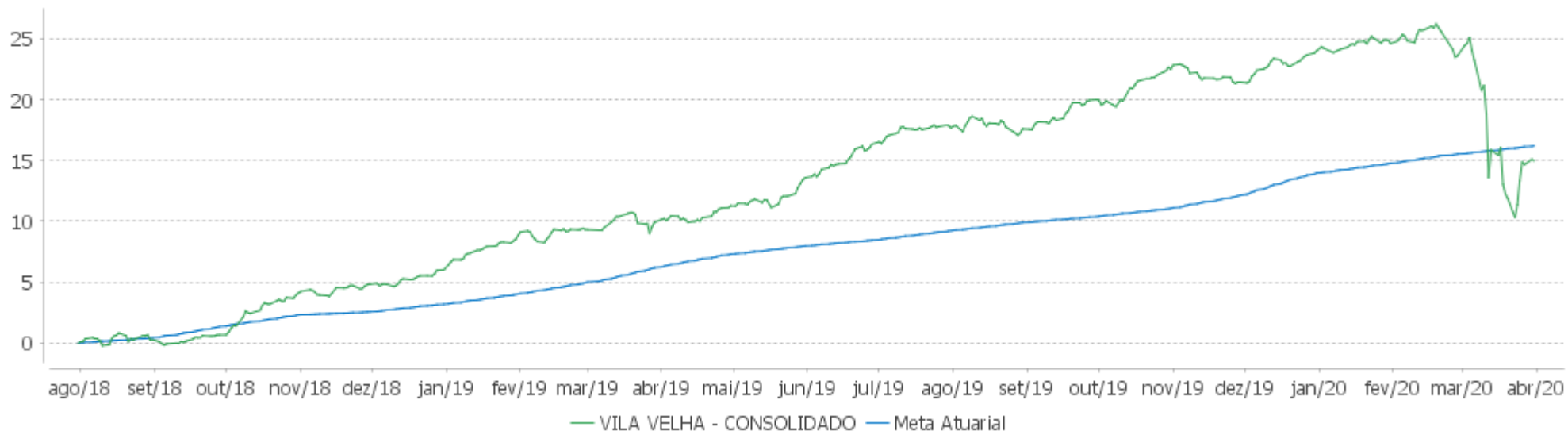
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

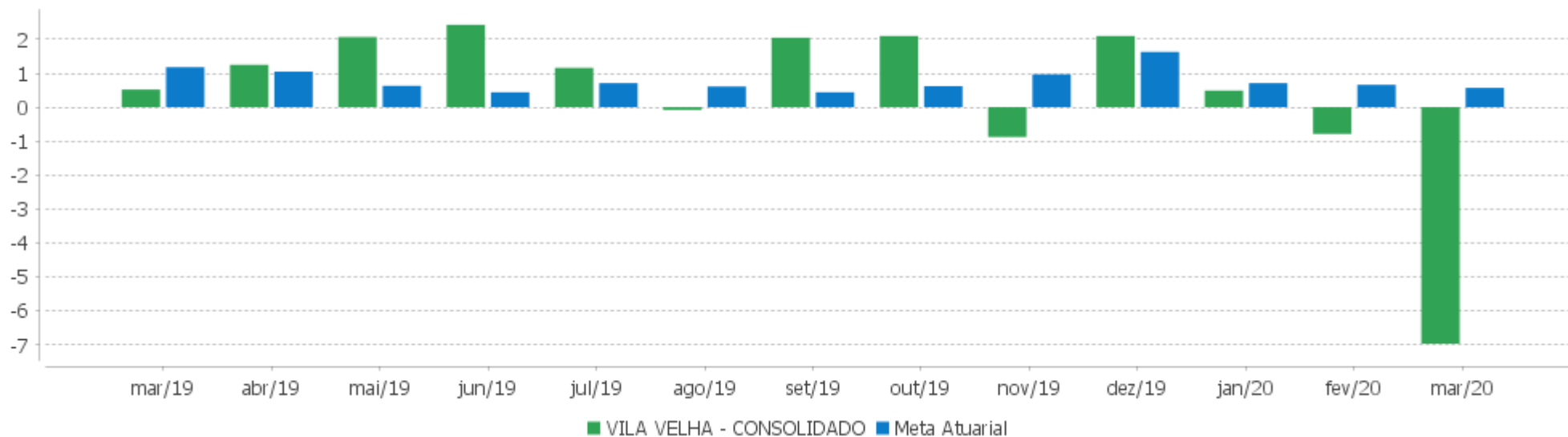
|                                 | Quantidade | Perc. (%) | Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial    | 11         | 55,00     | 03 meses         | -7,27    | 1,95          | -9,22      | 14,70              |
| Meses abaixo da Meta Atuarial   | 9          | 45,00     | 06 meses         | -4,17    | 5,30          | -9,48      | 10,59              |
|                                 |            |           | 12 meses         | 4,63     | 9,52          | -4,89      | 7,77               |
|                                 |            |           | 24 meses         |          |               |            |                    |
|                                 |            |           | 36 meses         |          |               |            |                    |
| Maior rentabilidade da Carteira | 3,39       | 2018-10   |                  |          |               |            |                    |
| Menor rentabilidade da Carteira | -6,98      | 2020-03   | Desde 31/07/2018 | 14,99    | 16,39         | -1,40      | 6,35               |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Performance dos Fundos

| Fundo<br>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<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                | -2,06<br>4,91   | -0,68<br>5,63   | -0,68<br>5,63   | 1,89<br>5,53    | 10,67<br>1,53  | 21,36<br>-2,74  | 36,83<br>-0,60  |
| BB PREVIDENCIÁRIO XI TP<br>Var. IMA-B 5 p.p.                                   | -1,73<br>0,02   | -0,39<br>0,18   | -0,39<br>0,18   | 2,03<br>0,00    | 10,06<br>0,72  | 20,31<br>0,92   | 35,61<br>1,93   |
| BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI<br>Var. IPCA + 6% p.p.          | -1,65<br>-2,23  | -0,46<br>-2,44  | -0,46<br>-2,44  | 1,96<br>-3,37   | 9,42<br>-0,13  | 29,59<br>8,20   | 41,12<br>9,16   |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI<br>Var. IRF-M 1 p.p.                 | 0,60<br>-0,01   | 1,38<br>-0,06   | 1,38<br>-0,06   | 2,70<br>-0,13   | 6,40<br>-0,26  | 13,27<br>-0,53  | 23,59<br>-0,83  |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IRF-M TOTAL p.p.          | -0,11<br>-0,01  | 1,36<br>-0,06   | 1,36<br>-0,06   | 3,20<br>-0,11   | 10,78<br>-0,31 | 20,64<br>-0,61  | 35,89<br>-0,97  |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5+ p.p.          | -10,91<br>0,02  | -10,68<br>-0,07 | -10,68<br>-0,07 | -8,13<br>-0,22  | 7,75<br>-0,49  | 25,87<br>-1,08  | 38,51<br>-1,44  |
| FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.            | -2,69<br>4,28   | -1,23<br>5,08   | -1,23<br>5,08   | 1,63<br>5,27    | 11,90<br>2,76  | 22,62<br>-1,48  | 34,70<br>-2,72  |
| BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                     | -1,93<br>5,05   | -0,82<br>5,49   | -0,82<br>5,49   | 1,75<br>5,39    | 9,49<br>0,35   | 19,40<br>-4,70  | 34,41<br>-3,02  |
| FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.           | -1,13<br>5,84   | -0,92<br>5,39   | -0,92<br>5,39   | 1,46<br>5,11    | 5,35<br>-3,79  | 13,64<br>-10,47 | 23,81<br>-13,61 |
| FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.            | -1,13<br>5,84   | -0,92<br>5,38   | -0,92<br>5,38   | 1,46<br>5,10    | 5,33<br>-3,81  | 13,60<br>-10,50 | 23,77<br>-13,66 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO<br>Var. IRF-M 1+ p.p. | -0,45<br>0,03   | 1,41<br>-0,03   | 1,41<br>-0,03   | 3,50<br>-0,07   | 12,70<br>-0,26 | 23,91<br>-0,60  | 41,11<br>-1,00  |
| FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IPCA + 6% p.p.              | 0,76<br>0,18    | 2,61<br>0,63    | 2,61<br>0,63    | 5,28<br>-0,05   | 7,16<br>-2,40  | 18,25<br>-3,13  | 25,14<br>-6,82  |
| BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1<br>Var. IRF-M 1 p.p.                         | 1,11<br>0,51    | 2,57<br>1,14    | 2,57<br>1,14    | 4,09<br>1,26    | 11,15<br>4,49  | 19,40<br>5,61   | 31,38<br>6,96   |
| BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                   | -13,12<br>-6,15 | -12,58<br>-6,27 | -12,58<br>-6,27 | -10,06<br>-6,42 | 6,89<br>-2,25  | 23,16<br>-0,94  | 35,15<br>-2,28  |
| BB PREV RF VII<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.  | -1,34<br>5,63   | -0,74<br>5,57   | -0,74<br>5,57   | 1,66<br>5,30    | 6,93<br>-2,21  | 16,97<br>-7,14  | 29,44<br>-7,98  |
| BB PREV RF IDKA2<br>Var. IDKA 2 p.p.   | -1,66<br>-0,45  | -0,66<br>-0,66  | -0,66<br>-0,66  | 1,94<br>-0,52   | 7,78<br>-1,34  | 17,10<br>-2,04  | 30,56<br>-3,36  |
| BB PREV RF IPCA  | -1,89           | -0,47           | -0,47           | 2,19            | 11,28          | 22,26           | 37,52           |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>Variação da Estratégia   | No Mês           | No Ano          | 3 meses         | 6 meses         | 12 meses        | 24 meses        | 36 meses       |
|---|------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|----------------|
| Var. IPCA + 6% p.p.   | -2,47            | -2,46           | -2,46           | -3,14           | 1,72            | 0,88            | 5,56           |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI<br>Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.      | -2,10<br>-0,17   | -1,18<br>-0,17  | -1,18<br>-0,17  | 0,61<br>-0,26   | 8,55<br>0,22    | 18,63<br>0,23   | 30,83<br>-0,39 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF<br>Var. IPCA p.p.          | -0,13<br>-0,20   | 1,31<br>0,78    | 1,31<br>0,78    | 3,13<br>0,82    | 13,46<br>10,16  | 23,65<br>15,62  | 35,73<br>24,81 |
| FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.    | -2,69<br>4,28    | -1,23<br>5,08   | -1,23<br>5,08   | 1,63<br>5,27    | 11,89<br>2,75   | 22,62<br>-1,48  | 34,69<br>-2,73 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IDKA 2 p.p. | -1,45<br>-0,24   | -0,41<br>-0,41  | -0,41<br>-0,41  | 1,98<br>-0,48   | 8,03<br>-1,08   | 17,44<br>-1,70  | 30,97<br>-2,96 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.           | -6,98<br>-0,01   | -6,33<br>-0,02  | -6,33<br>-0,02  | -3,73<br>-0,09  | 8,93<br>-0,22   | 23,52<br>-0,58  | 36,42<br>-1,00 |
| FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF<br>Var. IPCA + 6% p.p.                      | -2,91<br>-3,49   | -1,40<br>-3,38  | -1,40<br>-3,38  | 1,20<br>-4,13   | 11,23<br>1,68   | 21,29<br>-0,09  | 31,27<br>-0,69 |
| BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI<br>Var. IPCA + 6% p.p.           | -2,03<br>-2,62   | -0,90<br>-2,89  | -0,90<br>-2,89  | 1,51<br>-3,83   | 8,06<br>-1,50   | 18,88<br>-2,50  | 34,46<br>2,50  |
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                   | -14,22<br>-7,25  | -13,42<br>-7,11 | -13,42<br>-7,11 | -11,76<br>-8,12 | 4,77<br>-4,37   | 17,76<br>-6,34  | 29,41<br>-8,01 |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI<br>% do CDI                     | -1,31<br>-387,82 | -0,63<br>-62,35 | -0,63<br>-62,35 | 0,40<br>17,76   | 3,68<br>67,66   | 10,81<br>89,12  | 20,84<br>96,79 |
| BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF<br>% do CDI                            | -1,74<br>-515,15 | -0,72<br>-71,11 | -0,72<br>-71,11 | 2,81<br>123,97  | 12,99<br>238,97 |                 |                |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO<br>% do CDI            | 0,08<br>23,94    | 0,28<br>27,79   | 0,28<br>27,79   | 0,77<br>33,86   | 2,35<br>43,13   | 5,69<br>46,90   | 11,31<br>52,53 |
| BB PREV RF FLUXO FIC<br>% do CDI  | 0,25<br>73,55    | 0,75<br>74,38   | 0,75<br>74,38   | 1,73<br>76,27   | 4,31<br>79,23   | 9,74<br>80,32   | 17,73<br>82,36 |
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF<br>% do CDI                         | 0,26<br>78,23    | 0,80<br>79,03   | 0,80<br>79,03   | 1,83<br>81,02   | 4,55<br>83,67   | 10,26<br>84,64  | 18,56<br>86,21 |
| NTN-B 150545 (5,100000%) ..<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                    | 0,69<br>7,66     | 2,39<br>8,70    | 2,39<br>8,70    | 4,81<br>8,46    | 9,11<br>-0,03   |                 |                |
| NTN-B 150545 (4,290000%) ..<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                    | 0,62<br>7,59     | 2,20<br>8,51    | 2,20<br>8,51    | 4,41<br>8,05    | 8,27<br>-0,87   |                 |                |
| NTN-B 150545 (3,680000%) ..<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                    | 0,57<br>7,54     | 2,05<br>8,36    | 2,05<br>8,36    | 4,10<br>7,75    | 7,63<br>-1,51   |                 |                |
| FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA<br>Var. IBOVESPA p.p.                         | -29,71<br>0,19   | -36,62<br>0,24  | -36,62<br>0,24  | -30,06<br>0,23  | -23,40<br>0,08  | -14,79<br>-0,32 | 11,23<br>-1,13 |
| BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL                  | -31,64           | -35,22          | -35,22          | -28,77          | -13,41          | -0,89           | 26,00          |

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

| <b>Fundo</b><br><b>Varição da Estratégia</b>                 | <b>No Mês</b> | <b>No Ano</b> | <b>3 meses</b> | <b>6 meses</b> | <b>12 meses</b> | <b>24 meses</b> | <b>36 meses</b> |
|--|---------------|---------------|----------------|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.                           | -6,11         | -3,98         | -3,98          | -7,35          | -5,64           | -5,77           | -1,17           |
| <b>FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS</b>        | <b>-27,40</b> | <b>-30,98</b> | <b>-30,98</b>  | <b>-22,11</b>  | <b>-12,36</b>   | <b>1,73</b>     | <b>28,59</b>    |
| Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.                           | -1,87         | 0,25          | 0,25           | -0,69          | -4,59           | -3,15           | 1,41            |
| <b>BB AÇÕES DIVIDENDOS</b>                                   | <b>-29,38</b> | <b>-35,81</b> | <b>-35,81</b>  | <b>-29,79</b>  | <b>-21,20</b>   | <b>-13,42</b>   | <b>5,74</b>     |
| Var. IBOVESPA p.p.   | 0,53          | 1,05          | 1,05           | 0,50           | 2,27            | 1,04            | -6,63           |
| <b>JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII</b> | <b>-0,36</b>  | <b>-0,66</b>  | <b>-0,66</b>   | <b>-0,27</b>   | <b>-0,59</b>    | <b>-0,51</b>    | <b>-0,50</b>    |
| Var. IFIX p.p.   | 15,49         | 21,34         | 21,34          | 6,81           | -1,04           | -6,30           | -23,19          |
| <b>FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I</b>                   | <b>6,30</b>   | <b>6,80</b>   | <b>6,80</b>    | <b>12,71</b>   | <b>27,06</b>    | <b>62,46</b>    | <b>91,78</b>    |
| Var. IBOVESPA p.p.   | 36,21         | 43,65         | 43,65          | 43,00          | 50,53           | 76,92           | 79,42           |
| <b>CDI</b>   | <b>0,34</b>   | <b>1,01</b>   | <b>1,01</b>    | <b>2,26</b>    | <b>5,44</b>     | <b>12,12</b>    | <b>21,53</b>    |
| <b>IBOVESPA</b>  | <b>-29,90</b> | <b>-36,86</b> | <b>-36,86</b>  | <b>-30,29</b>  | <b>-23,47</b>   | <b>-14,46</b>   | <b>12,37</b>    |
| <b>INPC + 6%</b>   | <b>0,69</b>   | <b>1,99</b>   | <b>1,99</b>    | <b>5,38</b>    | <b>9,56</b>     | <b>21,50</b>    | <b>30,65</b>    |
| <b>IPCA + 6%</b>   | <b>0,58</b>   | <b>1,98</b>   | <b>1,98</b>    | <b>5,33</b>    | <b>9,55</b>     | <b>21,38</b>    | <b>31,96</b>    |



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Indexadores

| Indexador                     | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|-------------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| <b>Renda Fixa</b>             |        |        |         |         |          |          |          |
| IRF-M 1                       | 0,60   | 1,43   | 1,43    | 2,83    | 6,66     | 13,79    | 24,42    |
| IRF-M 1+                      | -0,47  | 1,44   | 1,44    | 3,57    | 12,96    | 24,50    | 42,11    |
| IRF-M TOTAL                   | -0,11  | 1,42   | 1,42    | 3,31    | 11,09    | 21,25    | 36,85    |
| IMA-B 5                       | -1,75  | -0,57  | -0,57   | 2,03    | 9,34     | 19,39    | 33,68    |
| IMA-B 5+                      | -10,93 | -10,62 | -10,62  | -7,92   | 8,24     | 26,94    | 39,94    |
| IMA-B TOTAL                   | -6,97  | -6,31  | -6,31   | -3,64   | 9,14     | 24,10    | 37,42    |
| IMA-C TOTAL                   | -3,52  | -0,45  | -0,45   | 1,38    | 13,06    | 32,40    | 46,04    |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL          | -1,93  | -1,00  | -1,00   | 0,87    | 8,34     | 18,40    | 31,22    |
| IMA-GERAL TOTAL               | -1,98  | -0,99  | -0,99   | 0,89    | 8,47     | 18,79    | 31,60    |
| IDKA 2                        | -1,21  | -0,00  | -0,00   | 2,46    | 9,11     | 19,14    | 33,92    |
| IDKA 20                       | -16,46 | -17,67 | -17,67  | -14,94  | 5,94     | 33,16    | 42,21    |
| CDI                           | 0,34   | 1,01   | 1,01    | 2,26    | 5,44     | 12,12    | 21,53    |
| <b>Renda Variável</b>         |        |        |         |         |          |          |          |
| IBOVESPA                      | -29,90 | -36,86 | -36,86  | -30,29  | -23,47   | -14,46   | 12,37    |
| IBRX 100                      | -30,09 | -36,64 | -36,64  | -29,86  | -22,20   | -12,35   | 15,05    |
| IBRX 50                       | -30,37 | -37,60 | -37,60  | -31,47  | -25,64   | -17,77   | 8,61     |
| SMALL CAP                     | -35,07 | -40,17 | -40,17  | -27,52  | -11,98   | -1,62    | 31,66    |
| IFIX                          | -15,85 | -22,00 | -22,00  | -7,08   | 0,45     | 5,79     | 22,69    |
| Índice Consumo - ICON         | -31,51 | -36,10 | -36,10  | -30,32  | -6,98    | -7,63    | 14,29    |
| Índice Dividendos - IDIV      | -25,53 | -31,24 | -31,24  | -21,42  | -7,78    | 4,87     | 27,17    |
| <b>Indicadores Econômicos</b> |        |        |         |         |          |          |          |
| IPCA                          | 0,07   | 0,53   | 0,53    | 2,31    | 3,30     | 8,03     | 10,93    |
| INPC                          | 0,18   | 0,54   | 0,54    | 2,36    | 3,31     | 8,13     | 9,82     |
| IGPM                          | 1,24   | 1,69   | 1,69    | 4,83    | 6,81     | 15,64    | 15,87    |
| SELIC                         | 0,34   | 1,01   | 1,01    | 2,26    | 5,44     | 12,13    | 21,55    |
| <b>Meta Atuarial</b>          |        |        |         |         |          |          |          |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

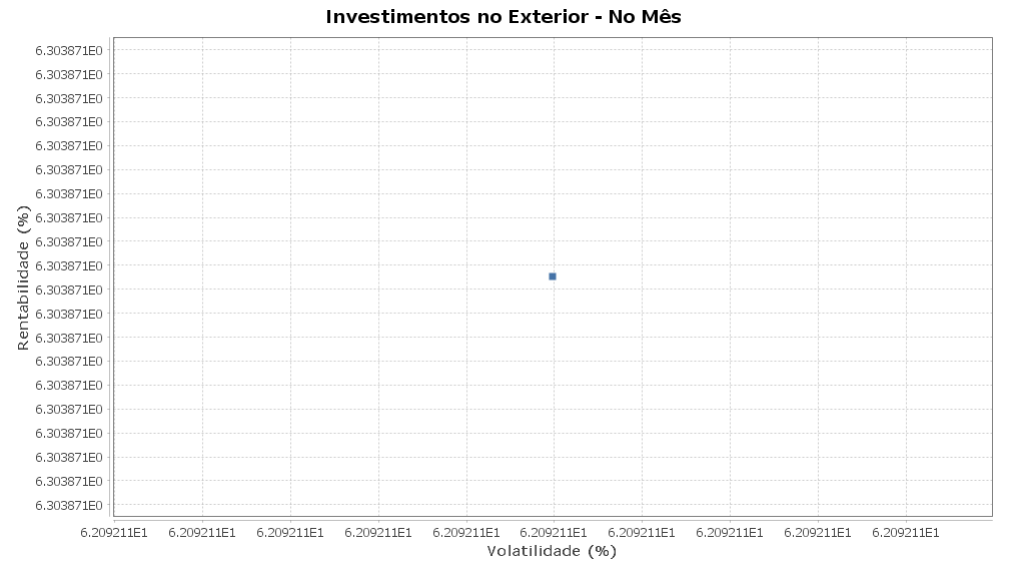
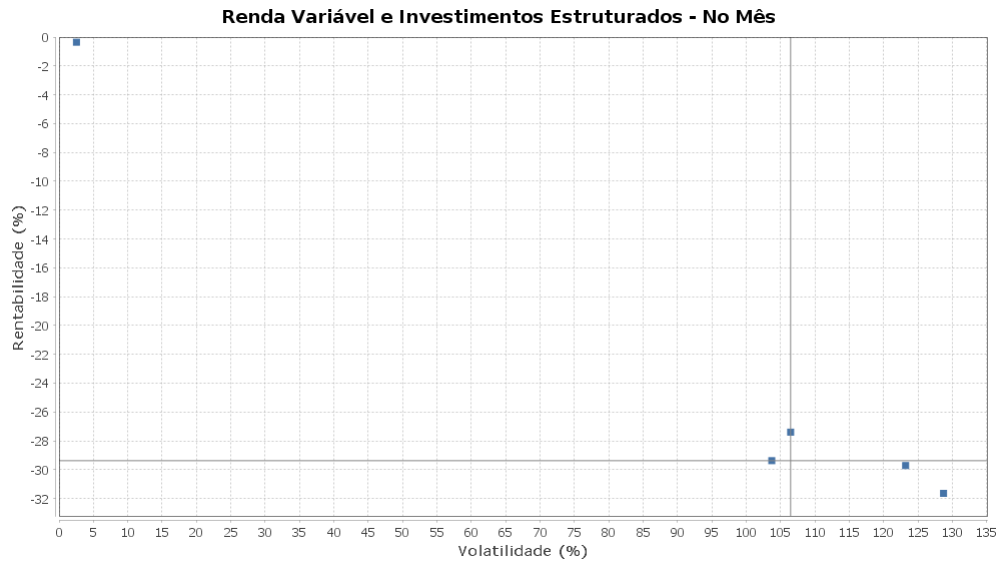
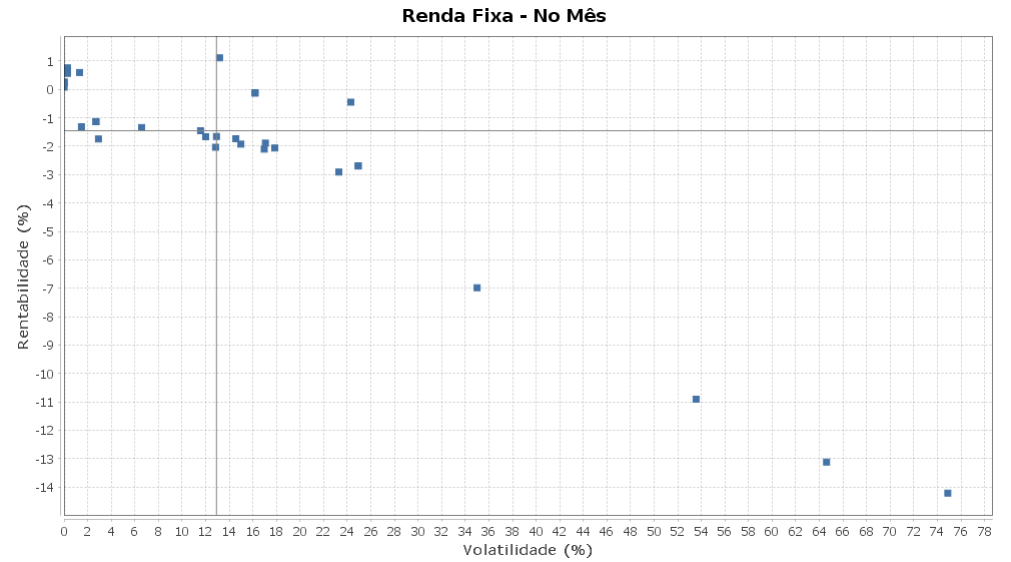
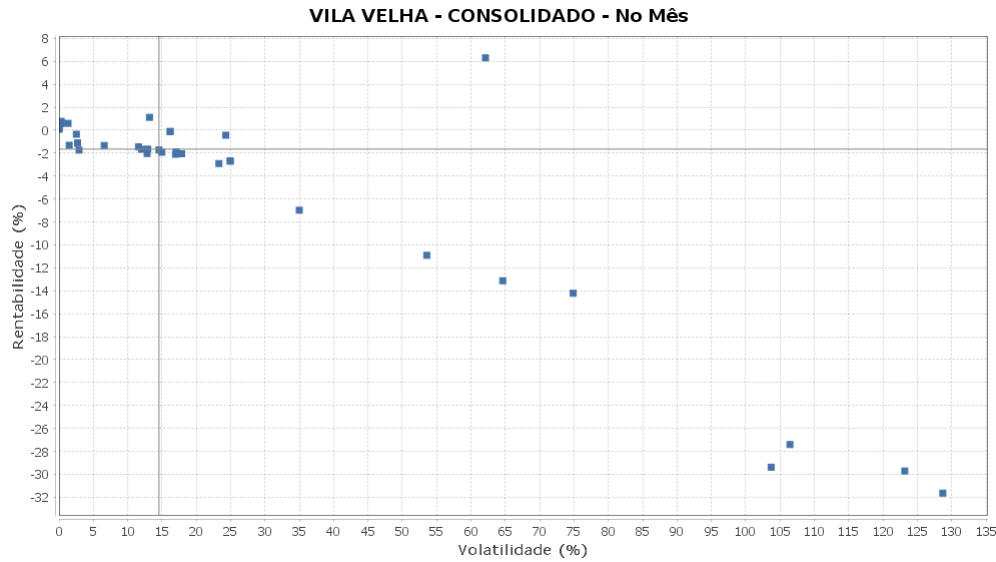
| APR | Data       | Ativo  | Aplicação    | Resgate      | Quantidade       | Valor Cota   |
|-----|------------|--|--------------|--------------|------------------|--------------|
| 87  | 02/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 0,00         | 1.959,86     | 937,37934100     | 2,0907864230 |
| 103 | 02/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 50.662,52    | 0,00         | 24.231,32245400  | 2,0907864230 |
| 119 | 04/03/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00         | 1.752,03     | 216,31853183     | 8,0993060800 |
| 83  | 04/03/2020 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF              | 0,00         | 65.925,76    | 35.500,02959600  | 1,8570620000 |
| 88  | 05/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 0,00         | 14.843,85    | 7.097,07034100   | 2,0915461290 |
| 104 | 05/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 163.493,02   | 0,00         | 78.168,49828600  | 2,0915461290 |
| 84  | 05/03/2020 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF              | 0,00         | 31,27        | 16,83623300      | 1,8572980000 |
| 99  | 06/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 35.500,14    | 0,00         | 16.971,13301000  | 2,0917955200 |
| 114 | 06/03/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 201,96       | 0,00         | 24,93329296      | 8,1000131200 |
| 89  | 09/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 0,00         | 4.047,28     | 1.934,60770100   | 2,0920417090 |
| 100 | 10/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 5.745,00     | 0,00         | 2.745,81130900   | 2,0922777830 |
| 90  | 11/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 0,00         | 8.187,66     | 3.912,79012300   | 2,0925374840 |
| 101 | 13/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 28.278,75    | 0,00         | 13.510,88509700  | 2,0930346010 |
| 91  | 17/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 0,00         | 1.417,05     | 676,86902300     | 2,0935364930 |
| 120 | 17/03/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00         | 177.221,52   | 21.872,47003080  | 8,1024923000 |
| 92  | 18/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 0,00         | 385,52       | 184,12524400     | 2,0937921997 |
| 80  | 18/03/2020 | BANESTES INSTITUCIONAL FI RF                     | 0,00         | 13.938,51    | 1.748,37803385   | 7,9722518400 |
| 93  | 19/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 0,00         | 70.888,68    | 33.852,60897900  | 2,0940388980 |
| 117 | 20/03/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 495.202,13   | 0,00         | 61.110,39793028  | 8,1034021500 |
| 105 | 20/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 49.580,09    | 0,00         | 23.674,35761100  | 2,0942528120 |
| 115 | 20/03/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 2.859.400,56 | 0,00         | 352.864,20529664 | 8,1034021500 |
| 94  | 23/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 0,00         | 6.448,76     | 3.078,95271900   | 2,0944654200 |
| 106 | 23/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 742,72       | 0,00         | 354,61077200     | 2,0944654200 |
| 107 | 23/03/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00         | 9.835,83     | 1.213,76030529   | 8,1036024600 |
| 108 | 23/03/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00         | 202,05       | 24,93329296      | 8,1036024600 |
| 109 | 23/03/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00         | 2.209.962,12 | 272.713,54062922 | 8,1036024600 |
| 86  | 23/03/2020 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI        | 2.220.000,00 | 0,00         | 833.277,64605100 | 2,6641780330 |
| 95  | 24/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 0,00         | 935,00       | 446,36975400     | 2,0946759760 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| APR | Data       | Ativo  | Aplicação    | Resgate    | Quantidade       | Valor Cota   |
|-----|------------|--|--------------|------------|------------------|--------------|
| 116 | 24/03/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 737,99       | 0,00       | 91,06712146      | 8,1038028700 |
| 118 | 25/03/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 1.510.000,00 | 0,00       | 186.327,65870652 | 8,1040035100 |
| 81  | 25/03/2020 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF              | 382.458,12   | 0,00       | 205.571,47333700 | 1,8604630000 |
| 97  | 26/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 246.486,79   | 0,00       | 117.648,87858300 | 2,0951053080 |
| 121 | 26/03/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00         | 167.034,67 | 20.610,86603006  | 8,1042043400 |
| 110 | 26/03/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00         | 230.000,06 | 28.380,33818707  | 8,1042043400 |
| 122 | 27/03/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00         | 495.263,46 | 61.110,39793028  | 8,1044057300 |
| 123 | 27/03/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00         | 58.547,08  | 7.224,10478561   | 8,1044057300 |
| 124 | 27/03/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00         | 791.432,76 | 97.654,63205528  | 8,1044057300 |
| 111 | 27/03/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00         | 372.936,61 | 46.016,52758156  | 8,1044057300 |
| 85  | 30/03/2020 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF              | 0,00         | 334.725,83 | 179.856,84774800 | 1,8610680000 |
| 112 | 30/03/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00         | 257,26     | 31,74243932      | 8,1046071300 |
| 96  | 31/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 0,00         | 58.033,37  | 27.691,17619700  | 2,0957351030 |
| 125 | 31/03/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00         | 573.411,13 | 70.749,49730142  | 8,1048085400 |
| 98  | 31/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 0,00         | 69.973,28  | 33.388,41817400  | 2,0957351030 |
| 102 | 31/03/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC                             | 0,00         | 6.155,67   | 2.937,23667200   | 2,0957351030 |
| 82  | 31/03/2020 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF              | 20.970,55    | 0,00       | 11.266,79027300  | 1,8612710000 |
| 113 | 31/03/2020 | BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO | 0,00         | 18.945,21  | 2.337,52714875   | 8,1048085400 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo  | Estratégia              | Volatilidade | VaR  | CVaR  | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|--|-------------------------|--------------|------|-------|--------|-------|---------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF                      | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,01         | 0,01 | 0,00  | -5,05  | 0,26  | 855.826,89    | 0,26       |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO         | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,01         | 0,01 | 0,00  | -17,41 | 0,08  | 173.435,81    | 0,05       |
| BB PREV RF FLUXO FIC                                     | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,02         | 0,01 | 0,00  | -5,75  | 0,25  | 5.503.130,74  | 1,67       |
| FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF               | Artigo 7º I, Alínea b   | 0,29         | 0,16 | 0,00  | 1,48   | 0,76  | 6.358.827,80  | 1,93       |
| NTN-B 150545 (4,290000%) ..                              | Artigo 7º I, Alínea a   | 0,29         | 0,16 | 0,00  | 0,97   | 0,62  | 322.425,24    | 0,10       |
| NTN-B 150545 (5,100000%) ..                              | Artigo 7º I, Alínea a   | 0,29         | 0,16 | 0,00  | 1,20   | 0,69  | 12.462.250,58 | 3,78       |
| NTN-B 150545 (3,680000%) ..                              | Artigo 7º I, Alínea a   | 0,29         | 0,16 | 0,00  | 0,79   | 0,57  | 6.354.936,56  | 1,93       |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,31         | 0,21 | 0,01  | 0,20   | 0,60  | 12.186.708,49 | 3,69       |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI                  | Artigo 7º IV, Alínea a  | 1,48         | 0,73 | -0,00 | -1,12  | -1,31 | 1.124.516,54  | 0,34       |
| JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII    | Artigo 8º IV, Alínea b  | 2,52         | 0,02 | 0,00  | -0,28  | -0,36 | 998.362,93    | 0,30       |
| FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF               | Artigo 7º I, Alínea b   | 2,70         | 0,60 | 0,00  | -0,54  | -1,13 | 3.718.400,92  | 1,13       |
| FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF              | Artigo 7º I, Alínea b   | 2,70         | 0,60 | 0,02  | -0,54  | -1,13 | 12.681.150,76 | 3,84       |
| BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF                         | Artigo 7º IV, Alínea a  | 2,92         | 1,39 | 0,00  | -0,71  | -1,74 | 5.307.876,94  | 1,61       |
| BB PREV RF VII   | Artigo 7º I, Alínea b   | 6,57         | 0,98 | 0,01  | -0,26  | -1,34 | 4.274.393,26  | 1,30       |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP      | Artigo 7º I, Alínea b   | 11,57        | 1,67 | 0,10  | -0,15  | -1,45 | 22.494.549,73 | 6,82       |
| BB PREV RF IDKA2   | Artigo 7º I, Alínea b   | 12,01        | 1,70 | 0,07  | -0,17  | -1,66 | 15.120.055,24 | 4,58       |
| BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI                   | Artigo 7º VII, Alínea b | 12,83        | 1,64 | 0,03  | -0,18  | -2,03 | 6.493.827,81  | 1,97       |
| BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI           | Artigo 7º I, Alínea b   | 12,92        | 2,12 | 0,02  | -0,15  | -1,65 | 3.833.203,63  | 1,16       |
| BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1                        | Artigo 7º I, Alínea b   | 13,18        | 1,69 | 0,04  | 0,06   | 1,11  | 9.294.410,53  | 2,82       |
| BB PREVIDENCIÁRIO XI TP                                  | Artigo 7º I, Alínea b   | 14,55        | 2,27 | 0,04  | -0,14  | -1,73 | 6.273.012,61  | 1,90       |
| BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI                        | Artigo 7º I, Alínea b   | 14,98        | 1,88 | 0,04  | -0,15  | -1,93 | 6.998.326,89  | 2,12       |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF             | Artigo 7º I, Alínea b   | 16,18        | 2,13 | 0,03  | -0,03  | -0,13 | 5.838.110,23  | 1,77       |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP             | Artigo 7º I, Alínea b   | 16,19        | 2,13 | 0,01  | -0,03  | -0,11 | 2.601.491,57  | 0,79       |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                         | Artigo 7º I, Alínea b   | 16,96        | 2,05 | 0,09  | -0,14  | -2,10 | 16.230.163,84 | 4,92       |
| BB PREV RF IPCA  | Artigo 7º I, Alínea b   | 17,06        | 2,61 | 0,03  | -0,13  | -1,89 | 4.003.307,94  | 1,21       |
| BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI                   | Artigo 7º I, Alínea b   | 17,85        | 2,47 | 0,02  | -0,13  | -2,06 | 2.338.713,39  | 0,71       |
| FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF                              | Artigo 7º VII, Alínea b | 23,29        | 3,09 | 0,01  | -0,14  | -2,91 | 1.202.768,00  | 0,36       |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO | Artigo 7º I, Alínea b   | 24,29        | 3,18 | 0,05  | -0,03  | -0,45 | 5.451.856,36  | 1,65       |
| FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF               | Artigo 7º I, Alínea b   | 24,93        | 3,27 | 0,13  | -0,12  | -2,69 | 14.234.157,00 | 4,31       |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo  | Estratégia             | Volatilidade | VaR   | CVaR | Sharpe | Rent.  | Valor(R\$)    | % Carteira |
|--|------------------------|--------------|-------|------|--------|--------|---------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF            | Artigo 7º I, Alínea b  | 24,93        | 3,27  | 0,17 | -0,12  | -2,69  | 18.949.276,39 | 5,74       |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI                   | Artigo 7º I, Alínea b  | 34,99        | 4,05  | 0,38 | -0,21  | -6,98  | 34.497.023,20 | 10,45      |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | Artigo 7º I, Alínea b  | 53,55        | 7,89  | 0,23 | -0,21  | -10,91 | 10.906.554,91 | 3,30       |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I                    | Artigo 9º A, III       | 62,09        | 17,36 | 0,20 | 0,10   | 6,30   | 5.335.318,35  | 1,62       |
| BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B                    | Artigo 7º I, Alínea b  | 64,61        | 8,87  | 0,06 | -0,21  | -13,12 | 23.505.134,64 | 7,12       |
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RF                           | Artigo 7º IV, Alínea a | 74,88        | 9,53  | 0,02 | -0,19  | -14,22 | 11.284.633,94 | 3,42       |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS                                    | Artigo 8º II, Alínea a | 103,70       | 26,12 | 0,67 | -0,29  | -29,38 | 9.167.280,60  | 2,78       |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS         | Artigo 8º II, Alínea a | 106,44       | 27,84 | 0,44 | -0,26  | -27,40 | 5.549.317,31  | 1,68       |
| FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA                              | Artigo 8º I, Alínea a  | 123,17       | 31,08 | 0,88 | -0,24  | -29,71 | 10.313.617,10 | 3,12       |
| BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL | Artigo 8º II, Alínea a | 128,70       | 28,88 | 0,46 | -0,25  | -31,64 | 5.809.534,17  | 1,76       |