



LDB
EMPRESAS

VILA VELHA
AGOSTO 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 82,43%

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	0,57	3,64	6.318.107,91	1,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,290000%) ..	0,37	0,62	4,05	320.727,27	0,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,100000%) ..	0,37	0,69	4,58	12.403.364,99	3,37
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,37	0,65	4,26	19.042.200,17	5,17

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	22,96	-3,55	-5,04	25.531.313,51	6,93	288.523.008,49	8,85
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,54	0,09	2,78	12.465.443,10	3,38	7.749.783.927,00	0,16
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,54	-1,85	0,64	39.791.260,20	10,80	5.638.549.883,16	0,71
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,12	0,69	4,43	20.981.348,86	5,69	6.452.433.505,43	0,33
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,46	-3,64	-2,24	11.938.034,33	3,24	1.873.284.904,48	0,64
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	8,77	-1,18	6,20	5.709.500,85	1,55	3.267.192.376,45	0,17
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,03	0,79	4,80	23.670.345,76	6,42	8.901.363.723,20	0,27
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,90	-0,77	5,06	2.696.383,59	0,73	16.114.955.012,29	0,02
BB	BB	BB PREV RF IPCA	6,03	0,66	5,89	4.153.022,36	1,13	351.222.926,25	1,18
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	6,09	0,46	5,18	2.416.619,12	0,66	286.436.026,50	0,84
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	4,20	-0,18	5,36	11.776.898,44	3,20	194.803.588,72	6,05
BB	BB	BB PREV RF VII	2,28	0,47	2,45	1.526.728,20	0,41	238.494.074,76	0,64
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	5,12	0,33	4,23	5.485.391,77	1,49	423.148.231,52	1,30
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	4,95	0,82	5,03	6.452.255,89	1,75	197.496.447,64	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	6,12	-0,89	2,63	16.855.190,67	4,57	10.897.747.304,90	0,15
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,93	-0,56	5,06	15.869.562,58	4,31	13.462.808.031,45	0,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,18	0,11	0,91	0,00	0,00	258.092.239,39	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,63	-0,24	5,45	19.769.984,13	5,37	1.418.940.292,33	1,39
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,18	0,11	0,92	0,00	0,00	1.001.818.388,63	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	27,46	-0,24	5,45	14.854.293,00	4,03	456.299.202,88	3,26
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,39	0,76	4,51	3.420.996,82	0,93	456.125.561,92	0,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,37	0,76	5,20	6.344.473,27	1,72	82.057.466,20	7,73
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,58	-0,72	2,29	251.709.046,45	68,31		

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	0,02	0,42	2.021.307,16	0,55	890.783.861,56	0,23
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	26,14	-3,63	-5,86	12.270.144,23	3,33	275.989.890,48	4,45
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,07	0,08	1,42	4.618.562,14	1,25	1.775.186.405,18	0,26
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,07	0,09	1,55	628.995,35	0,17	496.713.163,83	0,13
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,58	-0,64	-0,11	5.340.319,08	1,45	184.359.376,17	2,90
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			12,16	-1,96	-2,93	24.879.327,96	6,75		

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	0,49	4,20	6.828.079,35	1,85	609.571.668,59	1,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF	8,14	-0,22	5,24	1.283.837,10	0,35	184.626.995,14	0,70
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			5,01	0,38	4,36	8.111.916,45	2,20		
Renda Fixa			6,05	-0,71	2,03	303.742.491,03	82,43		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

13,45%

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	43,48	-3,43	-14,10	13.978.188,77	3,79	683.983.509,09	2,04
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			43,48	-3,43	-14,10	13.978.188,77	3,79		

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	38,15	-3,41	-19,86	11.445.216,26	3,11	937.612.766,29	1,22
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	38,93	-3,82	-13,31	10.958.700,47	2,97	819.770.596,51	1,34
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	44,95	-0,43	-1,13	12.179.455,13	3,31	157.969.354,10	7,71
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			39,71	-2,47	-12,69	34.583.371,86	9,39		

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	0,27	-0,32	1.001.790,58	0,27	125.640.968,03	0,80
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			1,38	0,27	-0,32	1.001.790,58	0,27		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			39,66	-2,67	-12,88	49.563.351,21	13,45		
--	--	--	--------------	--------------	---------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,12%

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	27,07	15,16	55,87	15.176.928,52	4,12	1.583.297.843,04	0,96
Sub-total Artigo 9º A, III			27,07	15,16	55,87	15.176.928,52	4,12		
Investimentos no Exterior			27,07	15,16	55,87	15.176.928,52	4,12		
Total			8,50	-0,49	0,74	368.482.770,76	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	19.042.200,17	5,17	0,00	47,50	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	251.709.046,45	68,31	0,00	20,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	24.879.327,96	6,75	0,00	5,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	8.111.916,45	2,20	0,00	2,50	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	303.742.491,03	82,43				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	13.978.188,77	3,79	0,00	10,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	34.583.371,86	9,39	0,00	13,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.001.790,58	0,27	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	49.563.351,21	13,45				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	15.176.928,52	4,12	0,00	1,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	15.176.928,52	4,12				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

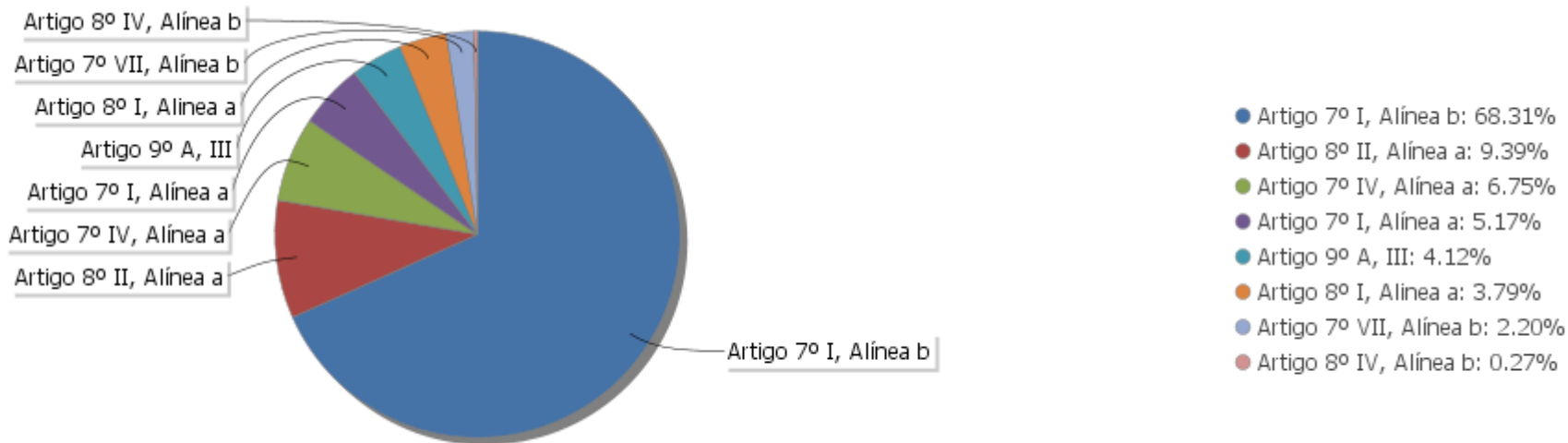
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,65 406,17	4,26 201,40	1,75 307,75	2,60 181,30	7,07 183,07	122.867,89	789.351,18
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,72 -449,67	2,29 108,33	3,01 529,74	1,31 91,46	7,05 182,72	-1.965.692,01	5.902.533,47
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-1,96 -1.223,47	-2,93 -138,46	3,20 563,10	-3,78 -263,43	1,65 42,75	-491.767,72	-712.104,39
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,38 236,14	4,36 206,14	2,54 447,65	3,11 216,61	8,81 228,13	30.513,38	338.912,04
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,43 0,01	-14,10 -0,03	13,42 -0,27	-4,74 -0,13	-1,87 -0,13	-496.416,03	-2.294.888,57
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,47 0,97	-12,69 1,38	12,57 -1,12	-6,20 -1,59	-2,28 -0,53	-744.983,69	-4.131.674,69
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,27 3,71	-0,32 13,75	0,27 -13,42	-0,02 4,59	-0,02 1,72	2.652,69	-3.230,97
Artigo 9º A, III % do CDI	15,16 9.483,09	55,87 2.641,22	22,45 3.954,81	55,15 3.845,54	68,87 1.784,17	1.602.443,40	3.132.587,07
						-1.940.382,09	3.021.485,14

Análise de Liquidez

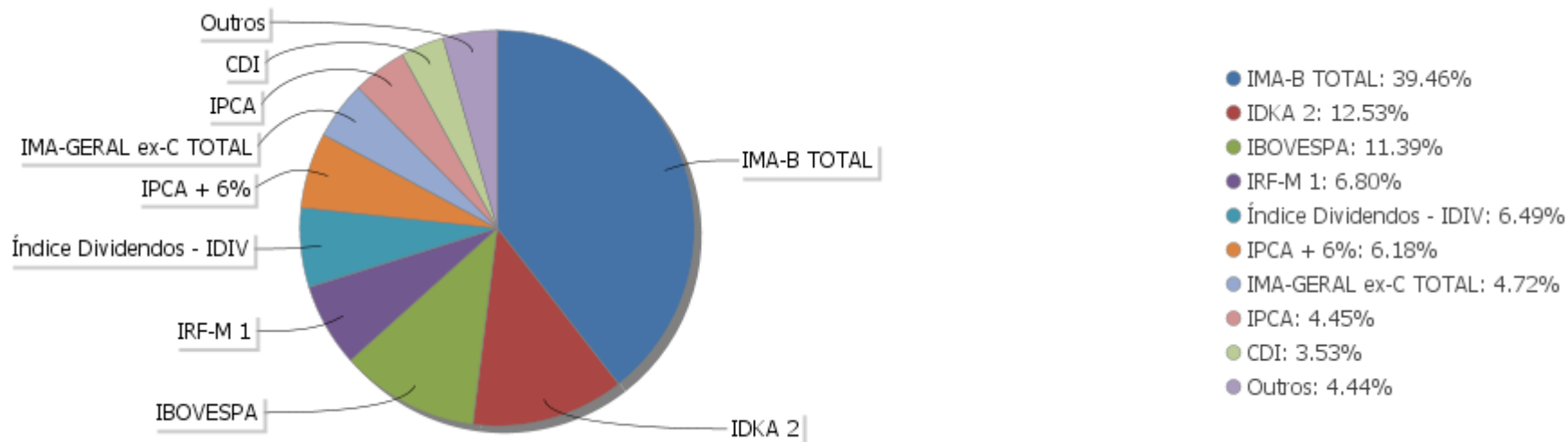
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	254.048.780,50	68,94	254.048.780,50	68,94
de 31 a 364 dias	24.139.946,18	6,55	278.188.726,68	75,50
acima de 365 dias	90.294.044,08	24,50	368.482.770,76	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

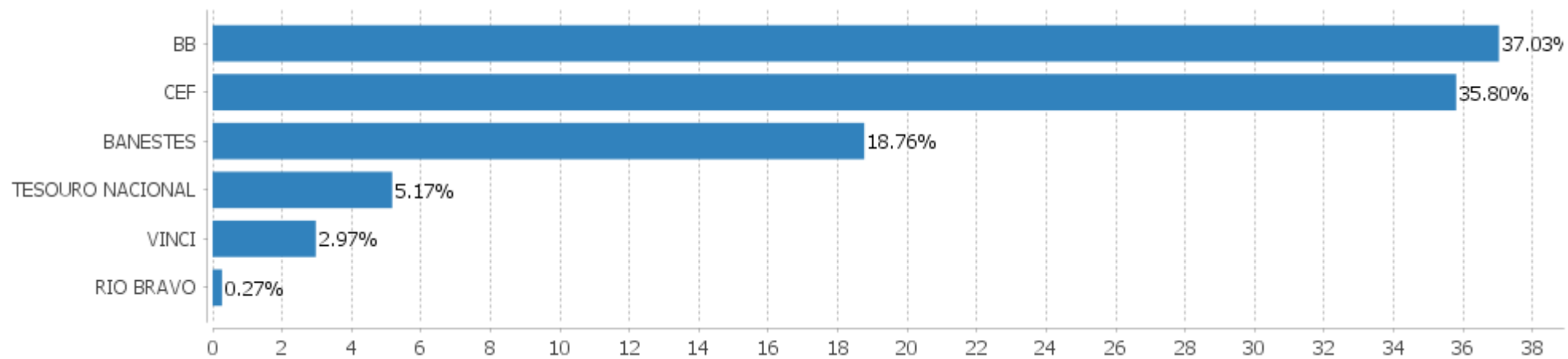


Alocação Por Estratégia



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	-0,49					0,74
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72					4,58
p.p. indexador	-0,22	-1,45	-7,55	1,75	1,95	1,28	2,06	-1,21					-3,84
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

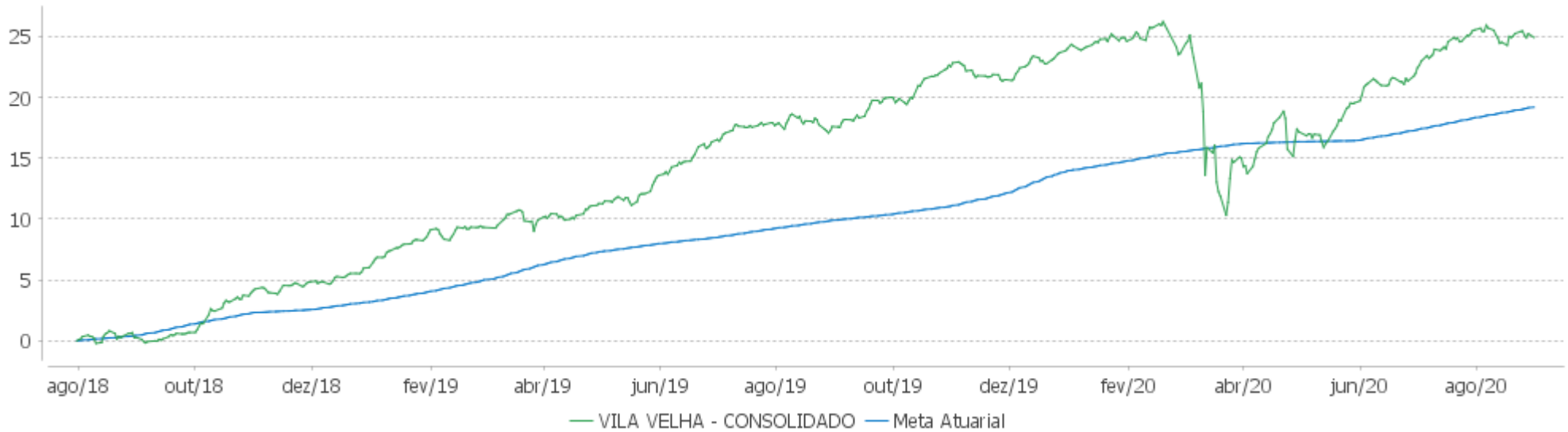
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

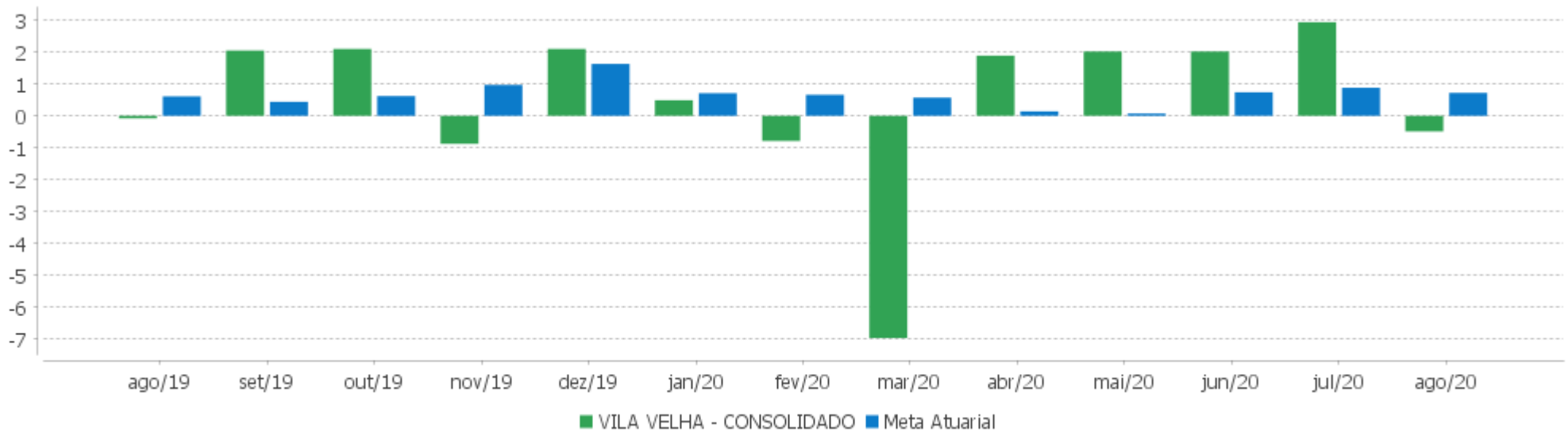
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	15	60,00	03 meses	4,50	2,36	2,15	3,65
Meses abaixo da Meta Atuarial	10	40,00	06 meses	1,04	3,16	-2,12	11,46
			12 meses	6,23	8,50	-2,27	8,50
			24 meses	24,57	18,87	5,71	6,39
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,39	2018-10	Desde 31/07/2018	24,92	19,39	5,52	6,29
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
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF Var. IPCA + 6% p.p.	-0,22 -0,94	5,24 0,58	2,92 0,53	3,63 0,41	10,47 1,89	28,20 9,24	34,80 3,48
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6% p.p.	0,49 -0,24	4,20 -0,47	2,47 0,08	3,01 -0,22	8,50 -0,09	23,10 4,13	33,50 2,17
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,46 2,26	5,18 4,37	2,81 -1,80	3,71 3,62	9,99 3,35	30,01 -5,99	37,21 -5,00
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	0,82 0,40	5,03 0,40	2,81 0,26	3,62 0,23	9,54 0,30	28,18 3,18	35,36 2,03
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,09 -0,03	2,78 -0,18	0,58 -0,06	1,99 -0,13	4,77 -0,29	12,31 -0,53	19,76 -0,86
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6% p.p.	0,76 0,03	4,51 -0,15	2,61 0,22	3,26 0,04	8,84 0,25	26,23 7,27	43,43 12,10
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,77 -0,02	5,06 -0,15	1,08 -0,03	3,53 -0,09	8,49 -0,22	26,36 -0,46	33,44 -0,90
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-3,64 -0,02	-2,24 -0,23	6,31 -0,07	-2,48 -0,13	4,26 -0,45	43,30 -1,41	46,76 -1,75
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,24 1,56	5,45 4,65	2,78 -1,83	3,88 3,79	10,88 4,23	33,70 -2,30	39,99 -2,21
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,33 2,13	4,23 3,43	2,44 -2,17	3,06 2,97	8,71 2,07	26,40 -9,60	33,84 -8,36
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,11 1,91	0,92 0,12	1,07 -3,54	0,71 0,61	4,07 -2,57	14,07 -21,92	22,92 -19,29
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO Var. IRF-M 1+ p.p.	-1,18 -0,05	6,20 -0,17	1,32 -0,04	4,26 -0,11	10,40 -0,23	32,83 -0,43	39,62 -0,96
FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,11 1,91	0,91 0,10	1,07 -3,54	0,70 0,60	4,06 -2,59	14,03 -21,97	22,85 -19,35
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IPCA + 6% p.p.	0,76 0,03	5,20 0,53	2,10 -0,29	3,30 0,08	8,53 -0,06	15,62 -3,34	27,76 -3,56
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	-0,18 -0,30	5,36 2,39	0,97 0,33	3,87 1,74	7,98 2,92	20,55 7,71	29,10 8,49
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-3,55 -1,75	-5,04 -5,85	6,06 1,45	-5,64 -5,73	2,57 -4,07	40,28 4,29	42,92 0,72
BB PREV RF VII	0,47	2,45	1,79	1,82	6,06	18,80	27,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,27	1,64	-2,82	1,73	-0,59	-17,19	-15,03
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,69 -0,35	4,43 -0,96	2,73 -0,26	3,38 -0,74	8,67 -1,03	21,54 -1,98	30,37 -3,07
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6% p.p.	0,66 -0,07	5,89 1,22	2,95 0,56	4,38 1,16	11,02 2,43	31,73 12,76	38,76 7,43
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,89 -0,21	2,63 -0,06	1,82 -0,06	1,67 -0,06	6,05 -0,11	23,16 0,44	30,22 0,25
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,56 -0,80	5,06 4,36	1,17 0,30	3,57 3,33	9,21 6,77	27,35 21,40	34,93 24,54
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,24 1,56	5,45 4,65	2,78 -1,83	3,89 3,80	10,88 4,24	33,70 -2,30	40,01 -2,19
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,79 -0,24	4,80 -0,59	2,82 -0,16	3,70 -0,42	8,84 -0,87	21,88 -1,64	30,88 -2,56
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,85 -0,06	0,64 -0,17	4,50 -0,11	-0,06 -0,15	6,38 -0,26	35,28 -0,71	41,12 -1,08
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-3,63 -1,83	-5,86 -6,66	4,97 0,37	-6,73 -6,82	0,44 -6,20	34,98 -1,02	37,17 -5,04
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	-0,64 -401,32	-0,11 -5,34	1,82 320,81	-1,14 -79,67	5,57 144,17	24,91 239,97	
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO % do CDI	0,02 15,14	0,42 20,09	0,06 11,35	0,22 15,64	1,13 29,29	4,38 42,20	8,30 46,31
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,08 47,03	1,42 67,24	0,31 54,01	0,91 63,80	2,78 72,12	8,08 77,81	14,23 79,42
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,09 56,62	1,55 73,25	0,35 61,99	1,01 70,44	3,00 77,62	8,56 82,45	15,03 83,88
NTN-B 150545 (5,100000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,69 2,49	4,58 3,78	1,87 -2,74	2,84 2,75	7,57 0,92	16,70 -19,29	
NTN-B 150545 (4,290000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,62 2,42	4,05 3,24	1,67 -2,94	2,44 2,35	6,74 0,10	12,30 -23,70	
NTN-B 150545 (3,680000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,57 2,37	3,64 2,84	1,51 -3,10	2,14 2,05	6,11 -0,53	11,21 -24,78	
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,43 4,40	-1,13 16,12	18,93 8,47	4,33 14,71	10,07 13,71	69,06 24,28	75,12 29,92
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-3,82 1,01	-13,31 3,94	8,95 -1,51	-8,81 1,57	-1,14 2,51	48,70 3,92	47,11 1,91
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-3,41	-19,86	9,92	-11,83	-10,80	22,37	23,27

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Varição da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	0,03	-5,78	-3,77	-7,22	-9,05	-7,23	-17,01
JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII	0,27	-0,32	0,27	-0,02	-0,02	-0,15	0,32
Var. IFIX p.p.	-1,53	12,67	-4,41	6,12	-4,74	-30,19	-33,17
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	-3,43	-14,10	13,42	-4,74	-1,87	28,69	38,62
Var. IBOVESPA p.p.	0,01	-0,03	-0,27	-0,13	-0,13	-0,90	-1,67
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	15,16	55,87	22,45	55,15	68,87	72,76	164,16
Var. IBOVESPA p.p.	18,61	69,94	8,76	59,76	70,62	43,17	123,88
CDI	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,92
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59	40,28
INPC + 6%	0,85	5,15	2,64	3,80	9,12	19,38	31,09
IPCA + 6%	0,73	4,66	2,39	3,22	8,58	18,96	31,33

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	0,12	2,96	0,64	2,12	5,06	12,83	20,62
IRF-M 1+	-1,13	6,37	1,36	4,37	10,64	33,26	40,58
IRF-M TOTAL	-0,75	5,20	1,11	3,62	8,70	26,82	34,34
IMA-B 5	0,43	4,63	2,55	3,39	9,24	25,01	33,33
IMA-B 5+	-3,62	-2,01	6,38	-2,35	4,71	44,71	48,51
IMA-B TOTAL	-1,80	0,80	4,61	0,09	6,64	36,00	42,20
IMA-C TOTAL	2,11	14,41	10,45	10,88	18,54	46,32	66,00
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,68	2,69	1,88	1,72	6,16	22,72	29,97
IMA-GERAL TOTAL	-0,60	3,02	2,13	1,99	6,51	23,37	30,91
IDKA 2	1,03	5,39	2,99	4,11	9,71	23,52	33,44
IDKA 20	-6,22	-7,86	9,49	-6,50	-0,24	59,80	58,73
CDI	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,92
Renda Variável							
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59	40,28
IBRX 100	-3,38	-13,46	14,15	-4,51	-1,12	33,35	43,15
IBRX 50	-3,42	-14,10	14,20	-4,15	-2,18	26,25	37,06
SMALL CAP	-1,23	-14,27	23,76	-6,96	6,02	60,17	56,43
IFIX	1,79	-12,99	4,68	-6,13	4,72	30,04	33,50
Índice Consumo - ICON	-1,48	-5,53	16,72	1,26	5,75	60,13	42,78
Índice Dividendos - IDIV	-4,83	-17,25	10,46	-10,38	-3,64	44,78	45,20
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,24	0,70	0,86	0,24	2,44	5,95	10,39
INPC	0,36	1,16	1,10	0,80	2,94	6,32	10,19
IGPM	2,74	9,64	6,67	9,17	13,02	18,62	29,16
SELIC	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,93
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
373	03/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	562.834,55	266.978,33885400	2,1081656160
374	03/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.172,40	1.504,81473400	2,1081656160
363	05/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	65,00	30,82972000	2,1083551580
375	05/08/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	73.585,76	39.272,98888455	1,8736990000
331	06/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	562.834,55	0,00	69.354,63950243	8,1153121700
376	06/08/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	8.898,37	0,00	4.748,85179481	1,8737940000
343	06/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	334,51	0,00	41,21960967	8,1153121700
364	07/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.940,00	3.765,66336300	2,1085262370
345	07/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	766,71	0,00	94,47534174	8,1154509300
365	10/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.852,60	4.198,33871000	2,1085959500
366	11/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.738,36	5.092,48979000	2,1086659850
333	17/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	110.776,44	0,00	13.649,45957104	8,1158114300
347	17/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	315.137,65	0,00	38.830,08528699	8,1158114300
357	17/08/2020	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	0,00	59.780,79	26.063,24756700	2,2936815470
359	17/08/2020	BB PREV RF VII	0,00	2.763.037,65	1.551.339,40240600	1,7810658620
358	17/08/2020	BB PREV RF VII	0,00	116.975,59	65.677,29610400	1,7810658620
356	17/08/2020	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	0,00	502.223,15	225.482,49300700	2,2273265800
355	17/08/2020	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	0,00	100.478,16	45.111,55252300	2,2273265800
360	17/08/2020	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	0,00	182.785,80	96.203,47815500	1,8999915960
361	17/08/2020	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	0,00	1.682.301,75	885.425,89006300	1,8999915960
362	17/08/2020	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	0,00	162.091,96	96.728,93064900	1,6757340220
380	17/08/2020	FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.787.198,80	2.885.574,93986479	1,3124590000
384	17/08/2020	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.916.942,43	10.163.434,31506079	1,2709230000
335	18/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	393.389,37	0,00	48.471,61139938	8,1158715100
349	18/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.589.017,76	0,00	319.006,74583252	8,1158715100
371	18/08/2020	BB PREV RF IDKA2	2.819.684,85	0,00	1.008.252,46580000	2,7966059550
370	18/08/2020	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	2.750.000,00	0,00	439.656,55725000	6,2548822590
378	18/08/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	8.703.234,94	0,00	5.826.023,90459583	1,4938550000

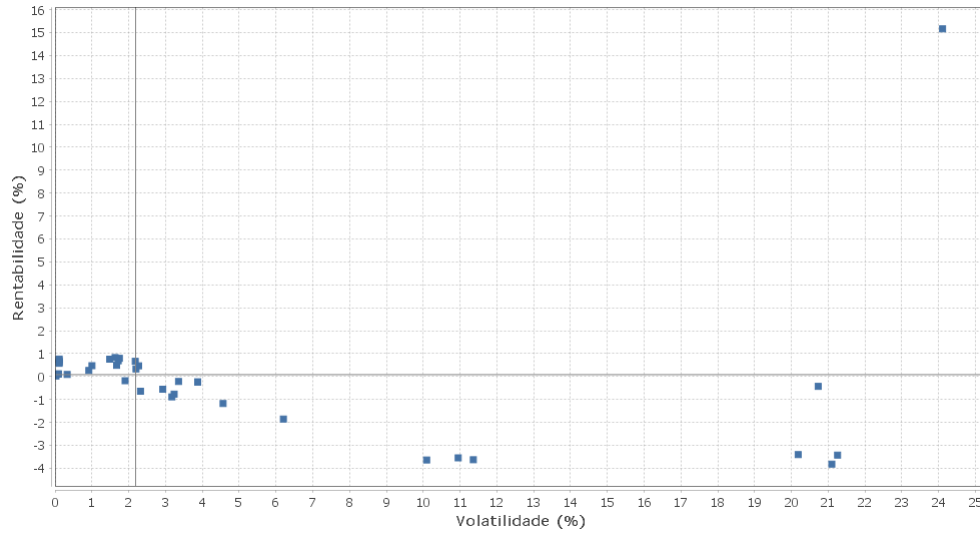
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
381	19/08/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4.000.000,00	0,00	785.169,56031094	5,0944410000
382	19/08/2020	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.000.000,00	0,00	2.161.462,31571507	1,8505990000
328	20/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	167.715,18	20.664,77955862	8,1159917300
340	20/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	70.404,13	8.674,74146625	8,1159917300
348	20/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	315.144,65	38.830,08515584	8,1159917300
342	20/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	13.618,86	1.678,02783111	8,1159917300
350	20/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.813.659,08	223.467,33958537	8,1159917300
344	20/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	334,54	41,21985472	8,1159917300
341	20/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	738,17	90,95253230	8,1159917300
346	20/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	766,76	94,47520716	8,1159917300
367	21/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.271,42	2.499,21979200	2,1092262540
327	21/08/2020	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	2.200.000,00	0,00	914.699,76869779	2,4051607700
368	26/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.681,59	5.063,70294600	2,1094424600
337	26/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	5.506.252,70	0,00	678.424,69907707	8,1162326600
354	26/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	737,99	0,00	90,92765460	8,1162326600
369	27/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	119.234,34	56.522,12409700	2,1095162630
329	27/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	18.937,05	2.333,21405228	8,1162934800
351	27/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.045,00	128,75335306	8,1162934800
334	28/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	110.783,85	13.649,45916514	8,1163545500
336	28/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	393.412,78	48.471,61094016	8,1163545500
330	28/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	13.342,74	1.643,93261997	8,1163545500
338	28/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.859.147,15	475.477,89173404	8,1163545500
332	28/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	562.906,84	69.354,63902325	8,1163545500
352	28/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	395.318,21	48.706,37520388	8,1163545500
339	31/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	5.445,44	670,91689037	8,1164151300
377	31/08/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	327.430,73	174.619,47832394	1,8751100000
353	31/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	257,26	31,69625948	8,1164151300

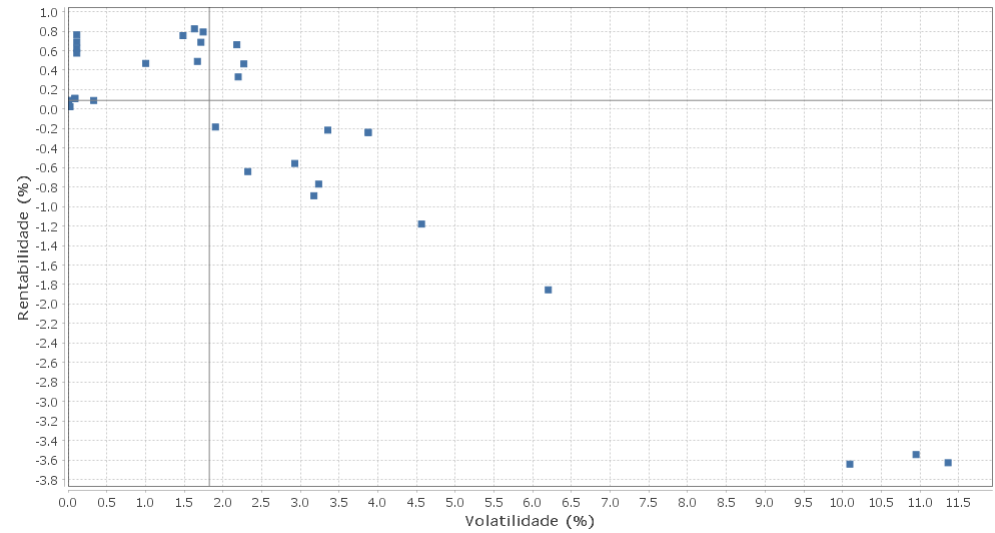
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

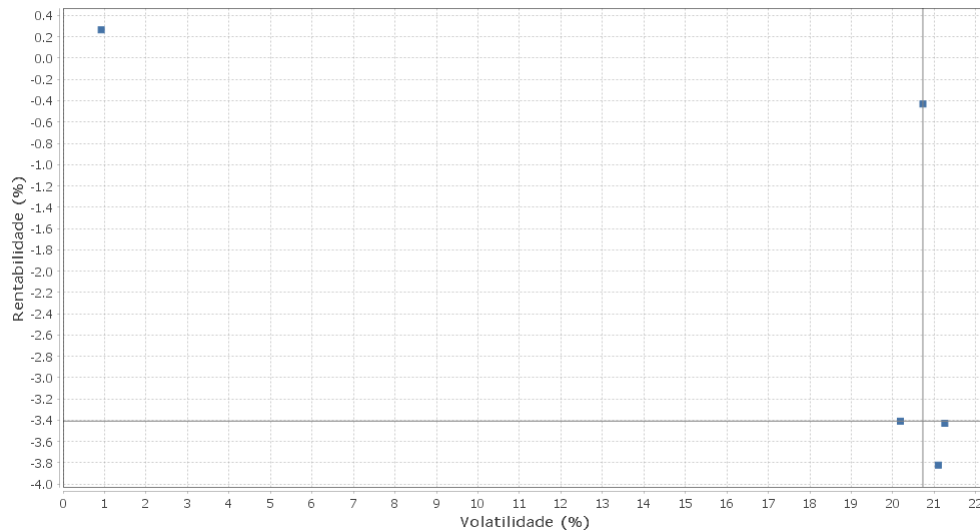
VILA VELHA - CONSOLIDADO - No Mês



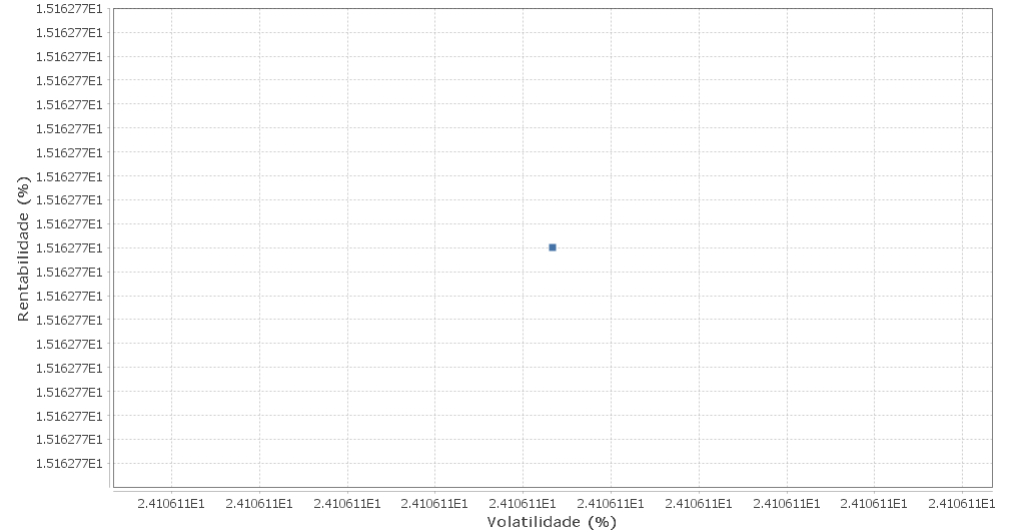
Renda Fixa - No Mês



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
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,02	0,00	-11,49	0,09	628.995,35	0,17
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,02	0,00	-9,48	0,08	4.618.562,14	1,25
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,01	0,00	-5,10	0,02	2.021.307,16	0,55
FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,09	NaN	0,00	-0,58	0,11	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,09	NaN	0,00	-0,56	0,11	0,00	0,00
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,11	0,11	-0,00	4,69	0,69	12.403.364,99	3,37
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,11	0,11	-0,00	3,68	0,57	6.318.107,91	1,71
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,11	0,11	-0,00	4,11	0,62	320.727,27	0,09
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,11	0,11	-0,00	5,33	0,76	6.344.473,27	1,72
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,22	0,00	-0,22	0,09	12.465.443,10	3,38
JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII	Artigo 8º IV, Alínea b	0,92	0,02	-0,00	0,11	0,27	1.001.790,58	0,27
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,00	0,52	0,00	0,31	0,47	1.526.728,20	0,41
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,48	0,96	0,01	0,40	0,76	3.420.996,82	0,93
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	Artigo 7º I, Alínea b	1,63	1,09	0,01	0,41	0,82	6.452.255,89	1,75
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	1,67	1,09	0,02	0,20	0,49	6.828.079,35	1,85
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,72	0,88	0,04	0,31	0,69	20.981.348,86	5,69
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,75	0,92	0,04	0,36	0,79	23.670.345,76	6,42
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	1,90	0,99	0,02	-0,18	-0,18	11.776.898,44	3,20
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	2,18	1,51	0,01	0,23	0,66	4.153.022,36	1,13
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,20	1,17	0,01	0,08	0,33	5.485.391,77	1,49
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,27	1,42	0,01	0,13	0,46	2.416.619,12	0,66
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	2,32	0,99	0,00	-0,35	-0,64	5.340.319,08	1,45
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,93	1,39	0,05	-0,24	-0,56	15.869.562,58	4,31
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,17	1,37	0,05	-0,33	-0,89	16.855.190,67	4,57
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,24	1,46	0,01	-0,29	-0,77	2.696.383,59	0,73
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF	Artigo 7º VII, Alínea b	3,35	1,99	0,01	-0,11	-0,22	1.283.837,10	0,35
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,88	2,04	0,07	-0,10	-0,24	14.854.293,00	4,03
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,88	2,04	0,09	-0,10	-0,24	19.769.984,13	5,37
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	4,56	2,09	0,03	-0,29	-1,18	5.709.500,85	1,55

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	6,20	3,11	0,28	-0,32	-1,85	39.791.260,20	10,80
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	10,09	5,38	0,14	-0,38	-3,64	11.938.034,33	3,24
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	10,95	5,49	0,10	-0,34	-3,55	25.531.313,51	6,93
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	11,36	6,14	0,05	-0,33	-3,63	12.270.144,23	3,33
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	20,18	11,87	0,32	-0,18	-3,41	11.445.216,26	3,11
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	20,73	12,64	0,34	-0,03	-0,43	12.179.455,13	3,31
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,10	13,21	0,34	-0,19	-3,82	10.958.700,47	2,97
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	21,25	12,11	0,38	-0,17	-3,43	13.978.188,77	3,79
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	24,11	13,62	-0,04	0,62	15,16	15.176.928,52	4,12