



LDB
EMPRESAS

VILA VELHA
OUTUBRO 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 16.12.2020.

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 82,71%

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%) ..	0,41	1,11	5,52	6.432.720,30	1,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,290000%) ..	0,41	1,16	6,04	326.864,79	0,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,100000%) ..	0,41	1,23	6,72	12.657.028,96	3,45
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,41	1,19	6,31	19.416.614,05	5,30

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	23,41	0,92	-9,01	21.469.269,06	5,86	273.991.442,96	7,84
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,56	0,11	2,94	12.484.914,09	3,41	7.887.722.403,08	0,16
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,77	0,20	-0,73	39.249.030,90	10,71	5.529.359.748,67	0,71
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,19	0,33	4,89	21.074.311,38	5,75	7.253.634.171,13	0,29
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,82	0,22	-4,61	11.647.830,06	3,18	1.789.450.540,00	0,65
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	8,97	-0,56	4,57	5.621.960,32	1,53	3.143.067.959,97	0,18
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,13	0,15	5,00	25.527.059,95	6,96	9.550.097.040,26	0,27
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,03	-0,36	4,04	2.670.248,67	0,73	9.226.615.794,13	0,03
BB	BB	BB PREV RF IPCA	6,14	-0,37	5,18	4.125.296,66	1,13	348.878.151,21	1,18
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	6,13	0,26	5,31	2.419.712,78	0,66	286.802.710,47	0,84
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	4,30	-0,35	4,76	17.714.084,47	4,83	192.524.615,09	9,20
BB	BB	BB PREV RF VII	2,40	0,49	3,15	1.537.177,10	0,42	240.126.324,03	0,64
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	5,22	0,18	4,15	5.481.271,10	1,50	422.830.359,08	1,30
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	4,96	0,49	5,75	6.496.595,68	1,77	198.853.639,86	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	6,26	-0,07	1,78	16.716.597,46	4,56	9.938.464.189,22	0,17
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	-0,11	4,42	16.751.248,17	4,57	13.635.004.724,81	0,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,73	-0,18	4,45	19.581.812,55	5,34	1.405.435.077,28	1,39
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,73	-0,18	4,45	14.712.822,30	4,01	451.953.430,56	3,26
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,41	0,49	5,23	3.444.559,26	0,94	459.267.170,07	0,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,41	1,30	7,51	6.483.622,86	1,77	83.857.196,80	7,73
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,61	0,15	1,35	255.209.424,82	69,63		

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	0,04	0,02	0,46	963.880,24	0,26	920.878.445,49	0,10
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	26,58	0,99	-9,64	5.790.300,76	1,58	266.751.360,36	2,17
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	0,06	1,48	5.184.587,43	1,41	1.611.170.285,08	0,32
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,07	0,09	1,73	212.996,84	0,06	622.243.810,38	0,03
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,78	0,17	-1,46	8.270.048,58	2,26	183.656.652,38	4,50
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			12,26	0,27	-4,82	20.421.813,85	5,57		

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	4,50	0,31	4,44	6.844.077,37	1,87	606.006.746,86	1,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF	8,24	-0,13	4,45	1.274.097,30	0,35	191.198.897,30	0,67
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			5,06	0,24	4,44	8.118.174,67	2,21		
Renda Fixa			6,07	0,23	1,22	303.166.027,39	82,71		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

12,83%

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 IBOVESPA	44,29	-0,74	-18,75	13.221.739,69	3,61	629.629.945,87	2,10
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			44,29	-0,74	-18,75	13.221.739,69	3,61		

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	38,79	-1,45	-24,73	10.749.121,29	2,93	871.977.000,93	1,23
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,50	0,05	-17,54	10.424.182,15	2,84	793.160.820,76	1,31
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	45,61	-1,72	-5,70	11.616.052,35	3,17	158.100.669,26	7,35
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			40,32	-1,08	-17,22	32.789.355,79	8,95		

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	1,42	0,41	0,15	1.006.494,66	0,27	126.230.937,11	0,80
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			1,42	0,41	0,15	1.006.494,66	0,27		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			40,33	-0,95	-17,36	47.017.590,14	12,83		
--	--	--	--------------	--------------	---------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,46%

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	29,24	-1,77	50,05	16.354.185,70	4,46	1.678.449.679,91	0,97
Sub-total Artigo 9º A, III			29,24	-1,77	50,05	16.354.185,70	4,46		
Investimentos no Exterior			29,24	-1,77	50,05	16.354.185,70	4,46		
Total			8,67	-0,01	-0,77	366.537.803,23	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	19.416.614,05	5,30	0,00	47,50	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	255.209.424,82	69,63	0,00	20,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	20.421.813,85	5,57	0,00	5,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	8.118.174,67	2,21	0,00	2,50	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	303.166.027,39	82,71				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	13.221.739,69	3,61	0,00	10,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	32.789.355,79	8,95	0,00	13,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.006.494,66	0,27	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	47.017.590,14	12,83				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	16.354.185,70	4,46	0,00	1,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	16.354.185,70	4,46				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades por Artigo

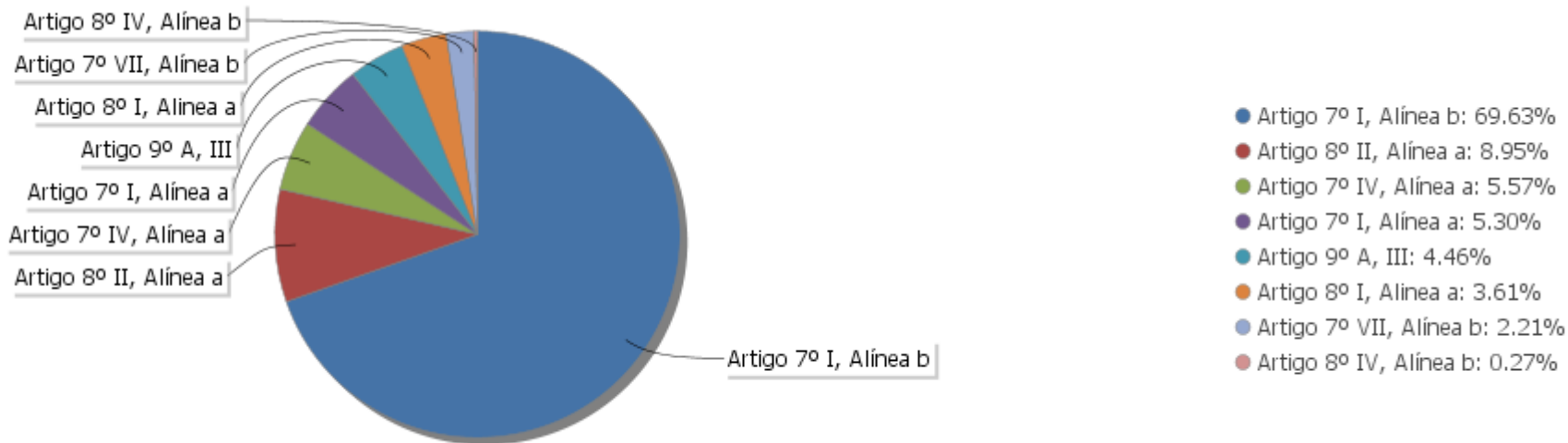
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,19 756,44	6,31 259,03	2,63 553,84	3,67 327,40	8,27 257,42	227.846,59	1.163.765,06
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,15 93,13	1,35 55,50	-1,63 -343,61	3,65 325,62	1,55 48,42	389.661,51	3.616.561,44
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,27 171,01	-4,82 -197,88	-3,87 -814,81	1,91 170,20	-5,16 -160,65	71.426,87	-1.257.206,69
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,24 155,72	4,44 182,29	0,46 95,88	4,95 441,70	5,30 164,95	19.794,88	345.170,26
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,74 -0,05	-18,75 0,01	-8,66 0,05	16,40 -0,31	-12,35 0,03	-98.023,19	-3.051.337,65
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,08 -0,39	-17,22 1,54	-7,53 1,18	14,35 -2,35	-10,38 1,99	-356.488,00	-5.925.690,76
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,41 1,10	0,15 18,90	0,74 9,44	0,58 -16,12	0,68 13,06	4.118,55	1.473,11
Artigo 9º A, III % do CDI	-1,77 -1.128,76	50,05 2.054,64	10,87 2.289,65	21,16 1.886,70	60,56 1.886,09	-320.071,63	2.509.844,25
VILA VELHA - CONSOLIDADO (Total)						-61.734,42	-2.597.420,98

Análise de Liquidez

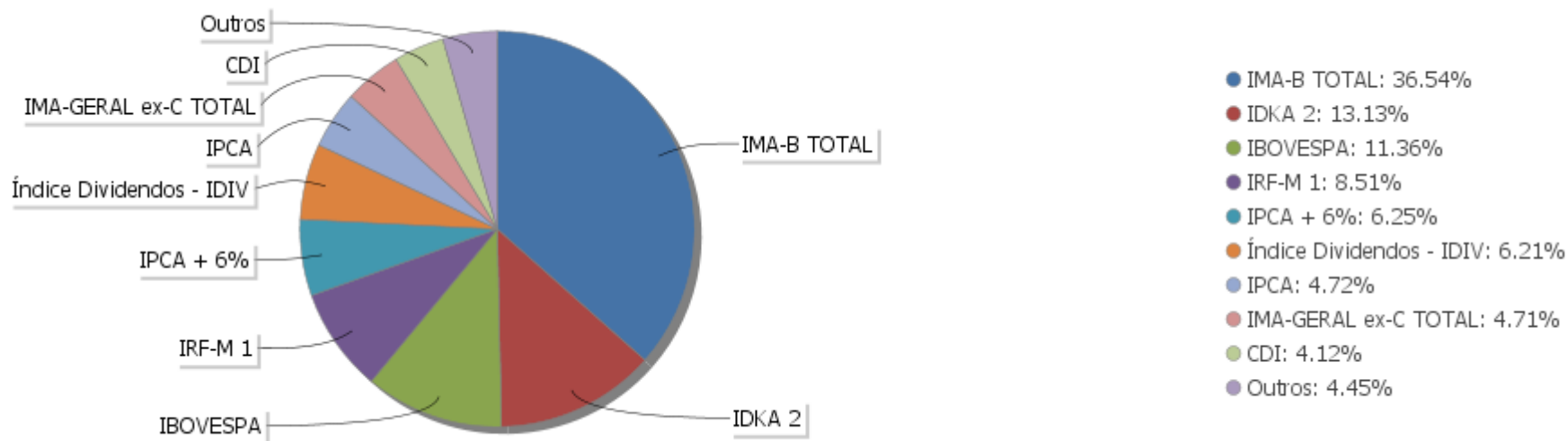
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	252.947.512,36	69,01	252.947.512,36	69,01
de 31 a 364 dias	23.046.729,16	6,29	275.994.241,52	75,30
acima de 365 dias	90.543.561,71	24,70	366.537.803,23	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

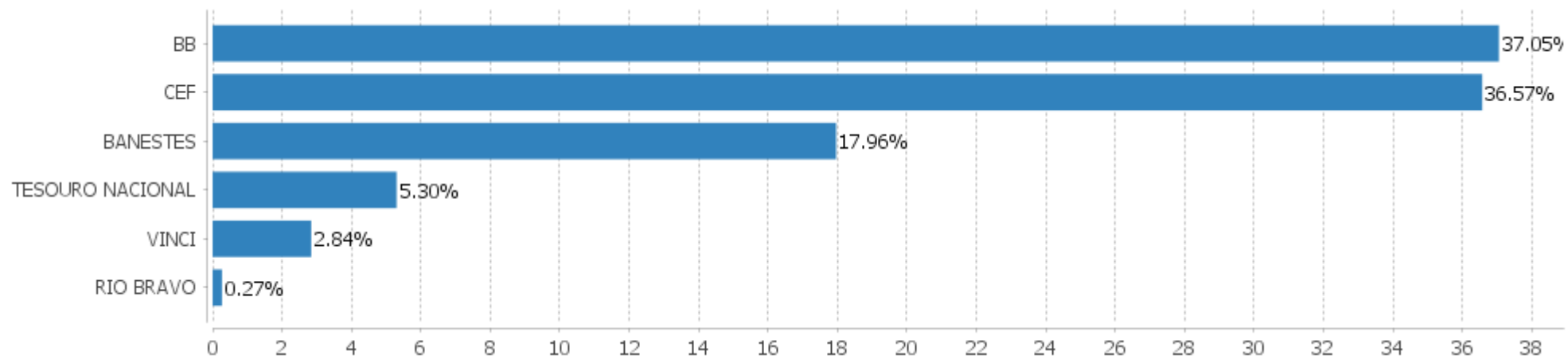


Alocação Por Estratégia



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	-1,49	-0,01			-0,77
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34			7,17
p.p. indexador	-0,22	-1,45	-7,55	1,75	1,95	1,28	2,06	-1,21	-2,61	-1,35			-7,94
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

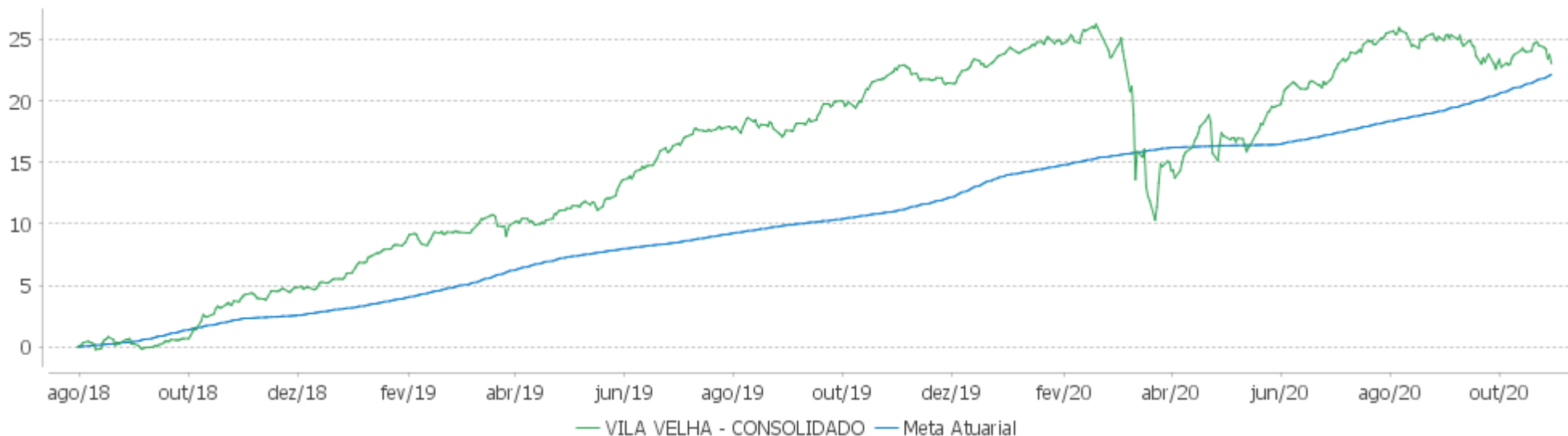
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

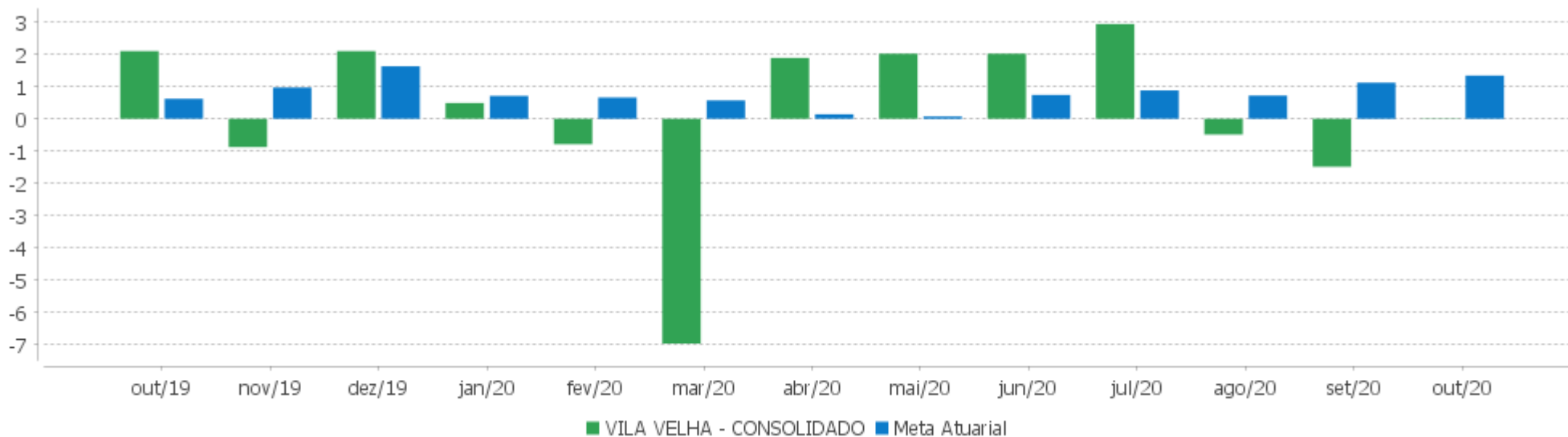
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	15	55,56	03 meses	-1,98	3,21	-5,19	4,70
Meses abaixo da Meta Atuarial	12	44,44	06 meses	5,02	4,97	0,05	4,50
			12 meses	0,43	9,99	-9,56	8,67
			24 meses	18,21	19,55	-1,33	6,50
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,39	2018-10	Desde 31/07/2018	23,04	22,35	0,70	6,22
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
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,99 0,78	-9,64 -9,13	-7,50 -4,43	2,26 -2,56	-11,64 -10,63	20,12 -5,35	29,19 -9,20
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	0,17 109,35	-1,46 -60,01	-1,98 -417,96	0,82 72,72	-0,34 -10,71	18,19 189,13	
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,06 35,66	1,48 60,70	0,13 27,58	0,52 46,41	2,07 64,40	7,24 75,26	13,03 77,62
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO % do CDI	0,02 10,01	0,46 18,73	0,06 11,69	0,13 11,16	0,73 22,76	3,86 40,18	7,47 44,48
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,09 55,36	1,73 70,85	0,26 55,74	0,70 62,32	2,36 73,40	7,80 81,13	13,92 82,88
NTN-B 150545 (5,100000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,23 1,01	6,72 7,23	2,75 5,82	3,91 -0,90	8,77 9,77	17,32 -8,14	
NTN-B 150545 (4,290000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,16 0,95	6,04 6,55	2,55 5,63	3,51 -1,30	7,93 8,94	12,90 -12,57	
NTN-B 150545 (3,680000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,11 0,90	5,52 6,03	2,40 5,48	3,20 -1,61	7,31 8,31	11,80 -13,66	
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,26 0,05	5,31 5,82	0,59 3,67	5,46 0,65	6,03 7,04	23,67 -1,80	35,60 -2,78
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	0,49 0,29	5,75 1,04	1,52 1,01	5,69 0,88	6,58 0,87	22,96 2,68	34,63 3,16
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,11 -0,05	2,94 -0,34	0,24 -0,19	1,13 -0,25	3,67 -0,39	10,79 -0,70	18,38 -0,98
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6% p.p.	0,49 -0,86	5,23 -2,05	1,45 -1,79	5,30 0,27	6,18 -3,92	21,41 1,75	42,48 9,91
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,36 -0,03	4,04 -0,23	-1,73 -0,10	1,50 -0,14	4,16 -0,28	19,08 -0,70	30,28 -0,80
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	0,22 -0,00	-4,61 -0,27	-5,99 -0,06	4,76 -0,14	-6,25 -0,40	27,85 -1,13	41,32 -1,69
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,18 -0,40	4,45 4,95	-1,19 1,89	5,01 0,20	4,96 5,96	25,09 -0,37	36,82 -1,57
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,18 -0,03	4,15 4,66	0,25 3,33	4,57 -0,25	5,08 6,09	20,59 -4,87	31,88 -6,50
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	-0,56	4,57	-2,69	1,65	4,41	22,74	35,49

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IRF-M 1+ p.p.	0,05	-0,19	-0,06	-0,09	-0,22	-0,67	-0,71
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,30	7,51	2,97	4,38	9,72	16,24	28,82
Var. IPCA + 6% p.p.	-0,05	0,23	-0,27	-0,65	-0,38	-3,43	-3,74
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	-0,35	4,76	-0,75	1,20	5,35	17,23	26,57
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,51	1,47	-1,19	-0,17	1,29	5,74	7,20
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,92	-9,01	-7,58	2,35	-10,73	23,19	34,63
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,70	-8,50	-4,50	-2,47	-9,72	-2,27	-3,75
BB PREV RF VII	0,49	3,15	1,16	3,77	4,54	15,45	26,10
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,28	3,66	4,23	-1,05	5,55	-10,01	-12,29
BB PREV RF IDKA2	0,33	4,89	1,13	5,25	6,32	18,19	28,86
Var. IDKA 2 p.p.	0,29	-0,56	0,04	0,40	-0,41	-1,41	-2,40
BB PREV RF IPCA	-0,37	5,18	-0,01	4,82	5,91	24,19	36,10
Var. IPCA + 6% p.p.	-1,72	-2,09	-3,25	-0,21	-4,19	4,53	3,53
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	-0,07	1,78	-1,70	2,07	1,80	17,32	27,46
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,07	-0,17	-0,31	-0,07	-0,37	0,22	0,26
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	-0,18	4,45	-1,19	5,01	4,96	25,09	36,83
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,40	4,96	1,89	0,20	5,97	-0,38	-1,55
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	-0,11	4,42	-1,16	1,94	4,51	23,65	32,48
Var. IPCA p.p.	-0,97	2,20	-2,91	-0,06	0,59	17,10	21,07
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,15	5,00	0,98	4,98	6,16	18,25	29,01
Var. IDKA 2 p.p.	0,12	-0,45	-0,11	0,13	-0,57	-1,35	-2,25
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,20	-0,73	-3,19	4,62	-1,29	24,83	37,31
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,23	-0,11	-0,19	-0,28	-0,64	-1,07
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	0,31	4,44	0,73	4,94	5,39	18,87	31,58
Var. IPCA + 6% p.p.	-1,04	-2,84	-2,52	-0,09	-4,71	-0,80	-0,99
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF	-0,13	4,45	-0,97	5,02	4,80	23,24	32,06
Var. IPCA + 6% p.p.	-1,48	-2,83	-4,22	-0,02	-5,30	3,57	-0,50
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	-0,74	-18,75	-8,66	16,40	-12,35	7,01	25,13
Var. IBOVESPA p.p.	-0,05	0,01	0,05	-0,31	0,03	-0,45	-1,30
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	-1,72	-5,70	-5,04	20,85	1,31	39,71	62,86
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-2,37	14,86	3,60	9,52	11,89	15,21	31,90
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	0,05	-17,54	-8,51	11,41	-10,04	27,58	34,92
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,60	3,02	0,13	0,08	0,54	3,08	3,96
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-1,45	-24,73	-9,28	8,19	-18,47	2,43	13,58
Var. IBOVESPA p.p.	-0,77	-5,97	-0,58	-8,51	-6,10	-5,04	-12,86
JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII	0,41	0,15	0,74	0,58	0,68	0,17	0,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Varição da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IFIX p.p.	1,42	13,62	-0,49	-5,68	1,59	-23,21	-23,73
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-1,77	50,05	10,87	21,16	60,56	94,90	135,92
Var. IBOVESPA p.p.	-1,08	68,81	19,57	4,46	72,93	87,43	109,48
VILA VELHA - CONSOLIDADO	-0,01	-0,77	-1,98	5,02	0,43	18,21	
Var. IPCA + 5,87% p.p.	-1,35	-7,94	-5,19	0,05	-9,54	-1,16	
CDI	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,79
IBOVESPA	-0,69	-18,76	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44
INPC + 6%	1,38	8,05	3,63	5,69	11,01	20,67	32,97
IPCA + 6%	1,35	7,28	3,24	5,03	10,10	19,67	32,57

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	0,16	3,29	0,43	1,38	4,06	11,49	19,36
IRF-M 1+	-0,61	4,76	-2,63	1,75	4,63	23,41	36,20
IRF-M TOTAL	-0,33	4,27	-1,63	1,64	4,44	19,78	31,08
IMA-B 5	0,20	4,72	0,50	4,81	5,71	20,28	31,47
IMA-B 5+	0,22	-4,35	-5,92	4,90	-5,85	28,98	43,02
IMA-B TOTAL	0,21	-0,51	-3,08	4,81	-1,00	25,47	38,38
IMA-C TOTAL	2,81	21,09	8,08	19,98	20,18	45,58	72,54
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,00	1,96	-1,39	2,13	2,16	17,10	27,20
IMA-GERAL TOTAL	0,09	2,49	-1,11	2,64	2,67	17,87	28,36
IDKA 2	0,04	5,45	1,09	4,85	6,73	19,60	31,26
IDKA 20	0,68	-11,22	-9,64	5,97	-13,27	34,55	50,97
CDI	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,79
Renda Variável							
IBOVESPA	-0,69	-18,76	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44
IBRX 100	-0,55	-17,87	-8,31	17,55	-11,05	11,01	29,92
IBRX 50	-0,54	-18,50	-8,37	18,20	-12,42	5,25	23,91
SMALL CAP	-2,28	-20,78	-8,74	20,16	-6,17	34,08	41,52
IFIX	-1,01	-13,47	1,23	6,27	-0,90	23,38	24,28
Índice Consumo - ICON	-2,86	-11,86	-8,08	17,23	-1,94	42,20	27,52
Índice Dividendos - IDIV	0,65	-20,56	-8,64	11,34	-10,58	24,50	30,96
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,86	2,22	1,75	1,99	3,92	6,55	11,41
INPC	0,89	2,95	2,13	2,63	4,77	7,45	11,75
IGPM	3,23	18,10	10,67	15,22	20,93	24,74	38,21
SELIC	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,80
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
473	01/10/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	979.226,47	0,00	660.085,18454855	1,4834850000
435	02/10/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	66.586,47	35.476,98535664	1,8768920000
434	02/10/2020	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	3.000.000,00	0,00	2.419.111,83502406	1,2401245600
460	02/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	7.051.521,71	868.649,38200274	8,1177997200
457	02/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.991,25	245,29430002	8,1177997200
459	02/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	418,86	51,59772530	8,1177997200
456	02/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	768.847,68	94.711,33885033	8,1177997200
458	02/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.177.220,50	145.017,18946079	8,1177997200
433	02/10/2020	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	6.000.000,00	0,00	3.263.827,37329806	1,8383325200
463	06/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	268,22	0,00	33,04046822	8,1179237000
441	07/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.960,00	7.098,42930600	2,1075084860
465	07/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	575,03	0,00	70,83407245	8,1179858800
442	09/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.411,60	6.834,55438400	2,1086378410
443	15/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.529,37	1.672,30960300	2,1104764290
452	15/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	378.244,65	0,00	46.591,67746413	8,1182878700
467	15/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.489.254,37	0,00	306.623,07248289	8,1182878700
474	16/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	708,25	0,00	87,24065762	8,1183477900
453	19/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	19.137,87	0,00	2.357,34274653	8,1184079100
444	21/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	22.793,54	10.799,47180885	2,1106161860
466	21/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	575,07	70,83426632	8,1185283600
468	21/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.656.565,40	204.047,49808622	8,1185283600
462	21/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	740,37	91,19509930	8,1185283600
464	21/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	268,24	33,04047090	8,1185283600
461	21/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	141.850,92	17.472,49177559	8,1185283600
445	22/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	21.967,62	10.408,54276400	2,1105375170
440	22/10/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1.800.000,00	0,00	342.587,57537640	5,2541310000
446	23/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.999,96	2.369,01759900	2,1105626240
447	26/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	382.397,09	0,00	181.174,58959500	2,1106552020

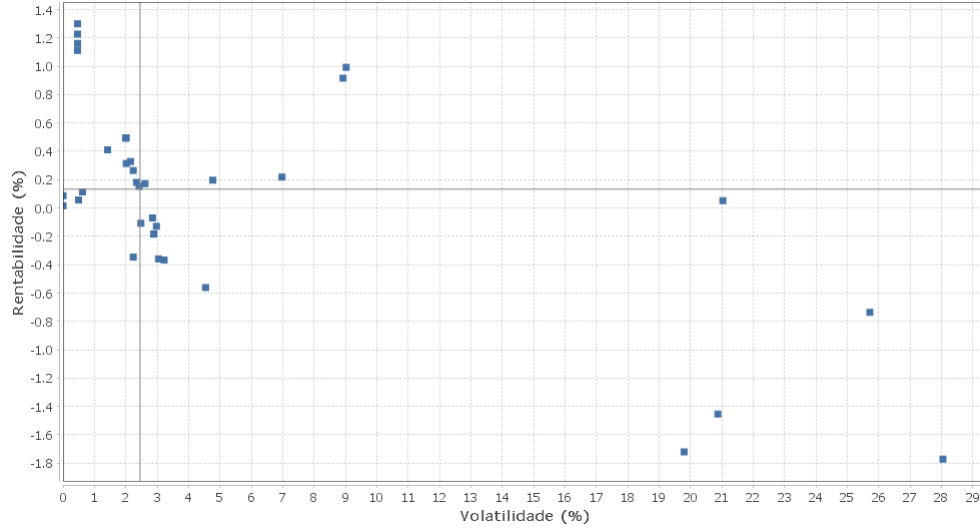
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
454	26/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	232.939,57	0,00	28.691,69877525	8,1187095900
469	26/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	633.039,95	77.972,97624486	8,1187095900
448	27/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	114.941,32	54.456,65025600	2,1106939090
436	27/10/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	316.671,46	168.609,35064907	1,8781370000
470	27/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	257,26	31,68706453	8,1187703500
449	28/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	85.053,79	40.294,48778000	2,1108045960
451	28/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	625.996,09	77.104,21649468	8,1188308300
437	28/10/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	26.160,16	0,00	13.928,21052340	1,8782140000
471	28/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	19.712,22	2.427,96289426	8,1188308300
450	29/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.307,05	4.409,22352700	2,1108138300
455	29/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.963,51	0,00	365,01412678	8,1188912500
438	29/10/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	126.638,86	0,00	67.422,34966661	1,8782920000
472	29/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	9.445,44	1.163,39038289	8,1188912500
475	30/10/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	126.772,56	67.490,72866368	1,8783700000
Total						

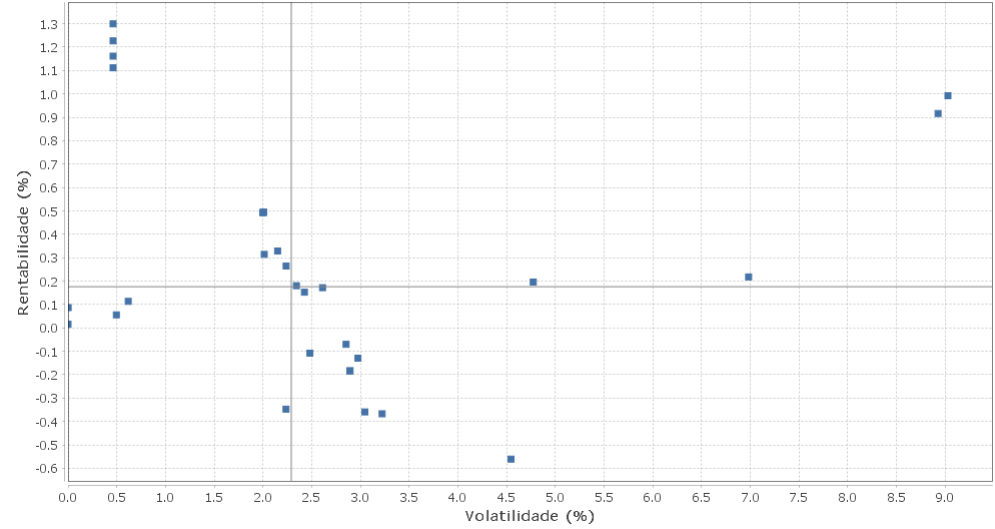
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

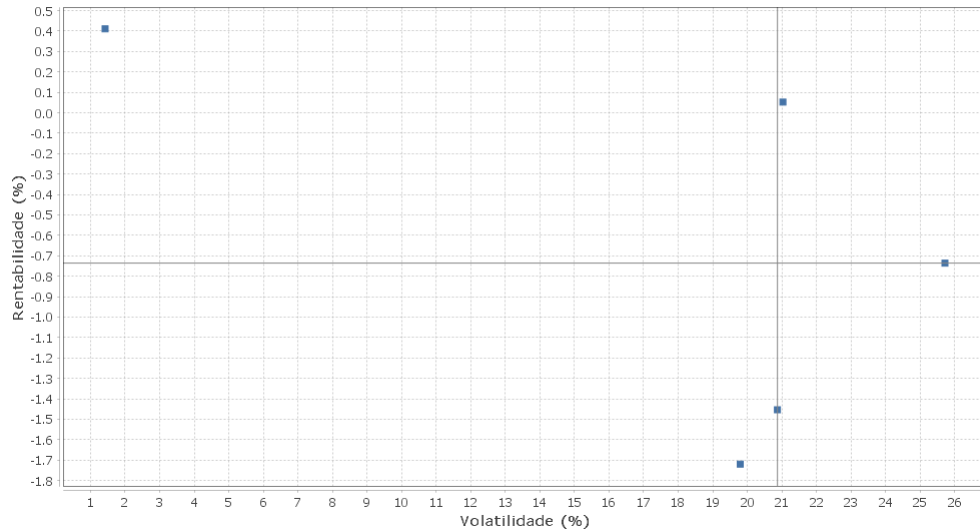
VILA VELHA - CONSOLIDADO - No Mês



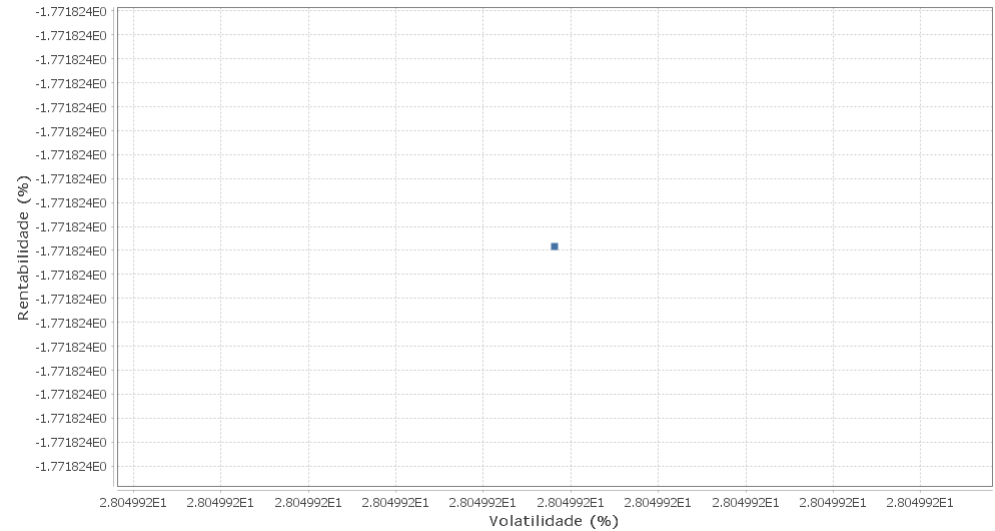
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 7.685.234,85

Value-At-Risk: 2,10%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	-647,52	0,02	963.880,24	0,26
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,01	0,00	-71,82	0,09	212.996,84	0,06
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,46	0,09	-0,00	2,47	1,30	6.483.622,86	1,77
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,46	0,09	-0,00	2,17	1,16	326.864,79	0,09
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,46	0,09	-0,00	2,06	1,11	6.432.720,30	1,75
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,46	0,09	-0,00	2,31	1,23	12.657.028,96	3,45
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,50	0,06	0,00	-0,20	0,06	5.184.587,43	1,41
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,62	0,17	0,00	-0,07	0,11	12.484.914,09	3,41
JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII	Artigo 8º IV, Alínea b	1,42	0,03	-0,00	0,18	0,41	1.006.494,66	0,27
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	2,00	0,89	0,00	0,17	0,49	1.537.177,10	0,42
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	0,93	0,01	0,17	0,49	3.444.559,26	0,94
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	0,94	0,01	0,17	0,49	6.496.595,68	1,77
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	2,01	0,83	0,01	0,08	0,31	6.844.077,37	1,87
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,15	0,90	0,03	0,08	0,33	21.074.311,38	5,75
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	2,24	0,87	0,03	-0,23	-0,35	17.714.084,47	4,83
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,24	1,11	0,00	0,05	0,26	2.419.712,78	0,66
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,34	1,15	0,01	0,01	0,18	5.481.271,10	1,50
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,43	1,08	0,05	-0,00	0,15	25.527.059,95	6,96
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,48	1,21	0,04	-0,11	-0,11	16.751.248,17	4,57
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	2,61	1,25	0,01	0,01	0,17	8.270.048,58	2,26
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,85	1,34	0,05	-0,08	-0,07	16.716.597,46	4,56
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,89	1,80	0,05	-0,12	-0,18	14.712.822,30	4,01
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,89	1,80	0,07	-0,12	-0,18	19.581.812,55	5,34
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF	Artigo 7º VII, Alínea b	2,97	1,76	0,00	-0,10	-0,13	1.274.097,30	0,35
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,04	1,36	0,01	-0,17	-0,36	2.670.248,67	0,73
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	3,22	1,42	0,01	-0,16	-0,37	4.125.296,66	1,13
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	4,54	2,04	0,02	-0,16	-0,56	5.621.960,32	1,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,77	3,15	0,26	0,01	0,20	39.249.030,90	10,71
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,98	4,93	0,12	0,01	0,22	11.647.830,06	3,18
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	8,93	5,38	0,04	0,09	0,92	21.469.269,06	5,86
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	9,03	4,92	0,01	0,09	0,99	5.790.300,76	1,58
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	19,79	10,05	0,26	-0,09	-1,72	11.616.052,35	3,17
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	20,87	9,39	0,24	-0,08	-1,45	10.749.121,29	2,93
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,03	9,83	0,24	-0,00	0,05	10.424.182,15	2,84
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	25,72	10,22	0,32	-0,03	-0,74	13.221.739,69	3,61
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	28,05	13,17	0,20	-0,07	-1,77	16.354.185,70	4,46