



LDB
EMPRESAS

VILA VELHA
JANEIRO 2020



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 12.11.2020.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

85,40%

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	1,11	1,11	6.296.488,61	1,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,290000%) ..	0,36	1,16	1,16	319.162,49	0,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,100000%) ..	0,36	1,23	1,23	12.320.999,73	3,50
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,36	1,19	1,19	18.936.650,83	5,37

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	7,90	0,55	0,55	25.938.709,35	7,36	304.786.097,11	8,51
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,26	0,42	0,42	9.867.825,63	2,80	7.374.284.212,96	0,13
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,90	0,26	0,26	36.295.771,85	10,30	6.477.324.446,92	0,56
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	1,49	0,38	0,38	15.279.716,33	4,34	6.900.045.813,02	0,22
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,28	-0,04	-0,04	12.206.416,50	3,46	2.270.256.483,13	0,54
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	2,93	1,08	1,08	5.434.006,26	1,54	2.361.861.808,09	0,23
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,50	0,46	0,46	22.689.905,00	6,44	8.791.015.868,25	0,26
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,10	0,84	0,84	2.588.072,10	0,73	15.527.608.259,67	0,02
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,77	0,67	0,67	4.049.156,09	1,15	342.438.909,73	1,18
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	2,63	0,69	0,69	2.430.137,85	0,69	288.038.368,79	0,84
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1,37	0,72	0,72	9.126.960,03	2,59	197.821.718,73	4,61
BB	BB	BB PREV RF VII	1,23	0,20	0,20	4.430.758,84	1,26	692.095.869,22	0,64
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,21	0,53	0,53	7.274.359,66	2,06	561.150.881,50	1,30
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	2,32	0,63	0,63	6.498.677,11	1,84	198.917.349,88	3,27

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,35	0,49	0,49	16.503.266,53	4,68	10.446.730.359,40	0,16
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,67	0,82	0,82	5.809.896,47	1,65	10.136.705.212,45	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,83	-0,04	-0,04	3.854.724,14	1,09	262.706.959,14	1,47
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,41	0,80	0,80	19.804.180,82	5,62	1.421.394.968,96	1,39
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,83	-0,03	-0,03	13.147.032,43	3,73	1.019.720.781,29	1,29
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	26,25	0,80	0,80	14.875.129,50	4,22	456.939.411,77	3,26
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	2,08	0,55	0,55	3.971.736,75	1,13	529.547.773,86	0,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,74	1,31	1,31	6.454.460,31	1,83	83.480.011,96	7,73
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,69	0,49	0,49	248.530.899,55	70,53		

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	0,12	0,12	416.926,29	0,12	599.611.553,61	0,07
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	7,51	0,74	0,74	13.145.381,30	3,73	354.602.133,24	3,71
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,04	0,29	0,29	4.693.241,37	1,33	1.500.776.659,75	0,31
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,04	0,30	0,30	843.177,29	0,24	487.819.881,57	0,17
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,09	0,39	0,39	1.136.126,40	0,32	2.809.844.885,27	0,04
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,59	0,62	0,62	5.379.245,40	1,53	216.119.068,94	2,49
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			3,29	0,51	0,51	25.614.098,05	7,27		

Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado")

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	1,70	0,83	0,83	6.607.748,80	1,88	589.901.823,84	1,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF	3,30	0,81	0,81	1.229.757,90	0,35	185.168.727,54	0,66
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			1,91	0,83	0,83	7.837.506,70	2,22		
Renda Fixa			2,39	0,55	0,55	300.919.155,13	85,40		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

13,78%

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	17,89	-1,67	-1,67	16.001.845,54	4,54	574.803.106,30	2,78
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			17,89	-1,67	-1,67	16.001.845,54	4,54		

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	16,73	-0,42	-0,42	14.221.489,89	4,04	1.176.739.396,25	1,21
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	15,73	1,53	1,53	8.163.666,44	2,32	943.947.729,59	0,86
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	16,51	2,03	2,03	9.149.479,84	2,60	132.732.358,95	6,89
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			15,80	0,79	0,79	31.534.636,17	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	1,17	0,65	0,65	1.011.552,06	0,29	126.865.217,56	0,80
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			1,17	0,65	0,65	1.011.552,06	0,29		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			15,81	-0,07	-0,07	48.548.033,77	13,78		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,83%

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	14,56	6,52	6,52	2.912.444,05	0,83	797.257.804,89	0,37
Sub-total Artigo 9º A, III			14,56	6,52	6,52	2.912.444,05	0,83		
Investimentos no Exterior			14,56	6,52	6,52	2.912.444,05	0,83		
Total			3,12	0,49	0,49	352.379.632,95	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	18.936.650,83	5,37	0,00	47,50	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	248.530.899,55	70,53	0,00	20,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	25.614.098,05	7,27	0,00	5,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	7.837.506,70	2,22	0,00	2,50	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	300.919.155,13	85,40				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	16.001.845,54	4,54	0,00	10,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	31.534.636,17	8,95	0,00	13,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.011.552,06	0,29	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	48.548.033,77	13,78				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	2.912.444,05	0,83	0,00	1,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	2.912.444,05	0,83				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

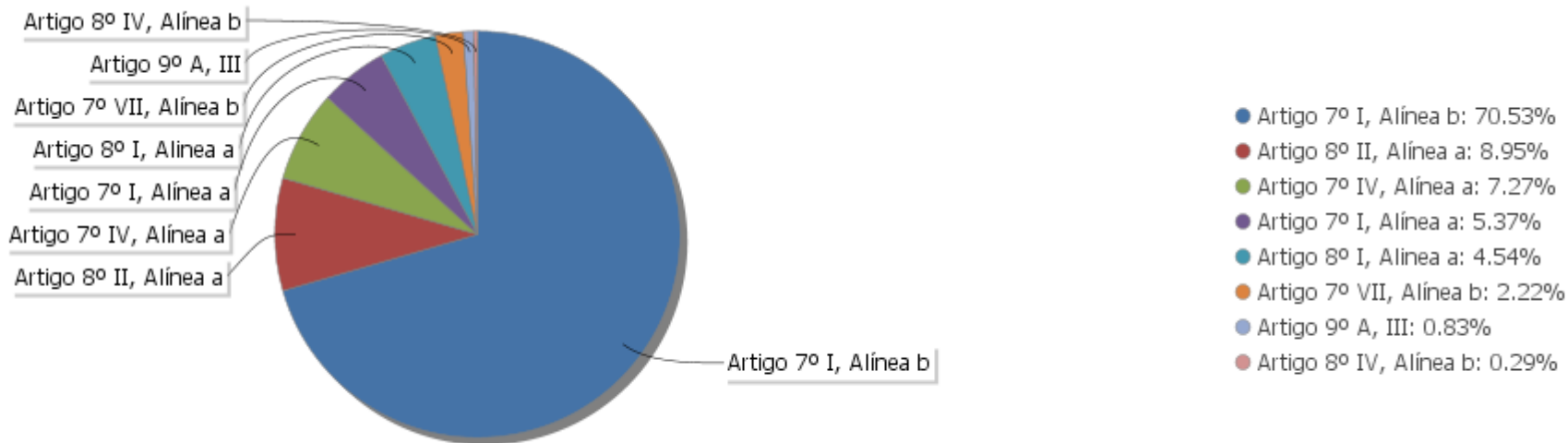
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,19 315,58	1,19 315,58	3,05 268,48	4,47 171,61	9,33 161,23	222.426,01	222.426,01
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,49 130,08	0,49 130,08	0,69 60,83	4,88 187,23	13,69 236,60	1.209.180,20	1.209.180,20
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,51 135,20	0,51 135,20	0,15 13,41	4,75 182,42	13,18 227,93	151.110,47	151.110,47
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,83 220,33	0,83 220,33	1,66 145,77	5,23 200,92	12,08 208,86	64.502,29	64.502,29
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,67 -0,04	-1,67 -0,04	6,08 -0,02	11,55 -0,18	16,45 -0,36	-271.231,80	-271.231,80
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,79 2,42	0,79 2,42	9,12 3,02	14,30 2,56	24,59 7,78	144.589,62	144.589,62
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,65 2,28	0,65 2,28	1,19 -4,91	1,14 -10,60	1,30 -15,50	6.530,51	6.530,51
Artigo 9º A, III % do CDI	6,52 1.730,84	6,52 1.730,84	13,98 1.230,63	22,36 858,57	42,28 730,99	178.236,29	178.236,29
						1.705.343,59	1.705.343,59

Análise de Liquidez

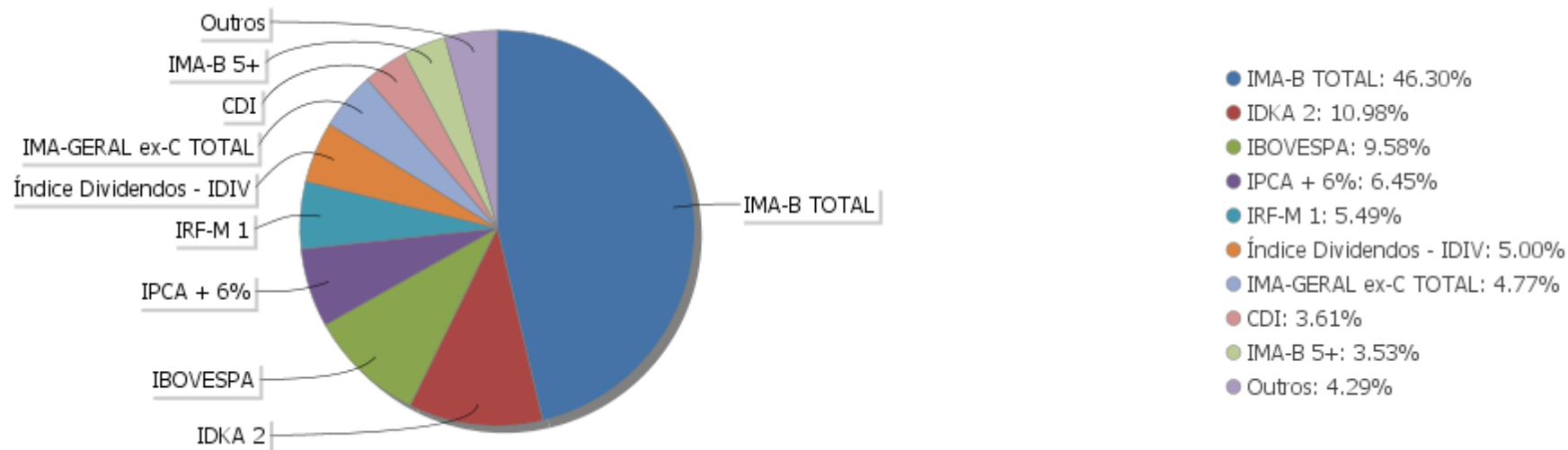
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	238.721.938,05	67,75	238.721.938,05	67,75
de 31 a 364 dias	17.313.146,28	4,91	256.035.084,33	72,66
acima de 365 dias	96.344.548,62	27,34	352.379.632,95	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

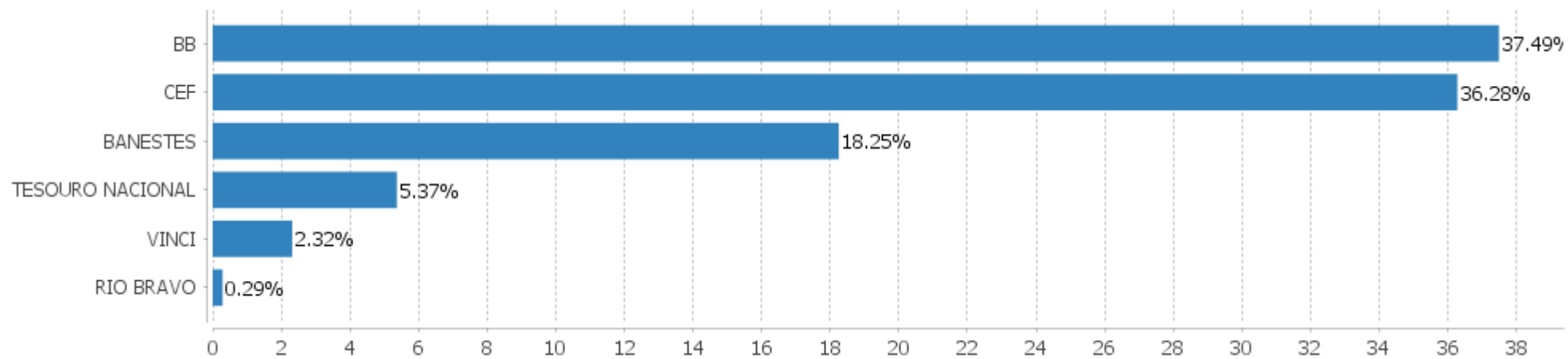


Alocação Por Estratégia



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												0,49
IPCA + 5,87%	0,71												0,71
p.p. indexador	-0,22												-0,22
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

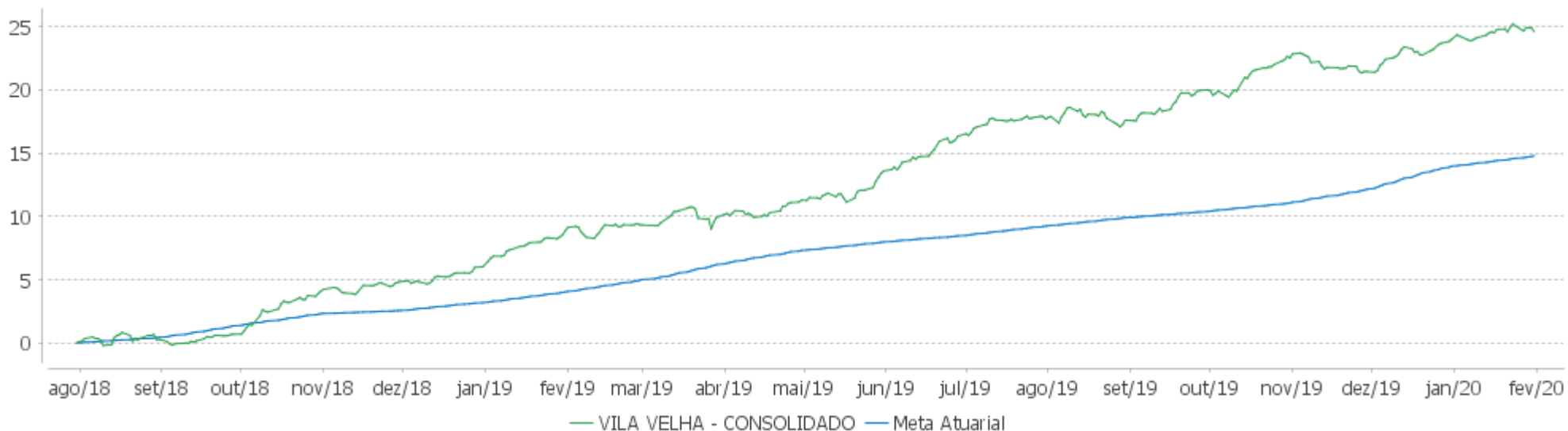
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

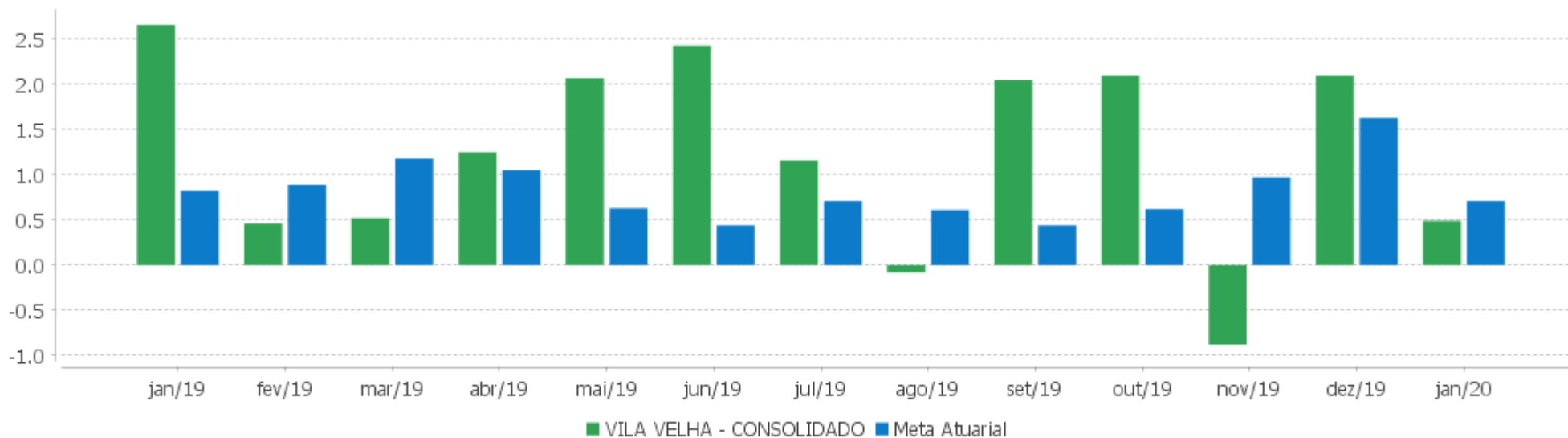
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	11	61,11	03 meses	1,71	3,36	-1,66	2,65
Meses abaixo da Meta Atuarial	7	38,89	06 meses	5,88	5,13	0,75	3,10
			12 meses	14,49	10,46	4,04	3,12
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,39	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-0,88	2019-11	Desde 31/07/2018	24,61	14,98	9,64	3,00

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.	0,74 0,47	0,74 0,47	-1,49 -1,25	5,41 -0,23	23,76 5,65	38,46 3,67	58,97 4,65
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,39 104,85	0,39 104,85	1,07 93,80	2,45 94,07	5,88 101,59	13,19 105,26	24,55 106,35
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	0,62 163,34	0,62 163,34	1,76 154,64	6,99 268,43	16,65 287,81		
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO % do CDI	0,12 31,20	0,12 31,20	0,39 34,44	1,07 40,98	2,69 46,53	6,08 48,55	12,73 55,12
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,29 75,83	0,29 75,83	0,87 76,39	2,05 78,56	4,65 80,38	10,14 80,90	19,28 83,49
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,30 80,31	0,30 80,31	0,92 81,38	2,17 83,29	4,90 84,70	10,67 85,16	20,08 86,99
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,69 0,43	0,69 0,43	1,38 1,62	5,35 -0,29	13,63 -4,48	26,26 -8,53	44,53 -9,79
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	0,63 0,08	0,63 0,08	1,43 -0,09	5,01 -0,03	12,62 0,56	24,71 1,34	42,66 3,53
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6% p.p.	0,55 -0,17	0,55 -0,17	1,46 -1,92	4,79 -0,35	11,93 1,46	32,69 11,23	44,78 12,45
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,42 -0,02	0,42 -0,02	1,13 -0,07	2,89 -0,15	6,33 -0,29	13,50 -0,54	24,99 -0,85
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,84 -0,04	0,84 -0,04	0,96 -0,08	4,33 -0,17	11,12 -0,35	22,99 -0,54	39,91 -1,04
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,04 -0,07	-0,04 -0,07	-1,75 -0,21	5,77 -0,31	21,74 -0,59	42,13 -1,28	64,08 -1,90
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,80 0,54	0,80 0,54	1,29 1,53	6,01 0,37	15,65 -2,46	28,48 -6,30	39,75 -14,57
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,53 0,27	0,53 0,27	1,43 1,67	4,95 -0,69	12,36 -5,76	24,12 -10,67	41,82 -12,50
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03 -0,30	-0,03 -0,30	1,62 1,86	3,33 -2,31	7,50 -10,62	17,30 -17,48	25,73 -28,59
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO Var. IRF-M 1+ p.p.	1,08 -0,04	1,08 -0,04	0,92 -0,07	5,12 -0,15	13,23 -0,34	27,17 -0,54	46,21 -1,16
FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	-0,04	-0,04	1,62	3,32	7,48	17,26	25,82

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.	-0,30	-0,30	1,86	-2,32	-10,64	-17,52	-28,50
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IPCA + 6% p.p.	1,31 0,59	1,31 0,59	3,40 0,02	2,38 -2,76	7,64 -2,83	18,33 -3,13	21,97 -10,36
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,55 0,29	0,55 0,29	-1,35 -1,11	6,31 0,67	25,06 6,94	42,79 8,00	64,13 9,81
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,72 0,28	0,72 0,28	1,29 0,10	3,71 0,66	10,08 3,46	19,31 5,27	32,09 6,25
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,20 -0,06	0,20 -0,06	1,55 1,79	3,91 -1,73	9,21 -8,90	20,11 -14,67	34,75 -19,57
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,38 -0,15	0,38 -0,15	1,75 -0,01	4,52 -0,22	10,29 -0,73	20,76 -1,68	35,58 -3,10
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,49 -0,01	0,49 -0,01	0,50 -0,21	3,93 -0,15	11,38 0,31	22,76 0,53	37,70 -0,16
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6% p.p.	0,67 -0,05	0,67 -0,05	1,36 -2,01	5,48 0,34	14,05 3,58	26,86 5,40	45,17 12,83
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,82 0,61	0,82 0,61	0,91 -0,97	4,67 2,62	14,10 9,91	25,30 17,17	39,15 27,94
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,80 0,54	0,80 0,54	1,29 1,53	6,02 0,38	15,64 -2,48	28,49 -6,30	39,69 -14,63
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,46 -0,08	0,46 -0,08	1,57 -0,19	4,44 -0,31	10,30 -0,72	20,93 -1,51	35,71 -2,96
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,26 -0,00	0,26 -0,00	-0,30 -0,06	5,54 -0,10	17,83 -0,29	34,11 -0,67	53,19 -1,13
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF Var. IPCA + 6% p.p.	0,81 0,09	0,81 0,09	1,16 -2,22	5,80 0,66	15,24 4,77	25,27 3,81	37,15 4,81
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6% p.p.	0,83 0,11	0,83 0,11	1,75 -1,62	5,13 -0,02	11,51 1,04	23,87 2,41	42,29 9,95
NTN-B 150545 (5,100000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,23 0,97	1,23 0,97	3,17 3,41	4,72 -0,92	9,61 -8,51		
NTN-B 150545 (4,290000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,16 0,90	1,16 0,90	2,97 3,21	4,30 -1,34	8,76 -9,36		
NTN-B 150545 (3,680000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,11 0,85	1,11 0,85	2,82 3,06	3,99 -1,65	8,12 -9,99		
JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII Var. IFIX p.p.	0,65 4,41	0,65 4,41	1,19 -9,03	1,14 -14,57	1,30 -26,40	0,70 -33,96	0,85 -58,21
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	2,03	2,03	9,61	15,76	31,93	59,36	105,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Varição da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	3,61	3,61	-1,18	-1,39	4,92	8,60	14,45
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	1,53	1,53	10,76	17,94	28,52	51,11	95,52
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	3,11	3,11	-0,03	0,79	1,51	0,35	4,37
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-0,42	-0,42	7,87	11,61	18,23	36,18	68,85
Var. IBOVESPA p.p.	1,21	1,21	1,77	-0,12	1,43	2,20	-7,06
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	-1,67	-1,67	6,08	11,55	16,45	32,88	73,28
Var. IBOVESPA p.p.	-0,04	-0,04	-0,02	-0,18	-0,36	-1,09	-2,63
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	6,52	6,52	13,98	22,36	42,28	55,39	99,23
Var. IBOVESPA p.p.	8,15	8,15	7,88	10,62	25,48	21,41	23,32
CDI	0,38	0,38	1,14	2,60	5,78	12,53	23,09
IBOVESPA	-1,63	-1,63	6,10	11,74	16,80	33,97	75,91
INPC + 6%	0,70	0,70	3,46	5,16	10,59	21,35	30,95
IPCA + 6%	0,72	0,72	3,37	5,14	10,47	21,46	32,33

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	0,44	0,44	1,20	3,05	6,61	14,04	25,84
IRF-M 1+	1,11	1,11	0,99	5,27	13,57	27,70	47,38
IRF-M TOTAL	0,88	0,88	1,04	4,50	11,47	23,54	40,94
IMA-B 5	0,56	0,56	1,51	5,04	12,06	23,36	39,12
IMA-B 5+	0,03	0,03	-1,54	6,07	22,33	43,41	65,98
IMA-B TOTAL	0,26	0,26	-0,24	5,64	18,11	34,79	54,32
IMA-C TOTAL	2,54	2,54	1,76	6,14	20,05	38,88	56,63
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,50	0,50	0,70	4,08	11,07	22,22	37,86
IMA-GERAL TOTAL	0,56	0,56	0,73	4,13	11,32	22,68	38,34
IDKA 2	0,54	0,54	1,76	4,74	11,02	22,45	38,67
IDKA 20	-1,37	-1,37	-3,65	5,34	28,11	57,81	85,76
CDI	0,38	0,38	1,14	2,60	5,78	12,53	23,09
Renda Variável							
IBOVESPA	-1,63	-1,63	6,10	11,74	16,80	33,97	75,91
IBRX 100	-1,25	-1,25	6,95	12,64	18,97	37,28	80,87
IBRX 50	-1,88	-1,88	5,44	10,57	14,75	29,92	71,82
SMALL CAP	0,45	0,45	18,98	24,82	45,25	64,69	130,34
IFIX	-3,76	-3,76	10,22	15,71	27,70	34,66	59,06
Índice Consumo - ICON	3,66	3,66	15,32	21,23	43,29	43,57	87,57
Índice Dividendos - IDIV	-1,58	-1,58	10,79	17,15	27,01	50,76	91,15
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,21	0,21	1,88	2,05	4,19	8,13	11,21
INPC	0,19	0,19	1,96	2,07	4,30	8,03	10,05
IGPM	0,48	0,48	2,89	2,88	7,81	15,07	14,60
SELIC	0,38	0,38	1,14	2,60	5,78	12,54	23,11
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	02/01/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	250,99	120,64773200	2,0803540640
2	03/01/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	61.575,16	33.337,80402100	1,8470070000
3	07/01/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	74.532,82	0,00	35.813,21242600	2,0811542710
4	07/01/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.030,92	975,86230300	2,0811542710
5	08/01/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	493,36	0,00	237,02996500	2,0814245960
6	08/01/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	20.458,52	9.829,09495700	2,0814245960
7	14/01/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	25.331,47	12.164,05724500	2,0824852670
8	15/01/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	27.704,35	0,00	13.301,78278400	2,0827546540
9	16/01/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	963.278,73	0,00	119.117,14082326	8,0868187680
10	16/01/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	5.510.017,00	0,00	681.357,79446467	8,0868187680
11	17/01/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.625.482,27	200.991,96745253	8,0872996598
12	17/01/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	4.517,73	558,62032941	8,0872996598
13	20/01/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.297,01	1.582,36506500	2,0835963040
14	20/01/2020	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	1.630.000,00	0,00	655.111,01290155	2,4881279171
15	20/01/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.260.000,00	403.082,17779875	8,0876808243
16	20/01/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	1.630.000,00	0,00	1.119.329,36387800	1,4562291070
17	21/01/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	742,72	0,00	356,41506800	2,0838625130
18	21/01/2020	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	1.630.000,00	0,00	738.898,94990219	2,2059850000
19	24/01/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	737,99	0,00	91,22913369	8,0894114600
20	28/01/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	4.479.694,78	0,00	553.713,39624741	8,0902770465
21	28/01/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	381.099,57	0,00	205.852,66636400	1,8513220000
22	29/01/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	106.709,66	51.167,57040500	2,0854939790
23	29/01/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.039,00	128,41888821	8,0907101322
24	30/01/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	294.571,52	36.406,66191176	8,0911434288
25	30/01/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	963.793,87	119.117,14082326	8,0911434288
26	30/01/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.343.021,36	413.170,44857970	8,0911434288
27	30/01/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.033,02	2.892,48571300	2,0857561970
28	30/01/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	24.309,26	11.654,89045900	2,0857561970

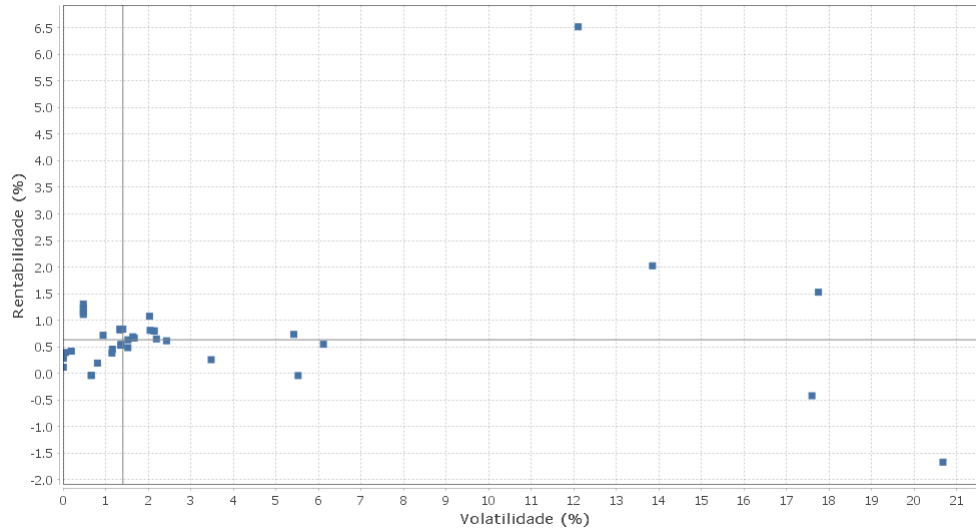
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
29	30/01/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	331.518,71	179.022,12162700	1,8518310000
30	30/01/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	359.997,43	44.492,77573286	8,0911434288
31	31/01/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	736.322,01	90.998,58015191	8,0915769100
32	31/01/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	85.964,33	41.209,79134100	2,0860171140
33	31/01/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	16.608,05	0,00	8.967,21318500	1,8520860000
34	31/01/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	320.182,69	0,00	153.489,96317000	2,0860171140
35	31/01/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	248.996,10	30.772,25895144	8,0915769100

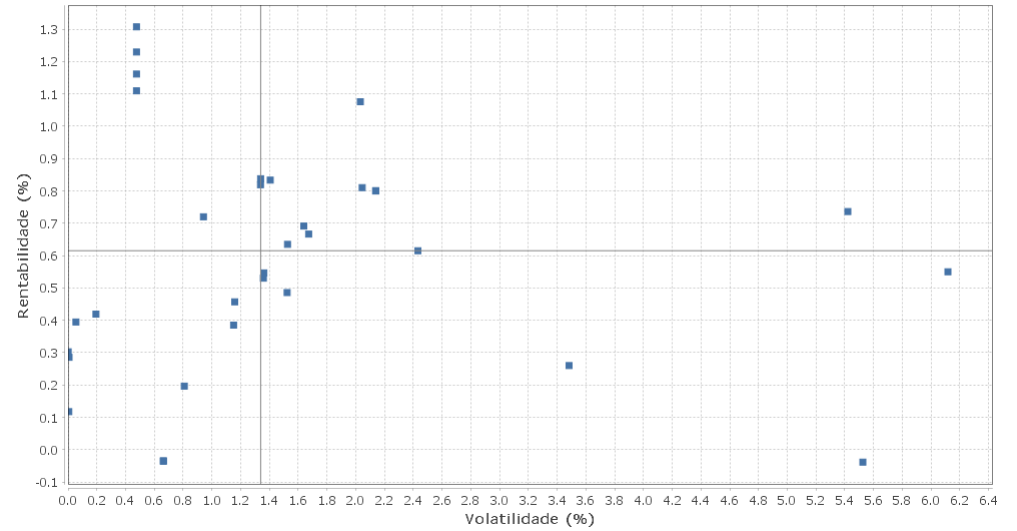
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

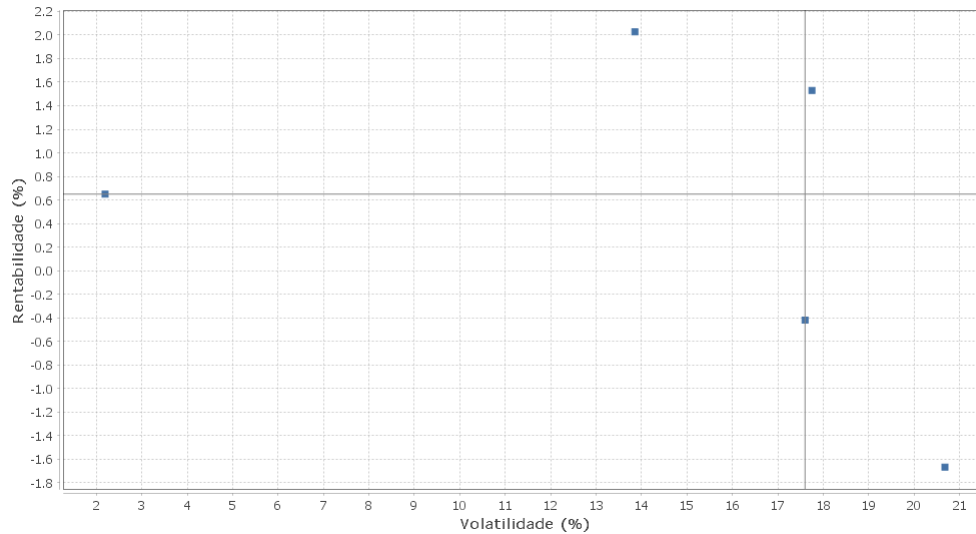
VILA VELHA - CONSOLIDADO - No Mês



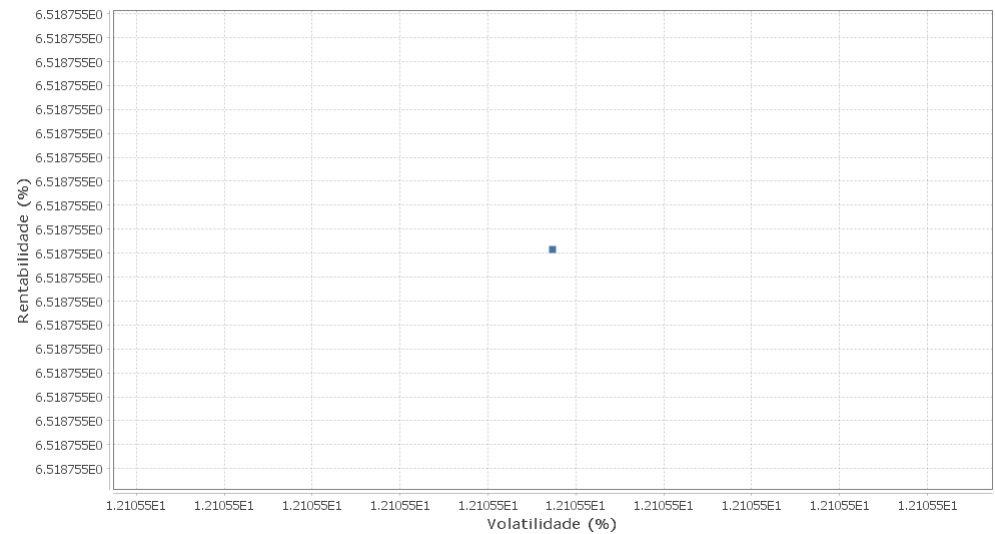
Renda Fixa - No Mês



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	0,00	0,02	0,00	-150,11	0,30	843.177,29	0,24
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,02	0,00	-47,41	0,12	416.926,29	0,12
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,02	0,00	-13,08	0,29	4.693.241,37	1,33
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,04	0,00	0,33	0,39	1.136.126,40	0,32
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,19	0,10	0,00	0,22	0,42	9.867.825,63	2,80
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,48	0,17	0,00	1,96	1,31	6.454.460,31	1,83
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,48	0,17	0,00	1,54	1,11	6.296.488,61	1,79
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,48	0,17	0,00	1,79	1,23	12.320.999,73	3,50
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,48	0,17	0,00	1,65	1,16	319.162,49	0,09
FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,66	0,47	0,00	-0,62	-0,04	3.854.724,14	1,09
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,66	0,47	0,00	-0,62	-0,03	13.147.032,43	3,73
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	0,81	0,49	0,00	-0,22	0,20	4.430.758,84	1,26
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	0,94	0,42	0,01	0,36	0,72	9.126.960,03	2,59
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,15	0,76	0,02	0,01	0,38	15.279.716,33	4,34
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,16	0,68	0,03	0,07	0,46	22.689.905,00	6,44
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,34	1,10	0,01	0,33	0,82	5.809.896,47	1,65
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,34	0,97	0,00	0,34	0,84	2.588.072,10	0,73
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,36	0,84	0,01	0,11	0,53	7.274.359,66	2,06
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,36	0,81	0,01	0,12	0,55	3.971.736,75	1,13
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	1,41	0,83	0,01	0,32	0,83	6.607.748,80	1,88
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,52	1,04	0,03	0,07	0,49	16.503.266,53	4,68
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	Artigo 7º I, Alínea b	1,53	0,89	0,01	0,17	0,63	6.498.677,11	1,84
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,64	0,97	0,00	0,19	0,69	2.430.137,85	0,69
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	1,67	1,04	0,01	0,17	0,67	4.049.156,09	1,15
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	2,03	1,35	0,01	0,34	1,08	5.434.006,26	1,54
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF	Artigo 7º VII, Alínea b	2,05	1,29	0,00	0,21	0,81	1.229.757,90	0,35
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,14	1,33	0,05	0,20	0,80	19.804.180,82	5,62
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,14	1,32	0,00	0,20	0,80	14.875.129,50	4,22
JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII	Artigo 8º IV, Alínea b	2,19	0,04	-0,00	0,12	0,65	1.011.552,06	0,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	2,43	1,12	0,01	0,10	0,62	5.379.245,40	1,53
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,48	2,32	0,18	-0,03	0,26	36.295.771,85	10,30
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	5,42	3,89	0,06	0,07	0,74	13.145.381,30	3,73
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,53	3,67	0,09	-0,08	-0,04	12.206.416,50	3,46
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	6,12	4,16	0,13	0,03	0,55	25.938.709,35	7,36
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	12,11	7,20	0,01	0,51	6,52	2.912.444,05	0,83
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	13,85	6,66	0,12	0,12	2,03	9.149.479,84	2,60
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	17,60	6,51	0,20	-0,05	-0,42	14.221.489,89	4,04
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	17,75	6,02	0,10	0,06	1,53	8.163.666,44	2,32
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	20,68	7,46	0,25	-0,10	-1,67	16.001.845,54	4,54