



LDB
EMPRESAS

VILA VELHA - CONSOLIDADO
FEVEREIRO 2021



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 26.02.2021.

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

76,59%

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%) ..	0,46	0,62	1,78	6.574.153,31	1,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,290000%) ..	0,46	0,67	1,87	334.040,89	0,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,100000%) ..	0,46	0,72	1,99	12.932.353,69	3,20
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,46	0,69	1,91	19.840.547,89	4,91

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	23,60	-2,46	-4,88	22.435.379,64	5,55	322.228.349,01	6,96
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,58	0,00	0,04	2.382.169,97	0,59	8.878.863.822,11	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,85	-1,53	-2,38	21.153.897,93	5,23	7.633.267.120,04	0,28
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,27	-0,55	-0,37	46.641.726,38	11,54	8.720.364.653,89	0,53
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,97	-2,35	-4,01	7.451.805,52	1,84	1.625.335.228,61	0,46
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	9,21	-1,99	-3,35	5.622.991,69	1,39	2.364.083.590,98	0,24
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,23	-0,53	-0,39	29.148.171,13	7,21	10.914.192.598,49	0,27
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,16	-1,15	-1,92	2.679.314,05	0,66	2.086.612.425,47	0,13
BB	BB	BB PREV RF IPCA	6,16	-0,58	-0,56	4.132.977,92	1,02	349.527.759,64	1,18
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	6,13	-0,49	-0,36	2.420.969,90	0,60	286.951.715,22	0,84
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	4,34	-0,27	-0,69	17.844.474,89	4,41	200.178.574,68	8,91
BB	BB	BB PREV RF VII	2,48	-0,01	0,27	1.536.580,86	0,38	240.033.347,68	0,64
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	5,29	-0,67	-0,59	5.479.985,76	1,36	422.731.206,91	1,30
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	4,93	-0,01	0,27	6.502.051,18	1,61	199.020.626,26	3,27
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,34	-0,91	-1,46	17.007.209,21	4,21	9.434.126.715,63	0,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,98	-0,51	-0,48	21.990.360,19	5,44	15.107.095.289,30	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,82	-1,43	-1,59	19.580.093,74	4,84	1.405.311.692,41	1,39
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,82	-1,43	-1,59	14.708.559,30	3,64	451.822.648,68	3,26
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,40	-0,01	0,28	3.446.429,35	0,85	459.517.263,27	0,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,95	0,71	2,04	6.629.642,15	1,64	85.745.744,83	7,73
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,71	-0,99	-1,48	258.794.790,76	64,02		

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	0,02	0,01	0,03	1.749.240,59	0,43	921.121.363,93	0,19
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	26,90	-2,62	-5,44	6.015.252,62	1,49	294.441.339,09	2,04
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,15	0,05	0,13	6.293.512,66	1,56	2.459.370.188,78	0,26
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,05	0,07	0,16	181.092,08	0,04	550.474.030,01	0,03
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,80	-0,85	-1,67	8.393.174,56	2,08	150.270.034,47	5,59
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			12,25	-0,90	-2,08	22.632.272,51	5,60		

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	4,63	-1,07	-0,98	7.005.721,04	1,73	620.319.436,86	1,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	8,19	-0,64	-0,64	1.304.044,00	0,32	201.458.926,32	0,65
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			5,15	-1,00	-0,92	8.309.765,04	2,06		

Renda Fixa			6,16	-0,88	-1,29	309.577.376,20	76,59		
-------------------	--	--	-------------	--------------	--------------	-----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

15,48%

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
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	45,27	-3,28	-6,01	4.761.027,26	1,18	1.143.330.805,79	0,42
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	44,74	-4,38	-7,56	15.456.814,78	3,82	757.221.929,79	2,04
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			44,73	-4,12	-7,20	20.217.842,04	5,00		

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	39,12	-4,74	-8,92	11.976.707,93	2,96	942.945.774,49	1,27
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,87	-4,31	-7,91	11.996.213,80	2,97	927.907.033,94	1,29
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	45,96	-2,52	-3,12	14.709.266,81	3,64	220.810.988,61	6,66
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			40,47	-3,77	-6,47	38.682.188,54	9,57		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	32,69	-2,18	-2,18	2.659.204,49	0,66	842.253.842,01	0,32
Sub-total Artigo 8º III			32,69	-2,18	-2,18	2.659.204,49	0,66		

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	1,55	-1,10	-0,65	1.002.350,24	0,25	125.711.158,87	0,80
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			1,55	-1,10	-0,65	1.002.350,24	0,25		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

40,54

-3,74

-6,52

62.561.585,31

15,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,94%

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	29,47	3,55	9,54	18.476.799,61	4,57	2.403.594.907,13	0,77
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	29,18	4,00	9,21	13.609.326,65	3,37	752.514.178,74	1,81
Sub-total Artigo 9º A, III			29,47	3,74	9,57	32.086.126,26	7,94		
Investimentos no Exterior			29,47	3,74	9,57	32.086.126,26	7,94		
Total			8,78	-1,04	-1,51	404.225.087,77	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	19.840.547,89	4,91	0,00	35,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	258.794.790,76	64,02	0,00	30,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	22.632.272,51	5,60	0,00	2,50	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	8.309.765,04	2,06	0,00	2,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	309.577.376,20	76,59				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	20.217.842,04	5,00	0,00	5,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	38.682.188,54	9,57	0,00	15,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	2.659.204,49	0,66	0,00	2,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.002.350,24	0,25	0,00	0,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	62.561.585,31	15,48				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	32.086.126,26	7,94	0,00	8,50	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	32.086.126,26	7,94				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

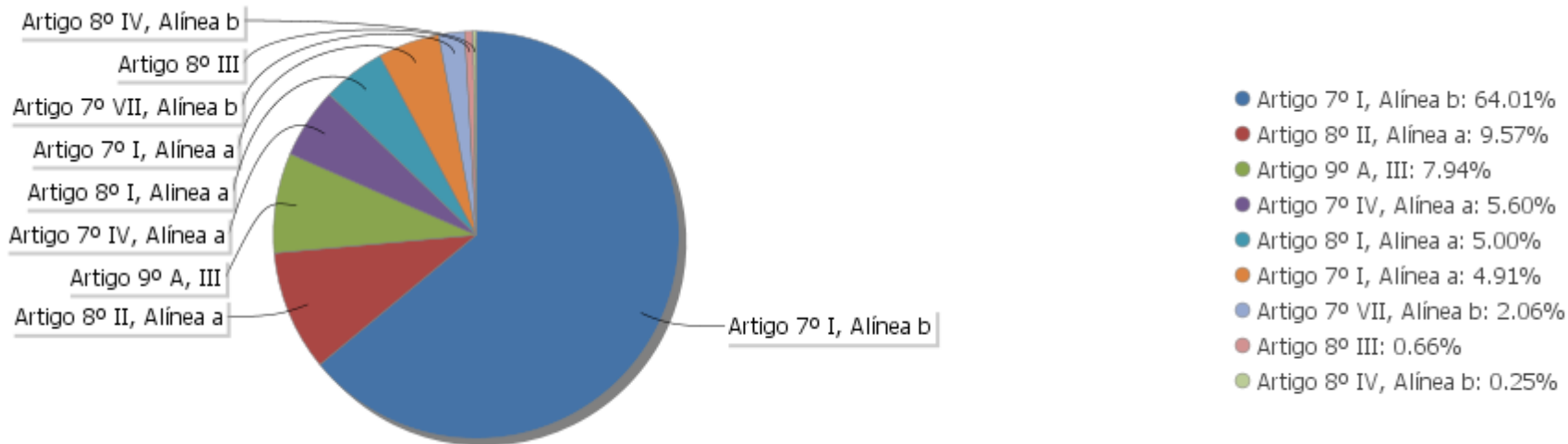
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,69 510,93	1,91 673,65	3,50 779,48	6,76 738,95	9,54 403,79	135.444,51	372.746,75
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,99 -738,96	-1,48 -519,24	1,50 333,46	1,89 206,95	3,23 136,75	-2.607.907,24	-3.877.889,11
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,90 -671,31	-2,08 -731,23	1,11 246,35	-0,15 -16,09	-3,92 -165,90	-230.541,70	-479.802,59
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-1,00 -746,50	-0,92 -324,70	0,93 206,63	2,44 266,45	5,62 237,93	-84.299,49	-77.402,16
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,12 0,25	-7,20 0,35	1,40 0,35	11,03 0,30	5,77 0,14	-869.546,75	-1.567.550,61
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,77 0,60	-6,47 1,07	0,32 -0,73	6,56 -4,18	-0,05 -5,68	-1.516.404,24	-2.676.697,73
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-2,18 4,91	-2,18 4,91				-45.543,77	-45.543,77
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-1,10 3,27	-0,65 6,90	-0,61 -1,66	0,06 -10,68	0,04 -5,59	-11.184,93	-6.573,41
Artigo 9º A, III % do CDI	3,74 2.783,64	9,57 3.367,18	10,40 2.316,07	8,87 968,61	68,90 2.916,46	924.877,30	2.117.422,72
VILA VELHA - CONSOLIDADO (Total)						-4.305.106,31	-6.241.289,91

Análise de Liquidez

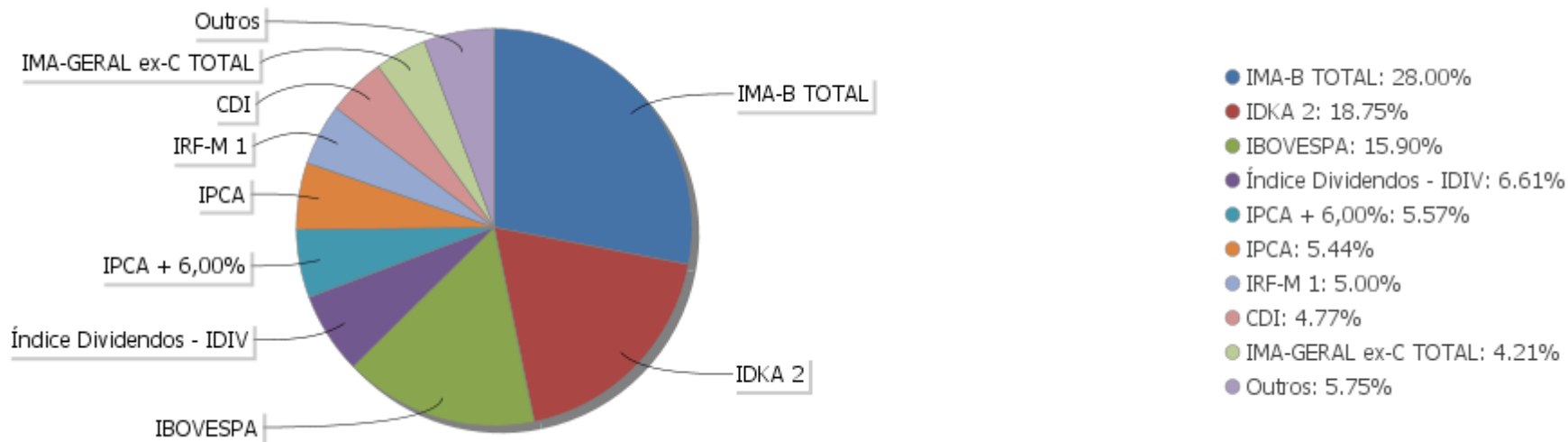
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	285.233.697,83	70,56	285.233.697,83	70,56
de 31 a 365 dias	27.707.830,85	6,85	312.941.528,68	77,42
acima de 365 dias	91.283.559,09	22,58	404.225.087,77	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

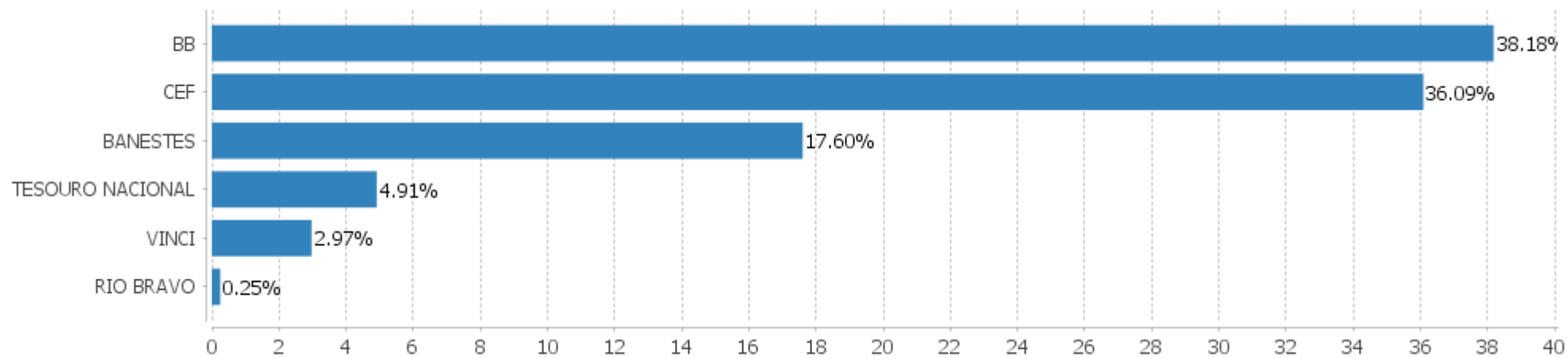


Alocação Por Estratégia



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
2021	-0,48	-1,04											-1,51
IPCA + 5,87%	0,70	1,27											1,99
p.p. indexador	-1,19	-2,31											-3,50
2020	0,49	-0,79	-6,98	1,89	2,02	2,02	2,94	-0,49	-1,49	-0,01	2,81	3,55	5,63
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,63
p.p. indexador	-0,22	-1,45	-7,55	1,75	1,95	1,28	2,06	-1,21	-2,61	-1,35	1,46	1,69	-5,00
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 + 6,00%	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 + 6,00%								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

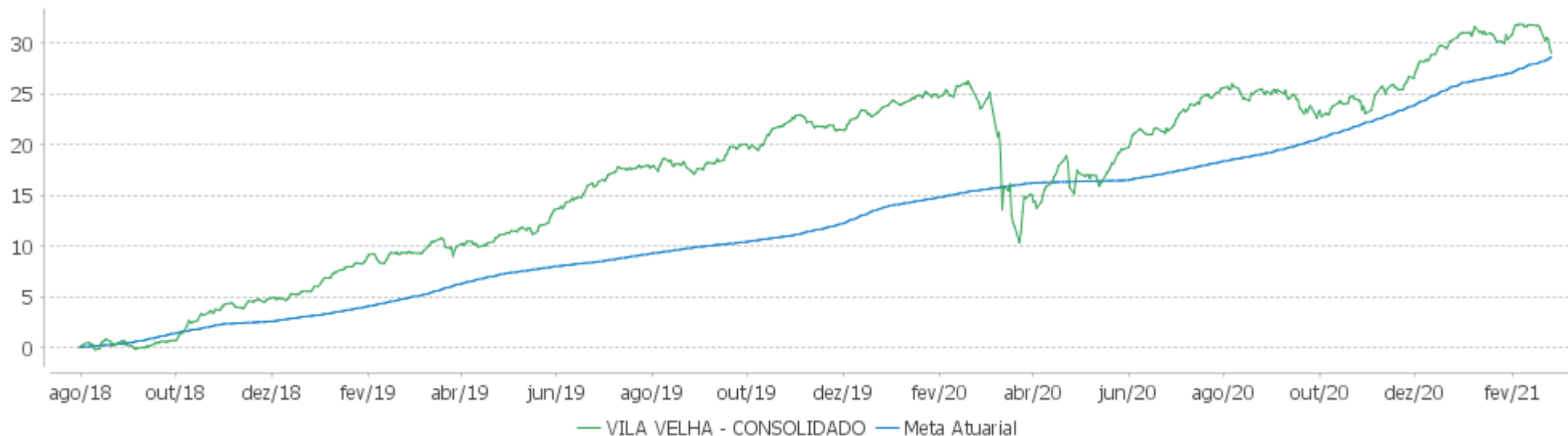
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

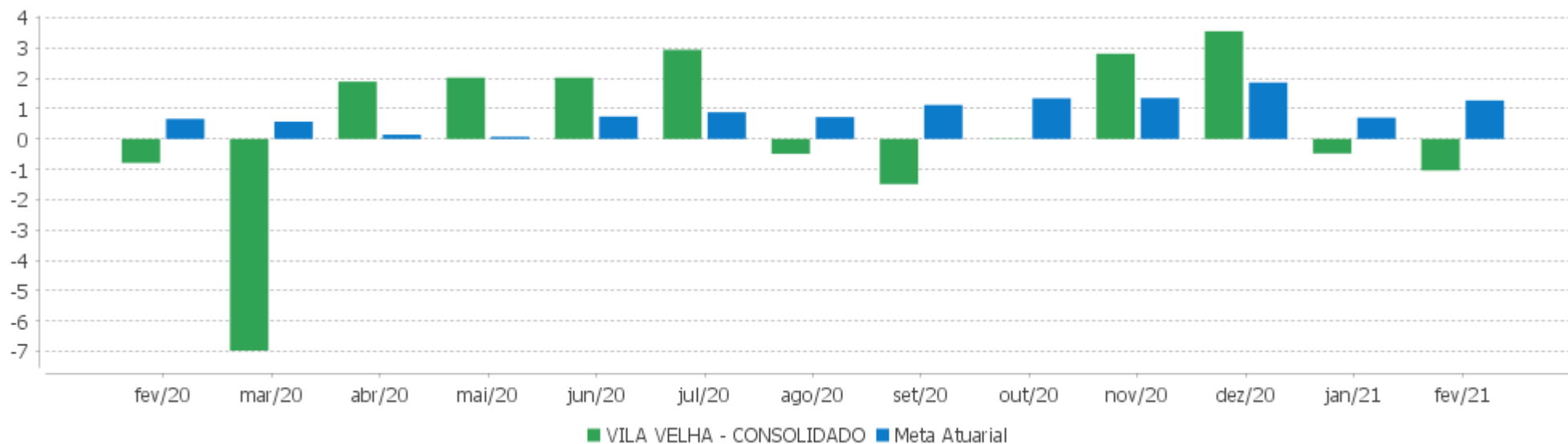
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	17	54,84	03 meses	1,98	3,88	-1,90	4,20
Meses abaixo da Meta Atuarial	14	45,16	06 meses	3,27	7,88	-4,61	4,60
			12 meses	4,35	11,29	-6,95	8,78
			24 meses	17,98	22,64	-4,67	6,66
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,55	2020-12					
Menor rentabilidade da Carteira	-6,98	2020-03	Desde 31/07/2018	29,00	28,81	0,20	6,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150545 (5,100000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,72 2,24	1,99 4,34	3,62 1,23	7,00 3,93	10,04 6,88	20,35 -1,39	
NTN-B 150545 (4,290000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,67 2,18	1,87 4,22	3,42 1,04	6,60 3,53	9,21 6,04	18,51 -3,22	
NTN-B 150545 (3,680000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,62 2,14	1,78 4,13	3,28 0,90	6,30 3,23	8,57 5,41	17,14 -4,59	
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,07 -2,35	-0,98 -2,98	0,89 -3,02	2,60 -5,35	5,69 -5,74	17,51 -5,31	30,57 -4,68
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,64 -1,92	-0,64 -2,64	1,13 -2,78	1,57 -6,37	5,27 -6,16	21,70 -1,11	32,28 -2,97
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,49 1,02	-0,36 1,99	1,29 -1,09	2,74 -0,33	6,55 3,39	21,41 -0,33	34,77 -4,14
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,01 0,58	0,27 0,76	1,49 0,16	3,38 0,64	7,12 0,89	20,93 1,77	33,84 2,65
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,01 -1,29	0,28 -1,73	1,49 -2,42	3,39 -4,56	6,76 -4,67	19,69 -3,12	41,70 6,45
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,00 -0,04	0,04 -0,05	0,35 -0,04	0,70 -0,23	2,71 -0,37	9,12 -0,68	16,38 -0,98
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-1,15 0,03	-1,92 0,06	0,01 0,06	-0,63 -0,05	2,87 -0,14	14,72 -0,51	25,86 -0,83
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-2,35 -0,02	-4,01 -0,03	3,25 0,02	3,33 -0,05	0,76 -0,18	22,39 -0,81	42,85 -1,57
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,67 0,85	-0,59 1,76	1,22 -1,17	2,51 -0,56	5,65 2,48	18,87 -2,86	31,19 -7,72
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,43 0,09	-1,59 0,76	0,90 -1,48	1,49 -1,58	5,44 2,27	22,36 0,62	35,77 -3,14
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	-1,99 0,02	-3,35 0,02	-0,41 0,01	-1,52 -0,03	2,68 -0,14	16,93 -0,51	29,76 -0,87
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,71 -0,57	2,04 0,04	3,75 -0,16	7,37 -0,58	10,92 -0,51	19,12 -3,70	31,11 -4,14
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,46 -0,95	-4,88 -2,53	2,67 0,29	0,13 -2,94	-5,51 -8,67	16,57 -5,17	33,95 -4,97
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	-0,27	-0,69	0,34	0,16	4,03	14,93	24,04

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.	-0,30	-0,78	-0,05	-0,78	0,95	5,13	6,68
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01 1,50	0,27 2,63	1,48 -0,90	3,37 0,30	5,26 2,09	14,83 -6,90	26,37 -12,54
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	-0,55 -0,07	-0,37 -0,04	1,15 -0,25	2,96 0,23	6,43 -0,52	17,41 -1,51	28,62 -2,42
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,91 -0,09	-1,46 -0,20	0,88 0,05	0,90 0,09	2,59 0,03	14,34 0,43	25,55 0,55
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,58 -1,87	-0,56 -2,56	1,40 -2,51	2,04 -5,91	6,51 -4,92	22,01 -0,80	35,39 0,14
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,43 0,09	-1,59 0,76	0,90 -1,48	1,50 -1,57	5,44 2,28	22,35 0,61	35,79 -3,13
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,51 -1,37	-0,48 -1,59	0,83 -1,65	1,04 -3,91	4,64 -0,55	19,53 10,12	31,08 17,41
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,53 -0,05	-0,39 -0,06	1,25 -0,14	2,68 -0,04	6,48 -0,47	17,50 -1,42	28,81 -2,22
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,53 -0,02	-2,38 -0,03	2,34 -0,05	2,95 -0,12	2,89 -0,27	21,16 -0,57	37,86 -1,05
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,62 -1,10	-5,44 -3,08	2,21 -0,18	-0,29 -3,36	-7,00 -10,16	13,73 -8,01	28,05 -10,87
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	-0,85 -632,06	-1,67 -586,53	0,88 195,38	0,12 12,91	-1,03 -43,42	14,97 185,50	
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO % do CDI	0,01 9,86	0,03 9,92	0,04 9,89	0,09 9,88	0,32 13,33	2,84 35,14	6,24 41,59
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,05 35,54	0,13 44,47	0,23 51,08	0,34 37,58	1,26 53,42	5,77 71,50	11,34 75,62
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,07 55,14	0,16 54,97	0,25 54,84	0,50 54,97	1,52 64,27	6,29 77,90	12,16 81,08
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP % do CDI	2,70 2.004,05	2,64 929,40	5,87 1.306,12	8,42 919,43	23,14 979,57	35,21 436,34	
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-4,38 -0,01	-7,56 -0,01	0,99 -0,06	10,58 -0,16	5,34 -0,29	14,58 -0,54	27,69 -1,23
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	-3,28 1,09	-6,01 1,54	2,21 1,17	11,03 0,29	5,37 -0,26	18,71 3,60	35,77 6,86
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-2,52 2,68	-3,12 6,90	1,90 3,87	5,59 -2,06	10,16 13,69	37,55 20,21	62,73 25,44
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-4,31	-7,91	0,72	9,47	-0,18	19,66	40,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,89	2,11	2,69	1,82	3,35	2,32	3,47
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-4,74	-8,92	-1,93	4,64	-7,73	1,54	14,30
Var. IBOVESPA p.p.	-0,36	-1,37	-2,98	-6,09	-13,36	-13,58	-14,61
JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII	-1,10	-0,65	-0,61	0,06	0,04	0,38	-0,06
Var. IFIX p.p.	-1,35	-1,22	-3,39	-3,70	2,65	-18,18	-24,94
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	3,55	9,54	10,30	8,76	68,74	114,04	150,85
Var. IBOVESPA p.p.	7,92	17,09	9,25	-1,97	63,12	98,92	121,93
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	4,00	9,21	9,86	7,26	63,36	94,82	126,09
Var. IBOVESPA p.p.	8,38	16,75	8,81	-3,47	57,73	79,70	97,17
VILA VELHA - CONSOLIDADO	-1,04	-1,51	1,98	3,27	4,35	17,98	
Var. IPCA + 5,87% p.p.	-2,31	-3,50	-1,90	-4,61	-6,95	-4,54	
CDI	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	14,99
IBOVESPA	-4,37	-7,55	1,05	10,73	5,63	15,12	28,92
INPC + 6,00%	1,24	1,98	4,00	8,39	12,51	23,91	36,52
IPCA + 6,00%	1,28	2,00	3,91	7,95	11,43	22,82	35,25

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	0,04	0,08	0,39	0,94	3,08	9,80	17,36
IRF-M 1+	-2,01	-3,37	-0,43	-1,48	2,82	17,44	30,64
IRF-M TOTAL	-1,18	-1,97	-0,06	-0,58	3,01	15,23	26,69
IMA-B 5	-0,60	-0,49	1,33	2,75	6,23	19,15	31,19
IMA-B 5+	-2,33	-3,98	3,24	3,38	0,95	23,20	44,42
IMA-B TOTAL	-1,52	-2,36	2,38	3,07	3,16	21,74	38,91
IMA-C TOTAL	3,72	10,42	9,19	17,82	30,63	54,91	81,60
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,83	-1,26	0,83	0,82	2,55	13,91	25,00
IMA-GERAL TOTAL	-0,69	-0,93	1,07	1,29	3,31	14,97	26,40
IDKA 2	-0,48	-0,33	1,40	2,72	6,95	18,92	31,03
IDKA 20	-2,69	-5,42	5,32	4,90	-1,91	24,76	54,08
CDI	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	14,99
Renda Variável							
IBOVESPA	-4,37	-7,55	1,05	10,73	5,63	15,12	28,92
IBRX 100	-3,45	-6,38	2,19	11,97	6,92	18,84	34,16
IBRX 50	-3,80	-6,48	2,33	12,81	8,13	15,27	27,76
SMALL CAP	-1,84	-5,21	1,92	9,84	2,20	38,68	54,97
IFIX	0,25	0,57	2,78	3,75	-2,61	18,56	24,88
Índice Consumo - ICON	-5,29	-6,50	-1,83	-0,23	1,03	36,15	35,39
Índice Dividendos - IDIV	-5,21	-10,02	-1,98	7,65	-3,53	17,34	37,29
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,86	1,11	2,48	4,95	5,20	9,41	13,66
INPC	0,82	1,09	2,57	5,37	6,22	10,38	14,73
IGPM	2,53	5,17	6,18	18,11	28,94	37,73	48,21
SELIC	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	15,00
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
615	01/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	35.132,30	16.603,25833600	2,1159882770
629	01/02/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	684.347,56	84.250,84038282	8,1227386800
646	01/02/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	61.338,92	0,00	32.571,17702752	1,8832270000
650	01/02/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	20.265,05	2.494,85435865	8,1227386800
633	02/02/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	33.354,95	0,00	4.106,33737975	8,1227982300
645	02/02/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	33.354,95	17.710,85936691	1,8833050000
654	02/02/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.270,31	0,00	156,38822534	8,1227982300
616	04/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.636,30	1.718,34688100	2,1161617830
617	05/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.816,99	4.638,91176100	2,1162269310
618	10/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.556,55	3.097,97819900	2,1163964300
619	12/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.927,64	2.800,67234400	2,1165060640
630	17/02/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	171.470,29	21.108,36006136	8,1233354700
651	17/02/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	16.045,62	1.975,25019855	8,1233354700
610	17/02/2021	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	0,00	90.937,92	39.258,83053200	2,3163685410
611	17/02/2021	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	0,00	62.386,70	26.203,62435400	2,3808424040
612	17/02/2021	BB PREV RF VII	0,00	41.816,49	22.581,33778700	1,8518163270
613	17/02/2021	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	0,00	144.241,16	73.186,90099900	1,9708603320
614	17/02/2021	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	0,00	169.171,85	97.079,06251300	1,7426193210
620	18/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	40,00	18,89802000	2,1166238820
647	18/02/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	70.550,68	37.445,69232729	1,8840800000
621	19/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.807,15	2.743,52708300	2,1166731090
635	19/02/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	551.762,35	0,00	67.922,12361372	8,1234555200
656	19/02/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	4.068.568,77	0,00	500.842,13054200	8,1234555200
643	19/02/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.054.748,26	0,00	754.525,01865302	1,3978970000
640	19/02/2021	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.000.000,00	1.809.291,28974606	2,7635130000
641	19/02/2021	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5.000.000,00	0,00	3.292.005,49633238	1,5188310000
655	22/02/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.270,42	156,38795982	8,1235154000
657	22/02/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.039.485,00	374.158,82783948	8,1235154000

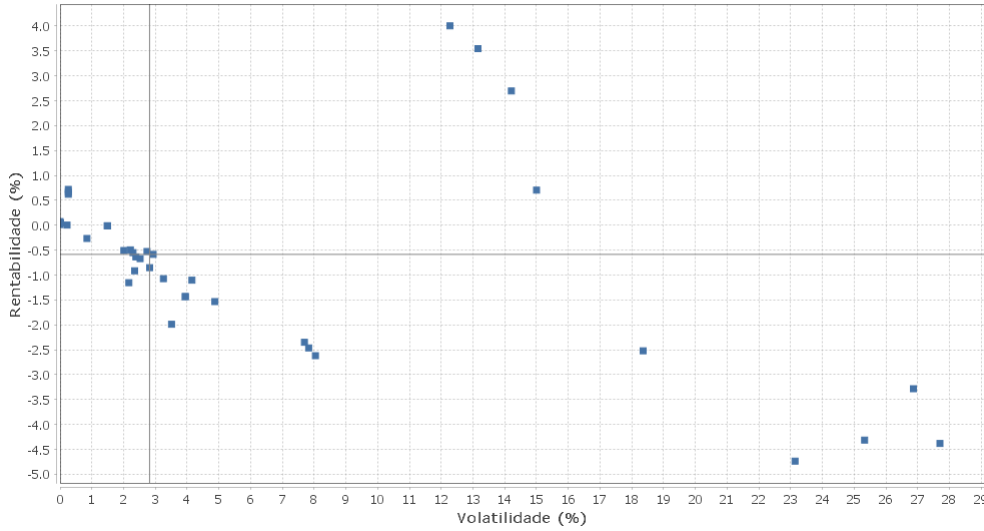
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
653	22/02/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	738,08	90,85721682	8,1235154000
652	22/02/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	253.291,72	31.180,06275953	8,1235154000
627	22/02/2021	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	522.854,80	0,00	227.889,35680400	2,2943361960
626	22/02/2021	BB PREV RF IDKA2	15.000.000,00	0,00	5.176.269,38733400	2,8978399070
625	22/02/2021	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	20.000.000,00	3.102.822,36768700	6,4457444320
644	22/02/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.650.000,00	0,00	1.190.152,46213692	1,3863770000
622	23/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	578.253,49	0,00	273.175,90875800	2,1167806950
631	23/02/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	220.902,21	27.192,73252406	8,1235752900
658	23/02/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	363.156,09	44.703,97294736	8,1235752900
628	23/02/2021	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	6.650.000,00	0,00	2.896.258,58576400	2,2960657010
637	24/02/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	5.405.907,22	0,00	665.454,18980097	8,1236354100
648	24/02/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	382.087,96	0,00	202.764,79921885	1,8843900000
623	25/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	89.944,80	42.489,96729800	2,1168479460
636	25/02/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	551.778,72	67.922,12370828	8,1236965200
638	25/02/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.868.046,79	476.143,68415624	8,1236965200
632	25/02/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	470.687,08	57.940,01275666	8,1236965200
634	25/02/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	33.358,64	4.106,33754201	8,1236965200
659	25/02/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	448.107,94	55.160,59578257	8,1236965200
624	26/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	324,00	153,05287100	2,1169155290
639	26/02/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	6.269,52	771,75131109	8,1237568500
649	26/02/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	335.726,77	178.147,29383098	1,8845460000
660	26/02/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	271,28	33,39341699	8,1237568500
Total						

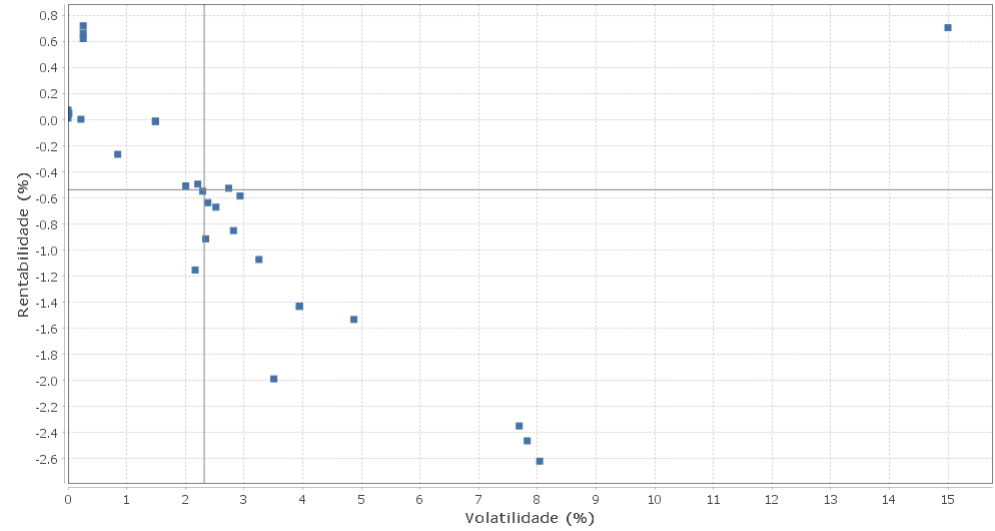
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

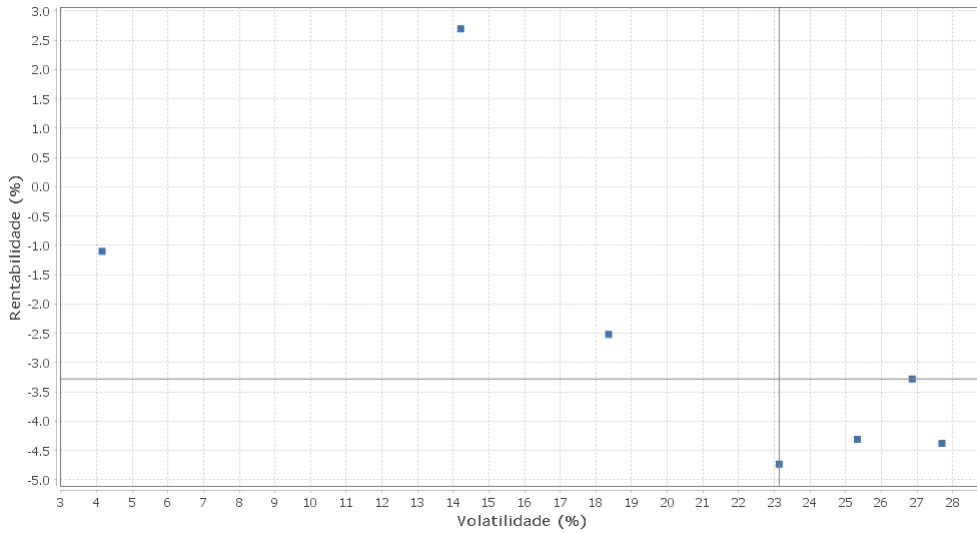
VILA VELHA - CONSOLIDADO - No Mês



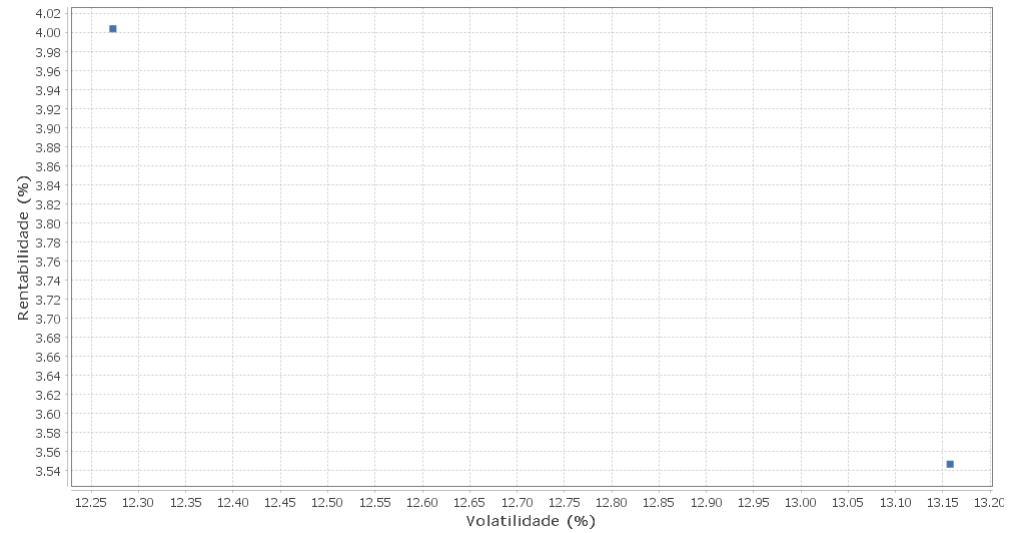
Renda Fixa - No Mês



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\$): 9.486.236,91

Value-At-Risk: 2,35%

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	0,00	0,01	1.749.240,59	0,43
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	-142,07	0,07	181.092,08	0,04
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,04	0,00	-6,17	0,05	6.293.512,66	1,56
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,22	0,16	0,00	-0,59	0,00	2.382.169,97	0,59
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,26	0,16	0,00	2,05	0,67	334.040,89	0,08
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,26	0,16	0,00	2,27	0,72	12.932.353,69	3,20
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,26	0,16	0,00	1,89	0,62	6.574.153,31	1,63
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	0,85	0,74	0,02	-0,47	-0,27	17.844.474,89	4,41
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,49	0,80	0,00	-0,10	-0,01	1.536.580,86	0,38
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,49	0,80	0,00	-0,10	-0,01	3.446.429,35	0,85
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	Artigo 7º I, Alínea b	1,49	0,81	0,01	-0,10	-0,01	6.502.051,18	1,61
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,06	0,04	-0,32	-0,51	21.990.360,19	5,44
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,17	1,35	0,00	-0,59	-1,15	2.679.314,05	0,66
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,21	1,09	0,00	-0,28	-0,49	2.420.969,90	0,60
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,30	1,07	0,07	-0,30	-0,55	46.641.726,38	11,54
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,35	1,31	0,03	-0,45	-0,91	17.007.209,21	4,21
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	Artigo 7º VII, Alínea b	2,39	1,23	0,00	-0,32	-0,64	1.304.044,00	0,32
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,52	1,24	0,01	-0,32	-0,67	5.479.985,76	1,36
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,74	1,16	0,05	-0,24	-0,53	29.148.171,13	7,21
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	2,82	1,27	0,01	-0,35	-0,85	8.393.174,56	2,08
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	2,93	1,31	0,01	-0,25	-0,58	4.132.977,92	1,02
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	3,25	1,27	0,01	-0,37	-1,07	7.005.721,04	1,73
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,51	2,15	0,01	-0,60	-1,99	5.622.991,69	1,39
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,94	1,62	0,03	-0,40	-1,43	14.708.559,30	3,64
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,94	1,62	0,05	-0,40	-1,43	19.580.093,74	4,84
JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII	Artigo 8º IV, Alínea b	4,15	0,00	-0,00	-0,30	-1,10	1.002.350,24	0,25
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,87	2,28	0,06	-0,34	-1,53	21.153.897,93	5,23
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,69	3,93	0,03	-0,32	-2,35	7.451.805,52	1,84

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	7,83	4,44	0,06	-0,33	-2,46	22.435.379,64	5,55
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	8,04	4,80	0,02	-0,34	-2,62	6.015.252,62	1,49
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	12,27	12,34	0,19	0,32	4,00	13.609.326,65	3,37
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	13,16	11,52	0,23	0,26	3,55	18.476.799,61	4,57
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	14,21	8,18	0,04	0,18	2,70	2.659.204,49	0,66
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	15,00	0,23	0,00	0,04	0,71	6.629.642,15	1,64
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	18,36	9,63	0,27	-0,14	-2,52	14.709.266,81	3,64
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	23,14	10,10	0,26	-0,21	-4,74	11.976.707,93	2,96
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	25,33	11,12	0,28	-0,18	-4,31	11.996.213,80	2,97
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	26,87	12,47	0,13	-0,13	-3,28	4.761.027,26	1,18
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	27,70	12,37	0,42	-0,16	-4,38	15.456.814,78	3,82