



LDB
EMPRESAS

VILA VELHA - CONSOLIDADO
JANEIRO 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 29.01.2021.

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

78,69%

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%) ..	0,47	1,15	1,15	6.533.455,78	1,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,290000%) ..	0,47	1,19	1,19	331.833,93	0,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,100000%) ..	0,47	1,26	1,26	12.839.813,67	3,17
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,47	1,22	1,22	19.705.103,38	4,87

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	23,63	-2,48	-2,48	23.002.023,52	5,68	296.079.652,80	7,77
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,58	0,03	0,03	2.382.069,40	0,59	8.572.331.669,58	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,85	-0,86	-0,86	41.604.675,07	10,28	8.335.200.025,45	0,50
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,24	0,18	0,18	31.906.308,59	7,88	9.200.599.633,08	0,35
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,97	-1,70	-1,70	12.632.155,47	3,12	1.699.071.109,60	0,74
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	9,18	-1,39	-1,39	5.737.062,43	1,42	2.764.051.643,34	0,21
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,18	0,13	0,13	29.302.252,81	7,24	10.852.113.121,11	0,27
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,14	-0,77	-0,77	2.710.569,72	0,67	2.465.176.454,79	0,11
BB	BB	BB PREV RF IPCA	6,15	0,02	0,02	4.157.289,27	1,03	351.583.780,87	1,18
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	6,12	0,13	0,13	2.495.171,46	0,62	295.746.645,48	0,84
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	4,35	-0,43	-0,43	17.891.950,27	4,42	200.293.256,86	8,93
BB	BB	BB PREV RF VII	2,45	0,29	0,29	1.578.419,31	0,39	246.568.875,27	0,64
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	5,26	0,08	0,08	5.660.802,15	1,40	436.679.551,26	1,30
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	4,93	0,29	0,29	6.671.377,50	1,65	204.203.518,84	3,27
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,33	-0,55	-0,55	17.164.077,94	4,24	9.495.985.226,13	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	5,97	0,03	0,03	17.115.974,64	4,23	14.822.912.413,17	0,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,78	-0,16	-0,16	20.357.023,05	5,03	1.461.073.478,69	1,39
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,78	-0,16	-0,16	15.294.913,20	3,78	469.834.494,84	3,26
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,40	0,29	0,29	3.537.389,77	0,87	471.644.372,24	0,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,47	1,33	1,33	6.764.494,81	1,67	87.489.905,60	7,73
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,68	-0,49	-0,49	267.966.000,38	66,18		

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	0,01	1.837.617,81	0,45	942.069.453,39	0,20
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	26,90	-2,89	-2,89	6.177.048,53	1,53	283.601.726,46	2,18
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,15	0,08	0,08	5.869.627,99	1,45	2.320.539.431,87	0,25
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,05	0,08	0,08	177.131,04	0,04	608.020.020,83	0,03
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,85	-0,82	-0,82	8.465.155,01	2,09	173.596.668,41	4,88
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			12,28	-1,19	-1,19	22.526.580,38	5,56		

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	4,57	0,10	0,10	7.081.676,53	1,75	627.044.892,55	1,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	8,20	-0,00	-0,00	1.312.388,00	0,32	203.100.317,51	0,65
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			5,10	0,08	0,08	8.394.064,53	2,07		
Renda Fixa			6,13	-0,41	-0,41	318.591.748,67	78,69		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

15,39%

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	45,64	-2,82	-2,82	4.922.547,46	1,22	1.218.203.539,76	0,40
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	45,03	-3,32	-3,32	16.164.841,33	3,99	761.516.224,91	2,12
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			45,03	-3,20	-3,20	21.087.388,79	5,21		

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	39,53	-4,39	-4,39	12.572.102,64	3,11	998.958.997,80	1,26
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	40,22	-3,76	-3,76	12.536.908,52	3,10	968.458.637,18	1,29
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	46,52	-0,61	-0,61	15.089.581,62	3,73	209.697.528,06	7,20
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			41,01	-2,81	-2,81	40.198.592,78	9,93		

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	1,30	0,46	0,46	1.013.535,17	0,25	127.113.931,76	0,80
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			1,30	0,46	0,46	1.013.535,17	0,25		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			41,01	-2,89	-2,89	62.299.516,74	15,39		
--	--	--	--------------	--------------	--------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,92%

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	30,33	5,79	5,79	17.843.942,40	4,41	2.159.778.426,35	0,83
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	29,90	5,00	5,00	6.144.451,76	1,52	609.313.979,93	1,01
Sub-total Artigo 9º A, III			30,34	5,62	5,62	23.988.394,16	5,92		
Investimentos no Exterior			30,34	5,62	5,62	23.988.394,16	5,92		
Total			8,82	-0,48	-0,48	404.879.659,57	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	19.705.103,38	4,87	0,00	35,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	267.966.000,38	66,18	0,00	30,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	22.526.580,38	5,56	0,00	2,50	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	8.394.064,53	2,07	0,00	2,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	318.591.748,67	78,69				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	21.087.388,79	5,21	0,00	5,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	40.198.592,78	9,93	0,00	15,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.013.535,17	0,25	0,00	0,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	62.299.516,74	15,39				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	23.988.394,16	5,92	0,00	8,50	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	23.988.394,16	5,92				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

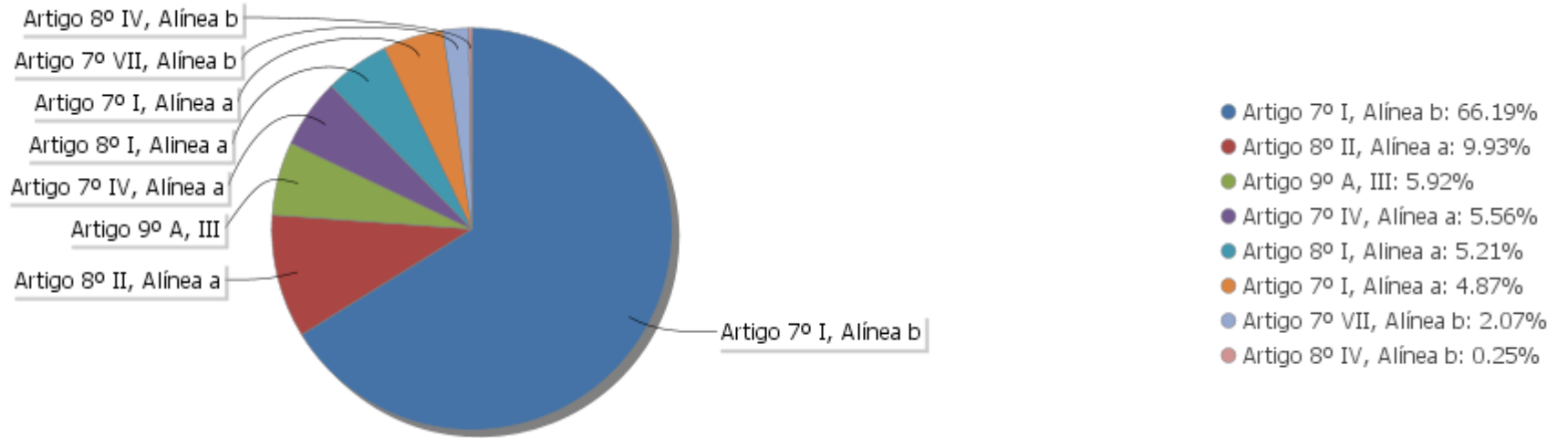
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,22 815,40	1,22 815,40	3,99 859,77	6,72 714,60	9,25 366,44	237.302,24	237.302,24
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,49 -325,44	-0,49 -325,44	3,87 834,09	2,18 231,43	4,76 188,59	-1.269.981,87	-1.269.981,87
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-1,19 -793,29	-1,19 -793,29	2,77 595,82	-1,21 -128,43	-2,68 -106,27	-249.260,89	-249.260,89
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,08 55,01	0,08 55,01	3,40 732,18	3,87 411,18	7,10 281,20	6.897,33	6.897,33
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,20 0,11	-3,20 0,11	22,43 -0,04	11,84 0,02	1,16 0,01	-698.003,86	-698.003,86
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,81 0,51	-2,81 0,51	16,79 -5,68	8,00 -3,81	-4,08 -5,23	-1.160.293,49	-1.160.293,49
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,46 3,78	0,46 3,78	0,70 -21,77	1,44 -10,37	0,20 -0,95	4.611,52	4.611,52
Artigo 9º A, III % do CDI	5,62 3.756,19	5,62 3.756,19	9,00 1.939,75	20,85 2.215,67	53,55 2.120,56	1.192.545,42	1.192.545,42
VILA VELHA - CONSOLIDADO (Total)						-1.936.183,60	-1.936.183,60

Análise de Liquidez

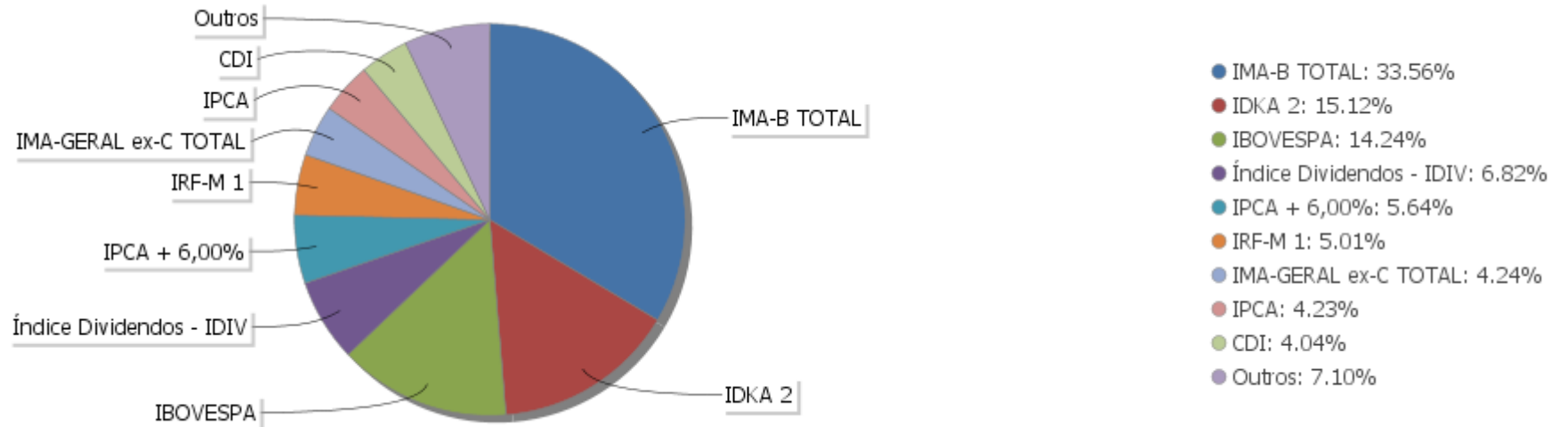
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	282.935.973,83	69,88	282.935.973,83	69,88
de 31 a 365 dias	28.640.025,31	7,07	311.575.999,14	76,96
acima de 365 dias	93.303.660,43	23,04	404.879.659,57	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

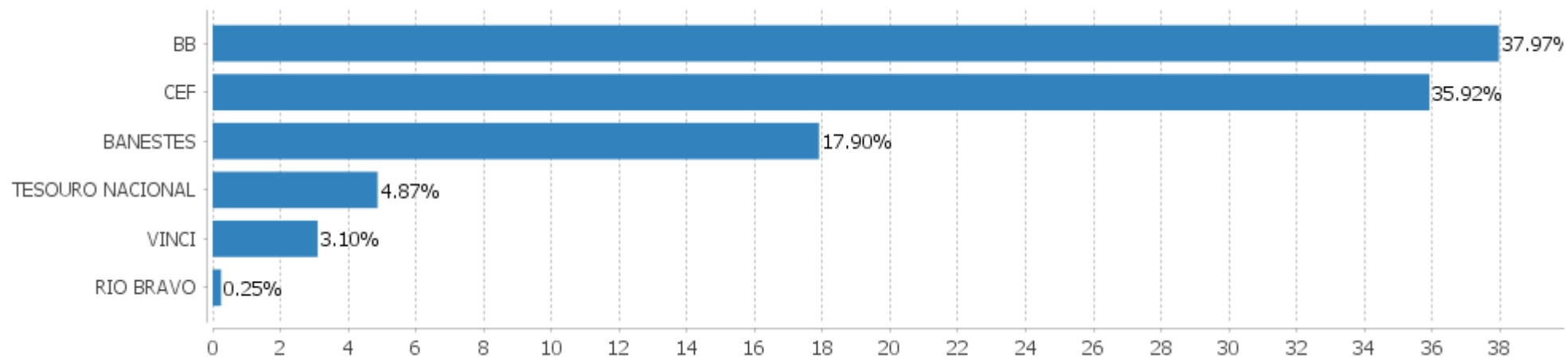


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

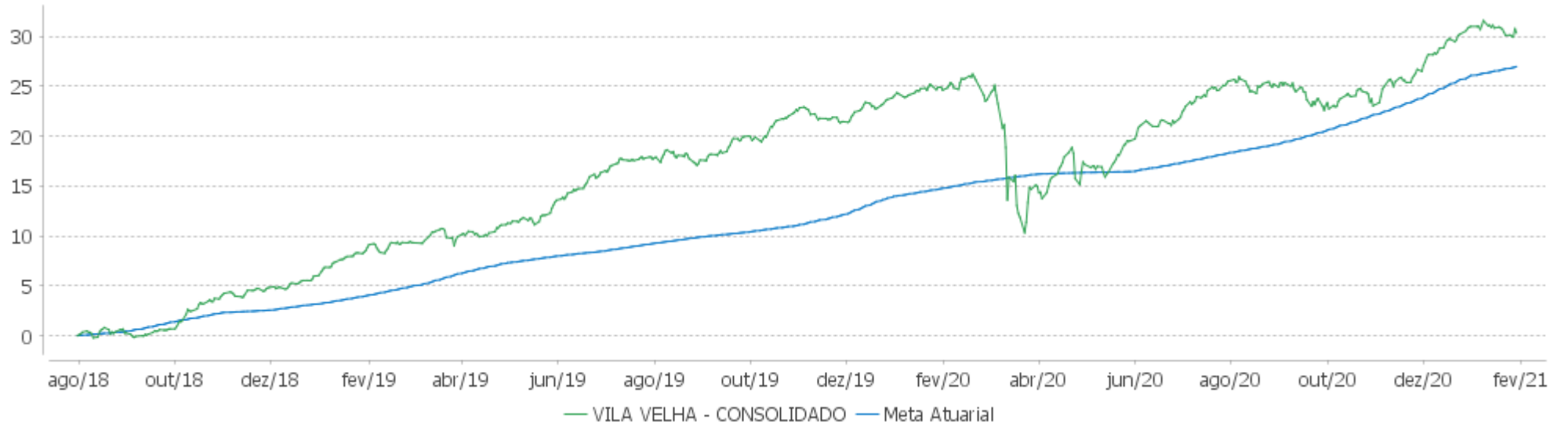
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,48												-0,48
IPCA + 5,87%	0,70												0,70
p.p. indexador	-1,19												-1,19
2020	0,49	-0,79	-6,98	1,89	2,02	2,02	2,94	-0,49	-1,49	-0,01	2,81	3,55	5,63
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	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

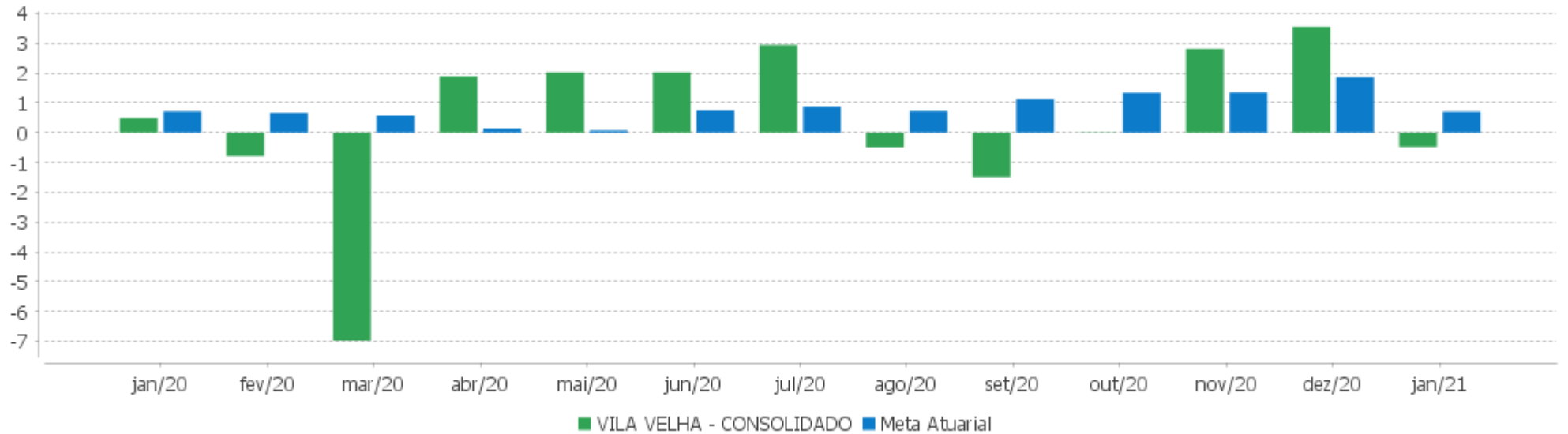
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	17	56,67	03 meses	5,94	3,96	1,98	3,82
Meses abaixo da Meta Atuarial	13	43,33	06 meses	3,84	7,29	-3,46	4,38
			12 meses	4,61	10,62	-6,02	8,82
			24 meses	19,77	22,19	-2,42	6,59
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,55	2020-12					
Menor rentabilidade da Carteira	-6,98	2020-03	Desde 31/07/2018	30,35	27,19	3,16	6,02

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.	-2,89 -2,04	-2,89 -2,04	6,68 0,64	-1,33 -4,10	-4,31 -9,54	18,43 -5,86	32,49 -9,34
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	-0,82 -551,04	-0,82 -551,04	2,36 508,28	0,33 34,95	0,25 9,74	16,94 200,28	
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,08 52,55	0,08 52,55	0,24 51,76	0,37 39,48	1,43 56,73	6,15 72,72	11,72 76,21
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO % do CDI	0,01 9,97	0,01 9,97	0,05 9,89	0,10 10,78	0,38 15,22	3,09 36,50	6,49 42,23
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,08 54,86	0,08 54,86	0,25 54,81	0,52 55,23	1,68 66,42	6,66 78,75	12,53 81,49
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,13 0,99	0,13 0,99	3,12 -2,92	3,73 0,95	7,85 2,62	22,55 -1,74	36,17 -5,66
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	0,29 0,18	0,29 0,18	2,69 -0,59	4,25 0,44	7,91 0,36	21,53 1,01	34,57 1,89
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,29 -0,43	0,29 -0,43	2,69 -1,29	4,18 -3,18	7,48 -3,28	20,30 -2,05	42,62 8,09
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,03 -0,01	0,03 -0,01	0,54 -0,04	0,79 -0,23	3,07 -0,36	9,59 -0,68	16,98 -0,96
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,77 0,03	-0,77 0,03	1,51 0,01	-0,25 -0,10	4,73 -0,18	16,38 -0,57	28,81 -0,80
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,70 -0,01	-1,70 -0,01	8,45 0,02	1,96 -0,05	3,49 -0,19	25,98 -0,85	47,09 -1,60
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,16 0,69	-0,16 0,69	3,96 -2,08	2,72 -0,06	7,72 2,49	24,58 0,29	38,40 -3,43
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,08 0,93	0,08 0,93	3,28 -2,76	3,54 0,76	7,00 1,77	20,22 -4,07	32,80 -9,02
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	-1,39 0,00	-1,39 0,00	2,05 -0,04	-0,70 -0,10	5,58 -0,19	19,55 -0,57	34,26 -0,81
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,33 0,61	1,33 0,61	4,33 0,34	7,43 0,07	10,71 -0,04	19,17 -3,18	31,01 -3,51
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,48 -1,63	-2,48 -1,63	7,14 1,10	-0,98 -3,75	-3,05 -8,27	21,25 -3,04	38,44 -3,39
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	-0,43	-0,43	1,00	0,24	5,05	15,64	25,33

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.	-0,47	-0,47	0,42	-0,77	1,62	5,37	7,39
BB PREV RF VII	0,29	0,29	2,68	3,87	5,71	15,45	26,97
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,14	1,14	-3,36	1,09	0,48	-8,84	-14,86
BB PREV RF IDKA2	0,18	0,18	3,07	4,24	7,69	18,77	30,05
Var. IDKA 2 p.p.	0,03	0,03	-0,09	-0,05	-0,51	-1,35	-2,43
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	-0,55	-0,55	2,68	0,93	4,00	15,84	27,67
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,11	-0,11	0,29	-0,03	0,14	0,48	0,72
BB PREV RF IPCA	0,02	0,02	3,33	3,31	7,96	23,13	36,96
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,69	-0,69	-0,66	-4,04	-2,79	0,78	2,43
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,03	0,03	2,18	0,99	5,82	20,75	32,60
Var. IPCA p.p.	-0,22	-0,22	-0,33	-3,31	1,27	11,80	19,54
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	-0,16	-0,16	3,96	2,72	7,72	24,57	38,41
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,69	0,69	-2,08	-0,05	2,50	0,28	-3,41
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,13	0,13	3,03	4,04	7,68	18,78	30,23
Var. IDKA 2 p.p.	-0,01	-0,01	-0,13	-0,24	-0,52	-1,35	-2,26
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,86	-0,86	6,00	2,62	4,95	23,66	40,75
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,01	-0,04	-0,16	-0,27	-0,63	-1,07
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	1,26	1,26	4,11	6,97	9,76	20,30	
Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,11	2,11	-1,93	4,19	4,53	-3,98	
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	1,19	1,19	3,91	6,56	8,92	18,46	
Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,05	2,05	-2,13	3,78	3,70	-5,82	
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	1,15	1,15	3,76	6,25	8,29	17,09	
Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,00	2,00	-2,28	3,47	3,07	-7,20	
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	-0,00	-0,00	3,01	2,00	6,72	22,98	33,69
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,72	-0,72	-0,98	-5,36	-4,04	0,63	-0,84
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	0,10	0,10	3,47	4,22	7,17	19,51	32,76
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,62	-0,62	-0,52	-3,14	-3,58	-2,84	-1,77
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,26	11,68	1,02	17,63	34,23
Var. IBOVESPA p.p.	-0,00	-0,00	-0,21	-0,13	-0,13	-0,51	-1,28
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-2,82	-2,82	21,89	11,05	0,49	20,53	39,88
Var. IBOVESPA p.p.	0,50	0,50	-0,59	-0,77	-0,66	2,38	4,37
JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII	0,46	0,46	0,70	1,44	0,20	1,50	0,90
Var. IFIX p.p.	0,13	0,13	-3,37	-3,91	6,62	-17,99	-25,10
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	-0,61	-0,61	13,57	7,85	4,97	38,49	67,28
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	4,47	4,47	-4,73	-0,22	9,49	17,22	23,33
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-3,76	-3,76	20,27	10,03	-2,32	25,54	47,60

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.	1,32	1,32	1,97	1,95	2,19	4,27	3,65
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-4,39	-4,39	16,96	6,10	-11,60	4,52	20,38
Var. IBOVESPA p.p.	-1,07	-1,07	-5,51	-5,71	-12,75	-13,63	-15,13
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5,79	5,79	9,11	20,97	53,70	118,69	138,83
Var. IBOVESPA p.p.	9,11	9,11	-13,36	9,15	52,55	100,54	103,32
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	5,00	5,00	7,75	18,26	50,02	97,61	118,46
Var. IBOVESPA p.p.	8,32	8,32	-14,72	6,45	48,87	79,46	82,95
VILA VELHA - CONSOLIDADO	-0,48	-0,48	5,94	3,84	4,61	19,77	
Var. IPCA + 5,87% p.p.	-1,19	-1,19	1,98	-3,46	-6,02	-2,29	
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,37
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
INPC + 6,00%	0,73	0,73	4,18	7,97	11,79	23,62	35,65
IPCA + 6,00%	0,71	0,71	3,99	7,36	10,76	22,35	34,53

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	0,04	0,58	1,02	3,43	10,27	17,95
IRF-M 1+	-1,39	-1,39	2,09	-0,60	5,77	20,12	35,07
IRF-M TOTAL	-0,80	-0,80	1,50	-0,15	4,92	16,95	29,61
IMA-B 5	0,11	0,11	3,28	3,80	7,55	20,52	32,68
IMA-B 5+	-1,69	-1,69	8,43	2,01	3,68	26,83	48,69
IMA-B TOTAL	-0,85	-0,85	6,04	2,78	5,22	24,29	41,83
IMA-C TOTAL	6,46	6,46	7,31	15,99	26,73	52,15	76,01
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,44	-0,44	2,38	0,96	3,87	15,36	26,95
IMA-GERAL TOTAL	-0,24	-0,24	2,52	1,39	4,50	16,33	28,20
IDKA 2	0,15	0,15	3,16	4,28	8,20	20,12	32,49
IDKA 20	-2,81	-2,81	11,88	1,09	0,71	29,02	58,93
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,37
Renda Variável							
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
IBRX 100	-3,03	-3,03	22,21	12,06	1,64	20,92	39,53
IBRX 50	-2,78	-2,78	23,61	13,27	2,67	17,81	33,39
SMALL CAP	-3,43	-3,43	21,10	10,52	-4,50	38,71	57,28
IFIX	0,32	0,32	4,07	5,35	-6,43	19,49	26,00
Índice Consumo - ICON	-1,28	-1,28	12,91	3,78	-3,99	37,57	37,84
Índice Dividendos - IDIV	-5,08	-5,08	18,30	8,08	-4,52	21,27	43,95
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,25	0,25	2,51	4,30	4,56	8,94	13,06
INPC	0,27	0,27	2,70	4,89	5,53	10,07	14,00
IGPM	2,58	2,58	6,95	18,36	25,71	35,53	44,66
SELIC	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,38
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
589	07/01/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	69.432,96	36.894,84381601	1,8819150000
564	11/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	6.269,52	771,93398575	8,1218344000
595	12/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	22.125,30	10.461,46322200	2,1149335930
576	15/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	16.045,62	1.975,55676321	8,1220749000
565	15/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	170.020,78	20.933,17066062	8,1220749000
578	18/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	5.706.870,73	0,00	702.631,83999488	8,1221351000
603	18/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	951.076,21	0,00	117.096,82223828	8,1221351000
581	19/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	967.807,03	0,00	119.155,84442207	8,1221952200
605	19/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	163.921,20	0,00	20.181,88378388	8,1221952200
596	20/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	419.846,74	0,00	198.471,84099300	2,1153970150
593	20/01/2021	BB PREV RF IDKA2	2.009.776,79	0,00	694.566,49705600	2,8935700160
588	20/01/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.000.000,00	0,00	1.250.719,16351902	2,3986200000
579	20/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	4.944.915,22	608.810,60750102	8,1222553600
577	20/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	306.836,94	37.777,30770582	8,1222553600
600	20/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	166.543,45	20.504,58187023	8,1222553600
580	21/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	762.045,67	93.821,23230245	8,1223157200
583	21/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	237.954,33	29.296,36549513	8,1223157200
594	22/01/2021	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	1.000.000,00	0,00	436.515,93547100	2,2908671110
590	26/01/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	387.861,17	0,00	205.989,62991445	1,8829160000
587	26/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	737,99	0,00	90,85752985	8,1224968500
607	26/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	4.924.984,24	0,00	606.338,70729048	8,1224968500
597	27/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	80.849,46	38.212,82175800	2,1157678570
584	27/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.100,00	135,42533099	8,1225572200
601	27/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	16.325,00	2.009,83502582	8,1225572200
598	28/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	12.411,84	5.866,21517600	2,1158173760
585	28/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	438.950,27	54.040,48823167	8,1226185100
604	28/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	951.132,82	117.096,82275845	8,1226185100
606	28/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	163.929,74	20.181,88344044	8,1226185100

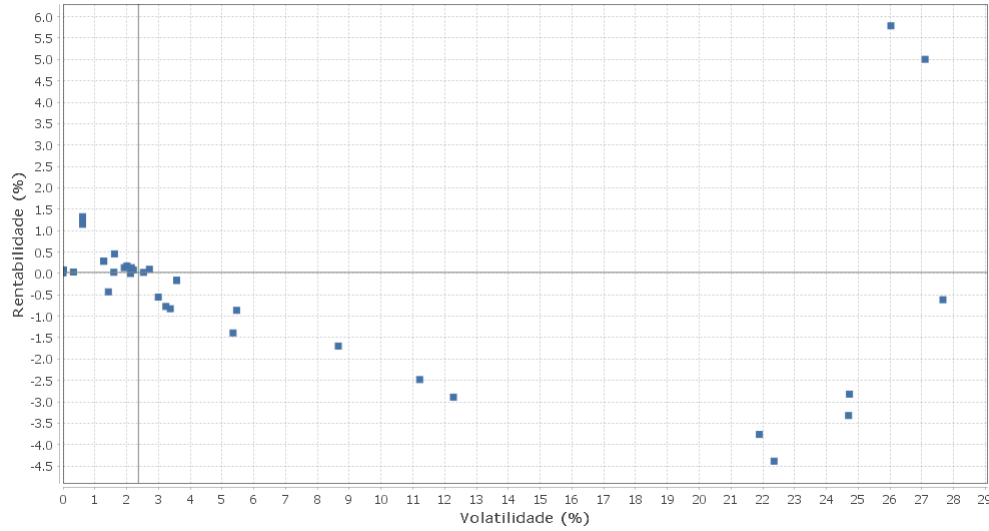
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
608	28/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.371.495,13	415.074,90790676	8,1226185100
602	28/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	534.523,23	65.806,76284894	8,1226185100
599	29/01/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	25.867,03	12.225,04943100	2,1159039190
591	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	341.824,67	181.517,59101378	1,8831490000
586	29/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	271,28	33,39784805	8,1226790300
609	29/01/2021	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	6.269,52	771,85371684	8,1226790300
Total						

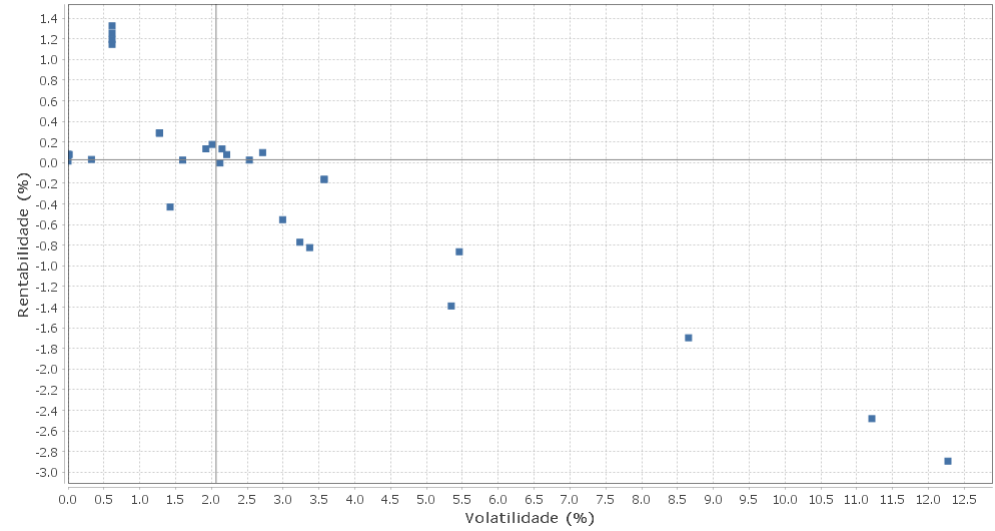
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

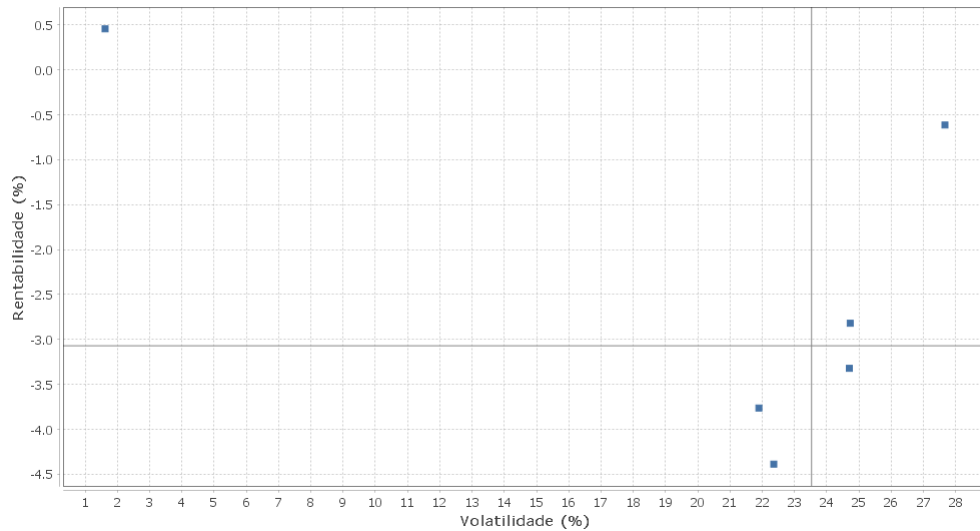
VILA VELHA - CONSOLIDADO - No Mês



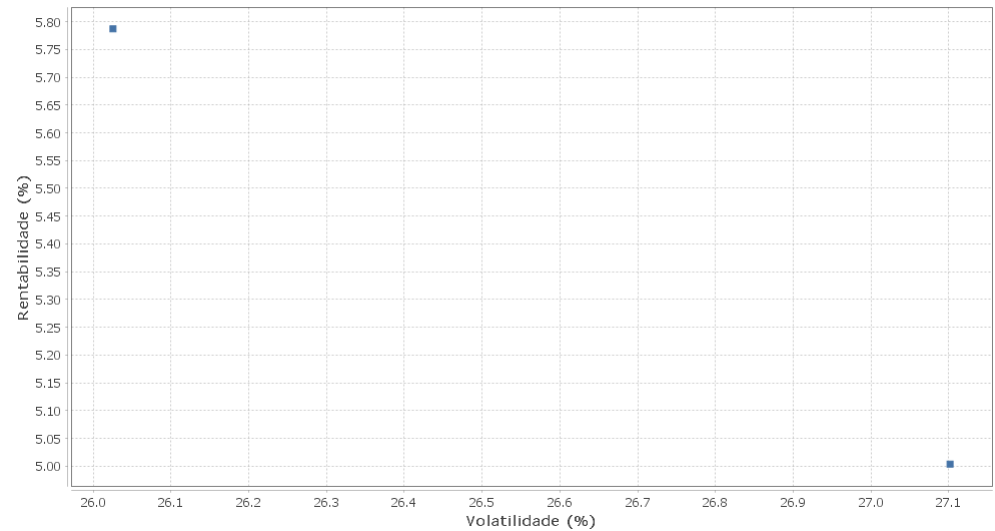
Renda Fixa - No Mês



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\$): 9.899.820,56

Value-At-Risk: 2,45%

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	-683,62	0,01	1.837.617,81	0,45
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	-164,63	0,08	177.131,04	0,04
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,06	0,00	-4,39	0,08	5.869.627,99	1,45
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,19	0,00	-0,36	0,03	2.382.069,40	0,59
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,61	0,22	0,00	1,92	1,33	6.764.494,81	1,67
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,62	0,22	0,00	1,70	1,19	331.833,93	0,08
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,62	0,22	0,00	1,62	1,15	6.533.455,78	1,61
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,62	0,22	0,00	1,80	1,26	12.839.813,67	3,17
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,27	1,09	0,00	0,11	0,29	1.578.419,31	0,39
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,28	1,09	0,01	0,11	0,29	3.537.389,77	0,87
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	Artigo 7º I, Alínea b	1,28	1,09	0,01	0,11	0,29	6.671.377,50	1,65
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	1,42	0,77	0,02	-0,41	-0,43	17.891.950,27	4,42
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,60	1,03	0,03	-0,08	0,03	17.115.974,64	4,23
JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII	Artigo 8º IV, Alínea b	1,62	0,05	-0,00	0,19	0,46	1.013.535,17	0,25
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,92	1,11	0,00	-0,01	0,13	2.495.171,46	0,62
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,08	0,05	0,01	0,18	31.906.308,59	7,88
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	Artigo 7º VII, Alínea b	2,12	1,32	0,00	-0,07	-0,00	1.312.388,00	0,32
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,15	1,17	0,05	-0,01	0,13	29.302.252,81	7,24
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,21	1,24	0,01	-0,03	0,08	5.660.802,15	1,40
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	2,53	1,41	0,01	-0,05	0,02	4.157.289,27	1,03
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	2,71	1,16	0,01	-0,02	0,10	7.081.676,53	1,75
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,99	1,33	0,04	-0,23	-0,55	17.164.077,94	4,24
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,23	1,49	0,01	-0,28	-0,77	2.710.569,72	0,67
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	3,37	1,50	0,01	-0,29	-0,82	8.465.155,01	2,09
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,57	1,62	0,04	-0,09	-0,16	15.294.913,20	3,78
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,57	1,62	0,05	-0,09	-0,16	20.357.023,05	5,03
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,35	2,39	0,02	-0,29	-1,39	5.737.062,43	1,42
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,46	2,56	0,17	-0,19	-0,86	41.604.675,07	10,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	8,65	4,24	0,08	-0,21	-1,70	12.632.155,47	3,12
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	11,21	5,25	0,06	-0,23	-2,48	23.002.023,52	5,68
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	12,27	5,79	0,02	-0,25	-2,89	6.177.048,53	1,53
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,89	9,87	0,26	-0,18	-3,76	12.536.908,52	3,10
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	22,35	10,05	0,28	-0,20	-4,39	12.572.102,64	3,11
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	24,70	11,62	0,41	-0,14	-3,32	16.164.841,33	3,99
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	24,73	11,58	0,13	-0,12	-2,82	4.922.547,46	1,22
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	26,03	11,89	0,17	0,22	5,79	17.843.942,40	4,41
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	27,10	12,68	0,06	0,18	5,00	6.144.451,76	1,52
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	27,66	12,98	0,40	-0,03	-0,61	15.089.581,62	3,73