



LDB
EMPRESAS

VILA VELHA
ABRIL 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

87,76%

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%) ..	0,33	0,19	2,25	6.367.281,61	1,89
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,290000%) ..	0,33	0,24	2,44	323.202,02	0,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,100000%) ..	0,33	0,30	2,70	12.499.947,40	3,71
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,33	0,27	2,54	19.190.431,03	5,70

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	22,33	1,69	-11,10	23.903.249,09	7,10	248.411.318,97	9,62
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,53	0,41	1,79	12.236.955,41	3,64	7.168.032.689,23	0,17
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,26	1,30	-5,12	34.944.864,98	10,38	5.412.184.320,85	0,65
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,07	0,32	-0,34	15.168.999,41	4,51	6.681.370.754,80	0,23
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	18,85	1,95	-8,95	11.118.716,02	3,30	1.937.305.372,80	0,57
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	8,58	1,44	2,87	5.530.433,63	1,64	2.809.224.859,68	0,20
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,97	0,43	0,02	22.590.334,07	6,71	8.182.089.077,85	0,28
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,78	1,13	2,50	2.630.846,23	0,78	16.130.391.856,09	0,02
BB	BB	BB PREV RF IPCA	6,06	0,82	0,34	4.036.145,71	1,20	341.338.616,41	1,18
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	6,12	0,54	-0,14	2.351.313,45	0,70	278.695.502,87	0,84
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	4,20	0,92	3,51	11.570.464,74	3,44	224.491.001,93	5,15
BB	BB	BB PREV RF VII	2,33	0,14	-0,60	4.280.508,52	1,27	668.626.387,30	0,64
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	5,13	0,42	-0,40	7.028.016,82	2,09	542.147.764,93	1,30
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	5,03	0,46	0,06	6.301.799,63	1,87	192.891.147,13	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	6,01	0,91	-0,28	16.378.279,93	4,87	10.512.346.440,60	0,16
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	6,00	1,11	2,43	5.902.988,50	1,75	11.368.843.034,79	0,05
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,19	-0,03	-0,95	3.717.454,45	1,10	253.351.612,75	1,47
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,53	0,70	-0,54	19.081.253,03	5,67	1.369.508.706,61	1,39
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,19	-0,02	-0,94	12.678.183,04	3,77	983.355.098,48	1,29
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	27,38	0,70	-0,54	14.333.223,90	4,26	440.292.930,31	3,26
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,47	0,39	-0,07	3.848.339,68	1,14	513.095.735,43	0,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,73	0,37	3,00	6.382.584,39	1,90	82.550.407,89	7,73
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,52	0,85	-2,22	246.014.954,63	73,09		

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	0,06	0,05	0,33	204.712,87	0,06	687.184.174,78	0,03
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	25,49	2,06	-11,64	11.517.020,10	3,42	199.092.846,68	5,78
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	0,20	0,95	5.033.387,56	1,50	1.637.982.393,12	0,31
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,06	0,22	1,02	488.522,98	0,15	577.158.987,32	0,08
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,91	-1,78	-2,40	0,00	0,00	2.039.086.693,71	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,62	-1,55	-2,26	5.225.577,31	1,55	175.932.315,10	2,97
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			11,70	0,31	-6,60	22.469.220,82	6,68		

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	4,40	0,43	-0,48	6.521.767,33	1,94	582.225.892,55	1,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF	8,07	0,87	-0,54	1.213.246,30	0,36	178.208.284,23	0,68
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			4,94	0,50	-0,49	7.735.013,63	2,30		
Renda Fixa			5,98	0,76	-2,24	295.409.620,11	87,76		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

10,40%

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	42,24	10,14	-30,20	11.359.286,68	3,37	529.649.188,40	2,14
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			42,24	10,14	-30,20	11.359.286,68	3,37		

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	36,80	8,38	-30,43	9.935.339,23	2,95	816.453.425,74	1,22
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	37,40	7,24	-25,99	5.951.028,88	1,77	714.263.825,61	0,83
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	43,87	16,41	-21,97	6.762.772,05	2,01	126.854.958,61	5,33
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			38,54	10,34	-27,61	22.649.140,16	6,73		

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	0,23	-0,43	1.000.657,89	0,30	125.498.910,26	0,80
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			1,42	0,23	-0,43	1.000.657,89	0,30		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			38,49	9,96	-27,94	35.009.084,73	10,40		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,84%

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	25,47	15,96	23,85	6.187.091,35	1,84	1.075.121.854,10	0,58
Sub-total Artigo 9º A, III			25,47	15,96	23,85	6.187.091,35	1,84		
Investimentos no Exterior			25,47	15,96	23,85	6.187.091,35	1,84		
Total			8,35	1,89	-5,52	336.605.796,19	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	19.190.431,03	5,70	0,00	47,50	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	246.014.954,63	73,09	0,00	20,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	22.469.220,82	6,68	0,00	5,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	7.735.013,63	2,30	0,00	2,50	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	295.409.620,11	87,76				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	11.359.286,68	3,37	0,00	10,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	22.649.140,16	6,73	0,00	13,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.000.657,89	0,30	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	35.009.084,73	10,40				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	6.187.091,35	1,84	0,00	1,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	6.187.091,35	1,84				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

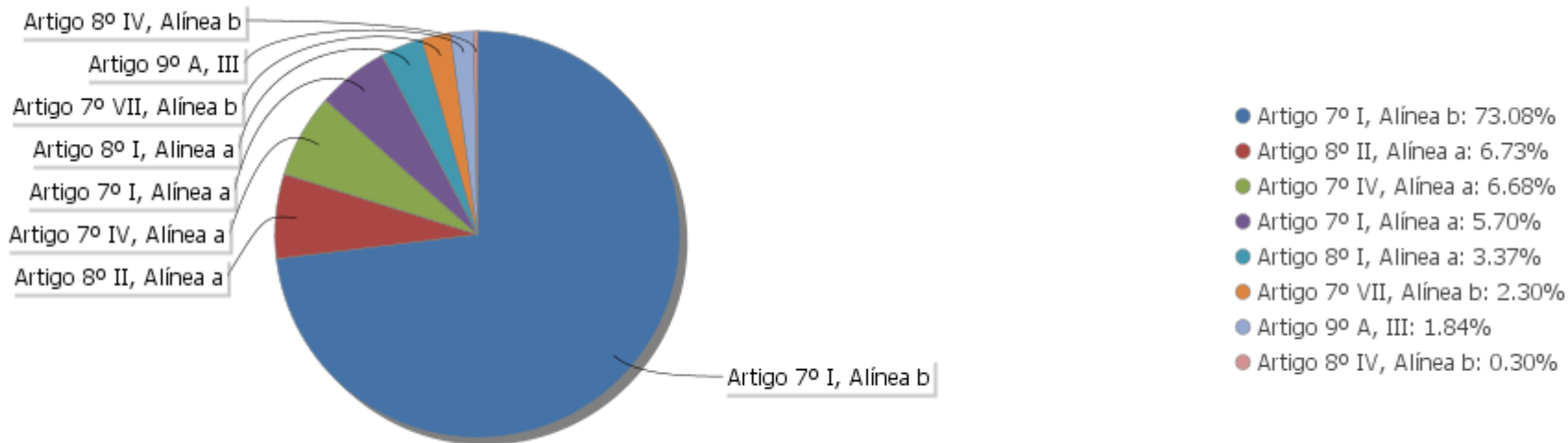
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,27 93,19	2,54 195,75	1,34 145,70	4,43 214,44	7,75 149,32	50.818,65	476.206,21
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,85 299,39	-2,22 -170,69	-2,70 -293,06	-2,02 -97,92	8,15 157,05	2.026.125,30	-5.418.100,55
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,31 107,44	-6,60 -507,97	-7,08 -769,31	-6,93 -335,62	3,04 58,57	143.266,95	-1.606.244,91
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,50 175,19	-0,49 -37,60	-1,31 -142,17	0,33 15,80	7,85 151,27	38.417,82	-37.990,78
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	10,14 -0,11	-30,20 0,19	-29,01 0,22	-24,69 0,22	-16,42 0,03	1.045.669,58	-4.913.790,66
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	10,34 0,09	-27,61 2,78	-28,18 1,06	-21,63 3,29	-10,94 5,51	2.123.008,08	-8.740.906,39
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,23 -10,02	-0,43 29,95	-1,08 28,16	0,10 25,01	-0,70 15,75	2.294,96	-4.363,66
Artigo 9º A, III % do CDI	15,96 5.603,14	23,85 1.834,43	16,27 1.768,47	32,52 1.573,89	39,65 763,72	851.773,00	874.115,73
						6.281.374,34	-19.371.075,01

Análise de Liquidez

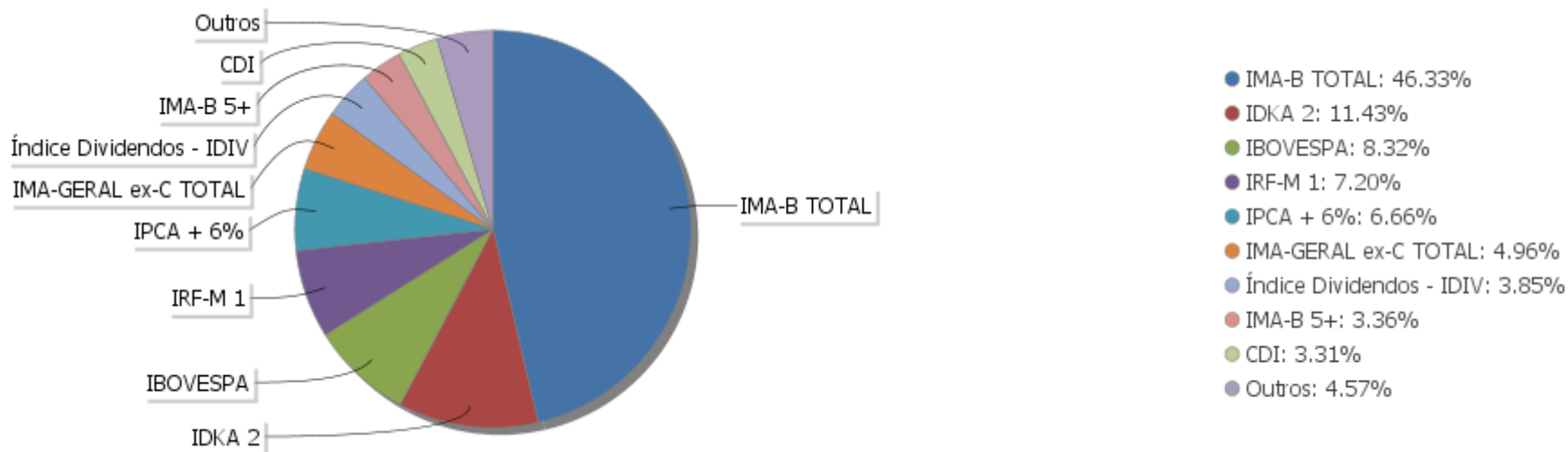
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	229.535.953,88	68,19	229.535.953,88	68,19
de 31 a 364 dias	12.713.800,93	3,78	242.249.754,81	71,97
acima de 365 dias	94.356.041,38	28,03	336.605.796,19	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

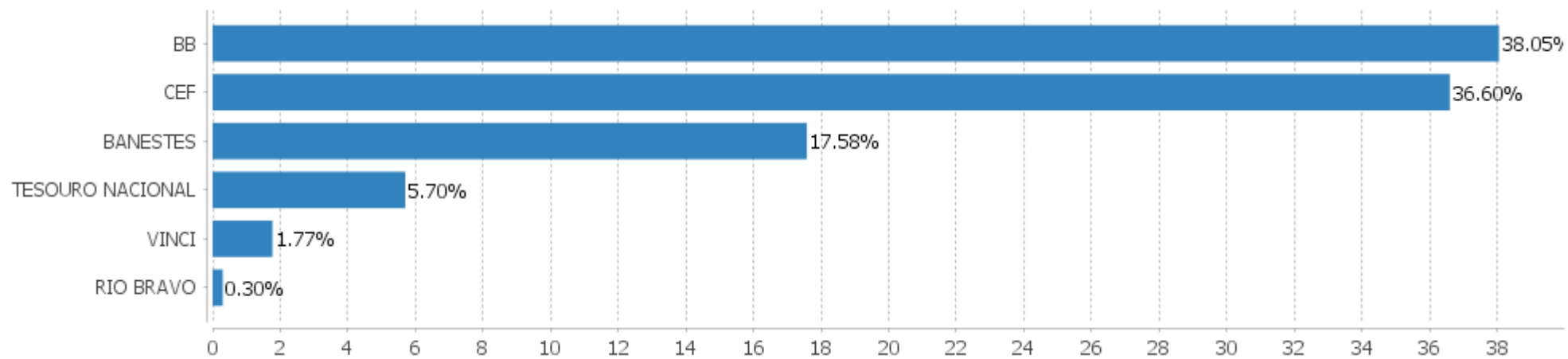


Alocação Por Estratégia



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									-5,52
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14									2,10
p.p. indexador	-0,22	-1,45	-7,55	1,75									-7,61
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

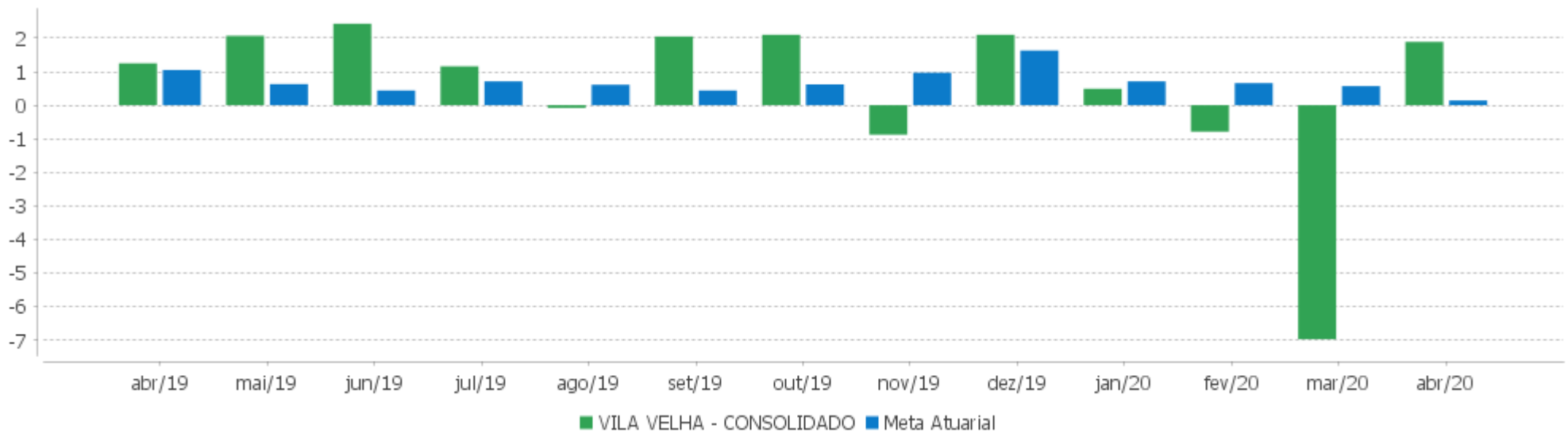
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	12	57,14	03 meses	-5,98	1,38	-7,35	16,23
Meses abaixo da Meta Atuarial	9	42,86	06 meses	-4,37	4,79	-9,16	11,49
			12 meses	5,29	8,52	-3,23	8,35
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,39	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-6,98	2020-03	Desde 31/07/2018	17,17	16,56	0,61	6,63

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.	0,30 -1,01	2,70 7,78	1,45 6,78	4,67 10,22	8,15 -0,79		
NTN-B 150545 (4,290000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,24 -1,07	2,44 7,52	1,27 6,59	4,27 9,83	7,31 -1,62		
NTN-B 150545 (3,680000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,19 -1,12	2,25 7,32	1,12 6,45	3,98 9,53	6,68 -2,25		
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,06 0,75	-11,64 -6,56	-12,28 -6,96	-13,59 -8,04	5,28 -3,66	20,20 -5,71	33,24 -6,44
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	-1,61 -566,65	-2,24 -171,96	-2,62 -284,83	-1,58 -76,58	1,44 27,82	8,38 70,64	17,91 85,56
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	-1,55 -544,18	-2,26 -173,79	-2,86 -310,57	-1,15 -55,67	10,27 197,82		
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,20 69,79	0,95 73,32	0,67 72,37	1,54 74,49	4,07 78,35	9,49 79,98	17,11 81,78
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO % do CDI	0,05 17,30	0,33 25,44	0,21 23,15	0,61 29,28	2,12 40,82	5,45 45,97	10,72 51,25
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,22 76,58	1,02 78,45	0,72 77,75	1,65 79,67	4,31 83,00	10,01 84,36	17,96 85,82
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,54 -0,78	-0,14 4,94	-0,83 4,50	0,54 6,09	9,92 0,98	21,85 -4,06	37,18 -2,50
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	0,46 -0,03	0,06 0,15	-0,57 0,07	0,85 -0,01	9,20 0,53	20,63 1,16	35,81 2,43
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,41 -0,03	1,79 -0,09	1,37 -0,07	2,51 -0,14	6,31 -0,29	13,19 -0,53	23,04 -0,85
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6% p.p.	0,39 0,24	-0,07 -2,21	-0,61 -2,02	0,83 -3,99	8,54 -0,02	29,24 8,53	40,81 9,38
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,13 -0,02	2,50 -0,09	1,65 -0,05	2,62 -0,13	11,40 -0,29	21,56 -0,51	36,77 -0,92
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	1,95 -0,07	-8,95 -0,13	-8,91 -0,06	-10,50 -0,25	7,94 -0,53	29,14 -1,18	42,37 -1,57
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,70 -0,62	-0,54 4,54	-1,33 4,00	-0,05 5,50	11,36 2,42	23,83 -2,08	35,53 -4,15
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	-0,02	-0,94	-0,91	0,70	4,34	12,57	22,94

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.	-1,34	4,13	4,41	6,25	-4,59	-13,35	-16,74
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	0,42	-0,40	-0,92	0,49	8,71	19,63	34,53
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,89	4,68	4,41	6,05	-0,23	-6,29	-5,15
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	1,44	2,87	1,77	2,71	13,65	25,31	42,67
Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,06	-0,09	-0,05	-0,13	-0,27	-0,49	-0,98
FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	-0,03	-0,95	-0,91	0,69	4,32	12,53	22,90
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,34	4,13	4,41	6,24	-4,61	-13,39	-16,78
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,37	3,00	1,67	5,12	6,20	17,92	24,85
Var. IPCA + 6% p.p.	0,22	0,86	0,26	0,29	-2,36	-2,80	-6,58
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	1,69	-11,10	-11,59	-12,78	7,09	25,47	38,78
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,38	-6,02	-6,26	-7,22	-1,85	-0,45	-0,90
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,92	3,51	2,77	4,10	11,55	19,86	31,52
Var. IRF-M 1 p.p.	0,47	1,63	1,34	1,45	4,94	6,14	7,63
BB PREV RF VII	0,14	-0,60	-0,79	0,75	5,98	16,46	28,78
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,17	4,48	4,53	6,30	-2,96	-9,45	-10,90
BB PREV RF IDKA2	0,32	-0,34	-0,72	1,02	6,95	16,67	30,00
Var. IDKA 2 p.p.	-0,25	-0,91	-0,76	-0,78	-1,67	-2,17	-3,46
BB PREV RF IPCA	0,82	0,34	-0,32	1,04	10,95	23,30	38,42
Var. IPCA + 6% p.p.	0,67	-1,79	-1,73	-3,79	2,38	2,59	6,99
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,91	-0,28	-0,76	-0,26	8,60	19,45	31,58
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,07	-0,10	-0,09	-0,29	0,26	0,41	-0,29
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,11	2,43	1,60	2,52	13,47	24,61	36,68
Var. IPCA p.p.	1,42	2,22	1,59	0,63	11,07	17,15	26,25
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,70	-0,54	-1,33	-0,05	11,35	23,84	35,52
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,62	4,54	4,00	5,50	2,41	-2,08	-4,16
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,43	0,02	-0,44	1,13	7,34	17,02	30,50
Var. IDKA 2 p.p.	-0,15	-0,55	-0,47	-0,67	-1,27	-1,82	-2,96
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,30	-5,12	-5,36	-5,65	8,71	25,32	38,67
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,04	-0,04	-0,09	-0,22	-0,60	-1,01
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF	0,87	-0,54	-1,34	-0,20	10,96	21,81	31,47
Var. IPCA + 6% p.p.	0,72	-2,68	-2,75	-5,03	2,39	1,10	0,05
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	0,43	-0,48	-1,30	0,43	7,30	18,83	34,25
Var. IPCA + 6% p.p.	0,28	-2,62	-2,71	-4,40	-1,27	-1,89	2,82
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	20,45	-21,97	-23,52	-16,17	0,28	20,54	49,01
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	16,69	6,68	3,98	3,51	7,46	10,16	18,25
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	7,24	-25,99	-27,10	-19,26	-7,99	9,76	35,45

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.	3,48	2,66	0,40	0,43	-0,81	-0,62	4,69
BB AÇÕES DIVIDENDOS	8,38	-30,43	-30,14	-24,64	-16,90	-6,36	15,49
Var. IBOVESPA p.p.	-1,87	-0,05	-0,91	0,27	-0,45	0,15	-7,60
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	10,14	-30,20	-29,01	-24,69	-16,42	-6,92	21,69
Var. IBOVESPA p.p.	-0,11	0,19	0,22	0,22	0,03	-0,41	-1,40
JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII	0,23	-0,43	-1,08	0,10	-0,70	-0,04	-0,16
Var. IFIX p.p.	-4,16	18,14	14,32	6,84	-4,50	-11,43	-28,05
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	15,96	23,85	16,27	32,52	39,65	76,46	116,33
Var. IBOVESPA p.p.	5,71	54,23	45,50	57,44	56,10	82,98	93,24
CDI	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,93
IBOVESPA	10,25	-30,39	-29,23	-24,92	-16,45	-6,51	23,09
INPC + 6%	0,23	2,23	1,52	5,03	8,63	20,94	30,30
IPCA + 6%	0,15	2,14	1,41	4,83	8,57	20,71	31,43

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	0,45	1,88	1,44	2,65	6,60	13,72	23,89
IRF-M 1+	1,50	2,96	1,83	2,84	13,92	25,80	43,65
IRF-M TOTAL	1,15	2,59	1,70	2,75	11,69	22,07	37,69
IMA-B 5	0,49	-0,09	-0,64	0,86	8,67	19,47	33,38
IMA-B 5+	2,01	-8,82	-8,85	-10,25	8,47	30,32	43,94
IMA-B TOTAL	1,31	-5,08	-5,33	-5,55	8,94	25,91	39,68
IMA-C TOTAL	1,39	0,93	-1,57	0,17	12,99	32,94	49,94
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,84	-0,17	-0,67	0,03	8,34	19,04	31,87
IMA-GERAL TOTAL	0,86	-0,14	-0,69	0,03	8,47	19,43	32,35
IDKA 2	0,57	0,57	0,03	1,79	8,62	18,84	33,46
IDKA 20	1,77	-16,22	-15,05	-18,15	5,61	37,31	48,42
CDI	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,93
Renda Variável							
IBOVESPA	10,25	-30,39	-29,23	-24,92	-16,45	-6,51	23,09
IBRX 100	10,27	-30,14	-29,25	-24,33	-15,12	-4,14	25,76
IBRX 50	10,48	-31,05	-29,73	-25,91	-18,39	-9,72	19,28
SMALL CAP	10,19	-34,07	-34,37	-21,91	-4,59	5,90	40,30
IFIX	4,39	-18,58	-15,39	-6,75	3,79	11,40	27,89
Índice Consumo - ICON	17,67	-24,81	-27,47	-16,35	1,02	9,88	26,19
Índice Dividendos - IDIV	3,76	-28,65	-27,50	-19,68	-7,18	10,38	30,76
Indicadores Econômicos							
IPCA	-0,31	0,22	0,01	1,89	2,40	7,46	10,43
INPC	-0,23	0,31	0,12	2,08	2,46	7,66	9,48
IGPM	0,80	2,50	2,01	4,96	6,68	15,90	18,09
SELIC	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,94
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
156	01/04/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	33,38	15,92591500	2,0959548780
157	03/04/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.621,82	3.158,71858300	2,0963627580
158	07/04/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	756,70	360,88990000	2,0967613680
128	07/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	20.451,92	2.523,12116246	8,1058017800
167	07/04/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.115,43	4.824,31150900	2,0967613680
164	07/04/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	65.760,11	35.311,53447100	1,8622840000
148	07/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	575,03	0,00	70,94054554	8,1058017800
159	08/04/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.523,39	1.680,24531000	2,0969497600
129	08/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	21,20	2,61534641	8,1060007500
168	08/04/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.480,04	705,80613200	2,0969497600
139	08/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.045,00	128,91683986	8,1060007500
160	13/04/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	915,00	436,26178100	2,0973645630
166	13/04/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	64.017,25	0,00	30.522,70984700	2,0973645630
161	15/04/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	17.851,46	8.509,61402300	2,0977990250
130	16/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.580,02	441,59624363	8,1069983100
140	16/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	14.665,10	1.808,94326640	8,1069983100
136	17/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	314.693,37	0,00	38.816,53842798	8,1071981900
149	17/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.826.844,43	0,00	348.683,27682601	8,1071981900
152	22/04/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	742,72	0,00	353,90395900	2,0986484610
141	22/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	11.729,01	1.446,66920446	8,1075988000
142	22/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	738,34	91,06712146	8,1075988000
143	22/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	575,16	70,94054554	8,1075988000
144	22/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.186.957,49	269.741,70070194	8,1075988000
126	22/04/2020	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	2.200.000,00	0,00	1.205.056,89320958	1,8256399400
137	24/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.104.491,15	0,00	136.222,39433651	8,1079998300
127	24/04/2020	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	1.104.491,15	657.132,03968452	1,6807750700
150	24/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	737,99	0,00	91,01998218	8,1079998300
162	27/04/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	129.041,19	61.469,24504800	2,0992805410

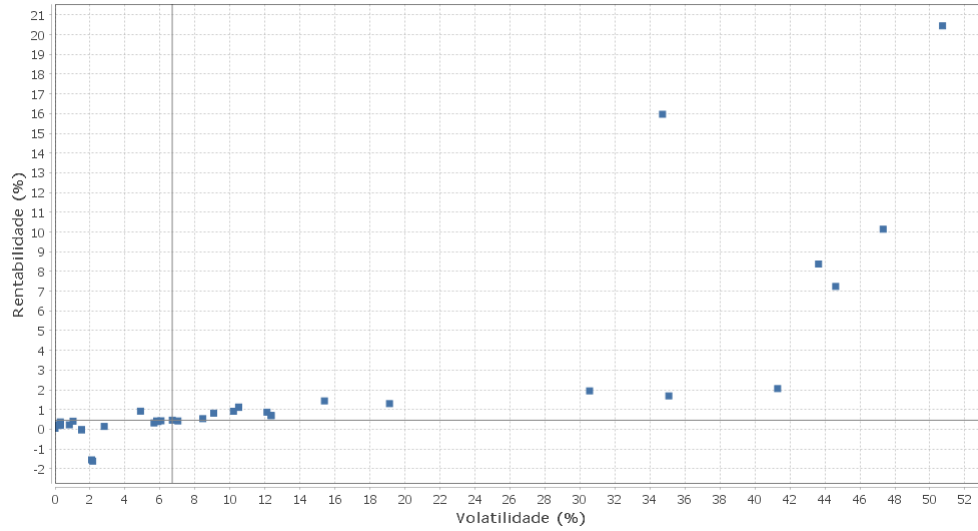
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
138	27/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	3.639.110,83	0,00	448.818,55290263	8,1082005300
169	27/04/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	368.994,85	175.772,05275500	2,0992805410
145	27/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.045,00	128,88186420	8,1082005300
151	28/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	373,07	0,00	46,01030088	8,1084016600
155	29/04/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	321.906,86	0,00	153.311,40741800	2,0996928110
133	29/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.104.573,31	136.222,39433651	8,1086029300
134	29/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.895.728,78	357.118,08851992	8,1086029300
131	29/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	121.273,86	14.956,19659730	8,1086029300
132	29/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	314.747,90	38.816,53842798	8,1086029300
170	29/04/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	16.012,18	7.625,96314800	2,0996928110
153	29/04/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	305.850,86	145.664,57455300	2,0996928110
163	29/04/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	21.201,02	0,00	11.367,05899000	1,8651280000
146	29/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	599.003,95	73.872,64550373	8,1086029300
135	30/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	562.154,76	69.326,46821045	8,1088042500
154	30/04/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.033,02	2.873,00034600	2,0999022880
165	30/04/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	324.506,80	173.967,31534100	1,8653320000
147	30/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	17.882,53	2.205,32269009	8,1088042500

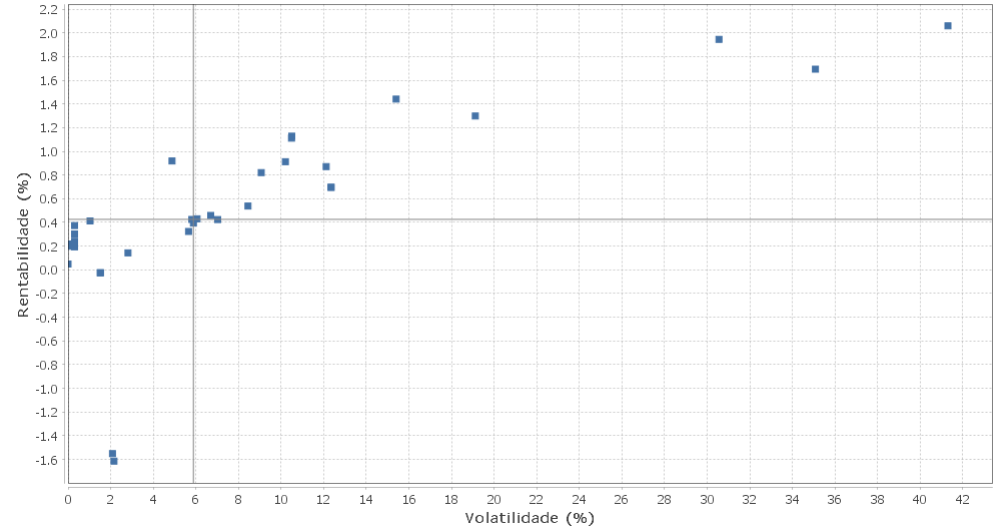
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

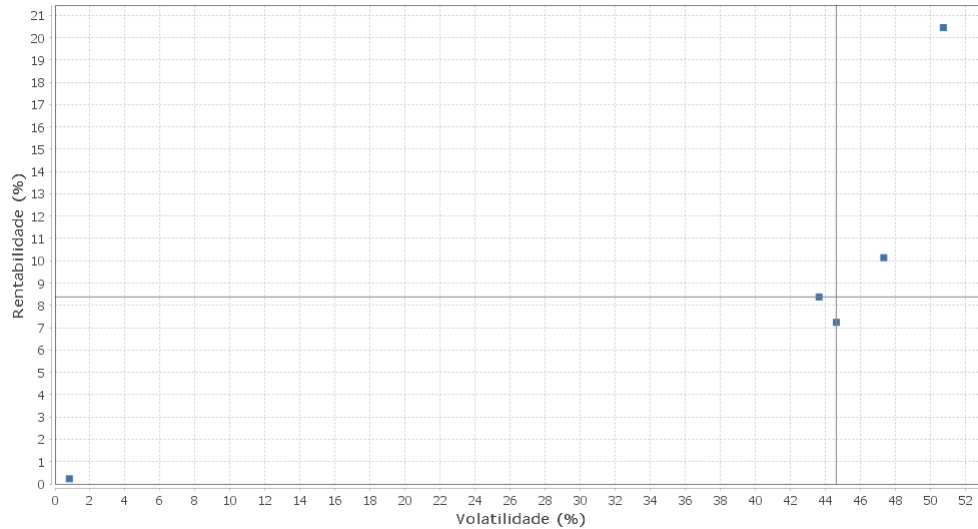
VILA VELHA - CONSOLIDADO - No Mês



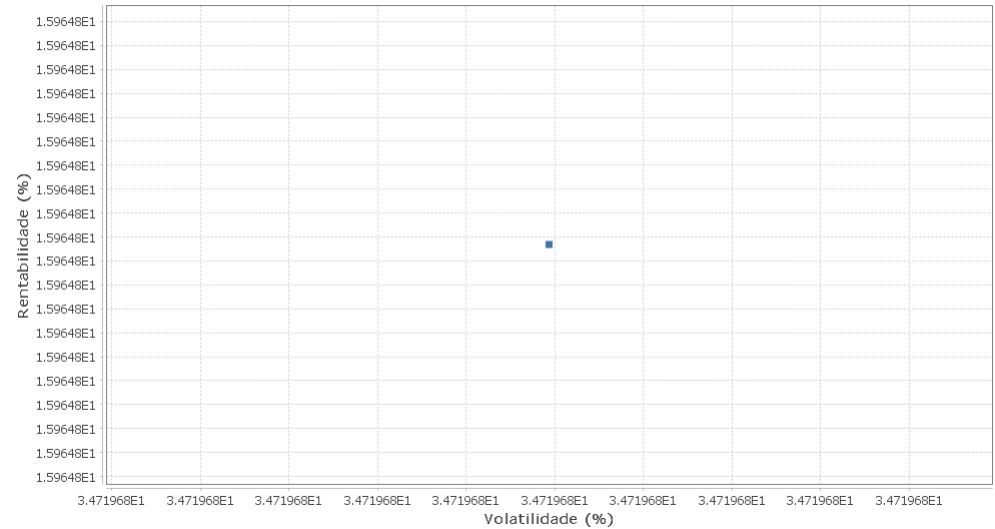
Renda Fixa - No Mês



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
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,01	-0,00	-1.021,54	0,05	204.712,87	0,06
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,01	-0,00	-144,70	0,22	488.522,98	0,15
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,01	-0,00	-7,89	0,20	5.033.387,56	1,50
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,30	0,18	-0,00	0,29	0,37	6.382.584,39	1,90
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,30	0,18	-0,00	0,06	0,30	12.499.947,40	3,71
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,30	0,18	-0,00	-0,15	0,24	323.202,02	0,10
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,30	0,18	-0,00	-0,30	0,19	6.367.281,61	1,89
JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII	Artigo 8º IV, Alínea b	0,82	0,01	0,00	-0,07	0,23	1.000.657,89	0,30
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,03	0,29	0,01	0,12	0,41	12.236.955,41	3,64
FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,52	0,60	0,00	-0,20	-0,03	3.717.454,45	1,10
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,52	0,60	0,01	-0,20	-0,02	12.678.183,04	3,77
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	2,08	1,42	0,00	-0,88	-1,55	5.225.577,31	1,55
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	2,15	NaN	0,00	-0,88	-1,61	0,00	0,00
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	2,81	1,56	0,02	-0,05	0,14	4.280.508,52	1,27
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	4,88	2,38	0,07	0,13	0,92	11.570.464,74	3,44
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	5,66	2,03	0,08	0,01	0,32	15.168.999,41	4,51
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,81	2,19	0,13	0,02	0,43	22.590.334,07	6,71
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,88	2,33	0,02	0,02	0,39	3.848.339,68	1,14
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	6,06	2,73	0,05	0,02	0,43	6.521.767,33	1,94
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	Artigo 7º I, Alínea b	6,70	2,66	0,04	0,03	0,46	6.301.799,63	1,87
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,02	2,97	0,06	0,02	0,42	7.028.016,82	2,09
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	8,44	3,22	0,02	0,03	0,54	2.351.313,45	0,70
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	9,07	3,64	0,04	0,06	0,82	4.036.145,71	1,20
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	10,20	3,91	0,17	0,06	0,91	16.378.279,93	4,87
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	10,49	2,83	0,04	0,08	1,11	5.902.988,50	1,75
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	10,50	2,84	0,02	0,08	1,13	2.630.846,23	0,78
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF	Artigo 7º VII, Alínea b	12,11	5,02	0,02	0,05	0,87	1.213.246,30	0,36
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	12,35	5,04	0,20	0,03	0,70	14.333.223,90	4,26
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	12,35	5,04	0,26	0,03	0,70	19.081.253,03	5,67
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO	Artigo 7º I, Alínea b	15,40	4,38	0,06	0,08	1,44	5.530.433,63	1,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PRAZO								
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	19,12	9,50	0,89	0,05	1,30	34.944.864,98	10,38
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	30,55	14,14	0,41	0,05	1,95	11.118.716,02	3,30
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	34,72	19,71	0,19	0,45	15,96	6.187.091,35	1,84
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	35,08	18,18	0,38	0,04	1,69	23.903.249,09	7,10
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	41,30	23,16	0,22	0,04	2,06	11.517.020,10	3,42
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	43,63	26,83	0,67	0,19	8,38	9.935.339,23	2,95
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	44,62	28,31	0,43	0,16	7,24	5.951.028,88	1,77
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	47,32	31,46	0,87	0,21	10,14	11.359.286,68	3,37
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	50,73	29,66	0,48	0,40	20,45	6.762.772,05	2,01