



LDB
EMPRESAS

VILA VELHA - CONSOLIDADO
NOVEMBRO 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 30.11.2020.

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 81,10%

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%) ..	0,43	1,09	6,68	6.365.343,70	1,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,290000%) ..	0,43	1,14	7,25	322.979,59	0,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,100000%) ..	0,43	1,20	8,00	12.481.104,02	3,29
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,43	1,16	7,55	19.169.427,31	5,06

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	23,45	1,78	-7,39	21.852.020,10	5,77	279.018.560,81	7,83
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,57	0,20	3,15	12.509.570,48	3,30	7.844.641.875,20	0,16
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,79	1,99	1,24	40.031.320,28	10,56	5.721.224.105,90	0,70
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,21	1,34	6,29	21.939.743,54	5,79	7.802.150.183,83	0,28
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,84	2,57	-2,17	11.946.639,77	3,15	1.749.025.544,15	0,68
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	9,01	0,43	5,03	5.646.331,18	1,49	2.828.341.630,94	0,20
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,14	1,22	6,28	25.837.955,49	6,82	10.336.804.140,67	0,25
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,06	0,33	4,38	2.679.073,98	0,71	5.838.093.192,79	0,05
BB	BB	BB PREV RF IPCA	6,14	1,31	6,56	4.075.999,86	1,08	344.709.100,05	1,18
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	6,13	1,30	6,68	2.451.204,80	0,65	290.535.384,25	0,84
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	4,32	0,40	5,17	17.784.256,39	4,69	193.136.397,94	9,21
BB	BB	BB PREV RF VII	2,42	1,17	4,35	1.555.143,06	0,41	242.932.832,47	0,64
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	5,23	1,35	5,56	5.555.194,68	1,47	428.532.892,62	1,30
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	4,95	1,17	6,99	6.572.794,85	1,73	201.186.012,36	3,27
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,28	0,85	2,65	16.858.345,97	4,45	9.499.641.282,04	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	0,82	5,27	16.888.605,35	4,46	14.161.450.965,39	0,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,75	1,56	6,08	19.886.337,54	5,25	1.427.291.716,62	1,39
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,75	1,55	6,07	14.941.501,80	3,94	458.978.220,23	3,26
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,41	1,17	6,47	3.484.991,84	0,92	464.658.094,76	0,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,43	1,27	8,87	6.566.014,36	1,73	84.922.835,88	7,73
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,64	1,32	2,69	259.063.045,32	68,36		

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	0,03	0,01	0,47	1.158.463,62	0,31	841.892.345,90	0,14
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	26,63	1,64	-8,16	5.885.305,25	1,55	269.934.950,03	2,18
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	0,06	1,54	5.333.928,60	1,41	1.893.436.284,11	0,28
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,06	0,08	1,81	207.472,55	0,05	625.949.083,71	0,03
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,85	0,61	-0,86	8.320.162,23	2,20	186.732.499,63	4,46
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			12,25	0,72	-4,13	20.905.332,25	5,52		

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	4,52	1,46	5,96	6.943.873,32	1,83	614.843.149,22	1,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	8,23	1,21	5,71	1.289.479,80	0,34	193.821.613,42	0,67
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			5,07	1,42	5,92	8.233.353,12	2,17		
Renda Fixa			6,09	1,27	2,51	307.371.158,00	81,10		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

14,48%

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
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVSPA	44,68	15,76	-5,95	15.305.464,19	4,04	688.588.931,64	2,22
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			44,68	15,76	-5,95	15.305.464,19	4,04		

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	39,19	13,62	-14,49	12.212.634,97	3,22	984.415.780,43	1,24
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,86	14,26	-5,78	11.910.730,32	3,14	912.327.763,54	1,31
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	45,85	8,65	2,46	14.435.425,64	3,81	176.046.448,61	8,20
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			40,62	12,03	-7,26	38.558.790,93	10,17		

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	1,41	0,20	0,35	1.008.530,31	0,27	126.486.240,57	0,80
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			1,41	0,20	0,35	1.008.530,31	0,27		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			40,64	12,83	-6,76	54.872.785,43	14,48		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,42%

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	29,44	2,43	53,70	16.751.611,83	4,42	1.959.218.771,54	0,86
Sub-total Artigo 9º A, III			29,44	2,43	53,70	16.751.611,83	4,42		
Investimentos no Exterior			29,44	2,43	53,70	16.751.611,83	4,42		
Total			8,75	2,81	2,01	378.995.555,26	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	19.169.427,31	5,06	0,00	47,50	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	259.063.045,32	68,36	0,00	20,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	20.905.332,25	5,52	0,00	5,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	8.233.353,12	2,17	0,00	2,50	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	307.371.158,00	81,10				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	15.305.464,19	4,04	0,00	10,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	38.558.790,93	10,17	0,00	13,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.008.530,31	0,27	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	54.872.785,43	14,48				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	16.751.611,83	4,42	0,00	1,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	16.751.611,83	4,42				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

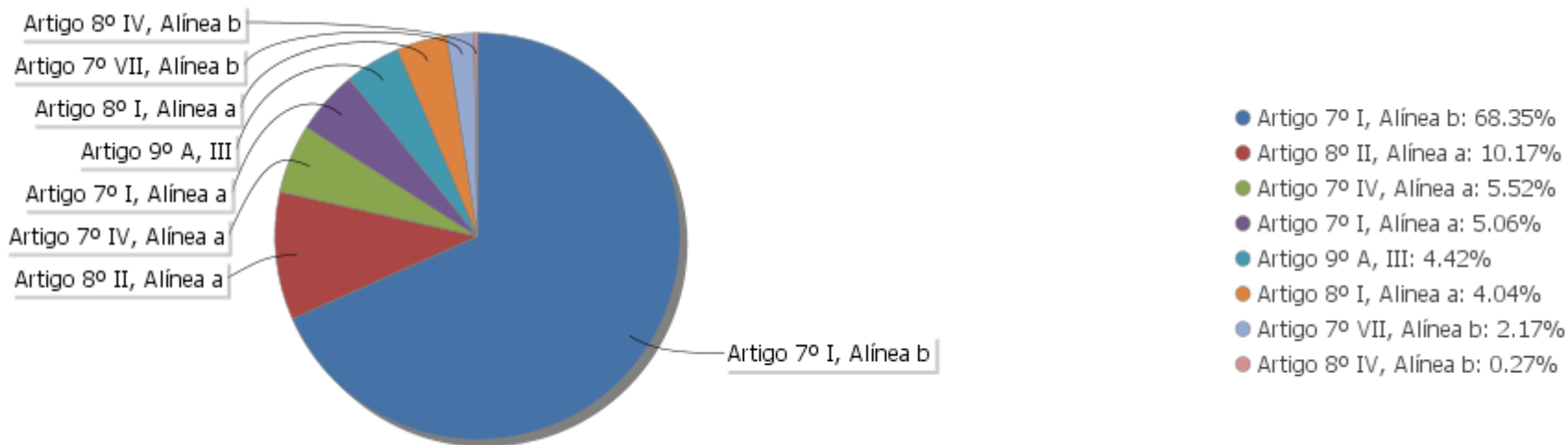
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,16 778,42	7,55 291,49	3,15 679,26	4,95 478,99	8,86 298,13	223.376,34	1.387.141,40
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,32 883,85	2,69 103,94	0,39 84,20	3,41 329,61	4,15 139,40	3.375.832,58	6.992.394,02
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,72 483,60	-4,13 -159,60	-1,24 -267,16	1,92 185,29	-2,43 -81,65	148.670,54	-1.108.536,15
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	1,42 949,07	5,92 228,74	1,50 322,53	4,08 394,04	7,15 240,45	115.178,45	460.348,71
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	15,76 -0,14	-5,95 -0,11	9,50 -0,09	24,19 -0,39	0,49 -0,12	2.083.724,50	-967.613,15
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	12,03 -3,87	-7,26 -1,43	6,22 -3,37	19,57 -5,01	0,17 -0,44	3.969.435,14	-1.956.255,62
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,20 -15,70	0,35 6,19	0,67 -8,91	0,94 -23,65	0,76 0,15	2.035,65	3.508,76
Artigo 9º A, III % do CDI	2,43 1.625,60	53,70 2.073,96	-1,39 -299,76	20,74 2.005,47	50,99 1.714,90	397.426,13	2.907.270,38
VILA VELHA - CONSOLIDADO (Total)						10.315.679,33	7.718.258,35

Análise de Liquidez

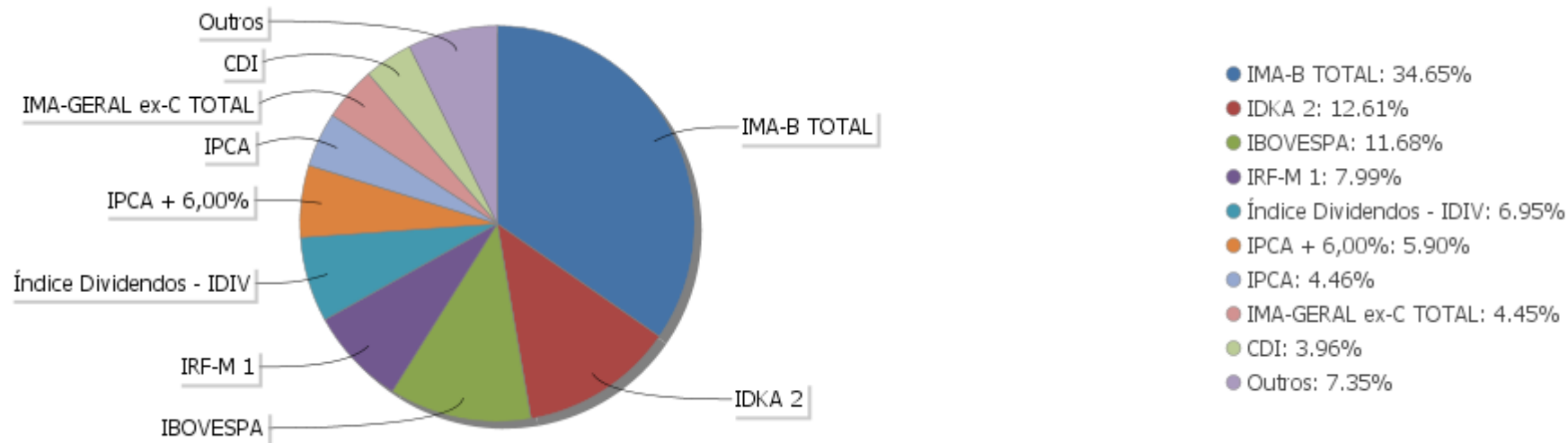
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	260.438.385,57	68,72	260.438.385,57	68,72
de 31 a 365 dias	27.354.686,27	7,22	287.793.071,84	75,94
acima de 365 dias	91.202.483,42	24,06	378.995.555,26	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

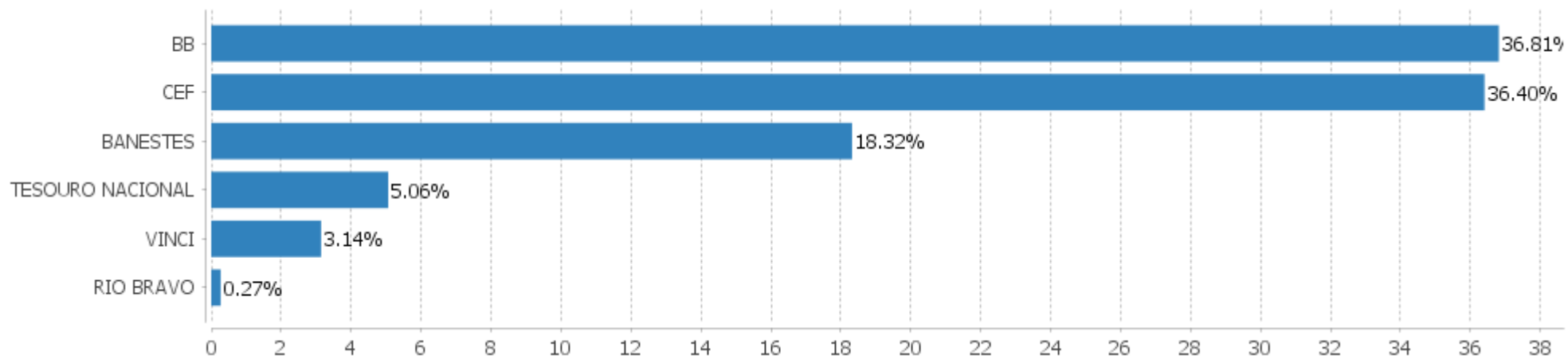


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2020	0,49	-0,79	-6,98	1,89	2,02	2,02	2,94	-0,49	-1,49	-0,01	2,81		2,01
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		8,61
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		-6,60
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

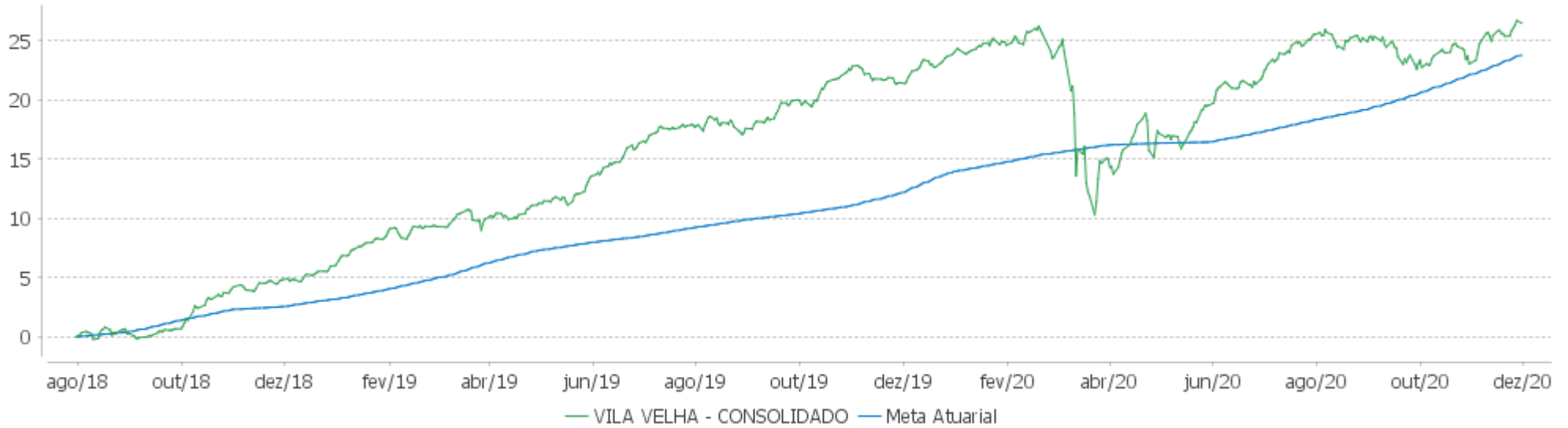
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

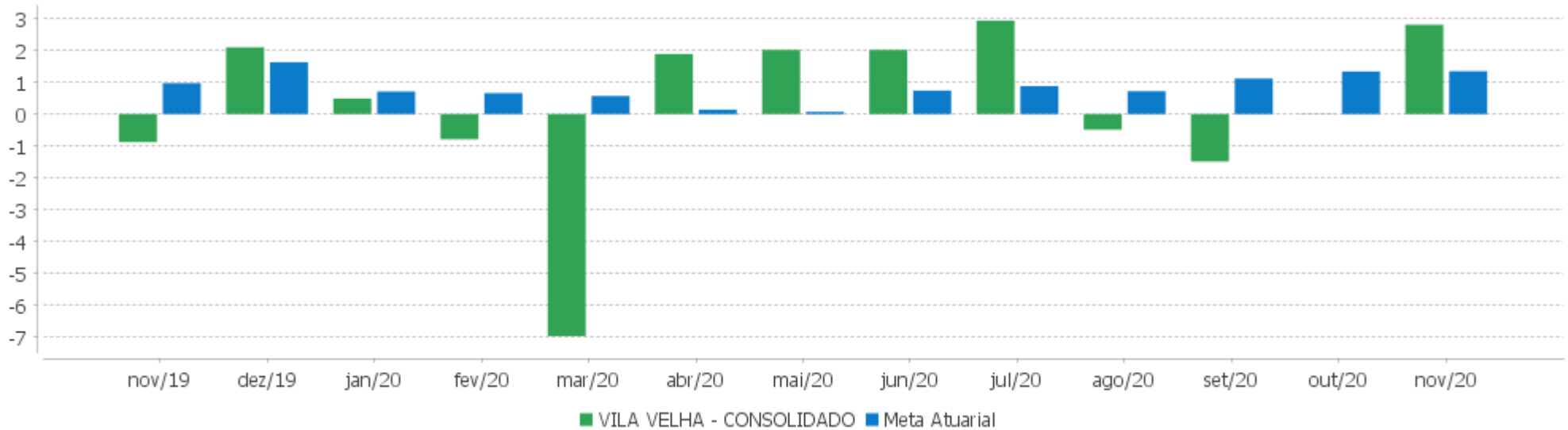
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	16	57,14	03 meses	1,27	3,86	-2,59	5,00
Meses abaixo da Meta Atuarial	12	42,86	06 meses	5,83	6,30	-0,48	4,36
			12 meses	4,16	10,40	-6,24	8,75
			24 meses	20,66	20,85	-0,19	6,54
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,39	2018-10	Desde 31/07/2018	26,50	24,00	2,50	6,16
Menor rentabilidade da Carteira	-6,98	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,30 -0,70	6,68 5,20	1,43 0,76	4,28 -1,03	8,05 4,53	24,98 -1,85	37,78 -4,45
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	1,17 -0,15	6,99 0,90	1,87 0,47	4,74 0,75	8,25 0,84	24,04 2,35	36,34 3,27
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,17 -0,18	6,47 -2,27	1,87 -2,02	4,53 -1,84	7,66 -2,86	22,51 1,53	42,98 9,61
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,20 -0,03	3,15 -0,38	0,35 -0,19	0,93 -0,25	3,56 -0,40	10,43 -0,70	17,92 -0,98
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,33 -0,03	4,38 -0,27	-0,64 -0,11	0,43 -0,15	5,02 -0,28	18,30 -0,74	30,60 -0,84
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	2,57 -0,02	-2,17 -0,29	0,07 -0,07	6,38 -0,14	0,33 -0,35	29,21 -1,12	47,03 -1,76
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,35 -0,65	5,56 4,08	1,27 0,60	3,74 -1,57	6,81 3,30	21,99 -4,83	34,12 -8,11
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,55 -0,45	6,07 4,59	0,59 -0,08	3,38 -1,93	7,65 4,13	26,89 0,06	40,16 -2,08
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	0,43 -0,03	5,03 -0,22	-1,11 -0,05	0,20 -0,09	5,76 -0,24	21,83 -0,72	36,19 -0,76
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,27 -0,09	8,87 0,14	3,49 -0,40	5,67 -0,70	10,33 -0,19	17,03 -3,96	29,41 -3,97
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,40 0,17	5,17 1,65	-0,18 -0,72	0,79 -0,40	5,64 1,68	16,93 5,79	26,43 7,54
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,78 -0,22	-7,39 -8,87	-2,47 -3,14	3,44 -1,87	-5,01 -8,52	23,91 -2,91	38,48 -3,75
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,17 -0,83	4,35 2,87	1,86 1,19	3,69 -1,62	5,31 1,79	16,61 -10,22	27,51 -14,73
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,34 0,09	6,29 -0,47	1,79 0,48	4,57 0,23	7,52 -0,53	19,65 -1,24	30,22 -2,34
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,85 0,15	2,65 -0,02	0,02 0,04	1,84 -0,02	3,63 0,03	17,42 0,43	28,71 0,61
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,31 -0,05	6,56 -2,18	0,63 -3,26	3,60 -2,77	8,10 -2,42	25,66 4,67	38,55 5,17
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,82	5,27	0,20	1,37	5,90	24,20	33,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	-0,07	2,15	-2,20	-1,92	1,59	16,47	21,12
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,56	6,08	0,59	3,39	7,66	26,88	40,17
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,44	4,59	-0,08	-1,93	4,14	0,05	-2,06
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,22	6,28	1,41	4,27	7,44	19,53	30,28
Var. IDKA 2 p.p.	-0,03	-0,49	0,10	-0,06	-0,61	-1,35	-2,28
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,99	1,24	0,60	5,13	3,24	26,17	41,14
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,24	-0,07	-0,18	-0,27	-0,66	-1,09
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	1,64	-8,16	-2,45	2,41	-5,98	20,89	32,59
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,36	-9,64	-3,12	-2,90	-9,50	-5,94	-9,64
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	0,61	-0,86	-0,75	1,05	0,26	18,04	
% do CDI	405,35	-33,40	-162,18	101,95	8,87	195,22	
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,01	0,47	0,05	0,11	0,60	3,61	7,13
% do CDI	9,89	18,19	9,92	10,68	20,21	39,09	43,72
BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	1,54	0,11	0,42	1,83	6,86	12,56
% do CDI	39,20	59,41	24,63	40,72	61,45	74,29	77,02
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,08	1,81	0,26	0,61	2,12	7,43	13,44
% do CDI	55,06	69,89	55,22	58,88	71,33	80,43	82,44
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	1,20	8,00	3,27	5,20	9,37	18,13	
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,80	6,52	2,60	-0,11	5,85	-8,70	
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	1,14	7,25	3,07	4,79	8,53	16,32	
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,86	5,76	2,40	-0,52	5,02	-10,51	
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	1,09	6,68	2,93	4,48	7,90	14,97	
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,91	5,19	2,25	-0,83	4,39	-11,86	
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	1,46	5,96	1,70	4,21	7,13	20,20	33,29
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,10	-2,77	-2,19	-2,16	-3,39	-0,78	-0,08
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	1,21	5,71	0,44	3,37	7,26	24,58	33,20
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,15	-3,03	-3,45	-3,00	-3,26	3,59	-0,18
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	8,65	2,46	3,62	23,24	9,81	46,78	80,87
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-5,75	11,58	-6,19	1,94	9,86	14,01	20,35
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	14,26	-5,78	8,69	18,42	2,25	38,18	59,11
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,14	3,34	-1,13	-2,89	2,30	5,41	-1,41
BB AÇÕES DIVIDENDOS	13,62	-14,49	6,71	17,29	-7,46	10,30	35,23
Var. IBOVESPA p.p.	-2,29	-8,65	-2,88	-7,30	-8,07	-11,36	-16,08
JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII	0,20	0,35	0,67	0,94	0,76	0,38	0,75
Var. IFIX p.p.	-1,31	12,52	-0,28	-4,73	3,59	-21,71	-26,16
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	15,76	-5,95	9,50	24,19	0,49	21,06	49,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-0,14	-0,11	-0,09	-0,39	-0,12	-0,60	-1,40
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2,43	53,70	-1,39	20,74	50,99	90,52	137,19
Var. IBOVESPA p.p.	-13,47	59,54	-10,98	-3,84	50,38	68,85	85,89
VILA VELHA - CONSOLIDADO	2,81	2,01	1,27	5,83	4,16	20,66	
Var. IPCA + 5,87% p.p.	1,46	-6,60	-2,59	-0,48	-6,23	-0,03	
CDI	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
INPC + 6,00%	1,42	9,58	4,22	6,96	11,46	22,12	33,99
IPCA + 6,00%	1,36	8,73	3,89	6,37	10,52	20,99	33,37

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	0,23	3,52	0,54	1,19	3,95	11,13	18,89
IRF-M 1+	0,46	5,24	-1,06	0,29	6,00	22,54	36,94
IRF-M TOTAL	0,36	4,65	-0,53	0,58	5,30	19,04	31,44
IMA-B 5	1,32	6,10	1,40	3,99	7,41	21,69	33,06
IMA-B 5+	2,59	-1,87	0,14	6,53	0,68	30,33	48,80
IMA-B TOTAL	2,00	1,48	0,67	5,31	3,52	26,83	42,23
IMA-C TOTAL	1,94	23,44	7,90	19,17	23,94	48,54	75,37
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,70	2,67	-0,02	1,86	3,60	17,00	28,09
IMA-GERAL TOTAL	0,73	3,25	0,22	2,35	4,17	17,84	29,30
IDKA 2	1,25	6,77	1,31	4,33	8,05	20,89	32,56
IDKA 20	3,37	-8,22	-0,40	9,06	-4,60	35,17	60,63
CDI	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Renda Variável							
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
IBRX 100	15,46	-5,18	9,57	25,07	1,72	24,85	55,25
IBRX 50	16,21	-5,30	10,24	25,90	0,92	19,73	48,77
SMALL CAP	16,64	-7,60	7,78	33,38	4,09	49,24	69,17
IFIX	1,51	-12,17	0,95	5,68	-2,83	22,09	26,91
Índice Consumo - ICON	8,93	-3,98	1,63	18,62	3,72	48,84	43,97
Índice Dividendos - IDIV	14,40	-9,12	9,82	21,30	-0,05	32,77	60,52
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,89	3,13	2,41	3,29	4,31	7,73	12,09
INPC	0,95	3,93	2,73	3,87	5,20	8,74	12,61
IGPM	3,28	21,97	11,24	18,66	24,52	29,46	41,99
SELIC	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
506	03/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.529,41	0,00	311,54161614	8,1190116200
478	03/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.960,00	7.087,11807600	2,1108721260
494	04/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	49,91	6,14725486	8,1190712200
507	05/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	815,76	0,00	100,47380754	8,1191309500
489	05/11/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	68.725,67	36.583,44842200	1,8786000000
479	05/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.883,00	891,96647900	2,1110658800
508	09/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	373,07	0,00	45,94882299	8,1192504100
491	10/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	754.728,51	0,00	92.954,75749405	8,1193101900
480	10/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	34.644,08	16.410,18087000	2,1111333430
509	16/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.552.204,81	0,00	314.328,36570901	8,1195497700
486	16/11/2020	BB PREV RF IPCA	0,00	102.990,30	42.552,84117100	2,4202919750
492	16/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	418.520,54	0,00	51.544,79642010	8,1195497700
481	16/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	100,00	47,36471100	2,1112764640
510	17/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	708,25	0,00	87,22709893	8,1196097200
482	17/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.711,72	1.284,33328100	2,1113834230
513	20/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.529,65	311,54161614	8,1197897100
514	20/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	815,83	100,47380754	8,1197897100
516	20/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.625.223,45	200.155,85480725	8,1197897100
512	20/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	708,38	87,24065764	8,1197897100
515	20/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	373,09	45,94882299	8,1197897100
511	20/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	170.349,60	20.979,55763518	8,1197897100
505	23/11/2020	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	1.800.000,00	0,00	731.198,52268715	2,4617117600
485	24/11/2020	BB PREV RF IDKA2	580.778,22	0,00	204.726,37413100	2,8368510040
517	25/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	228.217,07	28.105,65439977	8,1199699800
493	25/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	4.635.878,35	0,00	570.923,08977795	8,1199699800
476	25/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	228.955,06	0,00	108.415,10396300	2,1118372960
518	26/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	390.101,76	48.041,90744073	8,1200306300
499	26/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.963,93	365,01412663	8,1200306300

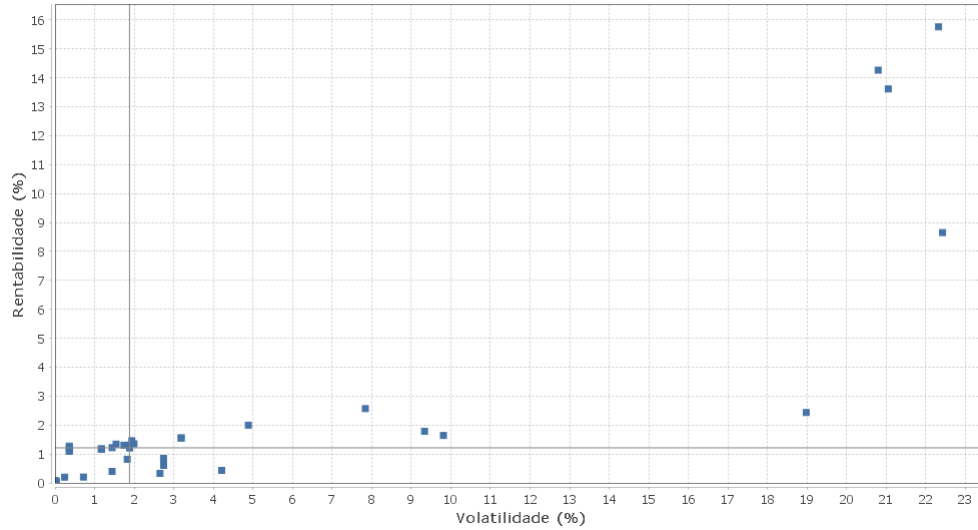
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
500	26/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	754.795,48	92.954,75749405	8,1200306300
496	26/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	378.325,85	46.591,67745896	8,1200306300
502	26/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.713.764,02	334.206,13089472	8,1200306300
498	26/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	232.977,47	28.691,69878620	8,1200306300
495	26/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	159.486,41	19.641,10959102	8,1200306300
501	26/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	418.545,33	51.544,79642010	8,1200306300
497	26/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	19.141,70	2.357,34274604	8,1200306300
487	26/11/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	234.540,10	0,00	124.771,30059100	1,8797600000
483	26/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	120.454,46	57.035,91355900	2,1119055080
519	27/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.282,46	157,93664764	8,1200913100
503	27/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	153.939,99	18.957,91366508	8,1200913100
490	27/11/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	303.065,92	161.219,17198200	1,8798380000
477	27/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	153.442,03	0,00	72.653,48704100	2,1119706190
520	30/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	21.002,26	2.586,43691410	8,1201516600
504	30/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	896.964,77	110.461,57850533	8,1201516600
488	30/11/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	131.593,16	0,00	69.999,48933800	1,8799160000
484	30/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	61.337,93	29.041,62013900	2,1120698400
Total						

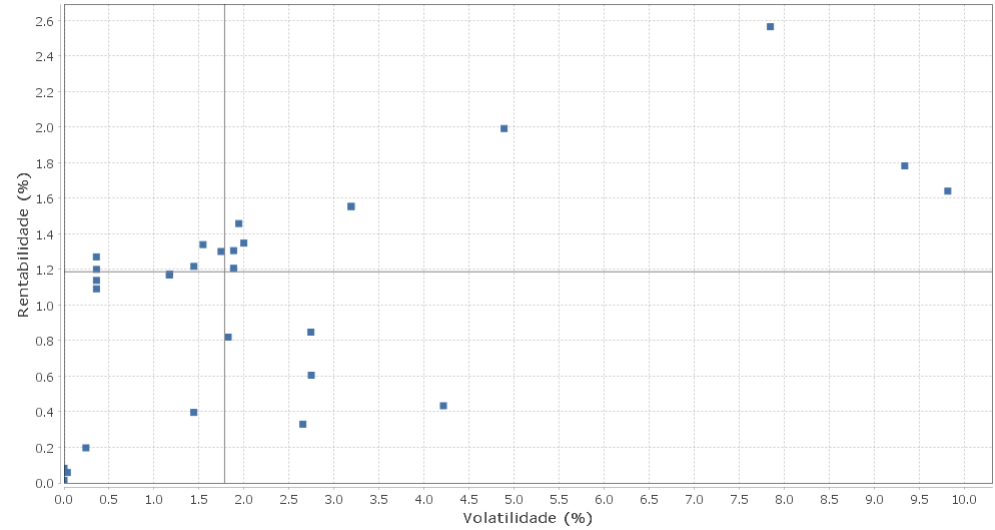
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

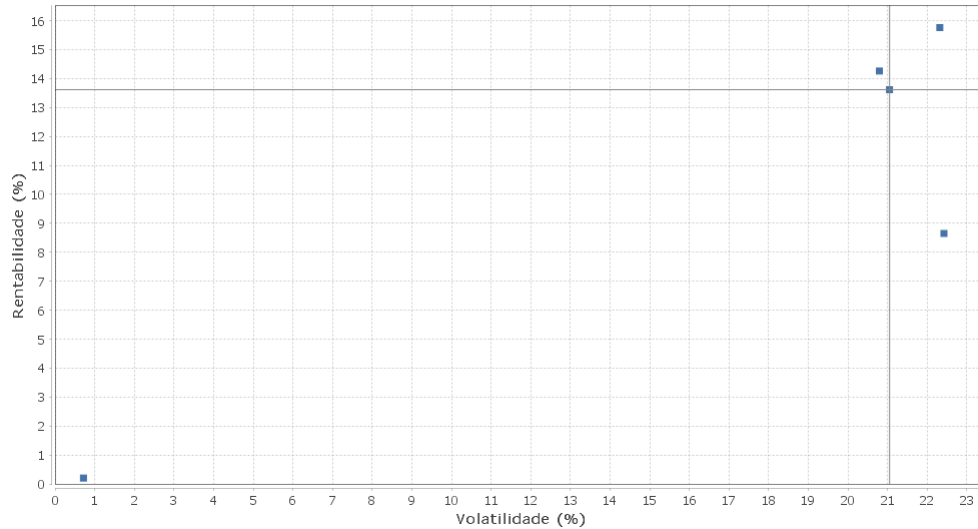
VILA VELHA - CONSOLIDADO - No Mês



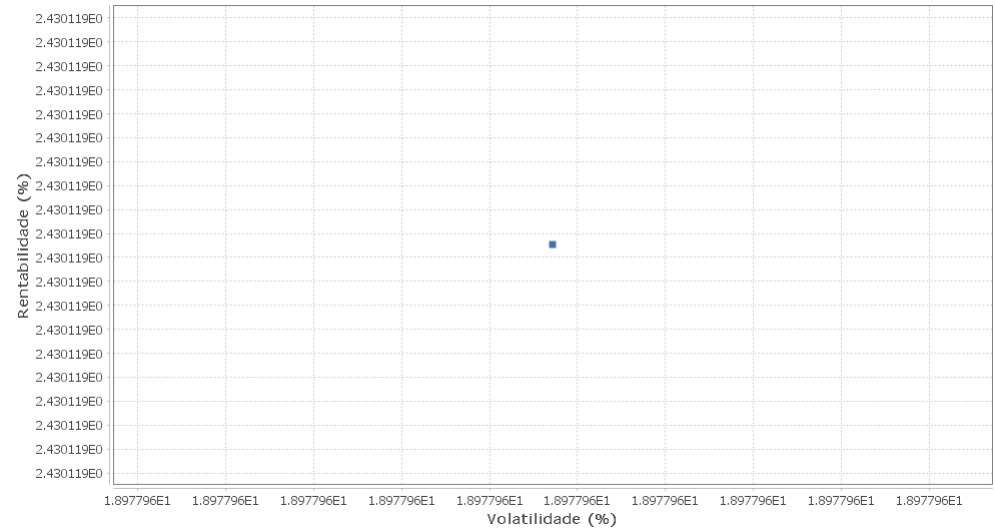
Renda Fixa - No Mês



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\$): 8.423.366,13

Value-At-Risk: 2,22%

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	1.158.463,62	0,31
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	-123,29	0,08	207.472,55	0,05
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,05	0,00	-2,51	0,06	5.333.928,60	1,41
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,24	0,17	0,00	0,20	0,20	12.509.570,48	3,30
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,36	0,09	0,00	3,12	1,27	6.566.014,36	1,73
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,36	0,09	0,00	2,75	1,14	322.979,59	0,09
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,36	0,09	0,00	2,92	1,20	12.481.104,02	3,29
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,36	0,09	0,00	2,62	1,09	6.365.343,70	1,68
JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII	Artigo 8º IV, Alínea b	0,72	0,04	-0,00	0,07	0,20	1.008.530,31	0,27
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,17	0,90	0,00	0,87	1,17	1.555.143,06	0,41
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,17	0,93	0,01	0,87	1,17	3.484.991,84	0,92
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	Artigo 7º I, Alínea b	1,17	0,94	0,01	0,87	1,17	6.572.794,85	1,73
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	1,44	0,87	0,03	0,17	0,40	17.784.256,39	4,69
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,44	1,07	0,05	0,74	1,22	25.837.955,49	6,82
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,54	0,91	0,03	0,77	1,34	21.939.743,54	5,79
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,74	1,11	0,00	0,66	1,30	2.451.204,80	0,65
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,82	1,23	0,04	0,37	0,82	16.888.605,35	4,46
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	1,88	1,42	0,01	0,61	1,31	4.075.999,86	1,08
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	Artigo 7º VII, Alínea b	1,88	1,75	0,00	0,56	1,21	1.289.479,80	0,34
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	1,94	0,96	0,01	0,67	1,46	6.943.873,32	1,83
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,00	1,16	0,01	0,60	1,35	5.555.194,68	1,47
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,65	1,34	0,01	0,07	0,33	2.679.073,98	0,71
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,74	1,33	0,05	0,25	0,85	16.858.345,97	4,45
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	2,74	1,26	0,01	0,17	0,61	8.320.162,23	2,20
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,19	1,70	0,05	0,44	1,55	14.941.501,80	3,94
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,19	1,70	0,06	0,44	1,56	19.886.337,54	5,25
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,21	2,01	0,02	0,07	0,43	5.646.331,18	1,49
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,89	2,66	0,21	0,38	1,99	40.031.320,28	10,56

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	7,84	4,17	0,09	0,31	2,57	11.946.639,77	3,15
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	9,33	4,66	0,05	0,17	1,78	21.852.020,10	5,77
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	9,81	4,57	0,01	0,15	1,64	5.885.305,25	1,55
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	18,98	12,80	0,18	0,12	2,43	16.751.611,83	4,42
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	20,79	9,69	0,27	0,68	14,26	11.910.730,32	3,14
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	21,05	9,69	0,28	0,64	13,62	12.212.634,97	3,22
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	22,32	10,55	0,38	0,70	15,76	15.305.464,19	4,04
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	22,42	10,18	0,33	0,38	8,65	14.435.425,64	3,81