



LDB
EMPRESAS

VILA VELHA
JUNHO 2020



Prezados Senhores,

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

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

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

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

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

85,96%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (3,680000%) ..	0,36	0,28	2,39	6.241.492,12	1,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,290000%) ..	0,36	0,33	2,68	316.513,65	0,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,100000%) ..	0,36	0,39	3,07	12.223.889,14	3,45
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,36	0,36	2,83	18.781.894,91	5,30

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	22,66	2,29	-8,42	24.624.472,35	6,94	273.434.802,05	9,01
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,53	0,26	2,45	12.425.507,46	3,50	7.792.694.548,07	0,16
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,40	2,02	-1,75	36.185.837,42	10,20	5.526.503.185,82	0,65
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,10	1,21	2,88	17.892.397,73	5,04	6.212.458.601,64	0,29
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,16	2,83	-5,44	11.547.407,26	3,26	1.967.228.116,14	0,59
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	8,67	1,02	5,88	5.692.304,62	1,60	2.971.560.297,96	0,19
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,01	1,18	3,12	23.291.330,89	6,57	7.740.606.629,29	0,30
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,82	0,77	4,73	2.688.032,66	0,76	17.164.831.993,69	0,02
BB	BB	BB PREV RF IPCA	6,04	1,14	4,03	4.080.093,89	1,15	345.055.333,30	1,18
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	6,09	1,20	3,53	2.437.843,50	0,69	288.951.700,68	0,84
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	4,16	0,48	4,85	11.719.628,64	3,30	215.246.883,23	5,44
BB	BB	BB PREV RF VII	2,30	0,99	1,64	4.376.935,50	1,23	683.688.528,70	0,64
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	5,12	1,13	2,90	7.260.432,62	2,05	560.076.535,65	1,30
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	4,98	1,18	3,36	6.509.626,27	1,84	199.252.491,46	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	6,05	0,95	1,75	16.710.923,99	4,71	10.783.491.196,95	0,15
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,96	0,75	4,63	6.029.234,03	1,70	12.211.119.756,17	0,05
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,21	0,89	0,73	3.780.475,41	1,07	257.646.723,28	1,47
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,57	1,24	3,87	19.926.973,37	5,62	1.430.208.068,48	1,39
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,21	0,89	0,74	12.893.607,19	3,64	1.000.064.153,24	1,29
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	27,39	1,24	3,87	14.968.315,20	4,22	459.801.943,88	3,26
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,42	1,14	3,02	3.967.212,98	1,12	528.945.008,55	0,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,73	0,47	3,52	6.414.827,08	1,81	82.967.396,19	7,73
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,54	1,33	0,63	255.423.420,06	72,02		

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	0,06	0,02	0,38	268.572,51	0,08	800.768.664,32	0,03
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	25,86	2,19	-8,35	11.945.112,79	3,37	257.794.723,23	4,63
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,07	0,13	1,24	5.091.839,34	1,44	1.768.065.678,44	0,29
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,07	0,14	1,34	111.860,86	0,03	517.750.287,34	0,02
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,52	0,60	-1,31	5.276.431,12	1,49	164.480.013,81	3,21
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			11,98	1,43	-4,59	22.693.816,62	6,40		

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	4,44	0,98	2,68	6.728.584,06	1,90	600.689.300,61	1,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF	8,11	1,26	3,55	1.263.176,60	0,36	181.550.388,59	0,70
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			4,99	1,02	2,81	7.991.760,66	2,25		
Renda Fixa			6,00	1,26	0,39	304.890.892,25	85,96		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

11,39%

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
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVSPA	43,22	8,61	-17,75	13.384.791,30	3,77	625.376.500,86	2,14
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			43,22	8,61	-17,75	13.384.791,30	3,77		

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	37,97	6,59	-22,29	11.097.965,67	3,13	907.675.512,87	1,22
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	38,70	4,58	-16,79	6.690.807,15	1,89	799.344.501,83	0,84
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	44,83	10,23	-8,36	8.218.029,97	2,32	158.247.917,35	5,19
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			39,55	7,18	-16,88	26.006.802,79	7,33		

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	1,36	0,01	-0,58	999.203,69	0,28	125.316.529,97	0,80
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			1,36	0,01	-0,58	999.203,69	0,28		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			39,47	7,46	-16,86	40.390.797,78	11,39		
--	--	--	--------------	-------------	---------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,65%

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	26,27	4,37	32,85	9.398.266,91	2,65	1.181.944.568,52	0,80
Sub-total Artigo 9º A, III			26,27	4,37	32,85	9.398.266,91	2,65		
Investimentos no Exterior			26,27	4,37	32,85	9.398.266,91	2,65		
Total			8,45	2,02	-1,66	354.679.956,94	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	18.781.894,91	5,30	0,00	47,50	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	255.423.420,06	72,02	0,00	20,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	22.693.816,62	6,40	0,00	5,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	7.991.760,66	2,25	0,00	2,50	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	304.890.892,25	85,96				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	13.384.791,30	3,77	0,00	10,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	26.006.802,79	7,33	0,00	13,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	999.203,69	0,28	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	40.390.797,78	11,39				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	9.398.266,91	2,65	0,00	1,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	9.398.266,91	2,65				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades por Artigo

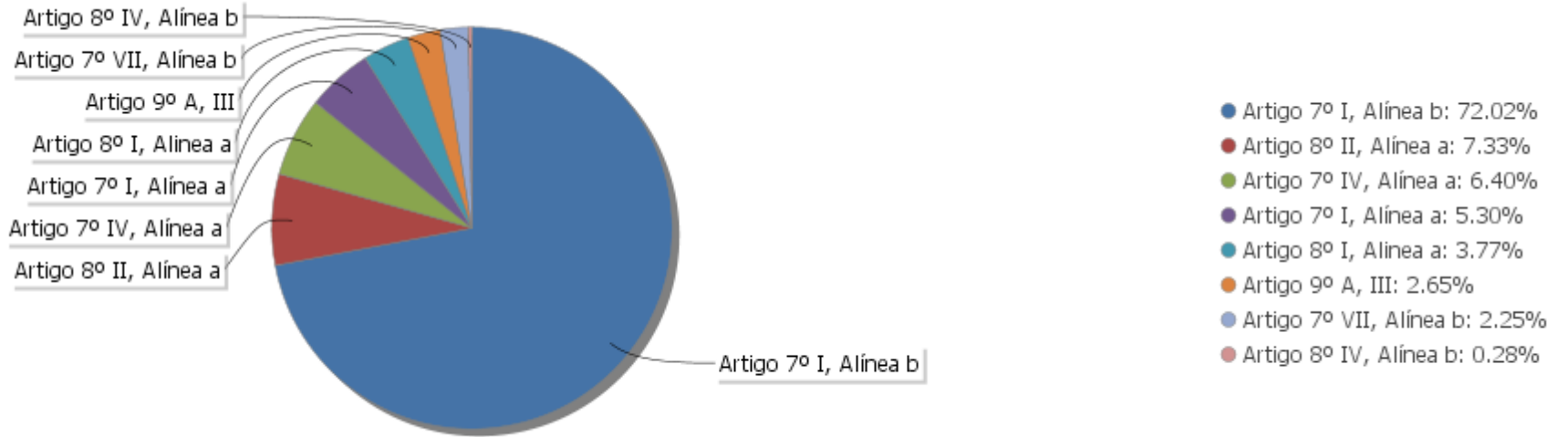
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,36 167,67	2,83 161,57	0,55 74,72	2,83 161,57	6,78 147,32	66.627,09	529.045,92
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,33 628,51	0,63 35,94	3,79 516,02	0,63 35,94	6,23 135,30	3.346.821,66	1.762.690,61
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,43 672,03	-4,59 -261,80	2,46 335,44	-4,59 -261,80	0,82 17,88	294.834,69	-1.111.656,85
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	1,02 481,37	2,81 160,42	3,84 521,88	2,81 160,42	8,22 178,53	80.856,31	218.756,25
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,61 -0,15	-17,75 0,06	29,78 -0,40	-17,75 0,06	-5,96 -0,11	1.061.022,91	-2.888.286,04
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	7,18 -1,58	-16,88 0,93	26,70 -3,48	-16,88 0,93	-3,85 2,00	1.741.443,91	-5.383.243,76
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,01 -8,75	-0,58 17,23	0,08 -30,09	-0,58 17,23	-0,20 5,65	87,45	-5.817,86
Artigo 9º A, III % do CDI	4,37 2.057,88	32,85 1.872,61	24,40 3.320,23	32,85 1.872,61	54,59 1.185,93	401.810,01	1.353.925,46
						6.993.504,03	-5.524.586,27

Análise de Liquidez

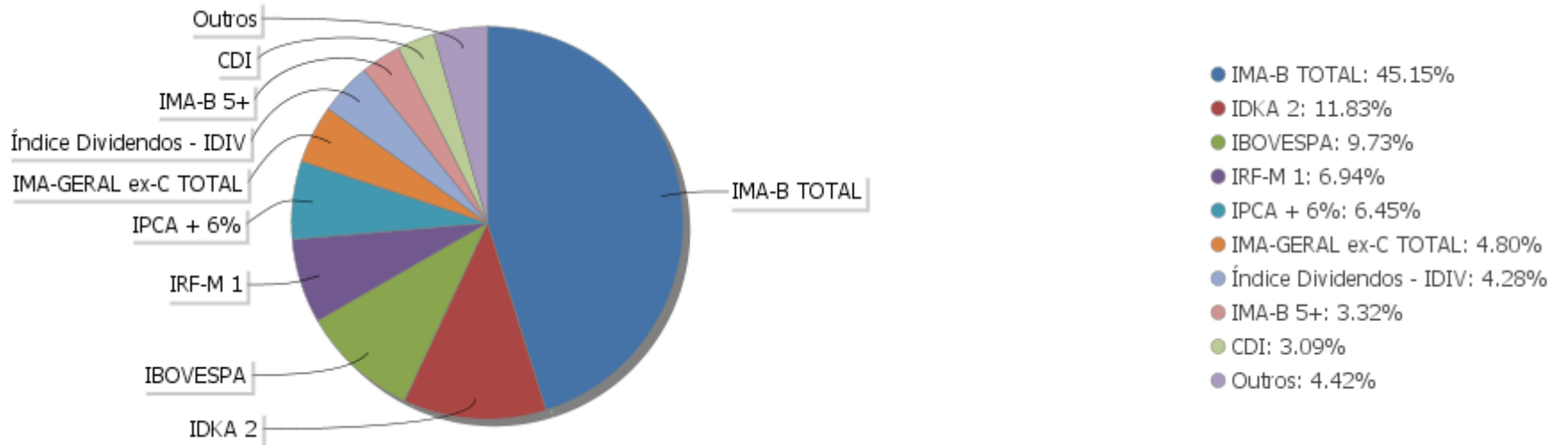
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	243.319.176,75	68,60	243.319.176,75	68,60
de 31 a 364 dias	14.908.837,12	4,20	258.228.013,87	72,81
acima de 365 dias	96.451.943,07	27,19	354.679.956,94	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

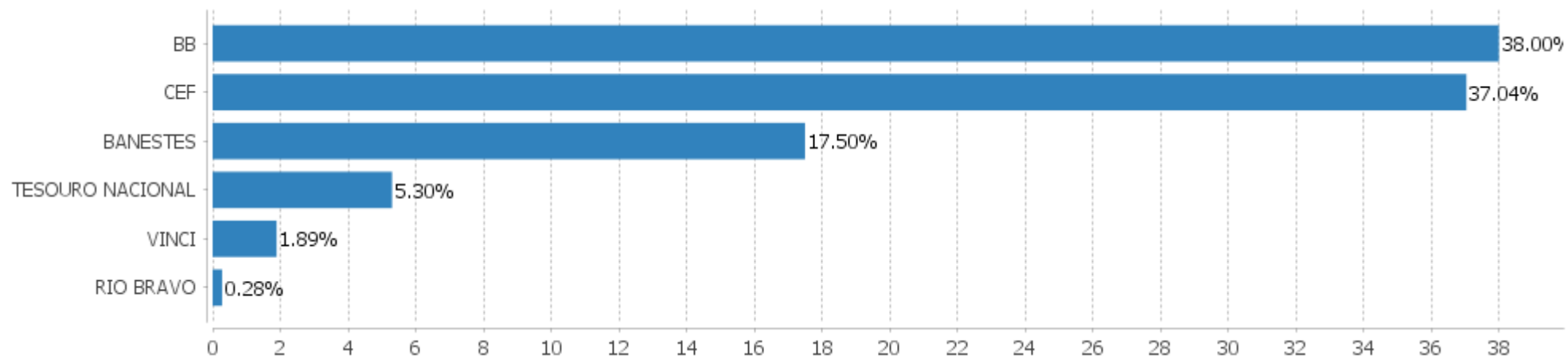


Alocação Por Estratégia



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							-1,66
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74							2,92
p.p. indexador	-0,22	-1,45	-7,55	1,75	1,95	1,28							-4,58
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

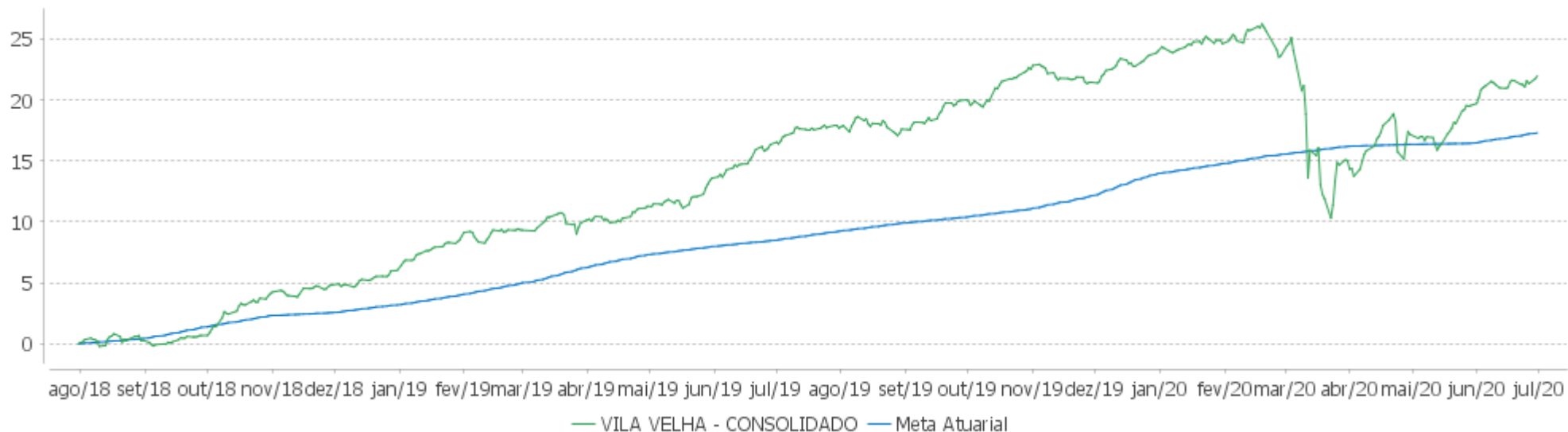
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

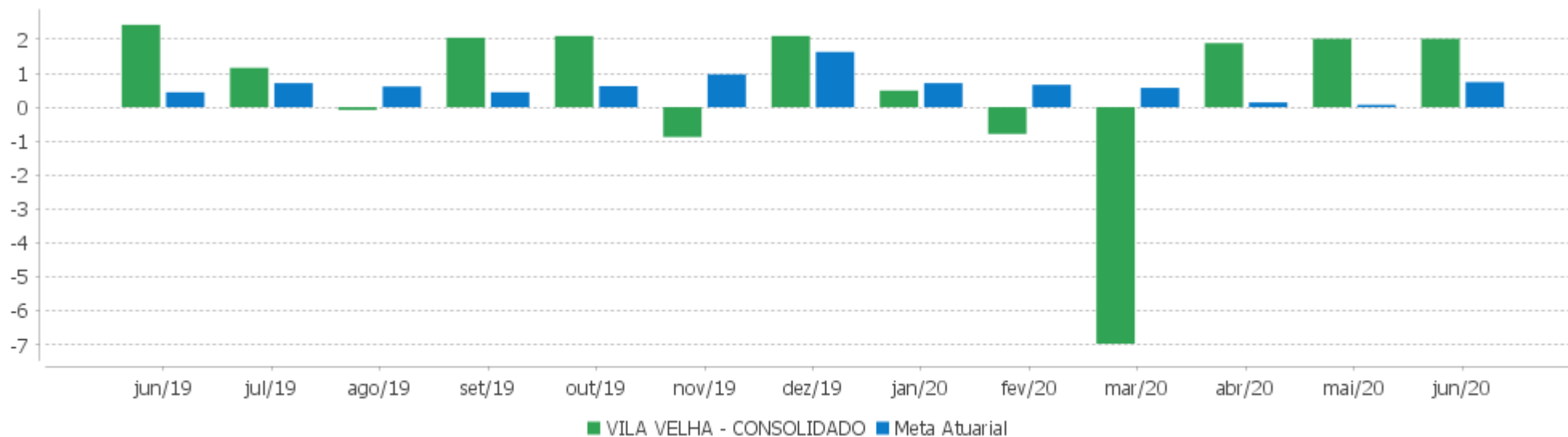
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	14	60,87	03 meses	6,05	0,95	5,09	7,30
Meses abaixo da Meta Atuarial	9	39,13	06 meses	-1,66	2,92	-4,58	11,71
			12 meses	4,82	8,22	-3,40	8,45
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,39	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-6,98	2020-03	Desde 31/07/2018	21,95	17,50	4,44	6,48

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.	1,20 -0,85	3,53 5,20	4,24 -0,72	3,53 5,20	9,39 4,45	29,75 -5,38	42,26 -3,95
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	1,18 0,07	3,36 0,19	3,77 0,01	3,36 0,19	8,94 0,12	27,77 3,02	40,28 3,38
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,26 -0,03	2,45 -0,14	1,06 -0,09	2,45 -0,14	5,71 -0,30	13,15 -0,52	21,70 -0,85
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6% p.p.	1,14 0,40	3,02 0,03	3,50 2,51	3,02 0,03	8,41 0,12	30,53 11,97	43,28 12,17
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,77 -0,02	4,73 -0,13	3,33 -0,06	4,73 -0,13	9,54 -0,27	26,59 -0,49	37,48 -0,96
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	2,83 -0,02	-5,44 -0,17	5,88 -0,11	-5,44 -0,17	1,57 -0,40	42,12 -1,44	50,48 -1,85
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,13 -0,92	2,90 4,56	3,75 -1,21	2,90 4,56	8,41 3,46	26,50 -8,63	38,87 -7,34
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,89 -1,16	0,74 2,40	1,68 -3,28	0,74 2,40	4,90 -0,05	15,30 -19,83	24,27 -21,94
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,24 -0,81	3,87 5,53	5,16 0,20	3,87 5,53	10,28 5,34	33,77 -1,36	41,86 -4,34
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO Var. IRF-M 1+ p.p.	1,02 -0,02	5,88 -0,15	4,41 -0,12	5,88 -0,15	11,53 -0,26	32,77 -0,47	44,55 -1,05
FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,89 -1,16	0,73 2,39	1,67 -3,29	0,73 2,39	4,88 -0,07	15,26 -19,87	24,22 -21,98
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IPCA + 6% p.p.	0,47 -0,28	3,52 0,53	0,88 -0,10	3,52 0,53	5,32 -2,96	16,11 -2,45	23,86 -7,25
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,29 0,24	-8,42 -6,75	4,76 -0,20	-8,42 -6,75	-0,74 -5,69	38,52 3,39	45,40 -0,80
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,48 0,20	4,85 2,25	2,22 1,07	4,85 2,25	9,17 3,16	21,18 7,51	31,47 8,92
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,99 -1,06	1,64 3,31	2,40 -2,56	1,64 3,31	6,28 1,33	19,00 -16,13	30,65 -15,55
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,21 0,22	2,88 -0,46	3,57 0,22	2,88 -0,46	8,18 -0,59	21,13 -2,04	32,87 -2,59
BB PREV RF IPCA	1,14	4,03	4,52	4,03	10,18	31,61	43,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 6% p.p.	0,40	1,04	3,54	1,04	1,90	13,04	12,76
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,95 0,05	1,75 0,04	2,96 0,22	1,75 0,04	6,31 -0,01	23,29 0,35	33,67 0,56
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,24 -0,81	3,87 5,53	5,16 0,20	3,87 5,53	10,29 5,34	33,77 -1,36	41,85 -4,35
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,75 0,49	4,63 4,53	3,27 3,70	4,63 4,53	9,82 7,69	28,20 22,63	38,61 28,41
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,18 0,19	3,12 -0,23	3,54 0,19	3,12 -0,23	8,19 -0,58	21,36 -1,81	33,16 -2,29
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,02 -0,03	-1,75 -0,08	4,90 -0,06	-1,75 -0,08	4,74 -0,20	34,48 -0,65	45,12 -1,09
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6% p.p.	0,98 0,23	2,68 -0,31	3,62 2,63	2,68 -0,31	7,94 -0,35	24,05 5,49	37,24 6,13
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF Var. IPCA + 6% p.p.	1,26 0,52	3,55 0,56	5,02 4,04	3,55 0,56	9,75 1,46	27,65 9,08	35,15 4,04
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,19 0,15	-8,35 -6,69	5,85 0,89	-8,35 -6,69	-1,68 -6,62	33,55 -1,58	40,67 -5,54
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	0,60 283,94	-1,31 -74,55	-0,59 -80,62	-1,31 -74,55	6,44 139,98		
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,13 60,81	1,24 70,84	0,49 66,18	1,24 70,84	3,50 76,04	8,88 79,16	15,65 80,73
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO % do CDI	0,02 10,88	0,38 21,85	0,10 13,86	0,38 21,85	1,64 35,54	4,94 44,07	9,43 48,64
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,14 68,08	1,34 76,36	0,54 72,86	1,34 76,36	3,73 81,05	9,38 83,62	16,47 84,93
NTN-B 150545 (5,100000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,39 -1,65	3,07 4,73	0,66 -4,30	3,07 4,73	7,25 2,31	17,20 -17,93	
NTN-B 150545 (4,290000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,33 -1,72	2,68 4,34	0,47 -4,49	2,68 4,34	6,42 1,48	12,77 -22,36	
NTN-B 150545 (3,680000%) .. Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,28 -1,77	2,39 4,05	0,33 -4,63	2,39 4,05	5,80 0,85	11,68 -23,45	
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	10,23 1,28	-8,36 10,02	41,46 22,76	-8,36 10,02	8,76 8,91	58,50 10,98	80,20 19,63
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	4,58 -4,37	-16,79 1,59	20,57 1,87	-16,79 1,59	-2,34 -2,18	45,78 -1,73	57,70 -2,87
BB AÇÕES DIVIDENDOS	6,59	-22,29	21,06	-22,29	-12,10	24,15	32,50

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.	-2,17	-4,49	-9,12	-4,49	-6,25	-6,49	-18,62
JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII	0,01	-0,58	0,08	-0,58	-0,20	-0,49	-0,37
Var. IFIX p.p.	-5,58	11,66	-12,43	11,66	-7,07	-32,53	-35,67
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	8,61	-17,75	29,78	-17,75	-5,96	29,82	49,23
Var. IBOVESPA p.p.	-0,15	0,06	-0,40	0,06	-0,11	-0,82	-1,90
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4,37	32,85	24,40	32,85	54,59	66,72	118,22
Var. IBOVESPA p.p.	-4,39	50,66	-5,78	50,66	60,44	36,08	67,09
CDI	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,39
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
INPC + 6%	0,79	3,25	1,24	3,25	8,51	18,75	30,23
IPCA + 6%	0,75	2,99	0,98	2,99	8,29	18,56	31,11

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	0,28	2,60	1,15	2,60	6,01	13,67	22,54
IRF-M 1+	1,04	6,03	4,53	6,03	11,80	33,23	45,60
IRF-M TOTAL	0,79	4,86	3,39	4,86	9,81	27,08	38,44
IMA-B 5	1,12	3,17	3,77	3,17	8,81	24,75	36,90
IMA-B 5+	2,84	-5,26	5,99	-5,26	1,97	43,55	52,33
IMA-B TOTAL	2,05	-1,66	4,96	-1,66	4,95	35,13	46,21
IMA-C TOTAL	3,74	7,46	7,95	7,46	13,21	41,24	63,14
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,90	1,71	2,74	1,71	6,32	22,95	33,11
IMA-GERAL TOTAL	0,99	1,87	2,89	1,87	6,52	23,45	33,90
IDKA 2	0,99	3,35	3,35	3,35	8,77	23,17	35,46
IDKA 20	4,18	-12,33	6,49	-12,33	-4,69	58,14	62,45
CDI	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,39
Renda Variável							
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
IBRX 100	8,97	-17,39	30,39	-17,39	-4,66	34,21	53,90
IBRX 50	9,33	-17,76	31,79	-17,76	-6,93	27,59	47,47
SMALL CAP	14,43	-20,73	32,49	-20,73	5,15	49,01	69,83
IFIX	5,59	-12,24	12,52	-12,24	6,86	32,05	35,30
Índice Consumo - ICON	10,08	-10,90	39,45	-10,90	13,99	52,93	55,22
Índice Dividendos - IDIV	8,95	-18,38	18,70	-18,38	-0,15	47,52	60,57
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,26	0,10	-0,43	0,10	2,13	5,57	10,21
INPC	0,30	0,36	-0,18	0,36	2,35	5,74	9,47
IGPM	1,56	4,39	2,66	4,39	7,31	14,30	22,21
SELIC	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,22	19,40
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
221	01/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	35.524,63	0,00	4.379,65777533	8,1112798800
237	01/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.033,02	2.868,26285800	2,1033706810
252	01/06/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	35.524,63	19.010,49812500	1,8686850000
238	02/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.417,38	4.476,94758600	2,1035269720
253	02/06/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	63.592,49	34.027,89257500	1,8688340000
213	02/06/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	461.365,83	0,00	108.800,81491101	4,2404630000
249	03/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	35.768,78	0,00	17.002,93985500	2,1036820870
232	04/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.551,18	0,00	191,23091283	8,1115546500
241	04/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.418,57	1.624,92501500	2,1038324650
233	05/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	799,76	0,00	98,59405353	8,1116453900
214	09/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.377,76	416,39944241	8,1118264200
242	09/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.264,67	4.877,98176700	2,1042862580
250	15/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	28.575,23	0,00	13.576,54239700	2,1047501760
243	15/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	314,45	149,40015400	2,1047501760
215	16/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	163.917,35	20.206,28821207	8,1121951800
216	16/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	8.574,88	1.057,03571072	8,1121951800
224	16/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	14.665,10	1.807,78441228	8,1121951800
234	18/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.892.255,49	0,00	356.523,76080132	8,1123779300
222	19/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	502.944,15	0,00	61.995,10214349	8,1126433000
225	19/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	21.174,34	2.610,04224859	8,1126433000
229	19/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.195.736,25	270.656,08199024	8,1126433000
226	19/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	738,16	90,98936617	8,1126433000
227	19/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.551,39	191,23091283	8,1126433000
228	19/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	799,86	98,59405353	8,1126433000
247	19/06/2020	BB PREV RF IDKA2	2.220.000,00	0,00	809.817,20886900	2,7413593780
236	22/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	742,72	0,00	352,77161000	2,1053848370
244	22/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	58.117,71	27.604,31678700	2,1053848370
235	25/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	737,99	0,00	90,96524078	8,1128790900

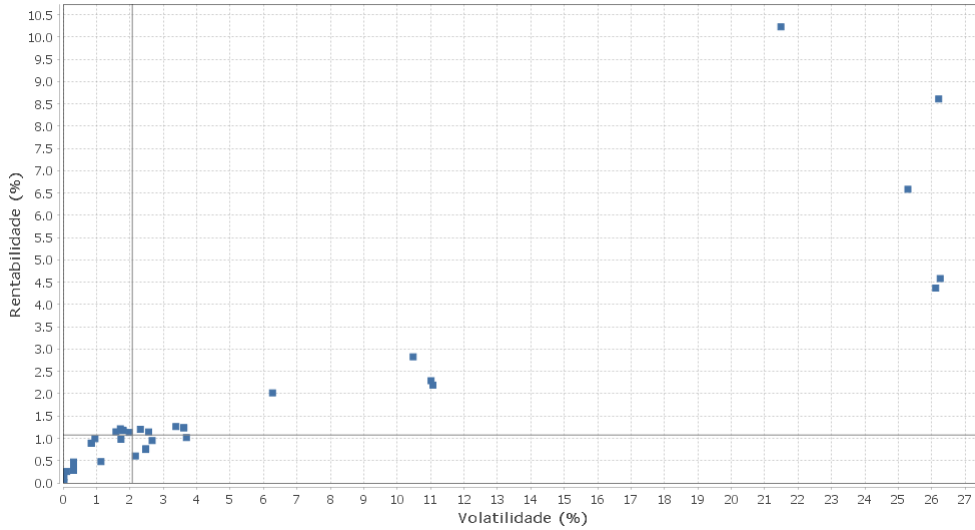
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
245	25/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.249,01	2.492,80362200	2,1056652650
223	26/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	5.178.598,47	0,00	638.313,41247895	8,1129400800
246	26/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	123.880,50	58.829,51558600	2,1057542080
218	29/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	502.966,34	61.995,10214349	8,1130012500
219	29/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	4.218.771,70	520.001,36217802	8,1130012500
217	29/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	26.956,44	3.322,62206461	8,1130012500
251	29/06/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	387.190,42	0,00	206.927,55218700	1,8711400000
230	29/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	380.906,23	46.950,10124916	8,1130012500
220	30/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	759.670,33	93.635,46214192	8,1130622200
239	30/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.033,02	2.864,78179300	2,1059265370
248	30/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	65.980,46	31.330,84599200	2,1059265370
254	30/06/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	319.390,82	170.684,41126300	1,8712360000
231	30/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	248.108,93	30.581,41591773	8,1130622200
240	30/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	330.723,05	0,00	157.043,96340000	2,1059265370

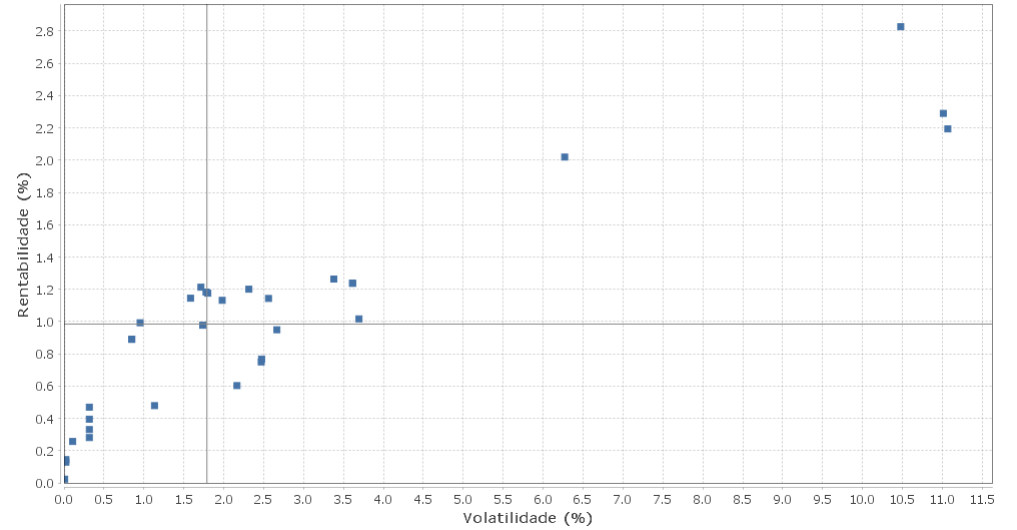
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

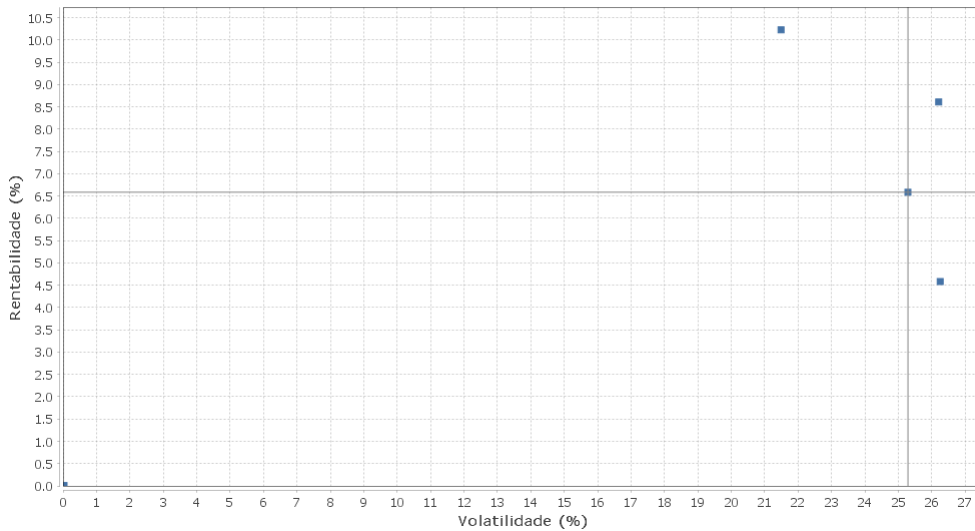
VILA VELHA - CONSOLIDADO - No Mês



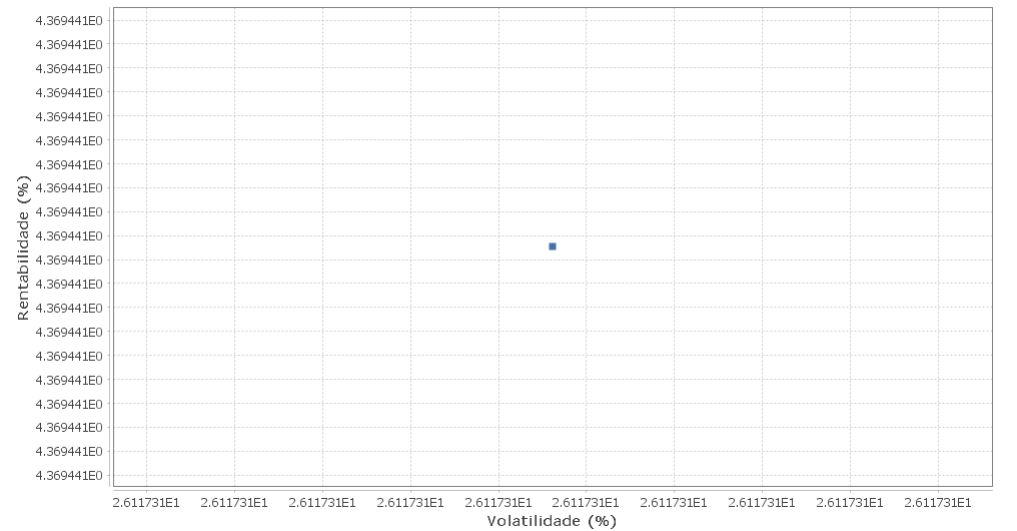
Renda Fixa - No Mês



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	0,01	0,01	-0,00	-22,42	0,02	268.572,51	0,08
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,02	-0,00	-2,96	0,14	111.860,86	0,03
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,02	-0,00	-3,48	0,13	5.091.839,34	1,44
JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII	Artigo 8º IV, Alínea b	0,03	0,03	0,00	-6,71	0,01	999.203,69	0,28
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,11	0,33	0,01	0,41	0,26	12.425.507,46	3,50
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,32	0,10	-0,00	0,81	0,47	6.414.827,08	1,81
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,32	0,10	-0,00	0,58	0,39	12.223.889,14	3,45
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,32	0,10	-0,00	0,37	0,33	316.513,65	0,09
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,32	0,10	-0,00	0,22	0,28	6.241.492,12	1,76
FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,85	0,61	0,00	0,80	0,89	3.780.475,41	1,07
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,85	0,61	0,01	0,80	0,89	12.893.607,19	3,64
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	0,95	1,62	0,02	0,82	0,99	4.376.935,50	1,23
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	1,13	2,38	0,07	0,23	0,48	11.719.628,64	3,30
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,59	2,40	0,02	0,59	1,14	3.967.212,98	1,12
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,71	2,11	0,09	0,58	1,21	17.892.397,73	5,04
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	1,74	2,79	0,05	0,44	0,98	6.728.584,06	1,90
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	Artigo 7º I, Alínea b	1,78	2,74	0,04	0,55	1,18	6.509.626,27	1,84
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	2,27	0,13	0,53	1,18	23.291.330,89	6,57
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,98	3,06	0,06	0,46	1,13	7.260.432,62	2,05
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	2,17	1,17	0,00	0,18	0,60	5.276.431,12	1,49
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,31	3,31	0,02	0,43	1,20	2.437.843,50	0,69
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,47	2,80	0,04	0,22	0,75	6.029.234,03	1,70
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,47	2,80	0,02	0,22	0,77	2.688.032,66	0,76
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	2,56	3,72	0,04	0,36	1,14	4.080.093,89	1,15
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,67	3,94	0,17	0,28	0,95	16.710.923,99	4,71
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF	Artigo 7º VII, Alínea b	3,38	5,12	0,02	0,31	1,26	1.263.176,60	0,36
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,61	5,16	0,20	0,28	1,24	14.968.315,20	4,22
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,61	5,16	0,27	0,28	1,24	19.926.973,37	5,62
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	3,69	4,43	0,06	0,22	1,02	5.692.304,62	1,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,27	9,57	0,88	0,29	2,02	36.185.837,42	10,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	10,48	14,21	0,41	0,25	2,83	11.547.407,26	3,26
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	11,01	18,19	0,32	0,19	2,29	24.624.472,35	6,94
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	11,07	23,20	0,18	0,18	2,19	11.945.112,79	3,37
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	21,49	29,99	0,58	0,47	10,23	8.218.029,97	2,32
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	25,29	27,02	0,73	0,25	6,59	11.097.965,67	3,13
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	26,12	19,78	0,26	0,16	4,37	9.398.266,91	2,65
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	26,21	32,03	1,02	0,32	8,61	13.384.791,30	3,77
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	26,25	28,36	0,47	0,17	4,58	6.690.807,15	1,89