



**LDB**  
EMPRESAS

**VILA VELHA**  
SETEMBRO 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 16.12.2020.

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 82,88%

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%) ..	0,38	0,69	4,36	6.361.985,62	1,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,290000%) ..	0,38	0,74	4,82	323.112,56	0,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,100000%) ..	0,38	0,81	5,43	12.503.669,28	3,43
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,38</b>	<b>0,77</b>	<b>5,06</b>	<b>19.188.767,46</b>	<b>5,27</b>

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	23,29	-5,05	-9,84	21.274.324,57	5,84	288.574.129,48	7,37
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,54	0,04	2,83	12.470.772,30	3,43	7.413.658.574,68	0,17
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,72	-1,56	-0,93	39.172.328,96	10,76	5.533.318.681,28	0,71
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,16	0,11	4,55	21.005.290,80	5,77	7.070.754.781,93	0,30
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,74	-2,64	-4,82	11.622.511,85	3,19	1.755.979.575,38	0,66
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	8,88	-0,98	5,16	5.653.669,86	1,55	3.209.755.140,80	0,18
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,08	0,04	4,84	25.488.119,96	7,00	9.208.011.978,57	0,28
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,98	-0,61	4,41	2.679.862,67	0,74	11.234.342.142,99	0,02
BB	BB	BB PREV RF IPCA	6,10	-0,30	5,57	4.140.486,66	1,14	350.162.776,21	1,18
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	6,12	-0,14	5,03	2.413.325,27	0,66	286.045.614,65	0,84
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	4,24	-0,23	5,12	11.750.369,13	3,23	194.056.442,06	6,06
BB	BB	BB PREV RF VII	2,35	0,19	2,64	1.529.643,55	0,42	238.949.489,36	0,64
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	5,20	-0,26	3,97	5.471.392,30	1,50	422.068.298,70	1,30
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	4,95	0,19	5,23	6.464.650,67	1,78	197.875.837,91	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	6,22	-0,75	1,86	16.728.347,00	4,60	10.452.752.168,75	0,16
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	-0,50	4,53	15.789.713,48	4,34	13.535.810.678,86	0,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,72	-0,77	4,64	19.617.779,36	5,39	1.408.015.961,73	1,39
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	27,49	-0,77	4,64	14.739.896,70	4,05	452.785.187,83	3,26
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,40	0,19	4,71	3.427.606,14	0,94	457.006.791,34	0,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,38	0,88	6,13	6.400.445,61	1,76	82.781.410,59	7,73
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>6,67</b>	<b>-1,06</b>	<b>1,20</b>	<b>247.840.536,84</b>	<b>68,08</b>		

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	0,05	0,02	0,44	9.927.836,34	2,73	899.876.672,43	1,10
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	26,43	-4,96	-10,53	5.733.395,41	1,57	291.923.457,14	1,96
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,08	-0,00	1,42	5.091.326,85	1,40	1.878.414.583,86	0,27
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,07	0,09	1,64	569.817,37	0,16	480.823.075,37	0,12
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,82	-1,52	-1,63	5.259.169,13	1,44	183.820.888,05	2,86
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>12,23</b>	<b>-2,21</b>	<b>-5,08</b>	<b>26.581.545,10</b>	<b>7,30</b>		

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	4,48	-0,08	4,11	6.822.629,79	1,87	604.107.677,88	1,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF	8,22	-0,63	4,58	1.275.750,00	0,35	186.232.441,88	0,69
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>5,04</b>	<b>-0,17</b>	<b>4,19</b>	<b>8.098.379,79</b>	<b>2,22</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>6,12</b>	<b>-1,02</b>	<b>0,99</b>	<b>301.709.229,19</b>	<b>82,88</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

13,04%

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	43,83	-4,71	-18,15	13.319.762,88	3,66	634.870.630,59	2,10
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b>			<b>43,83</b>	<b>-4,71</b>	<b>-18,15</b>	<b>13.319.762,88</b>	<b>3,66</b>		

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	38,48	-4,70	-23,62	10.907.711,36	3,00	890.322.162,57	1,23
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,13	-4,93	-17,58	10.418.777,82	2,86	783.577.685,83	1,33
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	45,33	-2,96	-4,05	11.819.354,61	3,25	157.034.448,33	7,53
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>40,02</b>	<b>-4,16</b>	<b>-16,32</b>	<b>33.145.843,79</b>	<b>9,10</b>		

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	1,38	0,06	-0,26	1.002.376,11	0,28	125.714.403,01	0,80
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>			<b>1,38</b>	<b>0,06</b>	<b>-0,26</b>	<b>1.002.376,11</b>	<b>0,28</b>		

Renda Variável e Investimentos Estruturados 39,99 -4,23 -16,56 47.467.982,78 13,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,09%

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	28,45	-1,99	52,76	14.874.257,33	4,09	1.671.279.124,17	0,89
<b>Sub-total Artigo 9º A, III</b>			<b>28,45</b>	<b>-1,99</b>	<b>52,76</b>	<b>14.874.257,33</b>	<b>4,09</b>		
Investimentos no Exterior			28,45	-1,99	52,76	14.874.257,33	4,09		
<b>Total</b>			<b>8,62</b>	<b>-1,49</b>	<b>-0,76</b>	<b>364.051.469,30</b>	<b>100,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>							
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	19.188.767,46	5,27	0,00	47,50	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	247.840.536,84	68,08	0,00	20,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	26.581.545,10	7,30	0,00	5,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	8.098.379,79	2,22	0,00	2,50	5,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>301.709.229,19</b>	<b>82,88</b>				
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	13.319.762,88	3,66	0,00	10,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	33.145.843,79	9,10	0,00	13,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.002.376,11	0,28	0,00	1,00	5,00	5,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>47.467.982,78</b>	<b>13,04</b>				
<b>Investimentos no Exterior</b>							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	14.874.257,33	4,09	0,00	1,00	10,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>14.874.257,33</b>	<b>4,09</b>				

## 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	0,77 490,34	5,06 222,48	2,17 423,05	2,73 218,06	7,42 209,50	146.567,29	935.918,47
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-1,06 -677,16	1,20 52,91	0,57 111,29	4,38 350,49	3,71 104,62	-2.675.633,54	3.226.899,93
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-2,21 -1.408,77	-5,08 -223,04	-0,51 -98,70	1,95 155,68	-3,10 -87,50	-616.529,17	-1.328.633,56
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,17 -106,31	4,19 183,96	1,33 260,53	5,22 417,40	6,75 190,65	-13.536,66	325.375,38
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,71 0,09	-18,15 0,05	-0,49 -0,01	29,15 -0,41	-9,67 0,01	-658.425,89	-2.953.314,46
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,16 0,64	-16,32 1,87	0,67 1,15	27,55 -2,01	-7,69 1,99	-1.437.528,07	-5.569.202,76
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,06 4,85	-0,26 17,93	0,32 0,79	0,40 -29,16	0,13 9,81	585,53	-2.645,44
Artigo 9º A, III % do CDI	-1,99 -1.270,48	52,76 2.318,55	14,98 2.925,84	43,04 3.441,04	61,21 1.727,74	-302.671,19	2.829.915,88
<b>VILA VELHA - CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>-5.557.171,70</b>	<b>-2.535.686,56</b>

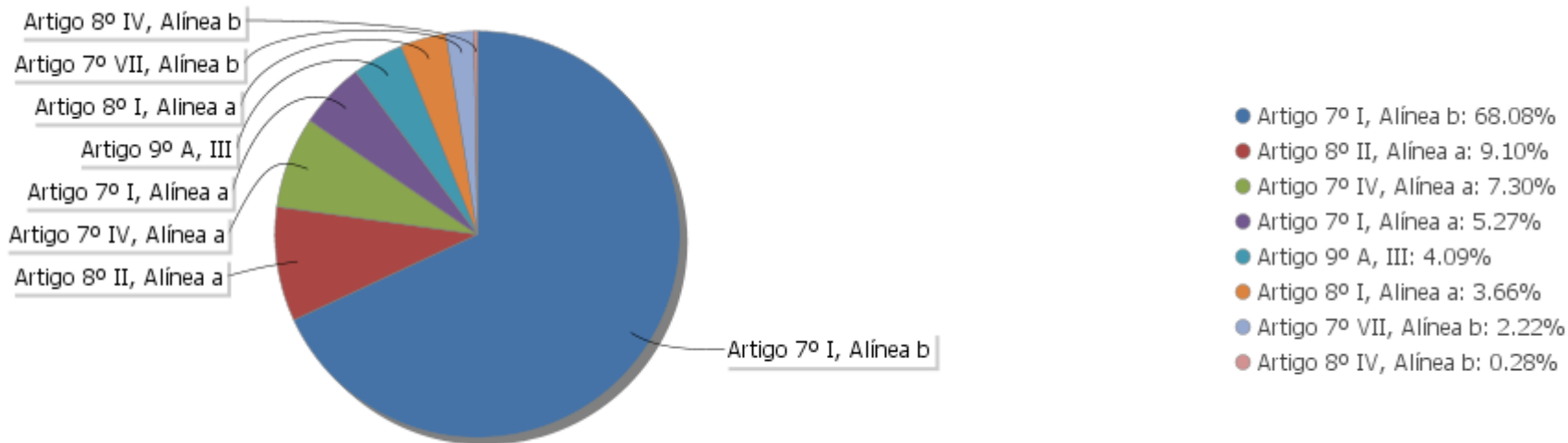
## Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	250.594.337,25	68,83	250.594.337,25	68,83
de 31 a 364 dias	23.240.508,54	6,38	273.834.845,79	75,22
acima de 365 dias	90.216.623,51	24,78	364.051.469,30	100,00

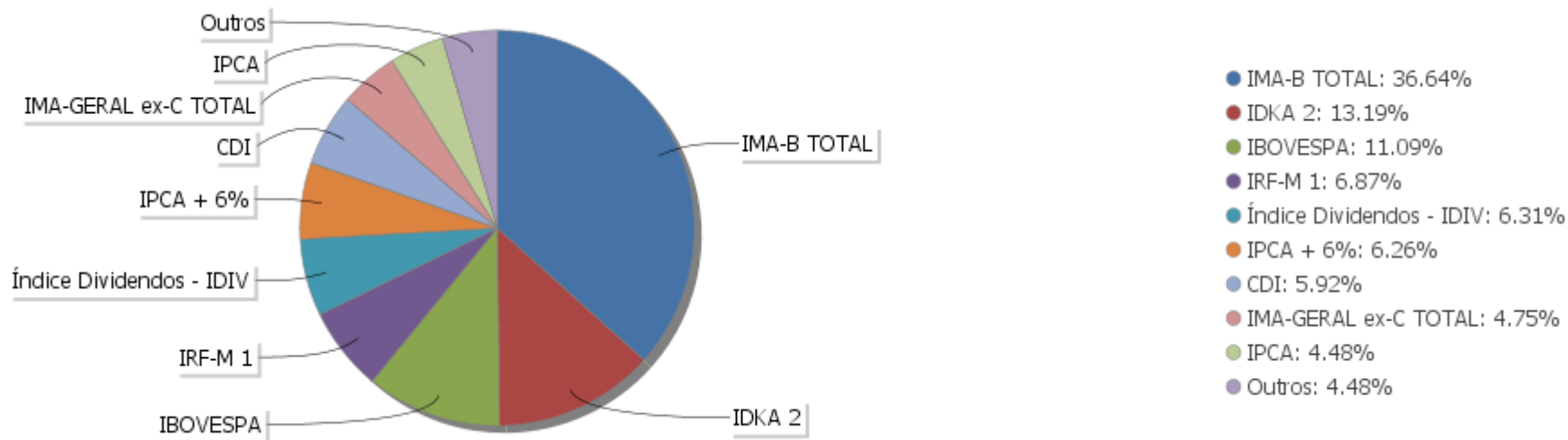


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

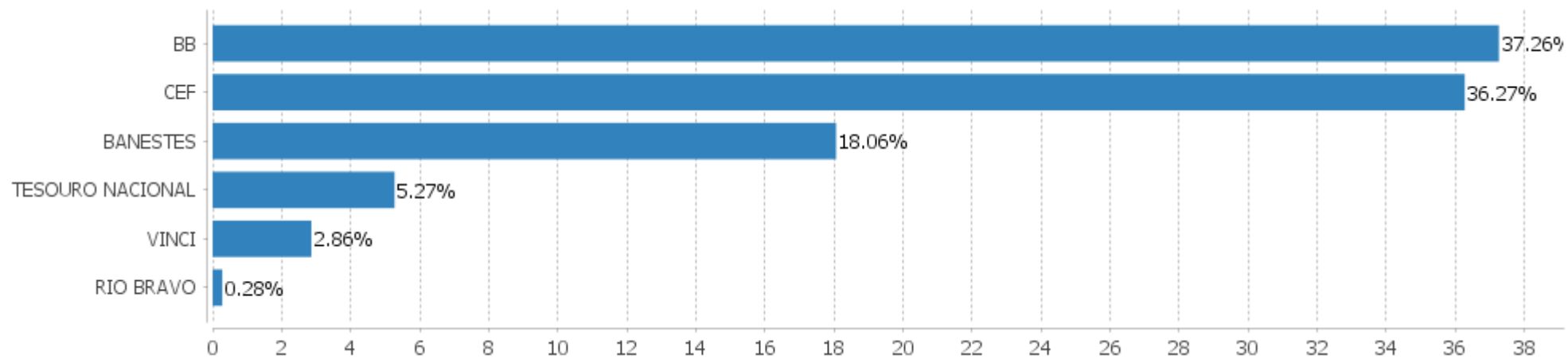


Alocação Por Estratégia



## 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				-0,76
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12				5,75
p.p. indexador	-0,22	-1,45	-7,55	1,75	1,95	1,28	2,06	-1,21	-2,61				-6,51
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

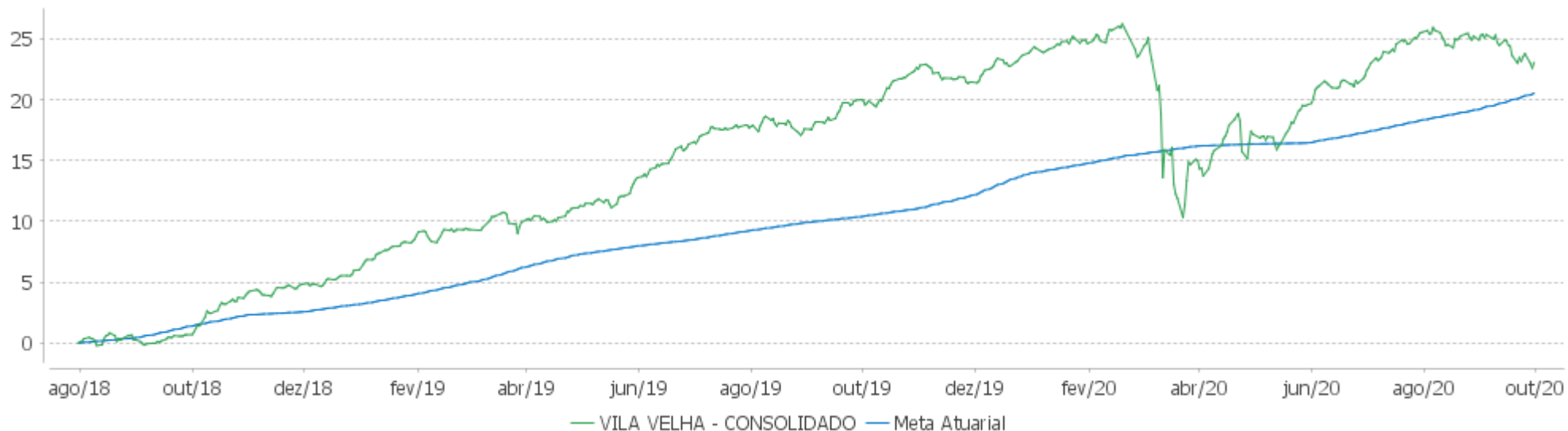
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

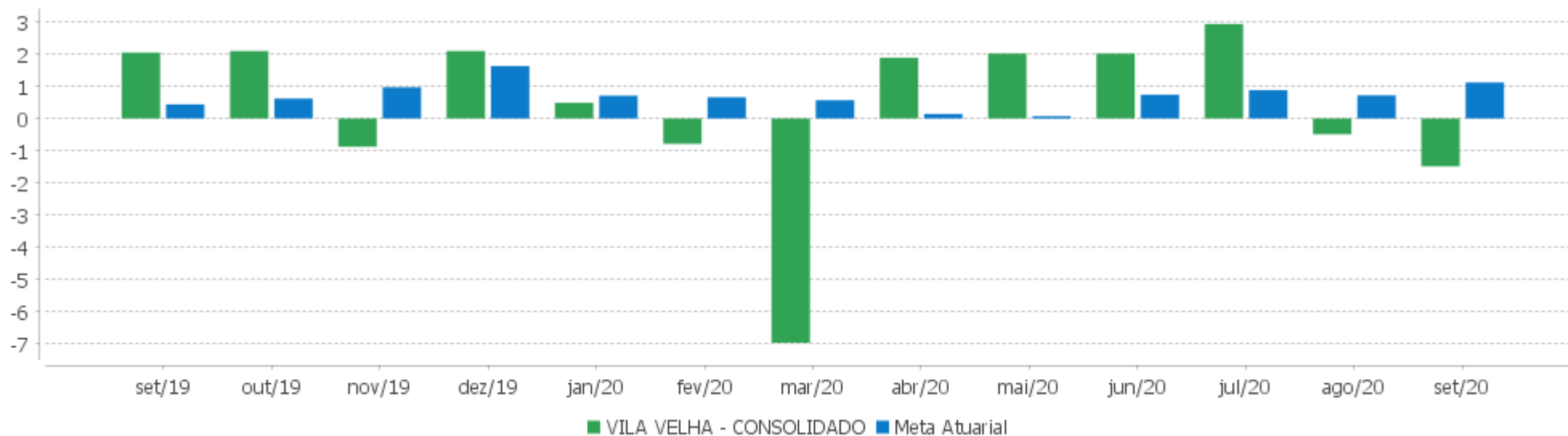
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	15	57,69	03 meses	0,91	2,75	-1,83	4,40
Meses abaixo da Meta Atuarial	11	42,31	06 meses	7,01	3,73	3,29	5,99
			12 meses	2,55	9,22	-6,68	8,62
			24 meses	22,23	19,10	3,13	6,47
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,39	2018-10	Desde 31/07/2018	23,06	20,73	2,33	6,27
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
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-4,96 -3,45	-10,53 -9,81	-2,38 -3,34	3,34 -2,63	-8,82 -10,92	28,45 -5,69	27,13 -10,43
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	-1,52 -968,06	-1,63 -71,67	-0,33 -63,89	-0,92 -73,37	1,86 52,59	22,52 224,33	
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	-0,00 -0,19	1,42 62,49	0,18 34,55	0,66 53,10	2,40 67,81	7,66 76,30	13,60 78,36
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO % do CDI	0,02 9,90	0,44 19,36	0,06 11,11	0,16 12,69	0,93 26,15	4,14 41,26	7,88 45,39
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,09 55,34	1,64 71,97	0,29 57,43	0,83 66,45	2,68 75,66	8,21 81,83	14,47 83,39
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,14 1,38	5,03 5,75	1,45 0,49	5,75 -0,22	7,75 5,64	29,23 -4,91	35,28 -2,28
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP Var. IMA-B 5 p.p.	0,19 0,32	5,23 0,73	1,81 0,51	5,65 0,54	7,79 0,55	27,37 3,62	33,98 2,14
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,04 -0,11	2,83 -0,29	0,36 -0,14	1,43 -0,23	4,17 -0,37	11,70 -0,63	18,97 -0,94
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI Var. IPCA + 6% p.p.	0,19 -0,94	4,71 -1,13	1,65 -1,13	5,20 1,41	7,26 -2,06	25,36 6,15	43,00 11,01
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,61 -0,05	4,41 -0,20	-0,30 -0,07	3,01 -0,13	6,31 -0,25	24,12 -0,38	30,74 -0,90
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-2,64 -0,04	-4,82 -0,27	0,65 -0,10	6,56 -0,22	-2,10 -0,43	40,97 -1,45	39,57 -1,69
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,77 0,74	4,64 5,36	0,74 -0,22	5,94 -0,03	7,66 5,55	33,03 -1,11	36,92 -0,64
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,26 1,26	3,97 4,68	1,04 0,08	4,82 -1,15	6,65 4,55	25,37 -8,77	31,82 -5,75
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,98 -0,06	5,16 -0,24	-0,68 -0,08	3,70 -0,20	7,33 -0,28	29,68 -0,32	35,97 -0,97
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IPCA + 6% p.p.	0,88 -0,25	6,13 0,28	2,52 -0,26	3,42 -0,36	8,88 -0,44	16,01 -3,20	28,26 -3,73
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-5,05 -3,54	-9,84 -9,12	-1,55 -2,51	3,14 -2,83	-7,24 -9,35	33,89 -0,25	32,47 -5,09
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	-0,23	5,12	0,26	2,49	6,68	19,42	27,61

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.	-0,38	2,00	-0,25	0,83	2,14	7,10	7,70
<b>BB PREV RF VII</b>	<b>0,19</b>	<b>2,64</b>	<b>0,98</b>	<b>3,41</b>	<b>5,12</b>	<b>17,74</b>	<b>26,32</b>
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,70	3,36	0,02	-2,56	3,01	-16,40	-11,25
<b>BB PREV RF IDKA2</b>	<b>0,11</b>	<b>4,55</b>	<b>1,61</b>	<b>5,24</b>	<b>7,28</b>	<b>20,27</b>	<b>29,41</b>
Var. IDKA 2 p.p.	0,10	-0,86	-0,38	-0,17	-0,72	-1,61	-2,85
<b>BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI</b>	<b>-0,75</b>	<b>1,86</b>	<b>0,10</b>	<b>3,07</b>	<b>3,70</b>	<b>21,50</b>	<b>27,56</b>
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,04	-0,10	-0,15	0,08	-0,19	0,39	0,18
<b>BB PREV RF IPCA</b>	<b>-0,30</b>	<b>5,57</b>	<b>1,48</b>	<b>6,07</b>	<b>8,40</b>	<b>30,87</b>	<b>36,57</b>
Var. IPCA + 6% p.p.	-1,43	-0,28	-1,30	2,28	-0,92	11,66	4,58
<b>FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF</b>	<b>-0,77</b>	<b>4,64</b>	<b>0,74</b>	<b>5,94</b>	<b>7,67</b>	<b>33,02</b>	<b>36,94</b>
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,74	5,36	-0,22	-0,03	5,56	-1,12	-0,63
<b>FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF</b>	<b>-0,50</b>	<b>4,53</b>	<b>-0,09</b>	<b>3,18</b>	<b>6,41</b>	<b>25,88</b>	<b>33,17</b>
Var. IPCA p.p.	-1,14	3,19	-1,34	2,37	3,27	19,76	22,25
<b>FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP</b>	<b>0,04</b>	<b>4,84</b>	<b>1,66</b>	<b>5,27</b>	<b>7,35</b>	<b>20,53</b>	<b>29,77</b>
Var. IDKA 2 p.p.	0,02	-0,57	-0,33	-0,15	-0,65	-1,35	-2,49
<b>BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI</b>	<b>-1,56</b>	<b>-0,93</b>	<b>0,83</b>	<b>5,77</b>	<b>1,83</b>	<b>33,39</b>	<b>36,49</b>
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,04	-0,21	-0,13	-0,20	-0,28	-0,75	-1,07
<b>NTN-B 150545 (5,100000%) ..</b>	<b>0,81</b>	<b>5,43</b>	<b>2,29</b>	<b>2,97</b>	<b>7,92</b>	<b>17,09</b>	
Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,32	6,15	1,33	-3,00	5,82	-17,05	
<b>NTN-B 150545 (4,290000%) ..</b>	<b>0,74</b>	<b>4,82</b>	<b>2,08</b>	<b>2,57</b>	<b>7,09</b>	<b>12,66</b>	
Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,26	5,54	1,12	-3,40	4,98	-21,48	
<b>NTN-B 150545 (3,680000%) ..</b>	<b>0,69</b>	<b>4,36</b>	<b>1,93</b>	<b>2,27</b>	<b>6,47</b>	<b>11,57</b>	
Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,21	5,08	0,97	-3,70	4,36	-22,57	
<b>FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF</b>	<b>-0,63</b>	<b>4,58</b>	<b>1,00</b>	<b>6,07</b>	<b>7,34</b>	<b>25,93</b>	<b>33,28</b>
Var. IPCA + 6% p.p.	-1,76	-1,27	-1,78	2,28	-1,98	6,72	1,29
<b>BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI</b>	<b>-0,08</b>	<b>4,11</b>	<b>1,40</b>	<b>5,06</b>	<b>6,65</b>	<b>21,92</b>	<b>31,74</b>
Var. IPCA + 6% p.p.	-1,21	-1,73	-1,38	1,27	-2,68	2,71	-0,25
<b>JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII</b>	<b>0,06</b>	<b>-0,26</b>	<b>0,32</b>	<b>0,40</b>	<b>0,13</b>	<b>0,32</b>	<b>0,05</b>
Var. IFIX p.p.	-0,40	12,33	0,72	-11,66	-3,99	-30,60	-25,79
<b>FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA</b>	<b>-4,71</b>	<b>-18,15</b>	<b>-0,49</b>	<b>29,15</b>	<b>-9,67</b>	<b>18,59</b>	<b>26,05</b>
Var. IBOVESPA p.p.	0,09	0,05	-0,01	-0,41	0,01	-0,64	-1,29
<b>BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL</b>	<b>-2,96</b>	<b>-4,05</b>	<b>4,70</b>	<b>48,11</b>	<b>5,50</b>	<b>60,57</b>	<b>61,54</b>
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,67	17,03	8,01	33,33	15,30	22,72	31,05
<b>FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS</b>	<b>-4,93</b>	<b>-17,58</b>	<b>-0,96</b>	<b>19,42</b>	<b>-6,98</b>	<b>43,54</b>	<b>33,91</b>
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,30	3,49	2,35	4,64	2,83	5,70	3,42
<b>BB AÇÕES DIVIDENDOS</b>	<b>-4,70</b>	<b>-23,62</b>	<b>-1,71</b>	<b>18,99</b>	<b>-16,46</b>	<b>13,75</b>	<b>13,73</b>

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

<b>Fundo</b> Variação da Estratégia	<b>No Mês</b>	<b>No Ano</b>	<b>3 meses</b>	<b>6 meses</b>	<b>12 meses</b>	<b>24 meses</b>	<b>36 meses</b>
Var. IBOVESPA p.p.	0,10	-5,43	-1,24	-10,57	-6,77	-5,49	-13,61
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-1,99	52,76	14,98	43,04	61,21	70,33	154,87
Var. IBOVESPA p.p.	2,80	70,95	15,46	13,48	70,90	51,09	127,53
VILA VELHA - CONSOLIDADO	-1,49	-0,76	0,91	7,01	2,55	22,23	
Var. IPCA + 5,87% p.p.	-2,61	-6,51	-1,83	3,29	-6,64	3,31	
CDI	0,16	2,28	0,51	1,25	3,54	10,04	17,36
IBOVESPA	-4,80	-18,20	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34
INPC + 6%	1,36	6,58	3,22	4,50	10,12	20,11	32,29
IPCA + 6%	1,13	5,85	2,78	3,79	9,32	19,21	31,99

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
<b>Renda Fixa</b>							
IRF-M 1	0,15	3,12	0,51	1,66	4,54	12,32	19,91
IRF-M 1+	-0,91	5,40	-0,59	3,90	7,61	30,00	36,94
IRF-M TOTAL	-0,56	4,62	-0,24	3,15	6,56	24,50	31,64
IMA-B 5	-0,12	4,51	1,30	5,11	7,24	23,75	31,84
IMA-B 5+	-2,60	-4,56	0,75	6,78	-1,67	42,42	41,26
IMA-B TOTAL	-1,51	-0,72	0,96	5,97	2,11	34,14	37,56
IMA-C TOTAL	2,95	17,78	9,60	18,32	19,95	48,39	67,40
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,71	1,96	0,25	2,99	3,90	21,11	27,38
IMA-GERAL TOTAL	-0,60	2,41	0,53	3,43	4,35	21,85	28,42
IDKA 2	0,02	5,41	1,99	5,41	8,00	21,88	32,26
IDKA 20	-4,30	-11,82	0,58	7,11	-8,89	56,79	46,43
CDI	0,16	2,28	0,51	1,25	3,54	10,04	17,36
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	-4,80	-18,20	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34
IBRX 100	-4,58	-17,42	-0,04	30,33	-8,59	23,26	30,47
IBRX 50	-4,62	-18,06	-0,37	31,30	-10,02	16,09	24,57
SMALL CAP	-5,44	-18,93	2,27	35,50	-1,78	54,49	42,68
IFIX	0,46	-12,59	-0,41	12,06	4,12	30,92	25,84
Índice Consumo - ICON	-3,96	-9,26	1,83	42,00	-1,04	53,03	27,90
Índice Dividendos - IDIV	-4,63	-21,08	-3,31	14,78	-9,81	37,85	30,49
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	0,64	1,34	1,24	0,81	3,14	6,12	10,92
INPC	0,87	2,04	1,68	1,49	3,89	6,93	11,17
IGPM	4,34	14,40	9,59	12,51	17,94	21,91	34,14
SELIC	0,16	2,28	0,51	1,25	3,54	10,04	17,37
<b>Meta Atuarial</b>							



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
424	02/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	321.897,70	0,00	152.571,48684000	2,1098155800
389	02/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	813.956,44	100.283,71584357	8,1165365000
419	02/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	24.147,48	0,00	12.876,83607383	1,8752650000
398	02/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	247.644,31	30.511,08191283	8,1165365000
420	04/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	65.459,93	34.904,14413838	1,8754200000
402	04/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	804,93	0,00	99,17014084	8,1166568200
425	09/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	13.227,23	6.268,56898600	2,1100876500
426	10/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.124,99	1.480,93176200	2,1101512440
427	11/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	23.816,44	11.286,47626700	2,1101749950
428	14/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	992,00	470,10241900	2,1101784630
393	14/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	556.319,63	0,00	68.537,98098522	8,1169538700
404	14/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.308.813,68	0,00	161.244,43984305	8,1169538700
421	15/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	192.184,06	0,00	102.449,86363762	1,8758840000
408	15/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.991,06	0,00	245,29463516	8,1170140500
390	16/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	169.081,51	20.830,35191215	8,1170741000
399	16/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	15.172,14	1.869,16366822	8,1170741000
409	17/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.177.123,93	0,00	145.017,18890595	8,1171338300
429	18/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	18.004,07	8.532,63300600	2,1100251220
432	18/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	418,83	0,00	51,59788129	8,1171937600
387	21/09/2020	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	0,00	1.026.786,99	125.716,77760225	8,1674618900
386	21/09/2020	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	0,00	1.308.775,34	160.242,60138911	8,1674618900
385	21/09/2020	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	0,00	3.664.437,67	448.662,96523362	8,1674618900
411	21/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	7.192.876,07	0,00	886.121,87300214	8,1172537200
388	21/09/2020	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	3.000.000,00	793.869,19378659	3,7789600900
413	21/09/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.807.123,93	0,00	777.676,37885003	2,3237480000
430	24/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	269.732,10	0,00	127.831,26852000	2,1100635480
391	24/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	169.882,21	20.928,06783180	8,1174340300
405	24/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	111.701,87	13.760,73640847	8,1174340300

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

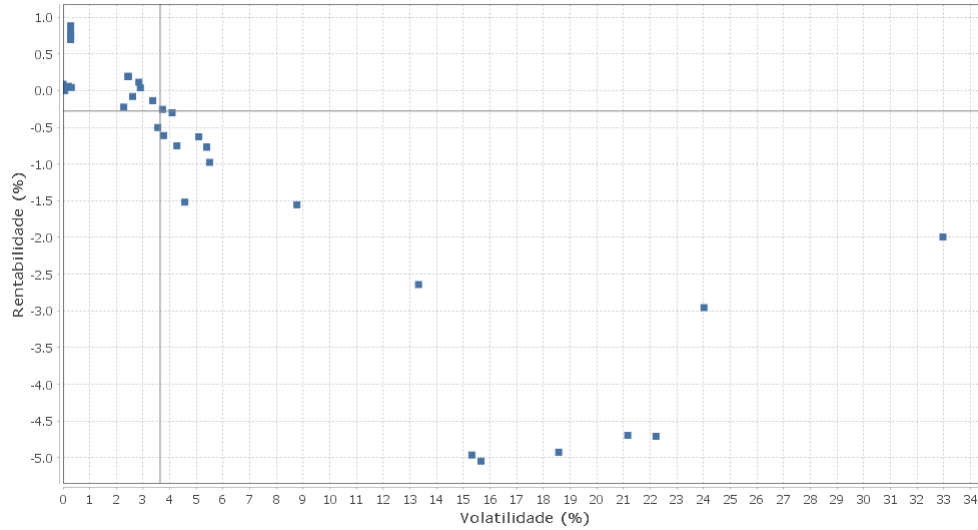
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
401	24/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	738,10	90,92774851	8,1174340300
400	24/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	116.017,09	14.292,33543152	8,1174340300
395	25/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	5.156.290,74	0,00	635.207,18635943	8,1174943400
412	25/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	740,28	0,00	91,19562872	8,1174943400
431	29/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	59.625,74	28.261,46059700	2,1097897540
394	29/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	556.364,98	68.537,98053704	8,1176156000
396	29/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.803.471,65	468.545,42484126	8,1176156000
392	29/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	488.954,47	60.233,75509429	8,1176156000
422	29/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	57.799,64	0,00	30.799,20710198	1,8766600000
406	29/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	406.879,77	50.123,06446243	8,1176156000
403	29/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	805,01	99,16828286	8,1176156000
397	30/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	567.509,07	69.910,28776047	8,1176760700
423	30/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	268.458,64	143.045,27161209	1,8767390000
407	30/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	21.506,16	2.649,30009704	8,1176760700

**Total**

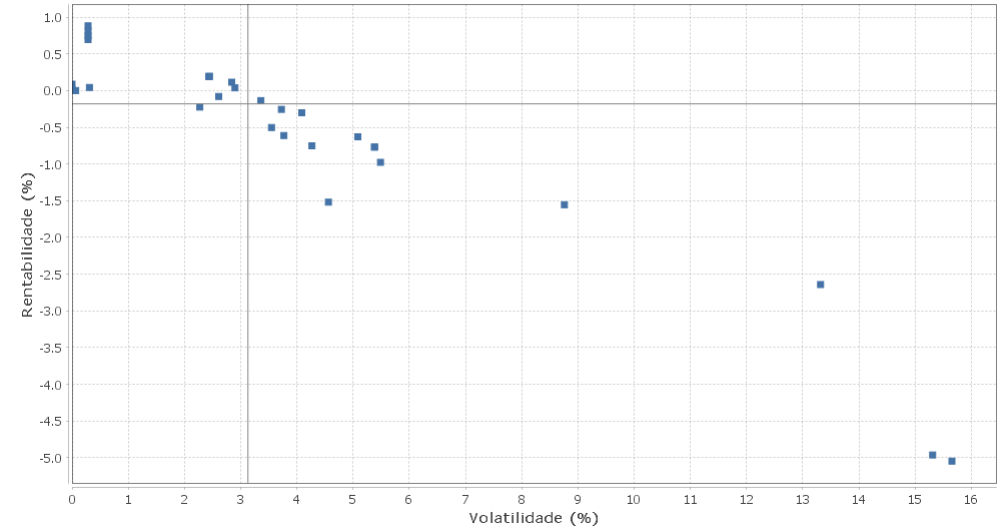
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

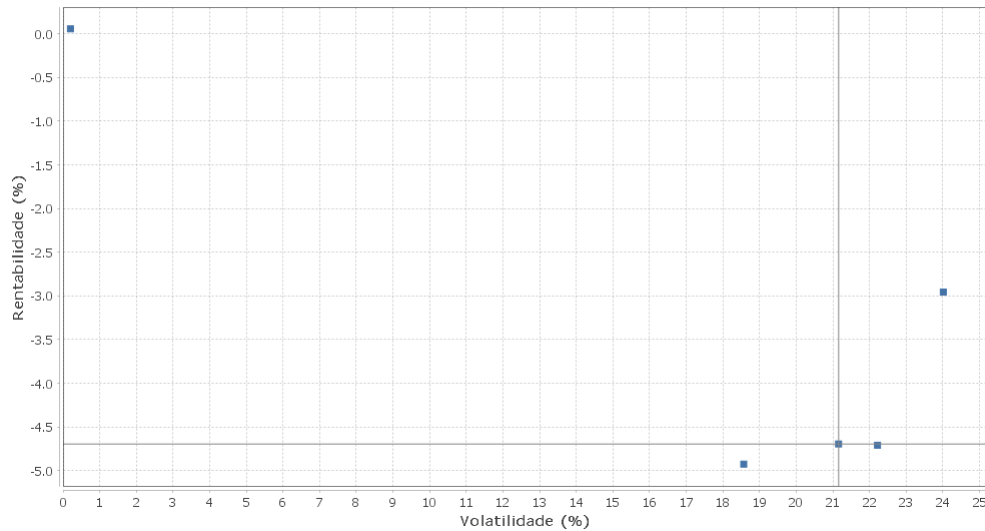
VILA VELHA - CONSOLIDADO - No Mês



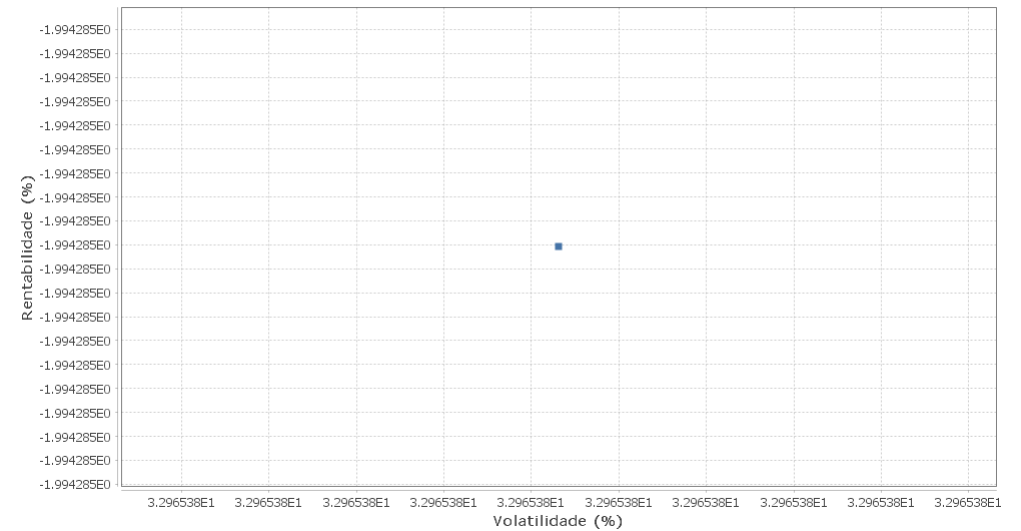
Renda Fixa - No Mês



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\$): 8.136.533,39

Value-At-Risk: 2,23%

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	-1.392,80	0,02	9.927.836,34	2,73
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,01	0,00	-140,08	0,09	569.817,37	0,16
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,04	0,00	-2,43	-0,00	5.091.326,85	1,40
JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISA CAPITAL PROTEGIDO FII	Artigo 8º IV, Alínea b	0,20	0,02	-0,00	-0,49	0,06	1.002.376,11	0,28
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,28	0,13	-0,00	2,55	0,88	6.400.445,61	1,76
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,28	0,13	-0,00	1,89	0,69	6.361.985,62	1,75
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,28	0,13	-0,00	2,06	0,74	323.112,56	0,09
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	Artigo 7º I, Alínea a	0,28	0,13	-0,00	2,29	0,81	12.503.669,28	3,43
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,31	0,14	0,00	-0,37	0,04	12.470.772,30	3,43
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	2,27	0,83	0,02	-0,17	-0,23	11.750.369,13	3,23
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	2,43	0,55	0,00	0,01	0,19	1.529.643,55	0,42
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,44	0,97	0,01	0,01	0,19	3.427.606,14	0,94
BB PREVIDENCIÁRIO XI TP	Artigo 7º I, Alínea b	2,44	0,98	0,01	0,01	0,19	6.464.650,67	1,78
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	2,61	0,87	0,01	-0,09	-0,08	6.822.629,79	1,87
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,84	0,94	0,04	-0,02	0,11	21.005.290,80	5,77
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,90	1,03	0,05	-0,04	0,04	25.488.119,96	7,00
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,36	1,16	0,01	-0,09	-0,14	2.413.325,27	0,66
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,55	1,33	0,05	-0,19	-0,50	15.789.713,48	4,34
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,72	1,11	0,01	-0,11	-0,26	5.471.392,30	1,50
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,77	1,39	0,01	-0,20	-0,61	2.679.862,67	0,74
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	4,09	1,32	0,01	-0,11	-0,30	4.140.486,66	1,14
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,27	1,43	0,05	-0,21	-0,75	16.728.347,00	4,60
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	4,56	1,15	0,00	-0,37	-1,52	5.259.169,13	1,44
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF	Artigo 7º VII, Alínea b	5,08	1,75	0,00	-0,15	-0,63	1.275.750,00	0,35
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,38	1,83	0,06	-0,17	-0,77	14.739.896,70	4,05
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,38	1,83	0,08	-0,17	-0,77	19.617.779,36	5,39
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	5,49	1,97	0,02	-0,21	-0,98	5.653.669,86	1,55

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	8,76	3,22	0,28	-0,20	-1,56	39.172.328,96	10,76
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	13,32	5,13	0,13	-0,21	-2,64	11.622.511,85	3,19
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	15,31	5,43	0,01	-0,33	-4,96	5.733.395,41	1,57
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	15,66	5,47	0,04	-0,33	-5,05	21.274.324,57	5,84
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	18,57	10,57	0,27	-0,27	-4,93	10.418.777,82	2,86
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	21,16	11,35	0,31	-0,23	-4,70	10.907.711,36	3,00
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	22,22	11,46	0,37	-0,22	-4,71	13.319.762,88	3,66
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	24,01	11,94	0,33	-0,13	-2,96	11.819.354,61	3,25
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	32,97	12,73	0,08	-0,07	-1,99	14.874.257,33	4,09