



IPAJM - ESTADO DO ESPÍRITO
AGOSTO 2020
SANTO



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 08.10.2020.

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

RENTA FIXA **83,52%**

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 150820	4,33	0,04	0,98	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830	13,63	-1,91	3,16	115.747.104,90	2,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822	4,96	0,85	5,21	407.600.977,63	8,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	6,04	0,68	6,03	77.221.355,34	1,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150521	2,15	0,69	2,98	318.604.570,29	6,58
TESOURO NACIONAL	LFT 010324	0,07	0,16	2,08	112.145.209,58	2,32
TESOURO NACIONAL	LFT 010921	0,07	0,16	2,11	247.118.548,43	5,10
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		3,41	0,35	3,57	1.278.437.766,17	26,39

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
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	5,92	-0,80	5,01	50.048.478,63	1,03	5.055.871.049,38	0,99
BRB	BRB	35-BRB MILLENIUM	0,08	0,12	1,73	1.389.997,02	0,03	55.003.760,79	2,53
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	22,96	-3,55	-5,04	34.631.325,05	0,71	288.523.008,49	12,00
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,54	0,09	2,78	303.814.906,74	6,27	7.749.783.927,00	3,92
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,54	-1,85	0,64	25.686.066,62	0,53	5.638.549.883,16	0,46
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,61	-1,83	0,54	13.940.662,00	0,29	6.019.680.821,86	0,23
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,10	2,83	40.345.062,16	0,83	10.245.504.415,29	0,39
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	0,39	4,45	34.727.616,89	0,72	12.740.710.327,20	0,27
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,12	0,69	4,43	41.656.778,67	0,86	6.452.433.505,43	0,65

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 IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,35	-3,69	-2,23	7.565.277,57	0,16	1.987.566.192,50	0,38
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,46	-3,64	-2,24	10.811.622,87	0,22	1.873.284.904,48	0,58
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	8,77	-1,18	6,20	21.009.980,13	0,43	3.267.192.376,45	0,64
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	4,03	0,79	4,80	33.204.026,69	0,69	8.901.363.723,20	0,37
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,90	-0,77	5,06	36.863.837,43	0,76	16.114.955.012,29	0,23
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	4,20	-0,18	5,36	1.411.824,97	0,03	194.803.588,72	0,72
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,12	-0,89	2,63	662.243.151,49	13,67	10.897.747.304,90	6,08
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,93	-0,56	5,06	697.127.924,72	14,39	13.462.808.031,45	5,18
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			5,03	-0,62	3,45	2.016.478.539,65	41,63		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	12,53	-1,85	0,56	2.056.226,21	0,04	2.909.854.221,69	0,07
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,53	-1,85	0,56	2.056.226,21	0,04		

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	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,07	0,07	0,34	654.457,63	0,01	90.629.040,62	0,72
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,92	0,34	-0,75	14.462.881,46	0,30	328.244.713,37	4,41
BRB	BRB	33-BRB TESOIRO	0,08	0,07	1,34	2.586,88	0,00	262.569.325,18	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,05	0,02	0,42	67.983.166,25	1,40	890.783.861,56	7,63
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,29	0,14	1,77	130.268.027,24	2,69	4.687.255.346,64	2,78
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	26,14	-3,63	-5,86	32.198.146,15	0,66	275.989.890,48	11,67
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,18	1,79	325.190.221,90	6,71	2.572.617.697,19	12,64
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,07	0,08	1,42	282.882,41	0,01	1.775.186.405,18	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,07	0,08	0,81	162,06	0,00	496.713.163,83	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,92	0,40	-0,55	170.444.065,51	3,52	2.028.417.251,32	8,40
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,58	-0,64	-0,11	7.217.976,02	0,15	184.359.376,17	3,92
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,28	0,04	0,47	748.704.573,51	15,46		
Renda Fixa			3,64	-0,19	2,94	4.045.677.105,54	83,52		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

13,62%

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 BRASIL IBX-50	44,80	-3,25	-14,62	145.136.507,79	3,00	1.002.237.416,93	14,48
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	44,14	-3,27	-13,42	98.941.054,31	2,04	942.280.344,59	10,50
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	42,73	-3,37	-14,06	9.147.800,43	0,19	115.299.415,24	7,93
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	43,48	-3,43	-14,10	65.784.404,35	1,36	683.983.509,09	9,62
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			44,26	-3,29	-14,21	319.009.766,88	6,59		

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	38,15	-3,41	-19,86	123.167.206,89	2,54	937.612.766,29	13,14
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	38,93	-3,82	-13,31	29.617.274,64	0,61	819.770.596,51	3,61
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	47,51	-1,38	-15,36	149.786.501,90	3,09	1.226.260.606,95	12,21
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	44,95	-0,43	-1,13	5.466.496,38	0,11	157.969.354,10	3,46
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			42,19	-2,42	-16,50	308.037.479,81	6,36		

Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIP CAIXA CYRELA	25,49	-0,15	-10,17	1.640.122,98	0,03	127.132.151,28	1,29
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			25,49	-0,15	-10,17	1.640.122,98	0,03		

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
CEF	CEF	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	44,37	-9,97	4,03	31.000.000,00	0,64	154.350.188,72	20,08
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			44,37	-9,97	12,18	31.000.000,00	0,64		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

40,36

-3,24

-13,90

659.687.369,67

13,62

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,86%

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	27,07	15,16	55,87	114.049.556,62	2,35	1.583.297.843,04	7,20
BB	BB	BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	26,69	14,67	49,74	24.633.889,49	0,51	411.907.217,20	5,98
Sub-total Artigo 9º A, III			26,89	15,06	54,61	138.683.446,11	2,86		
Investimentos no Exterior			26,89	15,06	54,61	138.683.446,11	2,86		
Total						4.844.047.921,32	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos							
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	1.278.437.766,17	26,39	20,00	27,00	60,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	2.016.478.539,65	41,63	15,00	36,30	60,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	2.056.226,21	0,04	0,00	0,10	2,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	748.704.573,51	15,46	5,00	10,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	4.045.677.105,54	83,52				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	319.009.766,88	6,59	0,00	6,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	308.037.479,81	6,36	0,00	5,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	1.640.122,98	0,03	0,00	0,10	2,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	31.000.000,00	0,64	0,00	0,50	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	659.687.369,67	13,62				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	138.683.446,11	2,86	0,00	4,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	138.683.446,11	2,86				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

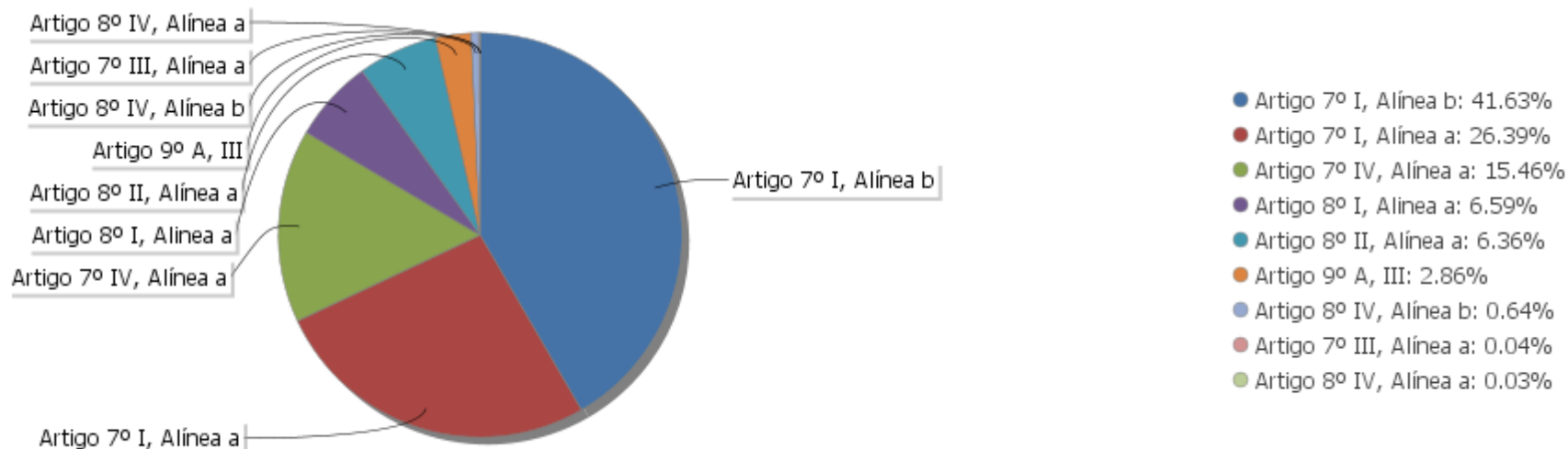
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,35 218,12	3,57 168,82	2,19 384,95	2,48 173,24	7,27 188,41	4.498.671,58	45.755.935,31
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,62 -387,60	3,45 163,29	1,52 268,58	2,38 166,15	6,71 173,92	-12.470.062,50	70.586.653,97
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-1,85 -1.157,00	0,56 26,64	4,54 799,81	-0,10 -7,09	6,26 162,08	-38.756,36	11.520,69
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,04 24,07	0,47 22,07	1,00 175,64	-0,22 -15,01	2,44 63,31	256.021,71	4.053.583,73
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,29 0,15	-14,21 -0,14	14,25 0,55	-4,96 -0,35	-2,06 -0,31	-10.607.457,23	-54.312.109,62
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,42 1,02	-16,50 -2,43	15,39 1,70	-9,39 -4,78	-2,79 -1,04	-7.650.600,69	-62.702.100,74
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,15 3,29	-10,17 3,90	-0,16 -13,85	-14,25 -9,64	-20,53 -18,78	-2.488,85	-250.246,77
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-9,97 -6,52	12,18 26,25	22,23 8,54	9,86 14,47	57,71 59,46	-3.460.000,00	3.473.000,00
Artigo 9º A, III % do CDI	15,06 9.419,82	54,61 2.581,68	21,82 3.843,52	54,57 3.805,54	67,68 1.753,21	16.880.602,07	43.079.914,53
						-12.594.070,27	49.696.151,10

Análise de Liquidez

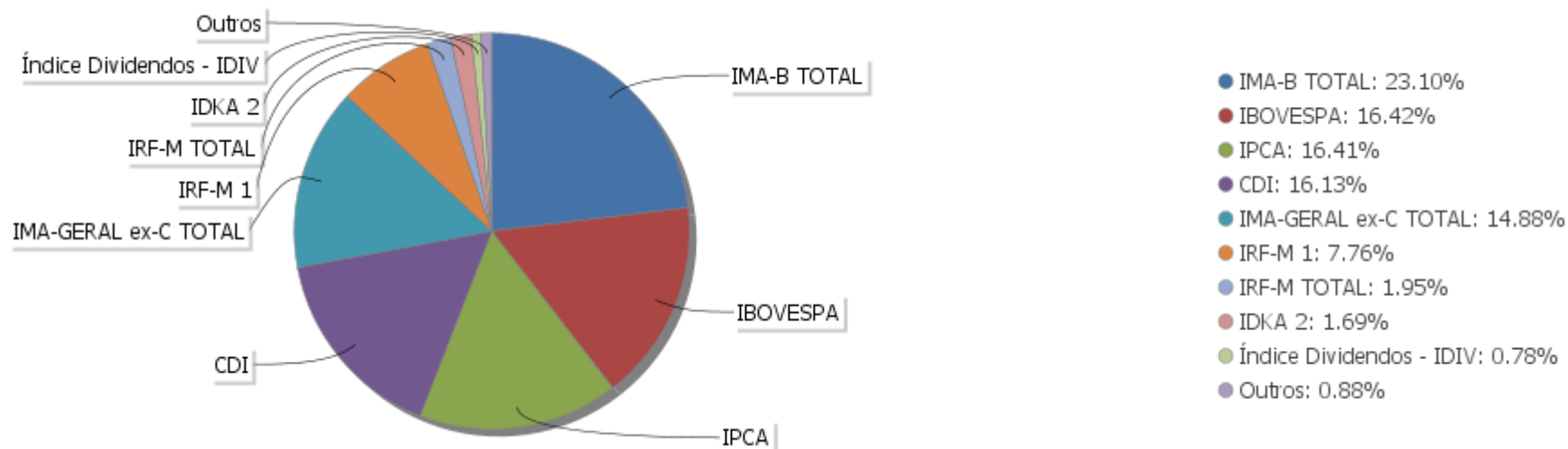
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	3.530.526.384,13	72,88	3.530.526.384,13	72,88
de 31 a 364 dias	353.688.341,31	7,30	3.884.214.725,44	80,19
acima de 365 dias	959.833.195,88	19,81	4.844.047.921,32	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

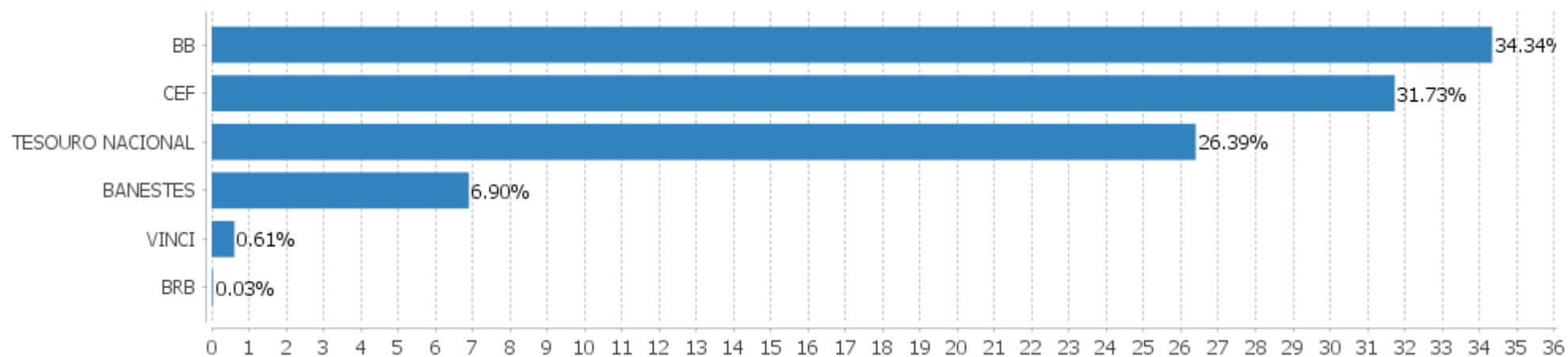


Alocação Por Estratégia



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	0,42	-0,92	-5,48	1,81	1,71	1,96	2,00	-0,26					1,01
IPCA + 5%	0,64	0,60	0,50	0,08	0,01	0,67	0,81	0,65					4,01
p.p. indexador	-0,22	-1,52	-5,98	1,74	1,70	1,29	1,19	-0,91					-3,00
2019	1,69	0,49	0,60	0,91	1,51	1,74	1,03	0,23	1,43	1,33	-0,10	1,02	12,53
IPCA + 5,5%	0,79	0,86	1,16	1,02	0,60	0,41	0,68	0,58	0,41	0,59	0,94	1,60	10,07
p.p. indexador	0,90	-0,37	-0,55	-0,11	0,91	1,32	0,35	-0,35	1,03	0,74	-1,04	-0,58	2,46
2018	1,29	0,58	1,11	0,44	-1,02	-0,00	1,12	0,18	0,62	1,87	0,52	0,84	7,80
IPCA + 5,75%	0,78	0,72	0,56	0,69	0,87	1,73	0,82	0,42	0,90	0,94	0,23	0,60	9,66
p.p. indexador	0,51	-0,14	0,56	-0,25	-1,89	-1,73	0,30	-0,24	-0,29	0,92	0,29	0,25	-1,86
2017	1,30	1,89	1,24	0,45	0,35	0,70	2,20	1,13	1,07	0,43	0,19	0,82	12,40
IPCA + 6%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	0,41	1,15	0,45	-0,11	-0,47	0,45	1,48	0,40	0,44	-0,48	-0,55	-0,09	3,35
2016	1,92	1,40	1,66	1,65	0,93	1,19	1,45	1,23	1,28	0,82	0,38	1,47	16,48
IPCA + 6%	1,74	1,34	0,94	1,08	1,27	0,86	1,01	0,98	0,57	0,72	0,64	0,81	12,64
p.p. indexador	0,18	0,05	0,72	0,57	-0,34	0,33	0,44	0,26	0,71	0,10	-0,26	0,66	3,84
2015	1,51	0,80	0,65	1,24	1,39	0,73	1,09	-0,17	0,72	1,96	0,91	1,67	13,20
IPCA + 6%	1,73	1,64	1,84	1,18	1,21	1,28	1,16	0,71	1,03	1,31	1,48	1,47	17,26
p.p. indexador	-0,22	-0,85	-1,19	0,06	0,19	-0,55	-0,07	-0,88	-0,31	0,64	-0,56	0,19	-4,06
2014	-1,15	2,71	0,90	1,75	2,50	0,76	1,06	2,33	-0,76	1,18	0,88	0,18	12,97
IPCA + 6%	1,06	1,16	1,36	1,14	0,95	0,87	0,54	0,74	1,08	0,96	0,98	1,29	12,82
p.p. indexador	-2,21	1,56	-0,46	0,61	1,55	-0,11	0,52	1,59	-1,84	0,22	-0,09	-1,12	0,15
2013	0,58	-0,48	-0,65	1,00	-1,62	-1,42	0,81	-0,81	0,75	0,72	-1,14	0,87	-1,43
IPCA + 6%	1,37	1,02	0,94	1,06	0,86	0,72	0,56	0,75	0,84	1,11	1,01	1,41	12,29
p.p. indexador	-0,80	-1,50	-1,58	-0,07	-2,48	-2,15	0,25	-1,56	-0,08	-0,38	-2,14	-0,54	-13,72
2012	1,48	1,67	1,59	3,31	1,29	-0,23	2,31	1,35	1,11	2,72	0,68	1,57	20,51
IPCA + 6%	1,07	0,89	0,72	1,11	0,87	0,54	0,94	0,95	1,01	1,10	1,07	1,26	12,16
p.p. indexador	0,41	0,78	0,87	2,20	0,42	-0,77	1,37	0,41	0,10	1,61	-0,38	0,31	8,35
2011	0,11	0,67	1,40	0,53	1,40	0,17	0,81	4,20	1,08	1,30	1,60	0,51	14,62
IPCA + 6%	1,32	1,27	1,28	1,21	0,98	0,64	0,65	0,91	1,02	0,90	0,99	1,01	12,87
p.p. indexador	-1,21	-0,60	0,12	-0,68	0,42	-0,47	0,17	3,30	0,06	0,40	0,61	-0,51	1,76

PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

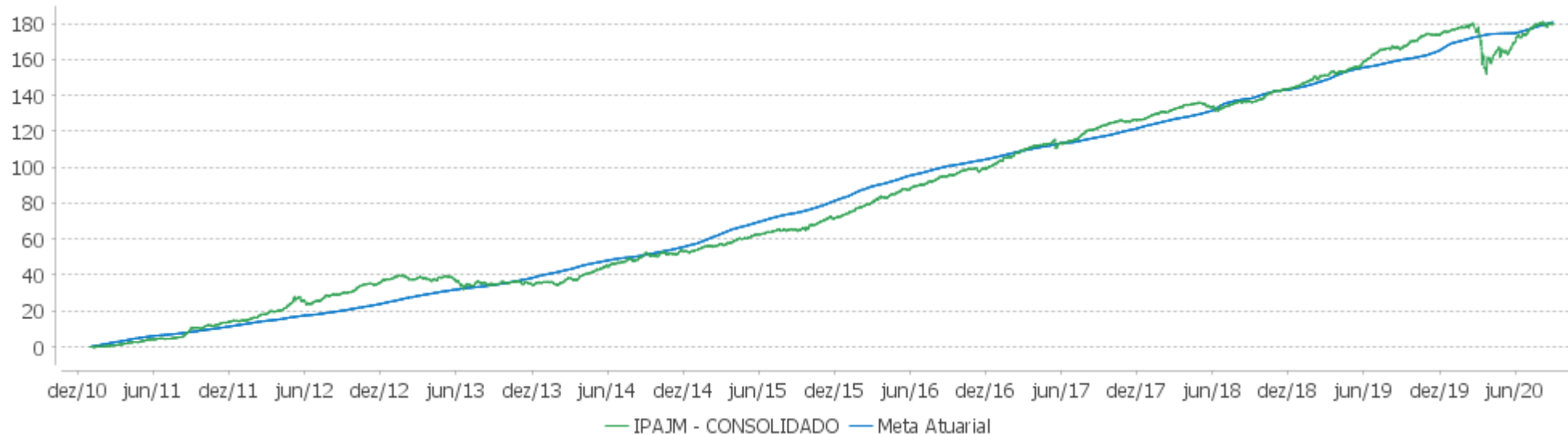
RELATÓRIO TRIMESTRAL

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

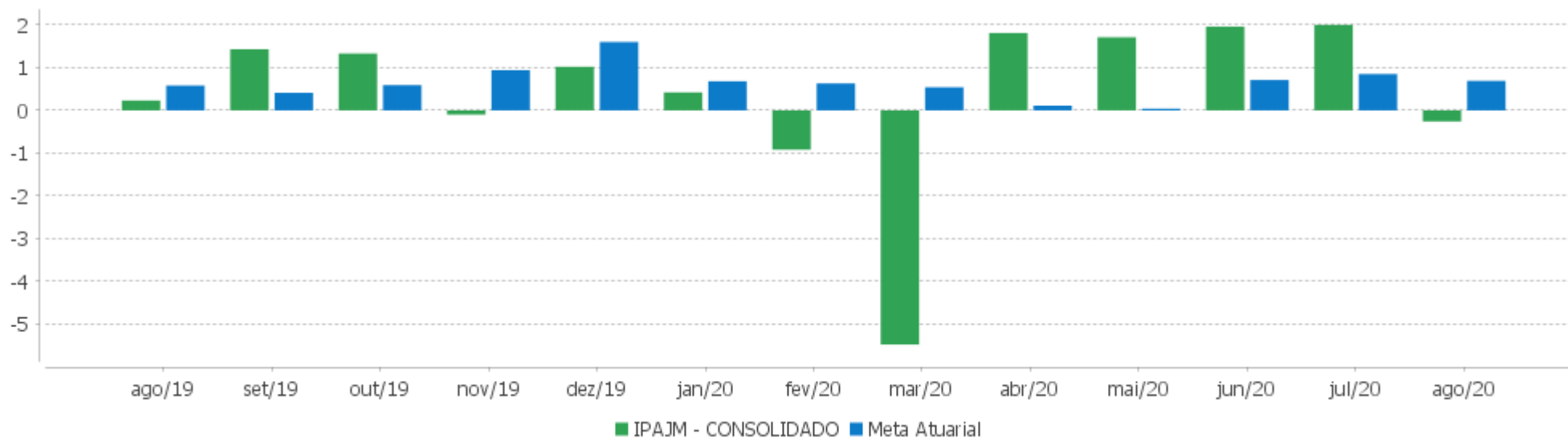
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	61	52,59	03 meses	3,73	2,14	1,59	3,66
Meses abaixo da Meta Atuarial	55	47,41	06 meses	1,53	2,73	-1,21	10,36
			12 meses	4,77	7,73	-2,96	7,53
			24 meses	18,09	17,57	0,52	5,50
			36 meses	25,62	29,58	-3,96	4,65
			Desde 31/12/2010	179,34	189,99	-10,65	3,67
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	4,20	2011-08					
Menor rentabilidade da Carteira	-5,48	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
NTN-B 150820 Var. IMA-B TOTAL p.p.							
LFT 010921	0,16	2,11	0,57	1,44	3,86	10,40	17,99
NTN-B 150822 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,85 2,64	5,21 4,40	2,88 -1,73	3,75 3,66	9,82 3,18	28,85 -7,15	36,33 -5,87
LFT 010324	0,16	2,08	0,58	1,42	3,84	10,39	
NTN-B 150523 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,68 2,47	6,03 5,22	3,01 -1,60	4,49 4,40	11,24 4,59	32,25 -3,75	39,67 -2,53
NTN-B 150521 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,69 2,49	2,98 2,17	1,92 -2,69	2,21 2,11	6,85 0,21	20,72 -15,28	29,26 -12,94
NTN-B 150830 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,91 -0,11	3,16 2,36	5,21 0,60	1,31 1,22	8,22 1,58	41,07 5,07	46,82 4,62
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,85 -0,05	0,56 -0,24	4,54 -0,07	-0,10 -0,19	6,26 -0,38	35,04 -0,95	41,14 -1,07
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,83 -0,03	0,54 -0,26	4,54 -0,07	-0,14 -0,23	6,20 -0,44	35,19 -0,80	41,02 -1,18
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,39 -0,03	4,45 -0,18	2,48 -0,07	3,24 -0,15	8,93 -0,32	24,43 -0,58	32,42 -0,91
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,09 -0,03	2,78 -0,18	0,58 -0,06	1,99 -0,13	4,77 -0,29	12,31 -0,53	19,76 -0,86
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,77 -0,02	5,06 -0,15	1,08 -0,03	3,53 -0,09	8,49 -0,22	26,36 -0,46	33,44 -0,90
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-3,64 -0,02	-2,24 -0,23	6,31 -0,07	-2,48 -0,13	4,26 -0,45	43,30 -1,41	46,76 -1,75
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO Var. IRF-M 1+ p.p.	-1,18 -0,05	6,20 -0,17	1,32 -0,04	4,26 -0,11	10,40 -0,23	32,83 -0,43	39,62 -0,96
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	-0,18 -0,30	5,36 2,39	0,97 0,33	3,87 1,74	7,98 2,92	20,55 7,71	29,10 8,49
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-3,55 -1,75	-5,04 -5,85	6,06 1,45	-5,64 -5,73	2,57 -4,07	40,28 4,29	42,92 0,72
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,69 -0,35	4,43 -0,96	2,73 -0,26	3,38 -0,74	8,67 -1,03	21,54 -1,98	30,37 -3,07
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	-0,89	2,63	1,82	1,67	6,05	23,16	30,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,21	-0,06	-0,06	-0,06	-0,11	0,44	0,25
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	-0,56	5,06	1,17	3,57	9,21	27,35	34,93
Var. IPCA p.p.	-0,80	4,36	0,30	3,33	6,77	21,40	24,54
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	0,79	4,80	2,82	3,70	8,84	21,88	30,88
Var. IDKA 2 p.p.	-0,24	-0,59	-0,16	-0,42	-0,87	-1,64	-2,56
BB PREV RF IRF-M	-0,80	5,01	1,09	3,47	8,43	26,24	33,44
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,05	-0,20	-0,03	-0,15	-0,28	-0,58	-0,90
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,10	2,83	0,60	2,03	4,85	12,44	19,97
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,13	-0,04	-0,10	-0,21	-0,40	-0,65
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	-1,85	0,64	4,50	-0,06	6,38	35,28	41,12
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,06	-0,17	-0,11	-0,15	-0,26	-0,71	-1,08
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	-3,69	-2,23	6,21	-2,57	4,54	43,91	47,28
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,07	-0,22	-0,16	-0,22	-0,18	-0,81	-1,23
35-BRB MILLENIUM	0,12	1,73	0,44	1,16	3,38	9,56	16,31
% do CDI	72,36	81,88	77,36	80,82	87,44	92,06	91,03
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	-3,63	-5,86	4,97	-6,73	0,44	34,98	37,17
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,83	-6,66	0,37	-6,82	-6,20	-1,02	-5,04
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,34	-0,75	1,30	-1,33	0,55	7,00	14,16
% do CDI	214,69	-35,49	228,51	-92,67	14,24	67,48	79,04
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,40	-0,55	1,47	-1,23	0,96	7,75	15,70
% do CDI	248,06	-25,95	258,86	-85,82	25,00	74,71	87,60
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	-0,64	-0,11	1,82	-1,14	5,57	24,91	
% do CDI	-401,32	-5,34	320,81	-79,67	144,17	239,97	
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	1,79	0,68	1,16	3,42	9,79	17,31
% do CDI	113,33	84,85	119,59	81,13	88,51	94,28	96,60
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,02	0,42	0,06	0,22	1,13	4,38	8,30
% do CDI	15,14	20,09	11,35	15,64	29,29	42,20	46,31
BB PREV RF FLUXO FIC	0,08	1,42	0,31	0,91	2,78	8,08	14,23
% do CDI	47,03	67,24	54,01	63,80	72,12	77,81	79,42
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,14	1,77	0,64	1,12	3,36	9,69	17,02
% do CDI	90,67	83,59	112,31	77,76	87,05	93,36	94,95
33-BRB TESOURO	0,07	1,34	0,29	0,86	2,71	8,29	14,33
% do CDI	42,87	63,32	50,49	60,00	70,32	79,88	79,96
FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,07	1,42	0,30	0,91	2,78	8,07	14,22
% do CDI	45,76	67,10	53,28	63,75	72,06	77,73	79,34
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,09	1,55	0,35	1,01	3,00	8,56	15,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	56,62	73,25	61,99	70,44	77,62	82,45	83,88
FIP CAIXA CYRELA Var. IPCA p.p.	-0,15 -0,39	-10,17 -10,87	-0,16 -1,02	-14,25 -14,49	-20,37 -22,81	2,30 -3,65	0,96 -9,43
FIA BRASIL IBX-50 Var. IBOVESPA p.p.	-3,25 0,19	-14,62 -0,55	14,57 0,88	-4,97 -0,36	-2,43 -0,69	24,25 -5,35	35,75 -4,54
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-3,43 0,01	-14,10 -0,03	13,42 -0,27	-4,74 -0,13	-1,87 -0,13	28,69 -0,90	38,62 -1,67
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-3,37 0,07	-14,06 0,01	13,95 0,26	-4,51 0,10	-1,96 -0,21	28,19 -1,41	37,93 -2,36
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	-3,27 0,18	-13,42 0,66	14,23 0,54	-5,10 -0,49	-0,39 1,36	35,87 6,27	39,55 -0,73
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,43 4,40	-1,13 16,12	18,93 8,47	4,33 14,71	10,07 13,71	69,06 24,28	75,12 29,92
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-1,38 2,06	-15,36 -1,28	21,66 7,96	-7,86 -3,25	3,92 5,67	51,07 21,47	48,05 7,76
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-3,82 1,01	-13,31 3,94	8,95 -1,51	-8,81 1,57	-1,14 2,51	48,70 3,92	47,11 1,91
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	-3,41 0,03	-19,86 -5,78	9,92 -3,77	-11,83 -7,22	-10,80 -9,05	22,37 -7,23	23,27 -17,01
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII Var. IPCA p.p.	-10,40 -10,64	4,03 3,33	19,23 18,37	5,16 4,92	41,29 38,86	63,76 57,81	41,37 30,97
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	15,16 18,61	55,87 69,94	22,45 8,76	55,15 59,76	68,87 70,62	72,76 43,17	164,16 123,88
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	14,67 18,11	49,74 63,81	19,32 5,63	52,30 56,91	63,67 65,42	56,69 27,09	140,73 100,45
CDI	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,92
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59	40,28
INPC + 6%	0,85	5,15	2,64	3,80	9,12	19,38	31,09
IPCA + 6%	0,73	4,66	2,39	3,22	8,58	18,96	31,33

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	0,12	2,96	0,64	2,12	5,06	12,83	20,62
IRF-M 1+	-1,13	6,37	1,36	4,37	10,64	33,26	40,58
IRF-M TOTAL	-0,75	5,20	1,11	3,62	8,70	26,82	34,34
IMA-B 5	0,43	4,63	2,55	3,39	9,24	25,01	33,33
IMA-B 5+	-3,62	-2,01	6,38	-2,35	4,71	44,71	48,51
IMA-B TOTAL	-1,80	0,80	4,61	0,09	6,64	36,00	42,20
IMA-C TOTAL	2,11	14,41	10,45	10,88	18,54	46,32	66,00
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,68	2,69	1,88	1,72	6,16	22,72	29,97
IMA-GERAL TOTAL	-0,60	3,02	2,13	1,99	6,51	23,37	30,91
IDKA 2	1,03	5,39	2,99	4,11	9,71	23,52	33,44
IDKA 20	-6,22	-7,86	9,49	-6,50	-0,24	59,80	58,73
CDI	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,92
Renda Variável							
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59	40,28
IBRX 100	-3,38	-13,46	14,15	-4,51	-1,12	33,35	43,15
IBRX 50	-3,42	-14,10	14,20	-4,15	-2,18	26,25	37,06
SMALL CAP	-1,23	-14,27	23,76	-6,96	6,02	60,17	56,43
IFIX	1,79	-12,99	4,68	-6,13	4,72	30,04	33,50
Índice Consumo - ICON	-1,48	-5,53	16,72	1,26	5,75	60,13	42,78
Índice Dividendos - IDIV	-4,83	-17,25	10,46	-10,38	-3,64	44,78	45,20
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,24	0,70	0,86	0,24	2,44	5,95	10,39
INPC	0,36	1,16	1,10	0,80	2,94	6,32	10,19
IGPM	2,74	9,64	6,67	9,17	13,02	18,62	29,16
SELIC	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,93
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
668	03/08/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	170.500,00	8.563,95545079	19,9090246300
681	03/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.155,53	0,00	548,12107324	2,1081656160
693	03/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.289,76	0,00	611,79254145	2,1081656160
669	04/08/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	65.387,72	3.284,31074223	19,9091149200
675	04/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	14.791.703,15	1.822.717,30700367	8,1151932300
682	04/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	4.025,21	0,00	1.909,24840919	2,1082694010
694	04/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	458,40	0,00	217,42951815	2,1082694010
676	05/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	8.800.000,00	0,00	1.084.377,84951471	8,1152524500
683	05/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.296,46	0,00	614,91537376	2,1083551580
688	05/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	15.100.000,00	0,00	1.860.693,80996275	8,1152524500
695	05/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.077,74	0,00	511,17573617	2,1083551580
677	06/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	116.944,66	0,00	14.410,37110468	8,1153121700
684	06/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	4.602,62	0,00	2.182,93508626	2,1084548180
689	06/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	46.240,32	0,00	5.697,91020128	8,1153121700
696	06/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	4.820,56	0,00	2.286,29988124	2,1084548180
670	07/08/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	40.953,12	2.056,76065519	19,9114660700
674	07/08/2020	33-BRB TESOIRO	0,00	3.154,49	795,43273878	3,9657532890
678	07/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	16.920,29	0,00	2.084,94760746	8,1154509300
685	07/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.980,59	0,00	1.413,58923958	2,1085262370
690	07/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	94.403,36	0,00	11.632,54646159	8,1154509300
697	07/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.370,74	0,00	1.124,35878596	2,1085262370
671	10/08/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	222.699,67	11.184,12582189	19,9121213000
679	10/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	912.133,57	0,00	112.393,84821919	8,1155115200
686	10/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	6.908,60	0,00	3.276,39821181	2,1085959500
698	10/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	13.419,40	0,00	6.364,14008099	2,1085959500
672	11/08/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	2.302,64	115,63630943	19,9127766300
691	11/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	5.041,75	621,24399904	8,1155713500
673	12/08/2020	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	5.753.971,57	0,00	289.979,91545035	19,8426555200

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
680	12/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	4.065.209,20	500.911,04993339	8,1156309100
687	12/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	8.907,69	0,00	4.224,18196511	2,1087372830
699	12/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	14.264,38	0,00	6.764,41779400	2,1087372830
700	12/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	140.000,00	0,00	37.711,26050158	3,7124190000
758	12/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.671.434,37	205.952,48706302	8,1156309100
704	13/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	11.051,88	0,00	5.240,81357418	2,1088099860
702	13/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	17.602,43	0,00	8.347,09154303	2,1088099860
705	14/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.938,51	0,00	919,21390678	2,1088780160
703	14/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	603,28	0,00	286,06680682	2,1088780160
709	17/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.415.555,50	297.635,73498898	8,1158114300
708	17/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	11.869,26	0,00	5.628,05528036	2,1089451700
706	17/08/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	6.815,91	342,24305757	19,9154076300
707	17/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	5.139,24	0,00	2.436,87700994	2,1089451700
744	17/08/2020	NTN-B 150820	0,00	33.101.472,79	10.000,00000000	3,310,1472790000
710	18/08/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	68.612,64	3.445,09607395	19,9160309400
712	18/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	18.504,38	0,00	8.773,91917776	2,1090210230
713	18/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	20.461,30	0,00	9.701,79992369	2,1090210230
714	18/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.047.596,25	0,00	252.295,30155536	8,1158715100
715	18/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	9.853,68	1.214,12469232	8,1158715100
716	18/08/2020	BB PREV RF IDKA2	12.000.000,00	0,00	4.290.915,55731884	2,7966059550
717	18/08/2020	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12.000.000,00	0,00	1.918.501,34073003	6,2548822590
720	19/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	166.367,21	78.881,72601956	2,1090716240
721	19/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.291.712,98	0,00	159.157,69414684	8,1159317300
722	19/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.719.569,62	0,00	211.875,81133091	8,1159317300
759	19/08/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	13.000.000,00	0,00	2.551.801,07101054	5,0944410000
760	19/08/2020	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	13.000.000,00	0,00	5.682.496,20693378	2,2877270000
723	20/08/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	74.422,09	3.736,54627819	19,9173473200
724	20/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	47.918,27	22.719,25964492	2,1091475140
725	20/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	800.000,00	0,00	98.570,82493602	8,1159917300
731	20/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	6.110,64	0,00	2.897,20845007	2,1091475140

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
732	20/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	360.000,00	0,00	44.356,87122121	8,1159917300
726	21/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	20.400.000,00	0,00	2.513.537,40420701	8,1160518900
733	21/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	6.110,64	752,90795116	8,1160518900
727	24/08/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	3.172.450,77	159.270,28853368	19,9186602800
728	24/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	20.576,76	9.755,25516847	2,1093000280
729	24/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.658.119,02	327.511,37777240	8,1161119900
730	24/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	818.763,18	0,00	100.881,20777643	8,1161119900
734	24/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	58.960,25	7.264,59295690	8,1161119900
735	24/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	607.038,66	0,00	74.794,26857933	8,1161119900
736	24/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.737,63	0,00	823,79461287	2,1093000280
737	25/08/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	250,92	12,59681808	19,9193160000
739	25/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.544,74	1.680,47230252	2,1093712730
740	25/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	557.377,89	243.673,27092542	2,2873985640
741	25/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	14.051.396,67	1.731.283,66362854	8,1161723900
742	25/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	23.698,45	2.919,90471139	8,1161723900
743	25/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	3.646.902,05	0,00	449.337,67726439	8,1161723900
745	26/08/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	708.413,73	35.562,99091909	19,9199705000
746	26/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	8.870,59	0,00	4.205,18225465	2,1094424600
747	26/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	23.863,38	2.940,20403304	8,1162326600
748	26/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	136.200.000,00	0,00	16.781.184,78185666	8,1162326600
749	27/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	14.064,60	1.732,88460239	8,1162934800
750	28/08/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	1.375.464,91	69.045,01104784	19,9212787300
751	28/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.238.804,09	978.510,96083357	2,2879703750
752	28/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	81.687,56	38.722,18674176	2,1095802400
753	28/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	9.887,57	0,00	4.686,98455386	2,1095802400
754	28/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	131.994.124,37	16.262.735,14258935	8,1163545500
755	28/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	5.432.543,35	669.332,92730540	8,1163545500
756	31/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.542,72	0,00	731,26525548	2,1096585520
757	31/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.267,98	0,00	1.549,05636123	2,1096585520

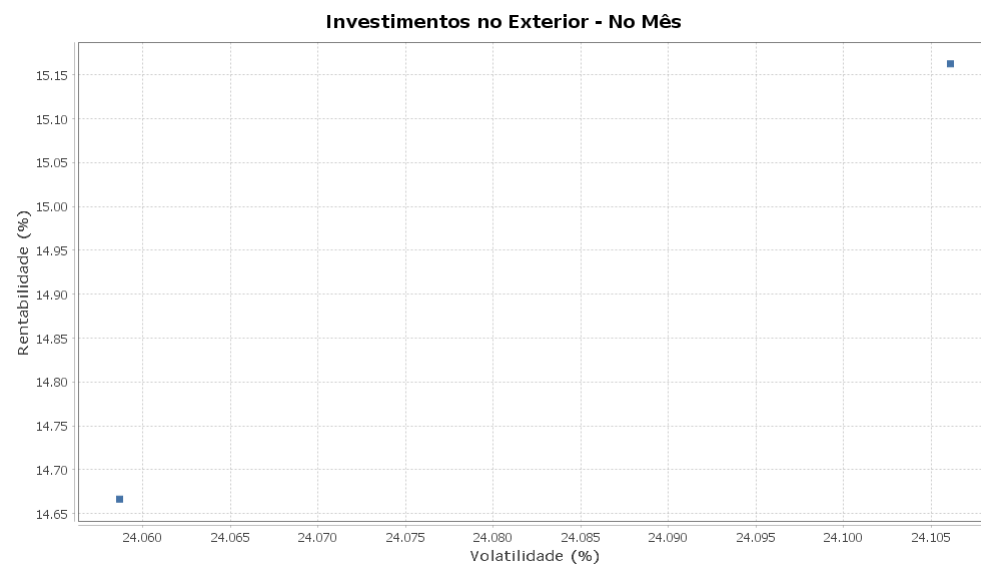
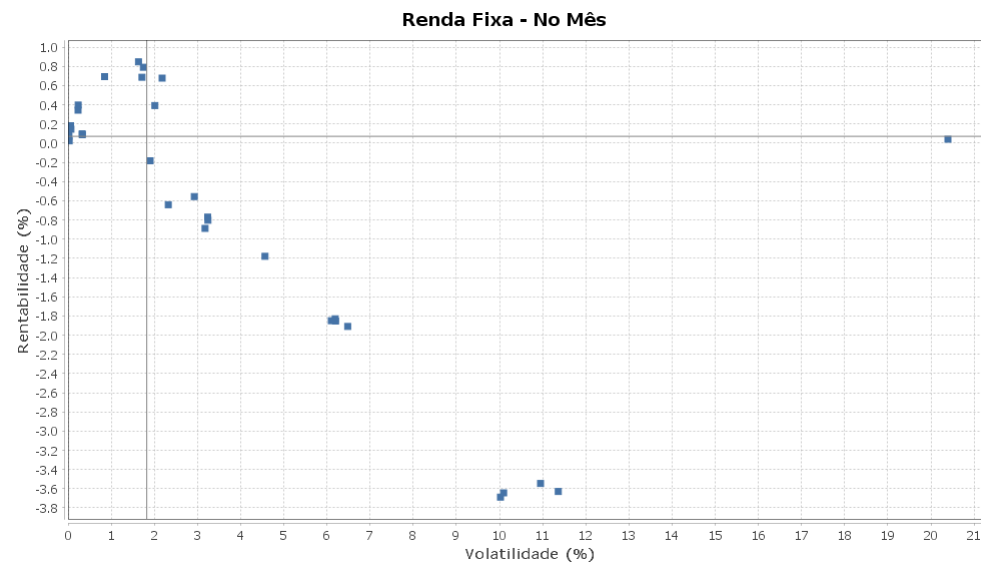
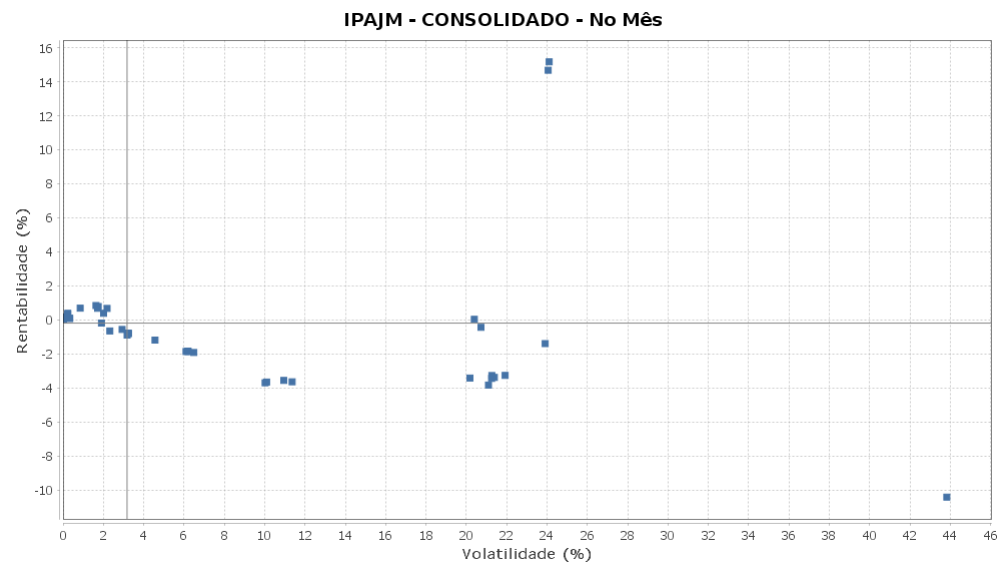
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rendimentos Realizados

Artigo	Ativo	Quantidade	Valor Aplicação	Valor Resgate	Rendimento
Artigo 7º IV, Alínea a	33-BRB TESOIRO	795,432739	3.126,33	3.154,49	28,16
Artigo 7º IV, Alínea a	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	21.835.525,553231	177.205.836,40	177.221.678,37	15.841,97
Artigo 7º IV, Alínea a	BB PREV RF FLUXO FIC	151.758,899877	319.570,87	320.094,54	523,67
Artigo 7º IV, Alínea a	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.222.184,231759	2.656.386,41	2.796.181,98	139.795,57
Artigo 7º IV, Alínea a	FI BANESTES INVEST MONEY RF	296.619,561708	5.902.637,31	5.908.274,12	5.636,81
Artigo 7º I, Alínea a	NTN-B 150820	10.000,000000	23.708.263,24	33.101.472,79	9.393.209,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,02	0,00	-11,49	0,09	162,06	0,00
LFT 010921	Artigo 7º I, Alínea a	0,01	0,02	0,00	0,34	0,16	247.118.548,43	5,10
33-BRB TESOUREO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,02	0,00	-13,14	0,07	2.586,88	0,00
LFT 010324	Artigo 7º I, Alínea a	0,01	0,02	0,00	0,19	0,16	112.145.209,58	2,32
35-BRB MILLENIUM	Artigo 7º I, Alínea b	0,01	0,02	0,00	-5,33	0,12	1.389.997,02	0,03
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,02	0,00	-9,48	0,08	282.882,41	0,01
FI BANESTES INVEST MONEY RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,02	0,00	-4,15	0,07	654.457,63	0,01
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,01	0,00	-5,10	0,02	67.983.166,25	1,40
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,07	0,00	0,37	0,18	325.190.221,90	6,71
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,09	0,00	-0,23	0,14	130.268.027,24	2,69
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,23	0,31	-0,00	0,79	0,34	14.462.881,46	0,30
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,24	0,31	-0,00	1,00	0,40	170.444.065,51	3,52
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,22	0,00	-0,19	0,10	40.345.062,16	0,83
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,22	0,01	-0,22	0,09	303.814.906,74	6,27
NTN-B 150521	Artigo 7º I, Alínea a	0,85	0,52	0,02	0,63	0,69	318.604.570,29	6,58
NTN-B 150822	Artigo 7º I, Alínea a	1,63	1,09	0,05	0,42	0,85	407.600.977,63	8,41
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,72	0,88	0,00	0,31	0,69	41.656.778,67	0,86
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,75	0,92	0,00	0,36	0,79	33.204.026,69	0,69
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	1,90	0,99	0,00	-0,18	-0,18	1.411.824,97	0,03
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,06	0,01	0,12	0,39	34.727.616,89	0,72
NTN-B 150523	Artigo 7º I, Alínea a	2,18	1,51	0,02	0,24	0,68	77.221.355,34	1,59
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	2,32	0,99	-0,00	-0,35	-0,64	7.217.976,02	0,15
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,93	1,39	0,15	-0,24	-0,56	697.127.924,72	14,39
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,17	1,37	0,15	-0,33	-0,89	662.243.151,49	13,67
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,24	1,46	0,01	-0,29	-0,77	36.863.837,43	0,76
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,24	1,44	0,01	-0,30	-0,80	50.048.478,63	1,03
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	4,56	2,09	0,01	-0,29	-1,18	21.009.980,13	0,43
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	6,10	3,12	0,00	-0,33	-1,85	2.056.226,21	0,04
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,19	3,13	0,01	-0,32	-1,83	13.940.662,00	0,29
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,20	3,11	0,01	-0,32	-1,85	25.686.066,62	0,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150830	Artigo 7º I, Alínea a	6,48	3,98	0,08	-0,32	-1,91	115.747.104,90	2,39
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	10,02	5,38	0,01	-0,38	-3,69	7.565.277,57	0,16
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	10,09	5,38	0,01	-0,38	-3,64	10.811.622,87	0,22
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	10,95	5,49	0,00	-0,34	-3,55	34.631.325,05	0,71
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	11,36	6,14	0,00	-0,33	-3,63	32.198.146,15	0,66
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	20,18	11,87	0,29	-0,18	-3,41	123.167.206,89	2,54
NTN-B 150820	Artigo 7º I, Alínea a	20,39	NaN	0,00	-0,01	0,04	0,00	0,00
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	20,73	12,64	0,01	-0,03	-0,43	5.466.496,38	0,11
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,10	13,21	0,08	-0,19	-3,82	29.617.274,64	0,61
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	21,25	12,11	0,15	-0,17	-3,43	65.784.404,35	1,36
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	21,26	12,62	0,24	-0,16	-3,27	98.941.054,31	2,04
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	21,39	12,17	0,02	-0,17	-3,37	9.147.800,43	0,19
FIA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	21,92	12,38	0,35	-0,16	-3,25	145.136.507,79	3,00
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	23,91	15,55	0,44	-0,06	-1,38	149.786.501,90	3,09
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	24,06	12,66	-0,01	0,60	14,67	24.633.889,49	0,51
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	24,11	13,62	-0,03	0,62	15,16	114.049.556,62	2,35
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	Artigo 8º IV, Alínea b	43,83	16,86	0,02	-0,24	-10,40	31.000.000,00	0,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de agosto de 2020, vale observar que:

- O Instituto está com 20,08% do patrimônio líquido do fundo CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII (Art. 8, Inciso IV, Alínea B), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;