



IPAJM - ESTADO DO ESPÍRITO
JUNHO 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 06.08.2020.

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 **84,65%**

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	1,21	0,91	0,85	34.007.420,82	0,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830	13,44	2,89	0,89	115.903.883,73	2,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822	4,98	1,21	3,49	411.557.009,27	8,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	6,05	1,16	4,13	75.839.063,52	1,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150521	2,18	0,90	1,94	315.409.287,33	6,67
TESOURO NACIONAL	LFT 010324	0,07	0,22	1,71	111.744.004,26	2,36
TESOURO NACIONAL	LFT 010921	0,07	0,21	1,74	246.237.432,23	5,21
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		3,43	1,00	2,37	1.310.698.101,16	27,72

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	5,84	0,77	4,68	49.891.775,35	1,06	5.220.862.294,67	0,96
BRB	BRB	35-BRB MILLENIUM	0,08	0,17	1,46	1.386.327,87	0,03	66.899.463,55	2,07
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	22,66	2,29	-8,42	33.401.262,60	0,71	273.434.802,05	12,22
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,53	0,26	2,45	287.869.895,18	6,09	7.792.694.548,07	3,69
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,40	2,02	-1,75	13.460.259,23	0,28	5.526.503.185,82	0,24
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,47	2,03	-1,88	13.605.352,14	0,29	5.979.262.081,07	0,23
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,26	2,48	40.209.252,11	0,85	11.257.382.974,77	0,36
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	1,10	3,04	34.258.546,96	0,72	8.746.335.681,60	0,39
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,10	1,21	2,88	29.214.027,65	0,62	6.212.458.601,64	0,47

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	19,05	2,80	-5,38	7.322.080,15	0,15	1.945.603.761,59	0,38
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,16	2,83	-5,44	10.457.853,34	0,22	1.967.228.116,14	0,53
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO	8,67	1,02	5,88	20.946.700,99	0,44	2.971.560.297,96	0,70
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	4,01	1,18	3,12	32.672.356,40	0,69	7.740.606.629,29	0,42
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,82	0,77	4,73	36.749.667,06	0,78	17.164.831.993,69	0,21
BANESTES	BANESTES	Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1	4,16	0,48	4,85	16.334.216,48	0,35	215.246.883,23	7,59
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,05	0,95	1,75	656.574.890,40	13,89	10.783.491.196,95	6,09
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,96	0,75	4,63	694.248.885,96	14,68	12.211.119.756,17	5,69
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,99	0,82	2,73	1.978.603.349,87	41,84		

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	12,39	2,02	-1,86	2.006.759,46	0,04	2.894.677.261,07	0,07
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,39	2,02	-1,86	2.006.759,46	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	0,13	0,17	950.848,00	0,02	90.790.797,48	1,05
BANESTES	BANESTES	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,99	0,40	-1,63	14.032.572,45	0,30	329.826.181,39	4,25
BRB	BRB	33-BRB TESOURO	0,07	0,12	1,17	8.954,20	0,00	279.190.913,04	0,00
BANESTES	BANESTES	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,06	0,02	0,38	81.339.014,36	1,72	800.768.664,32	10,16
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,30	0,24	1,37	94.997.112,71	2,01	5.172.945.706,81	1,84
BANESTES	BANESTES	Banestes Institucional FI Renda Fixa	25,86	2,19	-8,35	31.345.229,61	0,66	257.794.723,23	12,16
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,26	1,37	312.148.199,51	6,60	2.439.958.346,20	12,79
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,07	0,13	1,24	571.847,99	0,01	1.768.065.678,44	0,03
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,07	0,14	0,60	51,84	0,00	517.750.287,34	0,00
BANESTES	BANESTES	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,92	0,46	-1,54	168.740.943,71	3,57	1.967.233.455,21	8,58

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANESTES	BANESTES	Banestes Estrategia FIC de FI Renda Fixa	2,52	0,60	-1,31	7.131.625,00	0,15	164.480.013,81	4,34
		Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a	1,28	0,36	-0,17	711.266.399,38	15,04		
		Renda Fixa	3,63	0,79	2,09	4.002.574.609,87	84,65		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

13,09%

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	44,49	9,45	-18,44	138.650.292,02	2,93	895.832.942,84	15,48
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	43,93	8,89	-17,46	94.318.057,30	1,99	828.382.101,16	11,39
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	42,41	9,11	-17,71	8.759.101,24	0,19	119.727.942,05	7,32
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	43,22	8,61	-17,75	50.725.862,48	1,07	625.376.500,86	8,11
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			43,97	9,12	-18,06	292.453.313,04	6,18		

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	119.430.284,54	2,53	907.675.512,87	13,16
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	38,70	4,58	-16,79	28.429.959,74	0,60	799.344.501,83	3,56
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	47,24	12,89	-21,45	138.998.577,08	2,94	1.090.602.347,47	12,75
BANESTES	BANESTES	Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	44,83	10,23	-8,36	5.066.572,35	0,11	158.247.917,35	3,20
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			41,95	9,35	-20,87	291.925.393,71	6,17		

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	26,24	3,26	-7,09	3.392.524,87	0,07	150.839.883,53	2,25
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			26,24	3,26	-7,09	3.392.524,87	0,07		

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	42,26	20,84	4,70	31.200.000,00	0,66	158.864.619,09	19,64
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			42,26	20,84	10,90	31.200.000,00	0,66		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			40,04	9,73	-17,90	618.971.231,62	13,09		
---	--	--	-------	------	--------	----------------	-------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,26%

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	85.712.615,49	1,81	1.181.944.568,52	7,25
BB	BB	BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	26,11	3,05	29,32	21.274.707,33	0,45	245.062.802,14	8,68
Sub-total Artigo 9º A, III			26,11	4,10	32,13	106.987.322,82	2,26		
Investimentos no Exterior			26,11	4,10	32,13	106.987.322,82	2,26		
Total						4.728.533.164,31	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	1.310.698.101,16	27,72	20,00	27,00	60,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	1.978.603.349,87	41,84	15,00	36,30	60,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	2.006.759,46	0,04	0,00	0,10	2,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	711.266.399,38	15,04	5,00	10,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	4.002.574.609,87	84,65				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	292.453.313,04	6,18	0,00	6,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	291.925.393,71	6,17	0,00	5,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	3.392.524,87	0,07	0,00	0,10	2,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	31.200.000,00	0,66	0,00	0,50	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	618.971.231,62	13,09				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	106.987.322,82	2,26	0,00	4,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	106.987.322,82	2,26				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

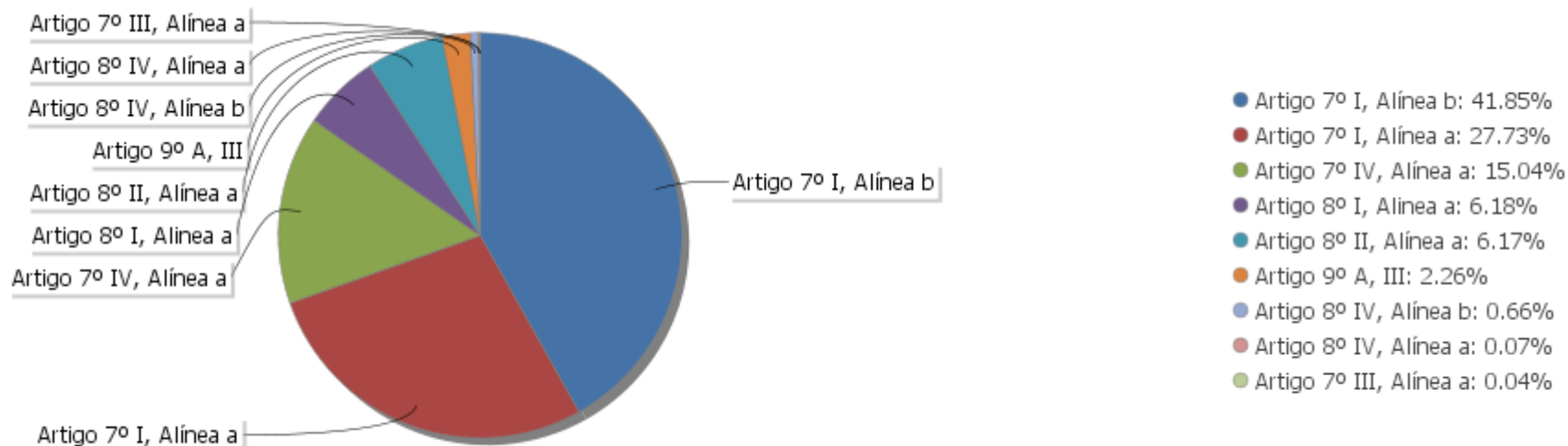
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,00 468,98	2,37 134,83	2,73 371,72	2,37 134,83	7,19 156,17	12.923.008,40	30.431.825,79
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,82 384,03	2,73 155,68	2,88 392,54	2,73 155,68	7,13 154,99	16.003.209,28	56.711.464,19
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	2,02 953,71	-1,86 -105,78	4,83 657,71	-1,86 -105,78	4,56 99,02	39.830,16	-37.946,06
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,36 170,15	-0,17 -9,43	0,33 44,70	-0,17 -9,43	2,86 62,13	2.606.222,35	-503.464,79
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	9,12 0,36	-18,06 -0,26	30,79 0,61	-18,06 -0,26	-6,09 -0,24	24.432.374,32	-67.868.563,46
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	9,35 0,60	-20,87 -3,07	26,17 -4,01	-20,87 -3,07	-4,52 1,33	24.970.378,09	-78.814.186,84
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	3,26 -5,50	-7,09 10,71	-15,72 -45,90	-7,09 10,71	-13,51 -7,65	107.094,98	-243.522,62
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	20,84 12,09	10,90 28,71	36,05 5,87	10,90 28,71	67,93 73,78	5.400.000,00	3.090.200,00
Artigo 9º A, III % do CDI	4,10 1.932,97	32,13 1.831,19	23,86 3.247,12	32,13 1.831,19	53,35 1.158,98	4.217.903,86	24.383.791,24
						90.700.021,44	-32.850.402,55

Análise de Liquidez

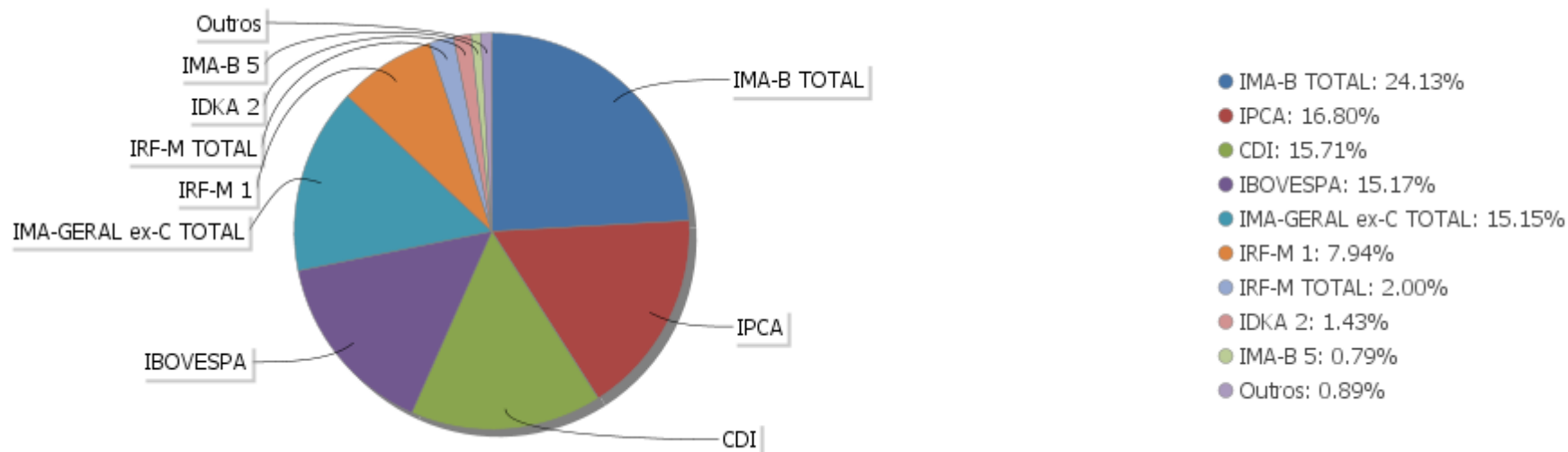
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	3.384.338.531,06	71,57	3.384.338.531,06	71,57
de 31 a 364 dias	382.913.240,24	8,10	3.767.251.771,30	79,67
acima de 365 dias	961.281.393,01	20,33	4.728.533.164,31	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

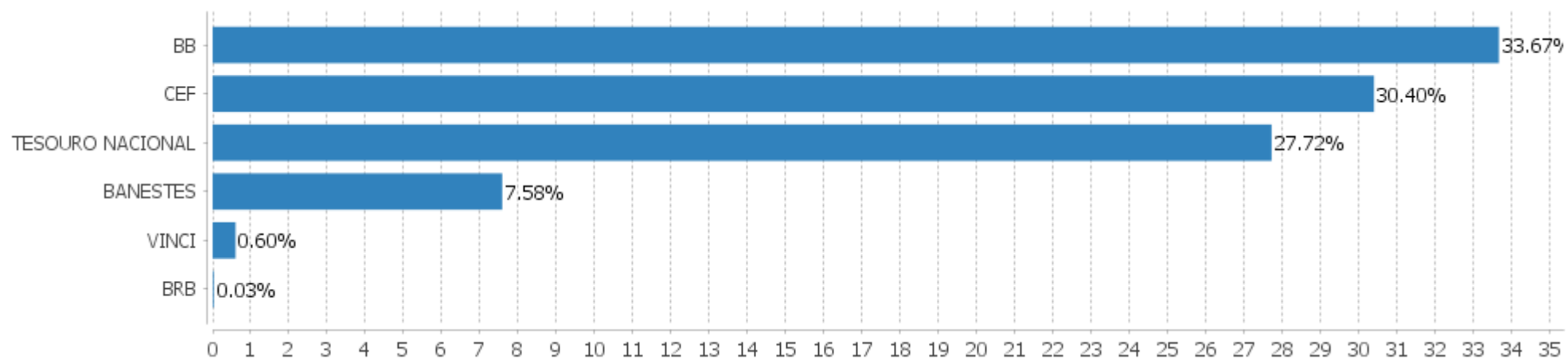


Alocação Por Estratégia



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							-0,71
IPCA + 5%	0,64	0,60	0,50	0,08	0,01	0,67							2,51
p.p. indexador	-0,22	-1,52	-5,98	1,74	1,70	1,29							-3,22
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

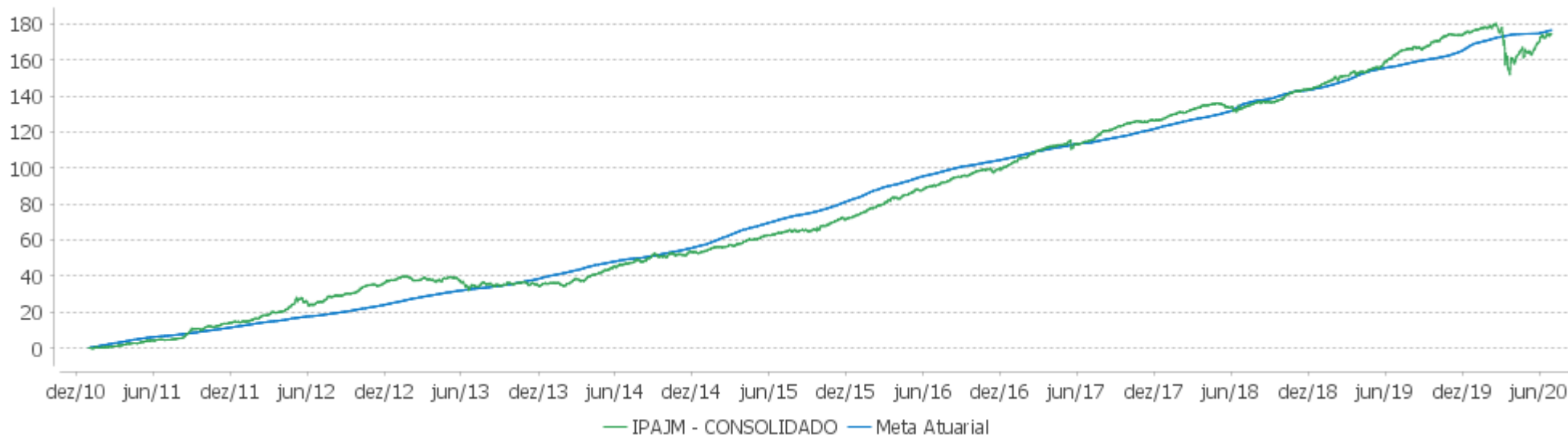
RELATÓRIO TRIMESTRAL

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

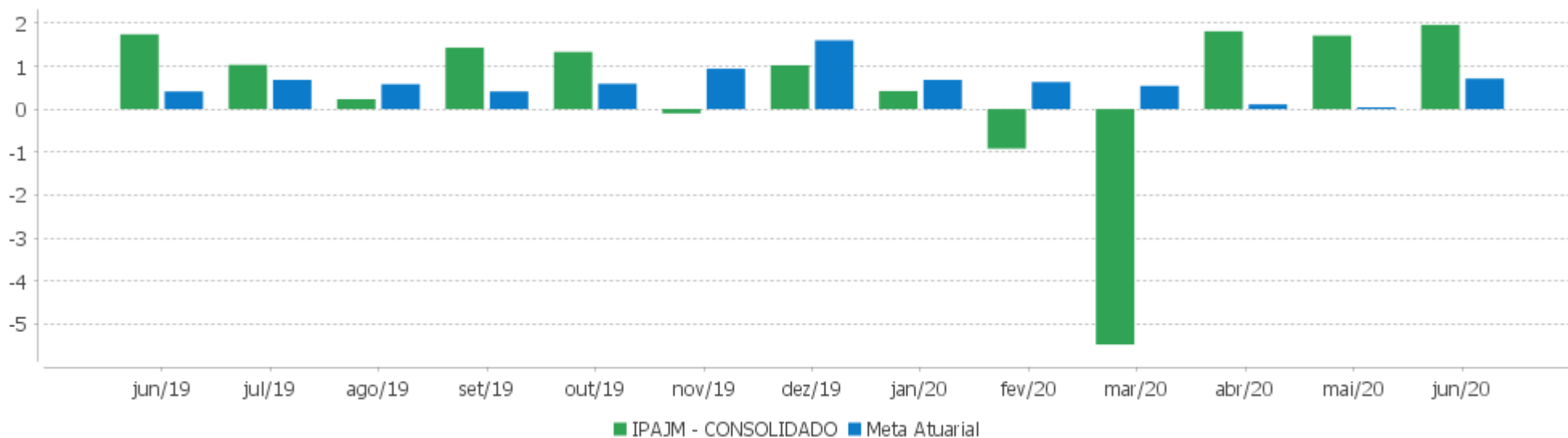
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	60	52,63	03 meses	5,58	0,75	4,83	6,24
Meses abaixo da Meta Atuarial	54	47,37	06 meses	-0,71	2,51	-3,22	10,51
			12 meses	4,28	7,52	-3,24	7,42
			24 meses	17,60	17,32	0,28	5,42
			36 meses	27,62	29,58	-1,95	4,59
			Desde 31/12/2010	174,57	185,81	-11,24	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
Banestes Institucional FI Renda Fixa 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 VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI % do CDI	0,40 188,12	-1,63 -92,92	-0,87 -118,48	-1,63 -92,92	1,01 21,96	7,20 64,18	14,95 77,09
Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI % do CDI	0,46 214,49	-1,54 -87,93	-0,92 -124,84	-1,54 -87,93	1,07 23,33	7,95 70,89	16,49 85,04
Banestes Estrategia FIC de FI Renda Fixa % 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 REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,26 122,46	1,37 78,16	0,78 105,60	1,37 78,16	4,06 88,25	10,51 93,70	18,70 96,43
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 Automatico FI Renda Fixa Curto % 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 RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,24 114,33	1,37 78,02	0,58 78,30	1,37 78,02	4,03 87,52	10,44 93,15	18,40 94,90
33-BRB TESOIRO % do CDI	0,12 58,13	1,17 66,95	0,46 62,29	1,17 66,95	3,45 74,92	9,12 81,33	15,78 81,38
FI BANESTES INVEST MONEY RF % do CDI	0,13 60,71	1,24 70,90	0,49 66,61	1,24 70,90	3,51 76,15	8,87 79,12	15,60 80,46
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 150820 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,91 -1,14	0,85 2,51	1,73 -3,23	0,85 2,51	5,13 0,18	15,80 -19,33	28,49 -17,72
NTN-B 150822 Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,21 -0,84	3,49 5,15	3,84 -1,12	3,49 5,15	9,22 4,27	28,44 -6,69	41,44 -4,77
LFT 010921	0,21	1,74	0,73	1,74	4,60	11,23	19,50
LFT 010324	0,22	1,71	0,72	1,71	4,58	11,24	
NTN-B 150523 Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,16 -0,89	4,13 5,79	4,58 -0,38	4,13 5,79	10,40 5,45	32,12 -3,01	44,82 -1,39
NTN-B 150521 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,90 -1,15	1,94 3,61	2,01 -2,95	1,94 3,61	6,95 2,01	21,00 -14,13	34,42 -11,79
NTN-B 150830	2,89	0,89	6,32	0,89	7,01	41,68	51,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,85	2,56	1,36	2,56	2,06	6,55	5,33
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,03	-1,88	4,91	-1,88	4,52	34,35	45,00
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,21	-0,05	-0,21	-0,42	-0,78	-1,21
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,10	3,04	3,71	3,04	8,51	24,21	35,98
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,13	-0,06	-0,13	-0,30	-0,55	-0,92
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,26	2,45	1,06	2,45	5,71	13,15	21,70
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,14	-0,09	-0,14	-0,30	-0,52	-0,85
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,77	4,73	3,33	4,73	9,54	26,59	37,48
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,02	-0,13	-0,06	-0,13	-0,27	-0,49	-0,96
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,83	-5,44	5,88	-5,44	1,57	42,12	50,48
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,02	-0,17	-0,11	-0,17	-0,40	-1,44	-1,85
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO	1,02	5,88	4,41	5,88	11,53	32,77	44,55
Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,02	-0,15	-0,12	-0,15	-0,26	-0,47	-1,05
Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1	0,48	4,85	2,22	4,85	9,17	21,18	31,47
Var. IRF-M 1 p.p.	0,20	2,25	1,07	2,25	3,16	7,51	8,92
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	2,29	-8,42	4,76	-8,42	-0,74	38,52	45,40
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,24	-6,75	-0,20	-6,75	-5,69	3,39	-0,80
BB PREV RF IDKA2	1,21	2,88	3,57	2,88	8,18	21,13	32,87
Var. IDKA 2 p.p.	0,22	-0,46	0,22	-0,46	-0,59	-2,04	-2,59
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,95	1,75	2,96	1,75	6,31	23,29	33,67
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,05	0,04	0,22	0,04	-0,01	0,35	0,56
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,75	4,63	3,27	4,63	9,82	28,20	38,61
Var. IPCA p.p.	0,49	4,53	3,70	4,53	7,69	22,63	28,41
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	1,18	3,12	3,54	3,12	8,19	21,36	33,16
Var. IDKA 2 p.p.	0,19	-0,23	0,19	-0,23	-0,58	-1,81	-2,29
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,26	2,48	1,09	2,48	5,78	13,28	21,89
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,11	-0,06	-0,11	-0,23	-0,39	-0,66
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,02	-1,75	4,90	-1,75	4,74	34,48	45,12
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,08	-0,06	-0,08	-0,20	-0,65	-1,09
BB PREV RF IRF-M	0,77	4,68	3,26	4,68	9,51	26,49	37,50
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,01	-0,18	-0,13	-0,18	-0,30	-0,59	-0,94
35-BRB MILLENIUM	0,17	1,46	0,60	1,46	4,11	10,39	17,78
% do CDI	81,94	83,41	82,02	83,41	89,38	92,68	91,67
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,80	-5,38	5,82	-5,38	1,87	42,80	51,23
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,04	-0,11	-0,17	-0,11	-0,10	-0,75	-1,10
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	2,02	-1,86	4,83	-1,86	4,56	34,21	44,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,19	-0,13	-0,19	-0,39	-0,92	-1,33
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 BRASIL IBX-50	9,45	-18,44	31,25	-18,44	-6,85	25,17	45,98
Var. IBOVESPA p.p.	0,70	-0,63	1,07	-0,63	-1,00	-5,47	-5,15
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	9,11	-17,71	29,45	-17,71	-6,12	29,35	48,47
Var. IBOVESPA p.p.	0,35	0,09	-0,73	0,09	-0,27	-1,29	-2,65
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	8,89	-17,46	30,78	-17,46	-3,93	35,59	49,22
Var. IBOVESPA p.p.	0,14	0,34	0,60	0,34	1,92	4,96	-1,90
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	20,00	4,70	33,33	4,70	51,16	70,31	40,59
Var. IPCA p.p.	19,74	4,60	33,77	4,60	49,03	64,74	30,38
FIP CAIXA CYRELA	3,26	-7,09	-15,72	-7,09	-13,41	5,55	4,20
Var. IPCA p.p.	3,00	-7,19	-15,29	-7,19	-15,54	-0,02	-6,00
Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	10,23	-8,36	41,46	-8,36	8,76	58,50	80,20
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,28	10,02	22,76	10,02	8,91	10,98	19,63
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	12,89	-21,45	31,67	-21,45	3,57	42,14	61,19
Var. IBOVESPA p.p.	4,14	-3,65	1,49	-3,65	9,43	11,50	10,06
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	4,58	-16,79	20,57	-16,79	-2,34	45,78	57,70
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-4,37	1,59	1,87	1,59	-2,18	-1,73	-2,87
BB AÇÕES DIVIDENDOS	6,59	-22,29	21,06	-22,29	-12,10	24,15	32,50
Var. IBOVESPA p.p.	-2,17	-4,49	-9,12	-4,49	-6,25	-6,49	-18,62
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
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	3,05	29,32	21,74	29,32	48,07	55,62	103,19
Var. IBOVESPA p.p.	-5,71	47,12	-8,44	47,12	53,93	24,98	52,07
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	11,21	19,40
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
487	01/06/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	173.033,84	8.711,22542580	19,8633179100
498	01/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	644,88	0,00	306,59360500	2,1033700000
518	01/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.846,98	0,00	878,10485100	2,1033700000
499	02/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	959,61	0,00	456,19096500	2,1035269720
500	02/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	143.486,28	0,00	17.689,52039640	8,1113719800
519	02/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.025,25	0,00	487,39569900	2,1035269720
488	03/06/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	173.342,49	8.725,48423270	19,8662315300
501	03/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.893,38	0,00	900,03143100	2,1036820870
502	03/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	14.800.000,00	0,00	1.824.578,12549477	8,1114641200
520	03/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.542,76	0,00	1.208,71875800	2,1036820870
521	03/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	14.706.317,32	1.813.028,70869300	8,1114641200
522	03/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	8.800.000,00	0,00	1.084.884,29083470	8,1114641200
503	04/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	769,80	0,00	365,90366000	2,1038324650
504	04/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	128.590,75	0,00	15.852,78723510	8,1115546500
523	04/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	47.663,77	5.876,03388760	8,1115546500
496	05/06/2020	33-BRB TESOUREO	0,00	3.251,77	821,62326634	3,9577384590
505	05/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.075,42	0,00	1.461,71475400	2,1039809520
506	05/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	90.138,80	0,00	11.112,27077140	8,1116453900
524	05/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.150,08	0,00	1.497,19986600	2,1039809520
489	08/06/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	52.904,55	2.662,46319646	19,8705281900
507	08/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.991,46	0,00	1.421,70760300	2,1041316740
525	08/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	975,44	0,00	463,58315500	2,1041316740
490	09/06/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	6.676,07	335,95427011	19,8719605400
508	09/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	8.492,58	0,00	4.035,84824400	2,1042862580
509	09/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	10.000,00	1.232,76799540	8,1118264200
526	09/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.109,66	2.903,43577400	2,1042862580
528	09/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	1.000.000,00	0,00	123.276,79954150	8,1118264200
527	09/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	6.257,53	0,00	2.973,70663100	2,1042862580

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
491	10/06/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	74.254,06	3.736,35539220	19,8733932400
510	10/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	6.225,98	0,00	2.958,50197900	2,1044366520
529	10/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	5.076,02	0,00	2.412,05644900	2,1044366520
530	10/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	47.038,31	0,00	5.798,66736350	8,1119172800
570	10/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	200.000,00	0,00	54.111,38287000	3,6960800000
511	12/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.728,60	0,00	821,34296300	2,1046019480
531	12/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.195,66	0,00	1.043,26616300	2,1046019480
497	15/06/2020	33-BRB TESOUREO	0,00	1.035,04	261,43154358	3,9591243880
512	15/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	18.025,86	0,00	8.564,37034900	2,1047501760
533	15/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	3.650.450,11	0,00	450.000,66545900	8,1120993600
532	15/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	18.793,60	0,00	8.929,13573000	2,1047501760
492	16/06/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	99.451,66	5.003,18342284	19,8776761900
534	16/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	5.320,28	0,00	2.527,56823300	2,1049006430
493	17/06/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	44.516,97	2.239,38436232	19,8791108600
513	17/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	9.232,10	0,00	4.385,69175700	2,1050499010
535	17/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	10.828,56	0,00	5.144,08708000	2,1050499010
494	18/06/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	9.574,67	481,61001694	19,8805458000
514	18/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	8.500,72	0,00	4.037,95694300	2,1052032300
515	18/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	1.725,28	212,67253740	8,1123779300
516	18/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	1.700.000,00	0,00	209.556,31183260	8,1123779300
536	18/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	190.490,12	83.680,23268400	2,2764052380
537	18/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	4.859.177,85	598.983,16987350	8,1123779300
538	18/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	1.720.000,00	0,00	212.021,68020710	8,1123779300
495	19/06/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	16.320,44	820,88975986	19,8814028400
517	19/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	618,20	76,20204370	8,1126433000
539	19/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	10.360,93	1.277,13368100	8,1126433000
540	19/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	2.542.365,80	0,00	313.383,16084800	8,1126433000
545	22/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	23.600.000,00	0,00	2.909.020,07060636	8,1126975500
546	23/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	26.106,84	12.399,46217300	2,1054816440
547	23/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	180.621,10	0,00	85.786,11953900	2,1054816440

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
548	23/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	1.485.360,65	183.089,48403140	8,1127578600
557	23/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	530.000,00	0,00	65.329,20239717	8,1127578600
556	23/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.189,44	0,00	1.514,82678900	2,1054816440
549	24/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	47.236,92	22.434,26131400	2,1055705530
550	24/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	1.807.180,53	222.756,18884137	8,1128185000
558	24/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	525,15	0,00	249,40983300	2,1055705530
559	24/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	359.224,04	0,00	44.278,57469812	8,1128185000
542	25/06/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	679.818,92	34.187,82062470	19,8848276300
551	25/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	492.119,35	216.034,67347600	2,2779646530
552	25/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	129.230.000,00	0,00	15.928.993,71066554	8,1128790900
561	25/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	3.620.000,00	0,00	446.204,11064849	8,1128790900
560	25/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.544,74	1.683,42996300	2,1056652650
543	26/06/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	472.856,31	23.778,73196920	19,8856823200
553	26/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	7.539.721,72	929.345,17444222	8,1129400800
554	26/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	1.450.000,00	0,00	178.726,82221962	8,1129400800
562	26/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	12.700,00	1.565,40044289	8,1129400800
544	29/06/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	864.941,95	43.493,83568727	19,8865410800
563	29/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	79.188,05	34.755,90795500	2,2784054470
564	29/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	5.409.952,54	666.825,05942508	8,1130012500
555	29/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.254.305,19	989.422,31417500	2,2784054470
572	29/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	131.831.087,09	16.249.361,12736530	8,1130012470
565	30/06/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	102.776,88	5.167,92232920	19,8874660700
566	30/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.571,34	0,00	746,15138300	2,1059265370
567	30/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.264,96	0,00	1.075,51709900	2,1059265370
568	30/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	1.367.341,68	168.535,83068420	8,1130622200
569	30/06/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	4.928,26	0,00	607,44757880	8,1130622200

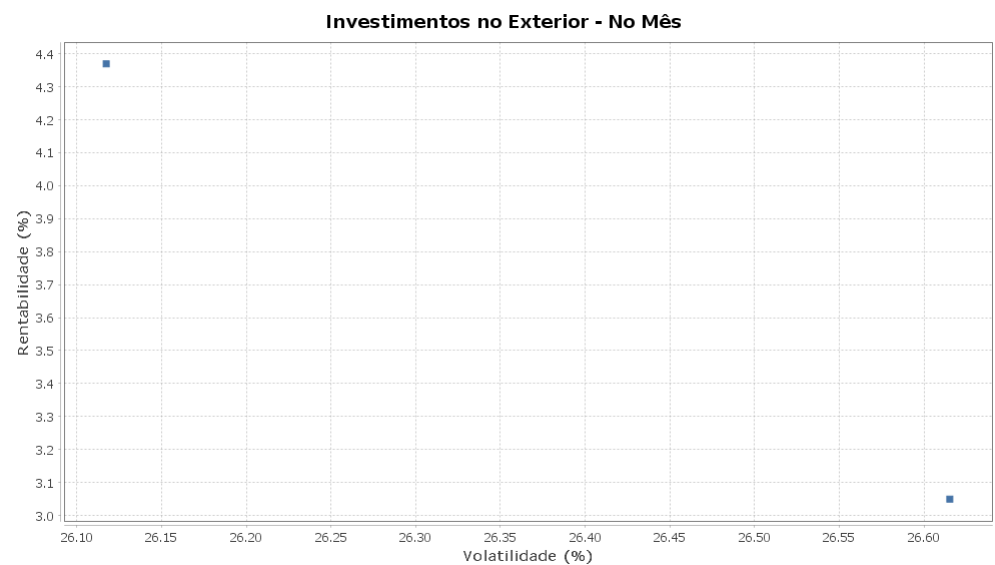
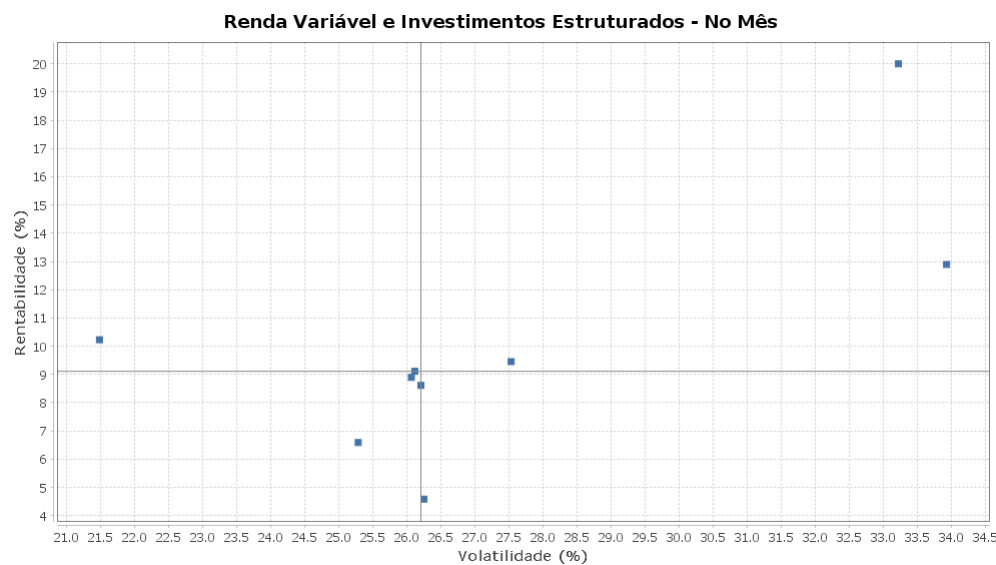
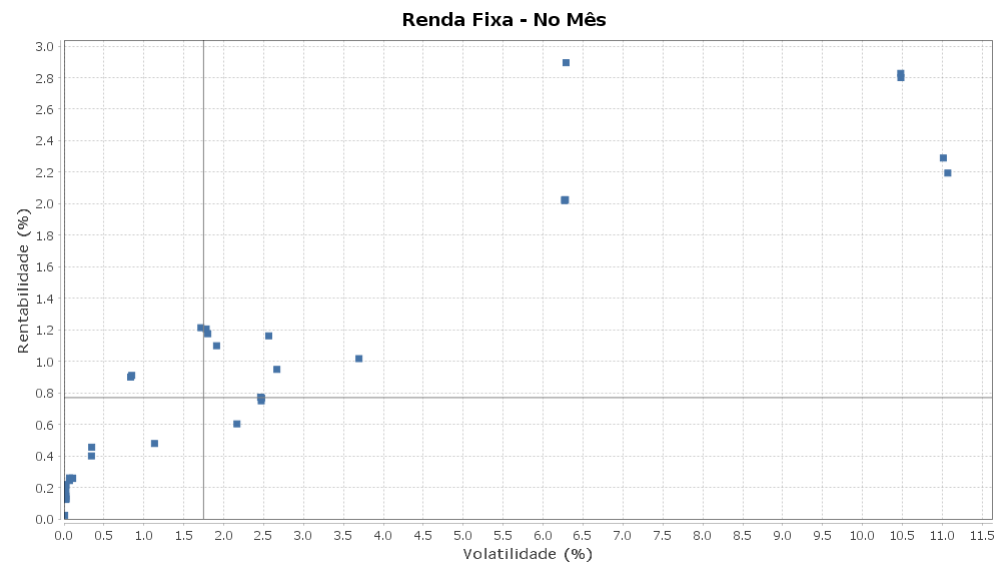
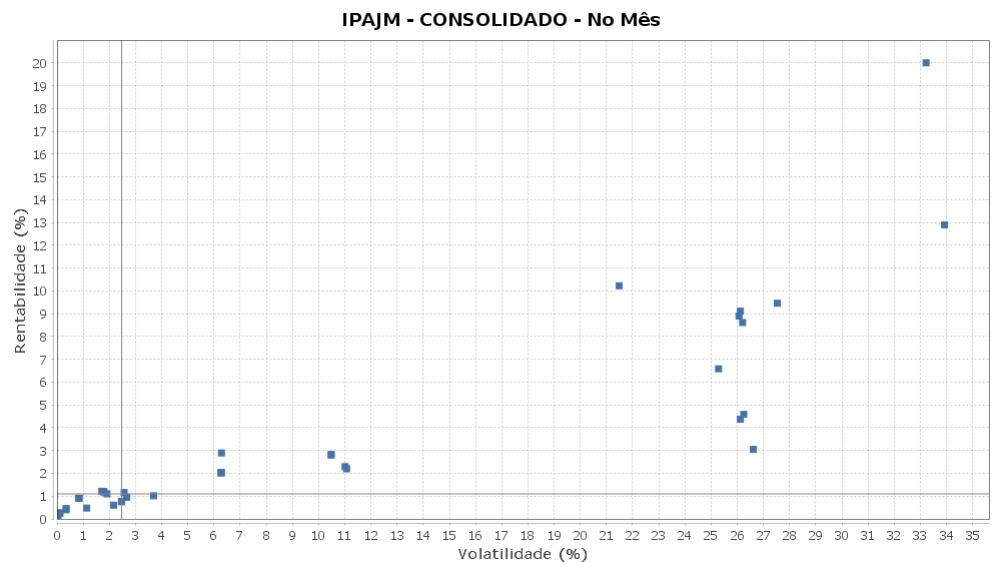
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rendimentos Realizados

Artigo	Ativo	Quantidade	Valor Aplicação	Valor Resgate	Rendimento
Artigo 7º IV, Alínea a	33-BRB TESOIRO	1.083,054810	4.256,79	4.286,81	30,02
Artigo 7º IV, Alínea a	BB PREV RF FLUXO FIC	39.420,589224	82.621,26	82.998,17	376,91
Artigo 7º IV, Alínea a	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.323.893,128290	2.877.448,11	3.016.102,71	138.654,60
Artigo 7º IV, Alínea a	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	20.842.164,953944	169.070.652,43	169.089.207,56	18.555,13
Artigo 7º IV, Alínea a	FI BANESTES INVEST MONEY RF	139.344,860690	2.766.647,14	2.770.468,81	3.821,67

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,00	0,02	81.339.014,36	1,72
FI BANESTES INVEST MONEY RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,13	950.848,00	0,02
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,14	51,84	0,00
LFT 010324	Artigo 7º I, Alínea a	0,02	0,01	0,22	111.744.004,26	2,36
33-BRB TESOURO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,12	8.954,20	0,00
35-BRB MILLENIUM	Artigo 7º I, Alínea b	0,02	0,01	0,17	1.386.327,87	0,03
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,13	571.847,99	0,01
LFT 010921	Artigo 7º I, Alínea a	0,02	0,01	0,21	246.237.432,23	5,21
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,02	0,24	94.997.112,71	2,01
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,02	0,26	312.148.199,51	6,60
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,11	0,02	0,26	40.209.252,11	0,85
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,11	0,02	0,26	287.869.895,18	6,09
Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,34	0,05	0,40	14.032.572,45	0,30
Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,35	0,06	0,46	168.740.943,71	3,57
NTN-B 150521	Artigo 7º I, Alínea a	0,83	0,13	0,90	315.409.287,33	6,67
NTN-B 150820	Artigo 7º I, Alínea a	0,85	0,13	0,91	34.007.420,82	0,72
Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1	Artigo 7º I, Alínea b	1,13	0,14	0,48	16.334.216,48	0,35
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,71	0,24	1,21	29.214.027,65	0,62
NTN-B 150822	Artigo 7º I, Alínea a	1,78	0,24	1,21	411.557.009,27	8,70
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	0,24	1,18	32.672.356,40	0,69
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,91	0,25	1,10	34.258.546,96	0,72
Banestes Estrategia FIC de FI Renda Fixa	Artigo 7º IV, Alínea a	2,17	0,25	0,60	7.131.625,00	0,15
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,46	0,29	0,77	49.891.775,35	1,06
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,47	0,29	0,75	694.248.885,96	14,68
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,47	0,29	0,77	36.749.667,06	0,78
NTN-B 150523	Artigo 7º I, Alínea a	2,56	0,32	1,16	75.839.063,52	1,60
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,67	0,32	0,95	656.574.890,40	13,89
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO	Artigo 7º I, Alínea b	3,69	0,43	1,02	20.946.700,99	0,44
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	6,27	0,74	2,02	2.006.759,46	0,04
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,27	0,74	2,02	13.460.259,23	0,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,28	0,75	2,03	13.605.352,14	0,29
NTN-B 150830	Artigo 7º I, Alínea a	6,29	0,79	2,89	115.903.883,73	2,45
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	10,48	1,22	2,83	10.457.853,34	0,22
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	10,48	1,22	2,80	7.322.080,15	0,15
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	11,01	1,25	2,29	33.401.262,60	0,71
Banestes Institucional FI Renda Fixa	Artigo 7º IV, Alínea a	11,07	1,25	2,19	31.345.229,61	0,66
Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	Artigo 8º II, Alínea a	21,49	2,69	10,23	5.066.572,35	0,11
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	25,29	2,92	6,59	119.430.284,54	2,53
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	26,07	3,11	8,89	94.318.057,30	1,99
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	26,12	3,12	9,11	8.759.101,24	0,19
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	26,12	2,91	4,37	85.712.615,49	1,81
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	26,21	3,11	8,61	50.725.862,48	1,07
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	26,25	2,93	4,58	28.429.959,74	0,60
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	26,62	2,90	3,05	21.274.707,33	0,45
FIA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	27,53	3,28	9,45	138.650.292,02	2,93
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	Artigo 8º IV, Alínea b	33,22	4,31	20,00	31.200.000,00	0,66
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	33,93	4,09	12,89	138.998.577,08	2,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 15,48% do patrimônio líquido do fundo FIA BRASIL IBX-50 (Art. 8, Inciso I, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- O Instituto está com 19,64% 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;