



IPAJM - ESTADO DO ESPÍRITO
MAIO 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	85,56%
------------	--------

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	1,22	0,82	-0,06	33.700.616,51	0,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830	13,44	1,78	-1,95	112.643.213,42	2,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822	5,06	2,12	2,26	406.655.988,31	8,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	6,14	2,52	2,93	74.968.404,96	1,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150521	2,24	1,03	1,03	312.594.500,25	6,77
TESOURO NACIONAL	LFT 010324	0,07	0,24	1,49	111.501.099,35	2,41
TESOURO NACIONAL	LFT 010921	0,06	0,24	1,53	245.711.269,96	5,32
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		3,47	1,30	1,36	1.297.775.092,76	28,10

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	5,87	1,38	3,88	49.509.573,83	1,07	4.981.094.634,77	0,99
BRB	BRB	35-BRB MILLENIUM	0,08	0,20	1,29	1.383.920,15	0,03	85.714.498,65	1,61
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	22,64	0,71	-10,47	32.653.485,31	0,71	260.165.233,98	12,55
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,54	0,39	2,19	287.132.803,71	6,22	7.581.218.915,05	3,79
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,41	1,50	-3,69	13.193.804,02	0,29	5.454.809.775,70	0,24
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,48	1,50	-3,82	13.335.286,55	0,29	5.962.762.833,75	0,22
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,54	0,39	2,22	40.105.293,94	0,87	10.824.772.393,85	0,37
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,00	2,11	1,92	33.886.266,59	0,73	8.882.233.150,63	0,38
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,12	2,00	1,65	28.863.904,83	0,62	6.335.156.883,21	0,46

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	19,00	1,00	-7,95	7.122.642,72	0,15	1.970.647.318,20	0,36
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,11	1,00	-8,04	10.170.313,94	0,22	1.931.164.845,98	0,53
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO	8,70	1,89	4,81	20.735.844,95	0,45	3.201.679.661,52	0,65
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	4,03	1,91	1,92	32.292.826,49	0,70	7.977.728.907,89	0,40
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,85	1,40	3,93	36.469.759,36	0,79	16.970.991.295,24	0,21
BANESTES	BANESTES	Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1	4,21	0,81	4,35	16.256.417,18	0,35	208.974.590,90	7,78
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,08	1,07	0,79	650.404.555,30	14,08	10.653.642.517,78	6,10
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	6,03	1,38	3,85	689.083.441,72	14,92	12.026.220.422,43	5,73
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			5,02	1,13	1,90	1.962.600.140,59	42,49		

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	12,40	1,49	-3,80	1.966.929,30	0,04	2.853.203.781,55	0,07
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,40	1,49	-3,80	1.966.929,30	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	0,06	0,04	0,04	3.717.272,10	0,08	94.396.464,33	3,94
BANESTES	BANESTES	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,99	0,37	-2,02	13.976.743,91	0,30	323.135.106,30	4,33
BRB	BRB	33-BRB TESOURO	0,08	0,15	1,05	13.228,11	0,00	262.992.869,54	0,01
BANESTES	BANESTES	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,06	0,03	0,36	56.993.559,93	1,23	754.928.997,84	7,55
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,30	0,33	1,12	94.567.271,18	2,05	4.656.011.205,04	2,03
BANESTES	BANESTES	Banestes Institucional FI Renda Fixa	25,86	1,49	-10,32	30.672.246,49	0,66	225.670.767,85	13,59
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,26	1,11	314.347.509,47	6,81	2.574.764.271,12	12,21
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	0,16	1,11	345.578,82	0,01	1.994.953.765,50	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,06	0,16	0,46	51,77	0,00	588.967.069,42	0,00
BANESTES	BANESTES	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,92	0,25	-1,99	167.975.944,42	3,64	1.967.279.723,17	8,54

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	2,56	0,37	-1,90	7.088.887,99	0,15	177.142.920,74	4,00
		Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a	1,28	0,30	-0,52	689.698.294,19	14,93		
		Renda Fixa	3,66	1,04	1,28	3.952.040.456,84	85,56		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

12,22%

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	44,16	9,07	-25,48	126.674.098,06	2,74	816.953.107,68	15,51
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	43,64	8,21	-24,20	86.614.266,44	1,88	727.406.879,47	11,91
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	42,11	7,85	-24,58	8.027.790,64	0,17	107.680.207,26	7,46
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	42,94	8,49	-24,27	46.704.783,58	1,01	577.291.375,77	8,09
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			43,66	8,65	-24,91	268.020.938,72	5,80		

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	37,59	4,80	-27,09	112.050.546,04	2,43	851.341.431,12	13,16
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	38,32	7,50	-20,43	27.184.124,94	0,59	768.284.939,45	3,54
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	46,53	4,76	-30,42	123.123.860,90	2,67	950.738.261,40	12,95
BANESTES	BANESTES	Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	44,74	10,24	-16,86	4.596.483,74	0,10	141.474.377,54	3,25
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			41,42	5,14	-27,64	266.955.015,62	5,78		

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	26,14	-18,30	-10,03	3.285.429,89	0,07	150.839.883,53	2,18
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			26,14	-18,30	-10,03	3.285.429,89	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	41,27	4,58	-12,75	26.000.000,00	0,56	155.729.883,63	16,70
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			41,27	4,58	-8,23	26.000.000,00	0,56		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			39,59	6,57	-25,18	564.261.384,23	12,22		
---	--	--	-------	------	--------	----------------	-------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,22%

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	25,65	2,78	27,29	82.124.244,82	1,78	1.133.955.741,98	7,24
BB	BB	BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	25,32	1,51	25,49	20.645.174,14	0,45	264.709.340,08	7,80
Sub-total Artigo 9º A, III			25,47	2,52	26,92	102.769.418,96	2,22		
Investimentos no Exterior			25,47	2,52	26,92	102.769.418,96	2,22		
Total						4.619.071.260,03	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	1.297.775.092,76	28,10	20,00	27,00	60,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	1.962.600.140,59	42,49	15,00	36,30	60,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	1.966.929,30	0,04	0,00	0,10	2,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	689.698.294,19	14,93	5,00	10,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	3.952.040.456,84	85,56				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alinea a	Fundos de Ações Referenciados	268.020.938,72	5,80	0,00	6,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	266.955.015,62	5,78	0,00	5,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	3.285.429,89	0,07	0,00	0,10	2,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	26.000.000,00	0,56	0,00	0,50	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	564.261.384,23	12,22				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	102.769.418,96	2,22	0,00	4,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	102.769.418,96	2,22				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

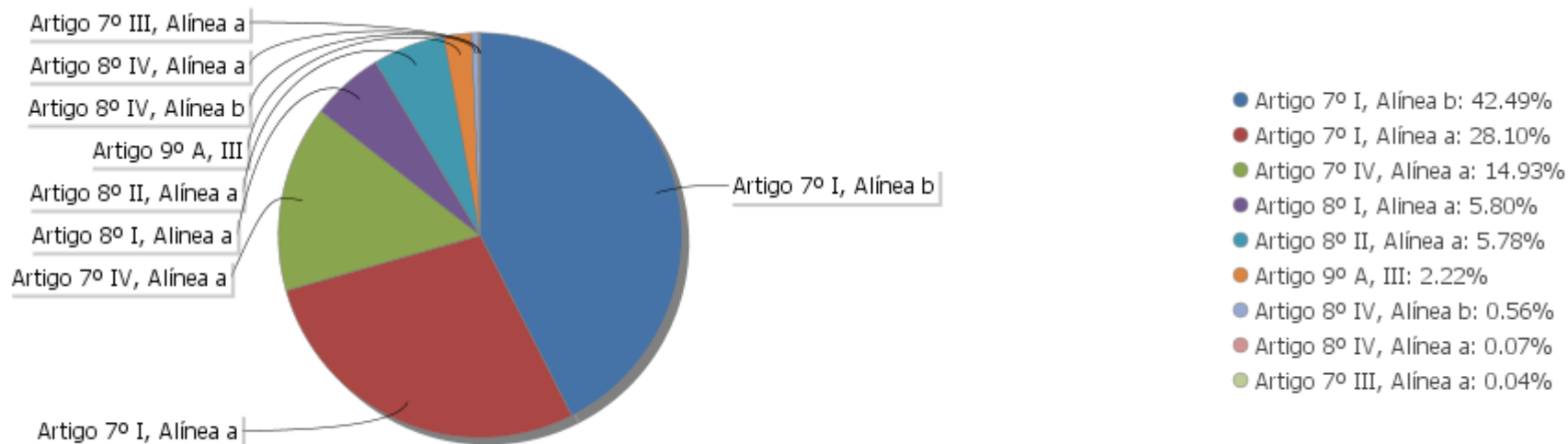
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,30 549,52	1,36 88,13	0,29 34,00	2,30 119,69	7,69 157,97	16.601.766,29	17.508.817,39
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,13 478,42	1,90 123,50	0,85 98,11	2,61 135,78	8,24 169,11	21.894.371,91	40.708.254,91
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,49 630,18	-3,80 -247,19	-4,44 -515,37	-1,89 -98,36	6,26 128,45	28.800,62	-77.776,22
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,30 127,80	-0,52 -34,11	-1,20 -139,32	0,01 0,59	3,28 67,30	2.121.529,65	-3.109.687,14
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,65 0,08	-24,91 -0,49	-16,81 -0,71	-19,60 -0,35	-10,35 -0,43	21.340.195,39	-92.300.937,78
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	5,14 -3,42	-27,64 -3,22	-21,48 -5,38	-20,63 -1,38	-9,28 0,64	13.054.949,09	-103.784.564,93
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-18,30 -26,87	-10,03 14,39	-14,12 1,98	-10,11 9,13	-16,31 -6,39	-735.902,77	-350.617,60
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	4,58 -3,99	-8,23 16,20	-10,12 5,97	2,40 21,65	41,57 51,49	1.138.800,00	-2.309.800,00
Artigo 9º A, III % do CDI	2,52 1.070,24	26,92 1.749,24	26,89 3.121,18	24,62 1.282,66	52,88 1.085,55	2.529.763,11	20.165.887,38
						77.974.273,29	-123.550.423,99

Análise de Liquidez

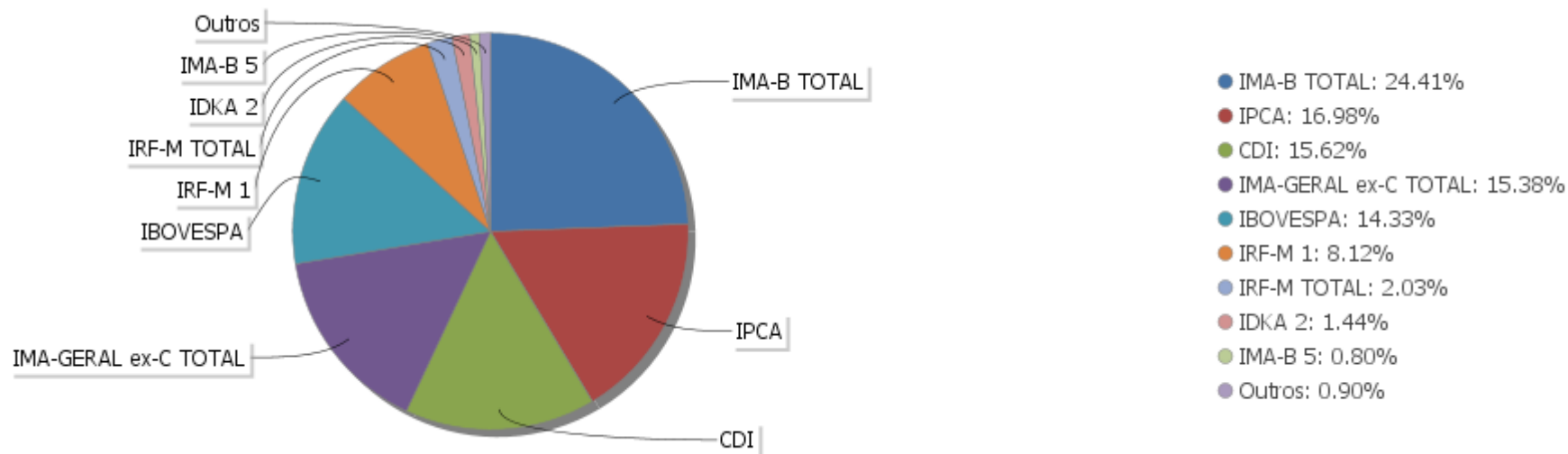
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	3.289.515.558,59	71,22	3.289.515.558,59	71,22
de 31 a 364 dias	378.075.725,44	8,19	3.667.591.284,03	79,40
acima de 365 dias	951.479.976,00	20,60	4.619.071.260,03	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

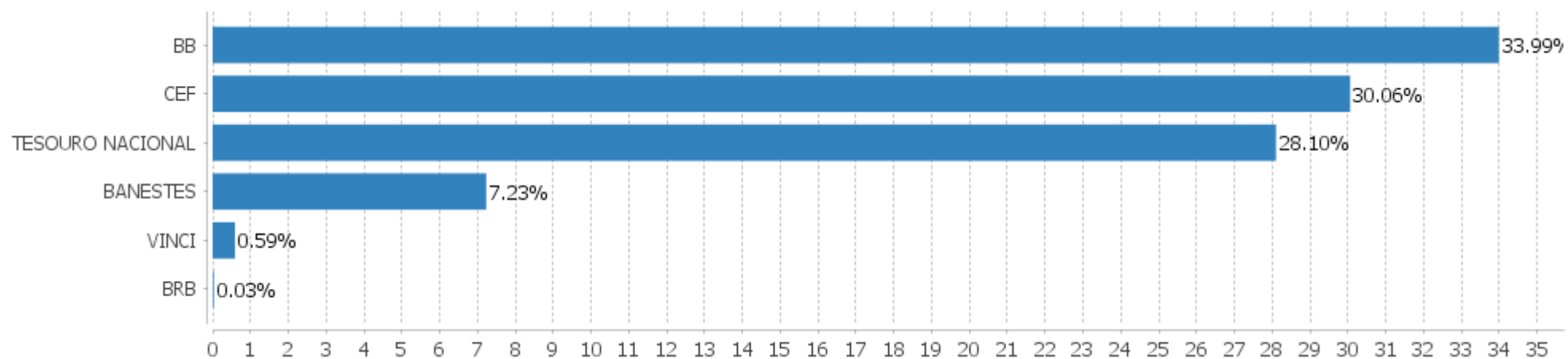


Alocação Por Estratégia



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								-2,62
IPCA + 5%	0,64	0,60	0,50	0,08	0,01								1,83
p.p. indexador	-0,22	-1,52	-5,98	1,74	1,70								-4,45
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

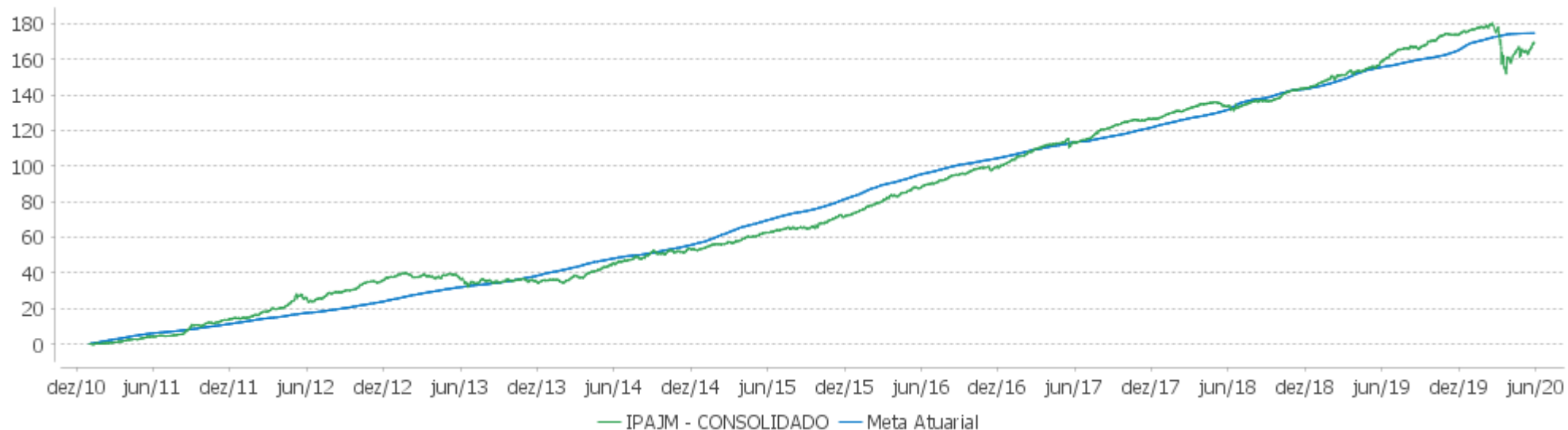
RELATÓRIO TRIMESTRAL

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

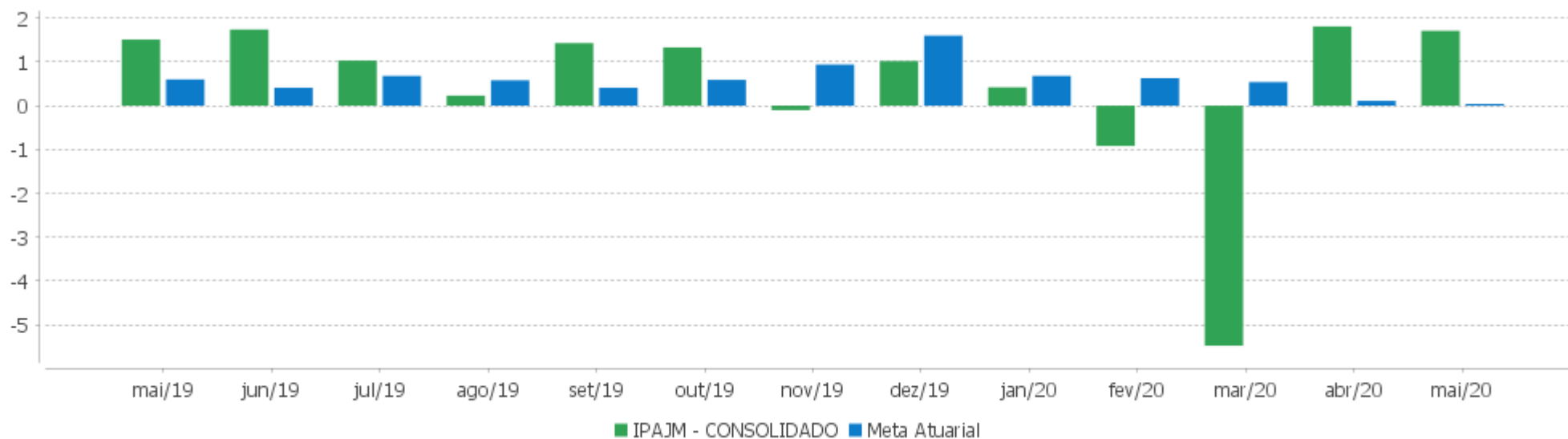
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	59	52,21	03 meses	-2,12	0,58	-2,70	14,37
Meses abaixo da Meta Atuarial	54	47,79	06 meses	-1,63	3,46	-5,09	10,39
			12 meses	4,05	7,25	-3,20	7,39
			24 meses	15,33	18,56	-3,23	5,48
			36 meses	26,05	29,05	-3,00	4,55
			Desde 31/12/2010	169,29	183,91	-14,62	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.	1,49 -0,03	-10,32 -6,68	-11,15 -6,83	-8,19 -6,49	1,29 -5,39	29,08 -2,91	38,10 -5,41
Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI % do CDI	0,37 157,57	-2,02 -131,37	-2,59 -300,91	-1,68 -87,54	1,05 21,59	7,31 63,27	15,50 77,12
Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI % do CDI	0,25 106,88	-1,99 -129,26	-2,66 -308,85	-1,60 -83,14	1,11 22,69	8,06 69,76	17,05 84,81
Banestes Estrategia FIC de FI Renda Fixa % do CDI	0,37 156,09	-1,90 -123,43	-2,91 -337,83	-0,78 -40,77	8,23 168,95		
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,26 108,46	1,11 72,02	0,48 55,88	1,47 76,39	4,27 87,61	10,77 93,25	19,35 96,29
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,16 66,82	1,11 72,28	0,61 70,39	1,40 72,95	3,77 77,32	9,20 79,65	16,34 81,31
Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto % do CDI	0,03 12,47	0,36 23,40	0,16 18,55	0,49 25,52	1,86 38,21	5,20 45,02	10,02 49,87
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,33 139,24	1,12 73,00	0,47 55,08	1,48 77,07	4,25 87,22	10,73 92,88	19,09 94,97
33-BRB TESOURO % do CDI	0,15 64,14	1,05 68,22	0,57 66,41	1,34 69,64	3,76 77,27	9,43 81,66	16,51 82,13
FI BANESTES INVEST MONEY RF % do CDI	0,16 66,33	1,11 72,36	0,61 70,79	1,41 73,32	3,77 77,44	9,20 79,62	16,26 80,89
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,17 72,82	1,19 77,55	0,66 76,14	1,50 78,31	4,00 82,15	9,71 84,03	17,16 85,39
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,49 -0,03	-3,80 -0,17	-4,44 -0,12	-1,89 -0,18	6,26 -0,42	31,07 -0,92	42,17 -1,34
NTN-B 150820 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,82 -0,70	-0,06 3,57	-0,31 4,01	0,74 2,44	4,84 -1,84	14,89 -17,10	28,08 -15,42
NTN-B 150822 Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,12 0,60	2,26 5,90	0,84 5,16	3,48 5,19	9,90 3,22	27,31 -4,69	40,25 -3,26
LFT 010921	0,24	1,53	0,86	1,91	4,87	11,57	20,36
LFT 010324	0,24	1,49	0,84	1,88	4,84	11,60	
NTN-B 150523 Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,52 1,00	2,93 6,57	1,44 5,76	4,45 6,15	11,73 5,05	31,08 -0,91	43,41 -0,10
NTN-B 150521	1,03	1,03	0,28	2,04	7,17	20,07	33,87

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.	-0,49	4,67	4,60	3,74	0,49	-11,92	-9,64
NTN-B 150830	1,78	-1,95	-3,71	-0,85	7,82	36,38	47,73
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,27	1,69	0,61	0,86	1,14	4,38	4,23
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,50	-3,82	-4,48	-1,91	6,23	31,21	42,33
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,19	-0,16	-0,20	-0,45	-0,78	-1,17
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,11	1,92	0,74	3,15	9,15	23,37	35,19
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,11	-0,08	-0,14	-0,31	-0,56	-0,90
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,39	2,19	1,41	2,60	6,04	13,42	22,44
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,12	-0,07	-0,14	-0,28	-0,55	-0,85
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,40	3,93	2,42	4,57	11,04	25,67	38,26
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,02	-0,11	-0,05	-0,12	-0,27	-0,48	-0,96
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,00	-8,04	-8,27	-5,68	3,72	36,70	46,24
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,02	-0,15	-0,06	-0,20	-0,45	-1,38	-1,80
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO	1,89	4,81	2,90	5,55	13,40	31,23	45,23
Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,03	-0,13	-0,06	-0,15	-0,25	-0,44	-1,05
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,71	-10,47	-11,02	-8,17	2,16	33,67	42,63
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,81	-6,83	-6,71	-6,46	-4,52	1,67	-0,88
Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1	0,81	4,35	2,87	4,81	10,49	20,96	32,13
Var. IRF-M 1 p.p.	0,39	2,04	1,40	2,07	4,17	6,99	8,85
BB PREV RF IDKA2	2,00	1,65	0,63	2,82	8,06	20,02	32,08
Var. IDKA 2 p.p.	0,25	-0,68	-0,47	-0,74	-0,97	-2,15	-3,11
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	1,07	0,79	-0,15	1,76	7,59	22,37	33,47
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,10	-0,00	0,00	0,05	0,17	0,40	0,42
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,38	3,85	2,37	4,46	11,99	27,82	38,17
Var. IPCA p.p.	1,76	4,01	2,99	3,48	10,11	21,20	28,50
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	1,91	1,92	0,85	3,04	8,24	20,20	32,44
Var. IDKA 2 p.p.	0,15	-0,41	-0,24	-0,52	-0,79	-1,97	-2,76
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,50	-3,69	-4,36	-1,79	6,48	31,36	42,46
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,06	-0,04	-0,09	-0,20	-0,64	-1,05
BB PREV RF IRF-M	1,38	3,88	2,35	4,51	10,99	25,54	38,26
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,04	-0,17	-0,12	-0,19	-0,31	-0,61	-0,97
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,39	2,22	1,42	2,63	6,11	13,55	22,63
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,09	-0,05	-0,11	-0,21	-0,42	-0,66
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,00	-7,95	-8,27	-5,45	4,09	37,43	46,99
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,03	-0,07	-0,06	0,04	-0,07	-0,65	-1,05
35-BRB MILLENIUM	0,20	1,29	0,72	1,63	4,41	10,71	18,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	84,73	83,64	83,20	85,15	90,60	92,70	92,10
Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	6,55 1,54	-16,86 8,22	-12,28 6,59	-10,89 6,71	3,44 8,94	41,18 11,64	66,84 21,26
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	4,76 -3,80	-30,42 -6,00	-24,26 -8,16	-21,69 -2,45	-2,38 7,55	20,38 6,50	42,95 3,58
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	7,50 2,50	-20,43 4,65	-16,30 2,56	-13,65 3,95	-1,18 4,33	31,96 2,42	50,60 5,01
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	4,80 -3,77	-27,09 -2,67	-19,79 -3,69	-21,10 -1,85	-15,56 -5,64	10,45 -3,43	24,38 -14,99
FIA BRASIL IBX-50 Var. IBOVESPA p.p.	9,07 0,50	-25,48 -1,06	-17,06 -0,96	-20,20 -0,96	-11,37 -1,45	7,93 -5,94	33,50 -5,87
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	8,49 -0,08	-24,27 0,15	-16,01 0,08	-19,09 0,16	-9,96 -0,04	13,28 -0,60	37,64 -1,73
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	7,85 -0,72	-24,58 -0,16	-16,20 -0,10	-19,50 -0,25	-10,56 -0,64	12,39 -1,49	36,28 -3,09
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	8,21 -0,36	-24,20 0,22	-16,92 -0,82	-18,48 0,77	-8,04 1,88	19,04 5,17	37,64 -1,74
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII Var. IPCA p.p.	3,87 4,25	-12,75 -12,59	-11,80 -11,19	-4,06 -5,05	27,45 25,58	25,24 18,62	16,96 7,29
FIP CAIXA CYRELA Var. IPCA p.p.	-18,30 -17,92	-10,03 -9,87	-14,12 -13,50	-10,11 -11,10	-16,22 -18,09	2,11 -4,51	0,82 -8,85
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	2,78 -5,79	27,29 51,71	26,70 42,80	25,05 44,30	53,85 63,77	66,23 52,36	116,02 76,65
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	1,51 -7,06	25,49 49,91	27,64 43,73	22,94 42,18	48,39 58,31	56,61 42,74	101,61 62,24
CDI	0,24	1,54	0,86	1,92	4,87	11,55	20,10
IBOVESPA	8,57	-24,42	-16,10	-19,25	-9,92	13,87	39,37
INPC + 6%	0,21	2,45	1,14	4,20	8,15	20,09	29,45
IPCA + 6%	0,08	2,22	0,82	3,90	7,97	19,75	30,46

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	0,42	2,31	1,47	2,74	6,33	13,97	23,28
IRF-M 1+	1,92	4,94	2,96	5,70	13,65	31,67	46,28
IRF-M TOTAL	1,42	4,05	2,47	4,69	11,31	26,14	39,22
IMA-B 5	2,12	2,03	0,82	3,29	9,46	23,93	36,10
IMA-B 5+	1,02	-7,88	-8,21	-5,48	4,17	38,08	48,04
IMA-B TOTAL	1,52	-3,64	-4,32	-1,70	6,68	31,99	43,51
IMA-C TOTAL	2,63	3,59	0,39	4,00	13,32	37,08	56,72
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,97	0,80	-0,15	1,71	7,42	21,97	33,05
IMA-GERAL TOTAL	1,02	0,88	-0,13	1,78	7,59	22,39	33,68
IDKA 2	1,75	2,33	1,10	3,57	9,03	22,17	35,19
IDKA 20	0,44	-15,84	-14,60	-12,53	-2,27	47,87	55,09
CDI	0,24	1,54	0,86	1,92	4,87	11,55	20,10
Renda Variável							
IBOVESPA	8,57	-24,42	-16,10	-19,25	-9,92	13,87	39,37
IBRX 100	8,52	-24,19	-16,35	-18,67	-8,92	16,77	41,65
IBRX 50	9,10	-24,78	-16,07	-19,84	-11,37	10,51	35,55
SMALL CAP	5,07	-30,73	-24,82	-21,96	-1,69	25,45	48,98
IFIX	2,08	-16,88	-10,33	-8,05	4,11	20,03	29,22
Índice Consumo - ICON	7,65	-19,06	-13,24	-12,56	7,69	32,60	36,80
Índice Dividendos - IDIV	5,00	-25,08	-18,87	-17,60	-5,50	29,54	45,59
Indicadores Econômicos							
IPCA	-0,38	-0,16	-0,62	0,99	1,88	6,62	9,67
INPC	-0,25	0,06	-0,30	1,28	2,05	6,93	8,81
IGPM	0,28	2,79	2,34	4,94	6,51	14,65	19,54
SELIC	0,24	1,54	0,86	1,92	4,87	11,55	20,11
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
393	04/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.966,53	0,00	936,38331800	2,1001330000
394	04/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.392,22	0,00	1.615,24015400	2,1001330000
392	04/05/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	176.073,05	9.002,75796920	19,5576789500
396	04/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	123.729,97	0,00	15.258,34356916	8,1090040600
399	05/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	143.001,45	0,00	17.634,46175515	8,1092041200
400	05/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.223,04	0,00	1.534,52134400	2,1003550000
401	05/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.329,04	0,00	632,76913900	2,1003550000
405	06/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	5.885.824,00	725.802,38833793	8,1094029100
406	06/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	14.950.000,00	0,00	1.843.538,93450638	8,1094029100
403	06/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	947,02	0,00	450,83957200	2,1005690000
404	06/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.347,98	0,00	1.117,78241200	2,1005690000
402	06/05/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	220.557,11	11.272,14753672	19,5665563500
409	07/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	3.260,39	402,04070274	8,1096017800
407	07/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	4.635,30	0,00	2.206,47406100	2,1007720000
408	07/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.735,74	0,00	1.302,25429800	2,1007720000
414	08/05/2020	33-BRB TESOURO	0,00	3.224,24	815,80521321	3,9522179410
413	08/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	890.306,09	0,00	109.781,27454165	8,1098174000
410	08/05/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	5.832,48	298,00421788	19,5718035200
411	08/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.571,34	0,00	747,92878500	2,1009210000
412	08/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.373,08	0,00	653,56069100	2,1009210000
418	11/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	2.964,70	365,56515000	8,1099087300
419	11/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	157.685,34	0,00	19.443,54065153	8,1099087300
415	11/05/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	13.531,46	691,23299725	19,5758305100
416	11/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	7.234,70	0,00	3.443,32298500	2,1010800000
417	11/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	5.452,46	0,00	2.595,07385900	2,1010800000
420	12/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	9.452,57	0,00	4.498,58388800	2,1012320000
421	12/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	13.563,05	0,00	6.454,80733800	2,1012320000
423	13/05/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	42.971,91	2.196,74918629	19,5615914000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
424	13/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	4.724,00	0,00	2.248,03744300	2,1013880000
425	13/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.924,10	0,00	1.867,38436300	2,1013880000
426	13/05/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	170.000,00	0,00	91.067,80212145	1,8667410000
427	14/05/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	20.581,61	1.052,22532206	19,5600786000
428	14/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.019,28	0,00	960,85814700	2,1015380000
429	14/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	14.933,51	0,00	7.105,99062400	2,1015380000
430	14/05/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	170.000,00	91.060,53382899	1,8668900000
431	14/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	170.000,00	0,00	46.134,74929020	3,6848580000
422	15/05/2020	LFT 010921	10.617.084,36	0,00	1.000,00000000	10.617,0843690000
437	15/05/2020	33-BRB TESOUREO	0,00	1.150,04	290,88364304	3,9536083500
438	15/05/2020	35-BRB MILLENIUM	121.667,73	0,00	39.510,38283827	3,0793862590
435	15/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	3.616.806,63	0,00	445.953,80897259	8,1102718600
436	15/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	9.076,21	1.119,10058640	8,1102718600
432	15/05/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	2.128,14	108,59420225	19,5971788200
433	15/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.780,08	0,00	1.322,78209200	2,1016910000
434	15/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.073,00	0,00	986,34833400	2,1016910000
439	18/05/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	131.047,11	6.686,25481660	19,5994788700
440	18/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	11.720,53	0,00	5.576,31135400	2,1018420000
441	18/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.487,62	0,00	707,76938300	2,1018420000
446	19/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	4.837.291,81	596.426,77574483	8,1104538000
447	19/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	1.590.000,00	0,00	196.043,28427610	8,1104538000
448	19/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	1.700.000,00	0,00	209.606,02721344	8,1104538000
442	19/05/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	9.054,45	462,02792947	19,5971919100
443	19/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	8.986,70	0,00	4.275,34005900	2,1019840000
444	19/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	5.104,24	0,00	2.428,29534100	2,1019840000
445	19/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	189.377,08	83.410,28540400	2,2704283900
450	20/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	35.250.000,00	0,00	4.346.193,75205745	8,1105450000
451	20/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	4.350.000,00	0,00	536.338,80344539	8,1105450000
449	20/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.299,54	0,00	618,19931000	2,1021370000
452	20/05/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	16.307.312,44	832.252,07720708	19,5941985500

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
455	21/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	2.883.599,70	355.533,09709940	8,1106364600
456	21/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	2.771.215,15	0,00	341.676,65678710	8,1106364600
453	21/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	45.082,35	21.444,40110546	2,1022900000
454	21/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	11.690,16	0,00	5.560,67776500	2,1022900000
457	22/05/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	993,35	50,68781691	19,5974113800
460	22/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	458,40	0,00	218,03201300	2,1024430000
459	22/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	470.870,12	207.301,45410792	2,2714270000
462	22/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	16.667.408,72	2.054.983,06933730	8,1107280000
463	22/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	1.334.856,77	164.579,15613147	8,1107280000
464	22/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	3.649.779,43	0,00	449.994,06090242	8,1107280000
458	22/05/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	5.745.890,55	0,00	289.397,33988319	19,8546764500
461	22/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.089,48	3.372,02007379	2,1024430000
467	25/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	2.553.173,07	314.786,07470868	8,1108196200
468	25/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	823.782,56	0,00	101.565,88345806	8,1108196200
469	25/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	53.976,90	6.654,92546337	8,1108196200
470	25/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	614.260,03	0,00	75.733,41030662	8,1108196200
465	25/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	574,56	0,00	273,26183900	2,1025980000
466	25/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	28.863,62	13.727,59795263	2,1025980000
472	26/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	134.851.000,00	0,00	16.625.875,33983496	8,1109112900
473	26/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	19.764,19	2.436,74098892	8,1109112900
471	26/05/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	706.209,33	35.563,76747015	19,8575511000
475	27/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	287.389,03	0,00	35.431,99474527	8,1110034000
476	27/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	635,69	0,00	302,29164100	2,1029020000
474	27/05/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	478.809,04	24.110,44514140	19,8589879700
482	28/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	131.577.307,63	16.221.890,52638938	8,1110957700
483	28/05/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	5.430.978,76	669.573,99024768	8,1110957700
479	28/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	76.388,38	36.322,71651561	2,1030470000
480	28/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	816,90	0,00	388,43631000	2,1030470000
481	28/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	661,40	0,00	314,49599100	2,1030470000
478	28/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.188.385,77	962.988,15618956	2,2724950000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
477	28/05/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	845.395,62	42.566,84622978	19,8604241300
484	29/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	37.989,83	0,00	18.062,78498105	2,1032100000
485	29/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	644,88	0,00	306,61702826	2,1032100000

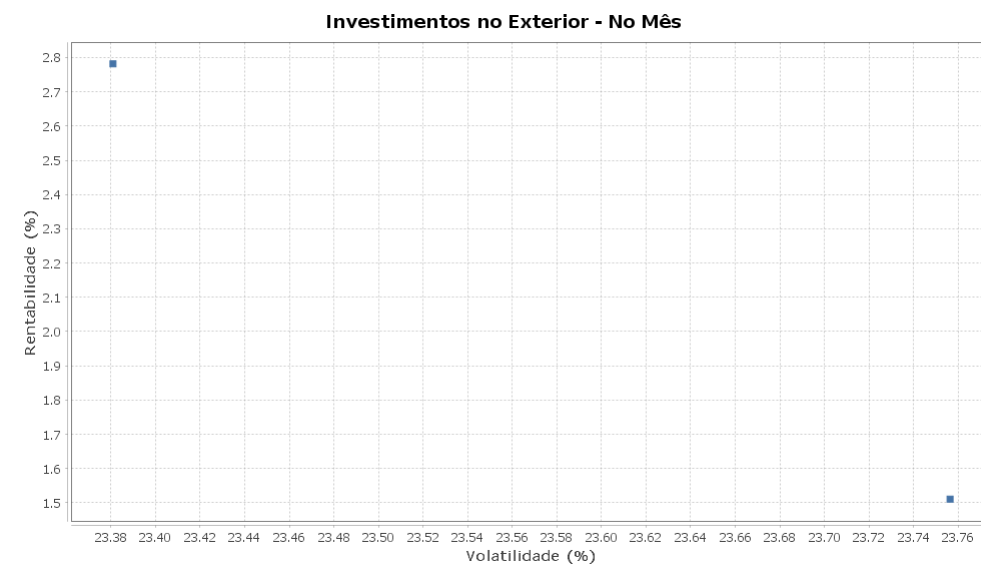
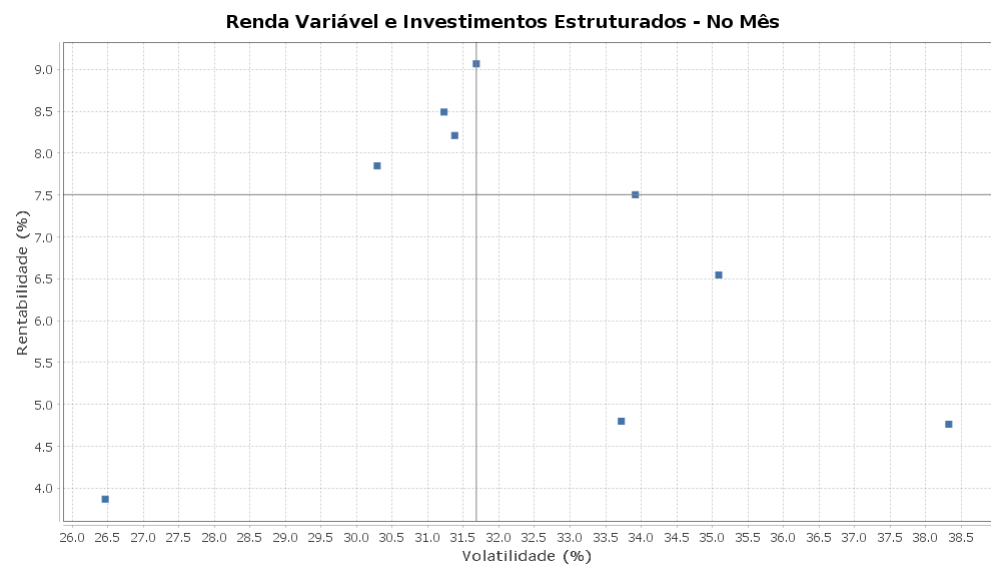
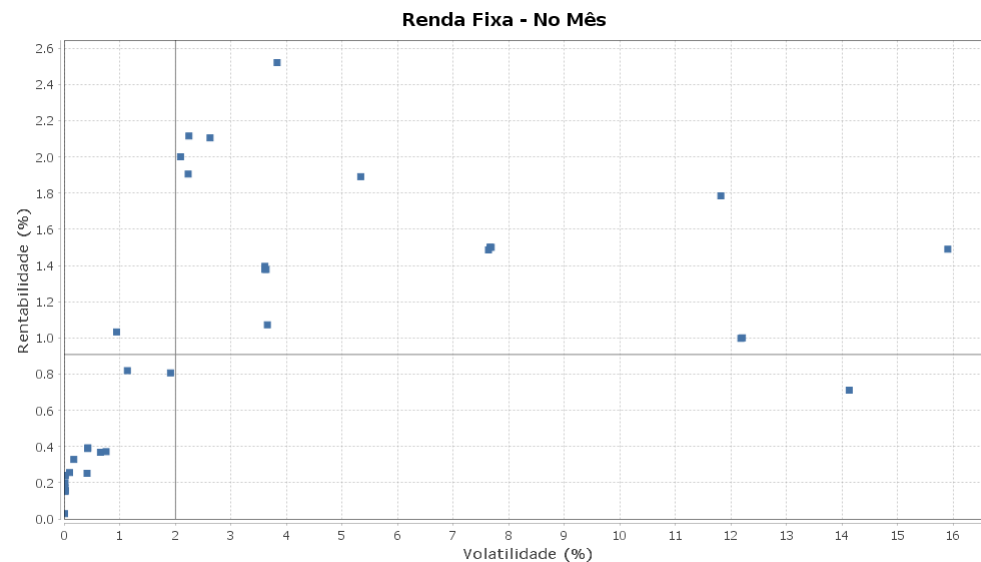
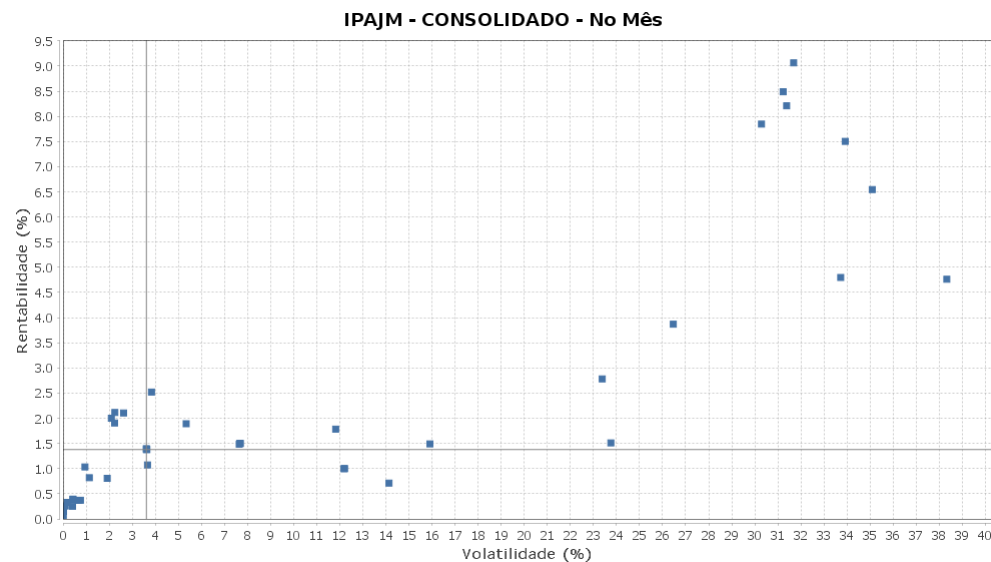
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rendimentos Realizados

Artigo	Ativo	Quantidade	Valor Aplicação	Valor Resgate	Rendimento
Artigo 7º IV, Alínea a	33-BRB TESOIRO	1.106,688856	4.349,67	4.374,28	24,61
Artigo 7º IV, Alínea a	BB PREV RF FLUXO FIC	74.866,735647	156.662,67	157.423,83	761,16
Artigo 7º IV, Alínea a	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.253.699,895701	2.724.884,91	2.848.632,97	123.748,06
Artigo 7º IV, Alínea a	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	21.114.553,450888	171.245.327,07	171.259.482,84	14.155,77
Artigo 7º IV, Alínea a	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	864.072,759202	17.358.818,93	16.930.083,11	-428.735,82
Artigo 7º IV, Alínea a	FI BANESTES INVEST MONEY RF	102.241,058841	2.029.963,15	2.030.413,99	450,84
Artigo 7º IV, Alínea a	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	91.060,533829	169.986,35	170.000,00	13,65

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	0,03	56.993.559,93	1,23
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,17	51,77	0,00
35-BRB MILLENIUM	Artigo 7º I, Alínea b	0,02	0,01	0,20	1.383.920,15	0,03
FI BANESTES INVEST MONEY RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,16	3.717.272,10	0,08
LFT 010324	Artigo 7º I, Alínea a	0,02	0,01	0,24	111.501.099,35	2,41
33-BRB TESOURO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,15	13.228,11	0,00
LFT 010921	Artigo 7º I, Alínea a	0,02	0,01	0,24	245.711.269,96	5,32
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,16	345.578,82	0,01
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,10	0,02	0,26	314.347.509,47	6,81
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,18	0,03	0,33	94.567.271,18	2,05
Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,41	0,06	0,25	167.975.944,42	3,64
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,43	0,06	0,39	287.132.803,71	6,22
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,43	0,06	0,39	40.105.293,94	0,87
Banestes Estrategia FIC de FI Renda Fixa	Artigo 7º IV, Alínea a	0,66	0,09	0,37	7.088.887,99	0,15
Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,76	0,10	0,37	13.976.743,91	0,30
NTN-B 150521	Artigo 7º I, Alínea a	0,95	0,15	1,03	312.594.500,25	6,77
NTN-B 150820	Artigo 7º I, Alínea a	1,14	0,16	0,82	33.700.616,51	0,73
Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1	Artigo 7º I, Alínea b	1,92	0,24	0,81	16.256.417,18	0,35
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,10	0,32	2,00	28.863.904,83	0,62
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,23	0,33	1,91	32.292.826,49	0,70
NTN-B 150822	Artigo 7º I, Alínea a	2,25	0,34	2,12	406.655.988,31	8,80
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,63	0,38	2,11	33.886.266,59	0,73
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,61	0,44	1,38	689.083.441,72	14,92
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,61	0,44	1,40	36.469.759,36	0,79
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,64	0,45	1,38	49.509.573,83	1,07
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,66	0,43	1,07	650.404.555,30	14,08
NTN-B 150523	Artigo 7º I, Alínea a	3,84	0,52	2,52	74.968.404,96	1,62
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO	Artigo 7º I, Alínea b	5,34	0,65	1,89	20.735.844,95	0,45
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	7,64	0,87	1,49	1.966.929,30	0,04
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,67	0,87	1,50	13.193.804,02	0,29

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	7,69	0,87	1,50	13.335.286,55	0,29
NTN-B 150830	Artigo 7º I, Alínea a	11,82	1,31	1,78	112.643.213,42	2,44
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	12,18	1,31	1,00	7.122.642,72	0,15
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	12,21	1,31	1,00	10.170.313,94	0,22
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	14,13	1,50	0,71	32.653.485,31	0,71
Banestes Institucional FI Renda Fixa	Artigo 7º IV, Alínea a	15,91	1,72	1,49	30.672.246,49	0,66
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	23,38	2,56	2,78	82.124.244,82	1,78
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	23,76	2,54	1,51	20.645.174,14	0,45
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	Artigo 8º IV, Alínea b	26,47	2,93	3,87	26.000.000,00	0,56
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	30,29	3,52	7,85	8.027.790,64	0,17
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	31,23	3,64	8,49	46.704.783,58	1,01
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	31,38	3,65	8,21	86.614.266,44	1,88
FIA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	31,68	3,72	9,07	126.674.098,06	2,74
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	33,72	3,73	4,80	112.050.546,04	2,43
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	33,92	3,88	7,50	27.184.124,94	0,59
Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	Artigo 8º II, Alínea a	35,09	3,95	6,55	4.596.483,74	0,10
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	38,32	4,20	4,76	123.123.860,90	2,67

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 15,51% 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 16,70% 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;