



IPAJM - ESTADO DO ESPÍRITO SANTO
NOVEMBRO 2020



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 22.12.2020.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA **81,98%**

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 150830	13,94	2,44	3,85	116.517.007,94	2,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822	4,96	1,19	7,24	415.474.485,58	8,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	6,14	1,32	6,75	75.749.384,64	1,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150521	2,10	1,21	6,03	319.047.115,59	6,43
TESOURO NACIONAL	LFT 010324	0,58	0,10	2,05	112.117.764,39	2,26
TESOURO NACIONAL	LFT 010921	0,10	0,16	2,56	248.203.180,52	5,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		3,43	1,02	5,16	1.287.108.938,66	25,95

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	6,08	0,34	4,35	49.732.980,05	1,00	4.734.232.270,41	1,05
BRB	BRB	35-BRB MILLENIUM	0,37	0,02	1,71	0,00	0,00	37.572.824,92	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	23,45	1,78	-7,39	33.776.071,98	0,68	279.018.560,81	12,11
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,57	0,20	3,15	304.890.404,53	6,15	7.844.641.875,20	3,89
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,79	1,99	1,24	25.841.030,28	0,52	5.721.224.105,90	0,45
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,85	1,99	1,17	14.026.957,67	0,28	5.938.047.265,27	0,24
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,55	0,22	3,34	40.543.813,51	0,82	13.835.706.591,01	0,29
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,04	1,29	5,82	35.182.474,59	0,71	19.732.912.783,40	0,18
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,21	1,34	6,29	42.402.041,85	0,86	7.802.150.183,83	0,54
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,73	2,49	-2,25	7.564.211,25	0,15	1.790.167.818,44	0,42
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,84	2,57	-2,17	10.819.416,35	0,22	1.749.025.544,15	0,62

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	9,01	0,43	5,03	20.777.526,66	0,42	2.828.341.630,94	0,73
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,14	1,22	6,28	33.672.127,85	0,68	10.336.804.140,67	0,33
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,06	0,33	4,38	36.627.187,62	0,74	5.838.093.192,79	0,63
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	4,32	0,40	5,17	1.409.317,54	0,03	193.136.397,94	0,73
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,28	0,85	2,65	662.367.123,64	13,36	9.499.641.282,04	6,97
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	0,82	5,27	698.553.890,19	14,09	14.161.450.965,39	4,93
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			5,16	0,78	3,61	2.018.186.575,56	40,70		

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	12,76	1,95	1,14	2.068.041,80	0,04	2.917.609.578,10	0,07
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,76	1,95	1,14	2.068.041,80	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	0,07	0,55	10.049,18	0,00	100.681.312,54	0,01
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,94	0,20	-0,48	12.786.243,15	0,26	298.693.178,97	4,28
BRB	BRB	33-BRB TESOUREIRO	0,37	-0,01	1,18	0,00	0,00	195.497.262,67	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,03	0,01	0,47	70.151.854,88	1,41	841.892.345,90	8,33
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,36	0,15	2,05	132.520.597,27	2,67	4.499.544.566,86	2,95
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	26,63	1,64	-8,16	31.410.783,64	0,63	269.934.950,03	11,64
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,23	0,16	2,14	317.537.563,53	6,40	2.405.684.296,02	13,20
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	0,06	1,54	290.171,68	0,01	1.893.436.284,11	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,06	0,50	1,07	66,25	0,00	625.949.083,71	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,93	0,25	-0,12	186.289.460,13	3,76	1.973.690.561,66	9,44
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,85	0,61	-0,86	7.163.642,48	0,14	186.732.499,63	3,84

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
		Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a	1,29	0,22	0,67	758.160.432,19	15,29		
		Renda Fixa	3,70	0,74	3,56	4.065.523.988,21	81,98		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

14,22%

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	46,02	15,69	-6,93	158.204.064,99	3,19	1.211.239.311,26	13,06
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	45,29	15,33	-5,95	107.471.778,98	2,17	1.059.305.047,31	10,15
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	43,98	15,71	-5,97	10.008.792,14	0,20	121.324.330,95	8,25
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	44,68	15,76	-5,95	72.030.851,89	1,45	688.588.931,64	10,46
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			45,47	15,59	-6,49	347.715.488,00	7,01		

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	39,19	13,62	-14,49	131.425.750,62	2,65	984.415.780,43	13,35
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,86	14,26	-5,78	32.190.255,75	0,65	912.327.763,54	3,53
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	48,69	15,73	-10,06	159.151.674,86	3,21	1.328.168.471,54	11,98
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	45,85	8,65	2,46	5.664.579,30	0,11	176.046.448,61	3,22
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			43,28	14,60	-10,98	328.432.260,53	6,62		

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	466,05	-98,18	-98,37	14.881,31	0,00	127.132.151,28	0,01
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			466,05	-98,18	-98,37	14.881,31	0,00		

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	49,45	-2,86	5,67	28.800.000,00	0,58	152.839.341,71	18,84
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			49,45	-2,86	5,67	28.800.000,00	0,58		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

41,55

14,19

-7,73

704.962.629,84

14,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,81%

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	29,44	2,43	53,70	142.601.356,90	2,88	1.959.218.771,54	7,28
BB	BB	BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	28,99	2,01	46,20	46.138.697,58	0,93	524.181.055,33	8,80
Sub-total Artigo 9º A, III			29,26	2,35	52,18	188.740.054,48	3,81		
Investimentos no Exterior			29,26	2,35	52,18	188.740.054,48	3,81		
Total			7,80	2,51	2,46	4.959.226.672,53	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	1.287.108.938,66	25,95	20,00	27,00	60,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	2.018.186.575,56	40,70	15,00	36,30	60,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	2.068.041,80	0,04	0,00	0,10	2,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	758.160.432,19	15,29	5,00	10,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	4.065.523.988,21	81,98				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	347.715.488,00	7,01	0,00	6,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	328.432.260,53	6,62	0,00	5,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	14.881,31	0,00	0,00	0,10	2,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	28.800.000,00	0,58	0,00	0,50	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	704.962.629,84	14,22				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	188.740.054,48	3,81	0,00	4,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	188.740.054,48	3,81				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

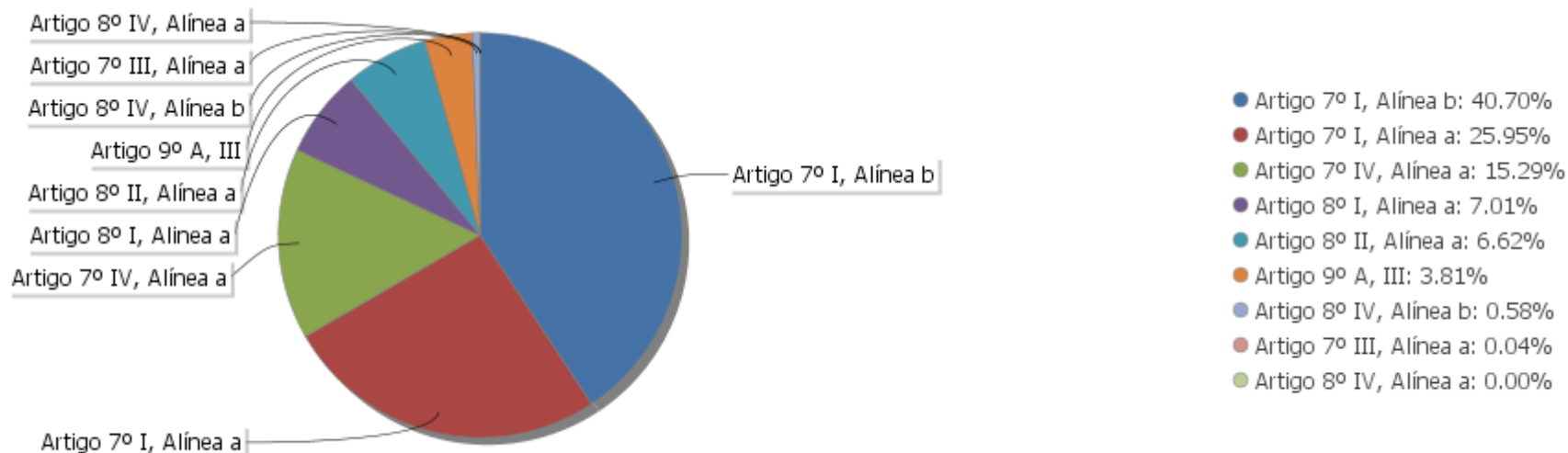
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,02 683,09	5,16 199,48	1,54 331,55	3,76 363,26	6,14 206,52	13.071.831,51	65.379.772,49
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,78 519,73	3,61 139,55	0,15 33,18	1,68 162,50	4,33 145,64	15.562.655,92	73.684.370,21
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,95 1.302,56	1,14 44,08	0,57 123,80	5,14 496,96	3,16 106,13	39.499,97	23.336,28
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,22 145,68	0,67 25,84	0,20 43,33	1,20 116,02	1,21 40,75	1.765.969,09	5.553.725,97
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	15,59 -0,31	-6,49 -0,65	9,00 -0,59	24,53 -0,06	0,12 -0,49	46.907.800,32	-25.606.388,50
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	14,60 -1,30	-10,98 -5,14	6,62 -2,96	23,03 -1,56	-2,35 -2,96	41.847.816,85	-42.307.320,02
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-98,18 -114,08	-98,37 -92,53	-98,19 -107,77	-98,19 -122,78	-98,37 -98,98	-143.692,98	-399.949,33
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-2,86 -18,77	5,67 11,51	-5,80 -15,39	15,14 -9,45	17,90 17,29	-860.000,00	1.693.000,00
Artigo 9º A, III % do CDI	2,35 1.572,91	52,18 2.015,43	-1,57 -337,84	19,91 1.924,44	49,42 1.662,16	3.367.353,79	41.136.522,90
IPAJM - CONSOLIDADO (Total)						121.559.234,47	119.157.070,00

Análise de Liquidez

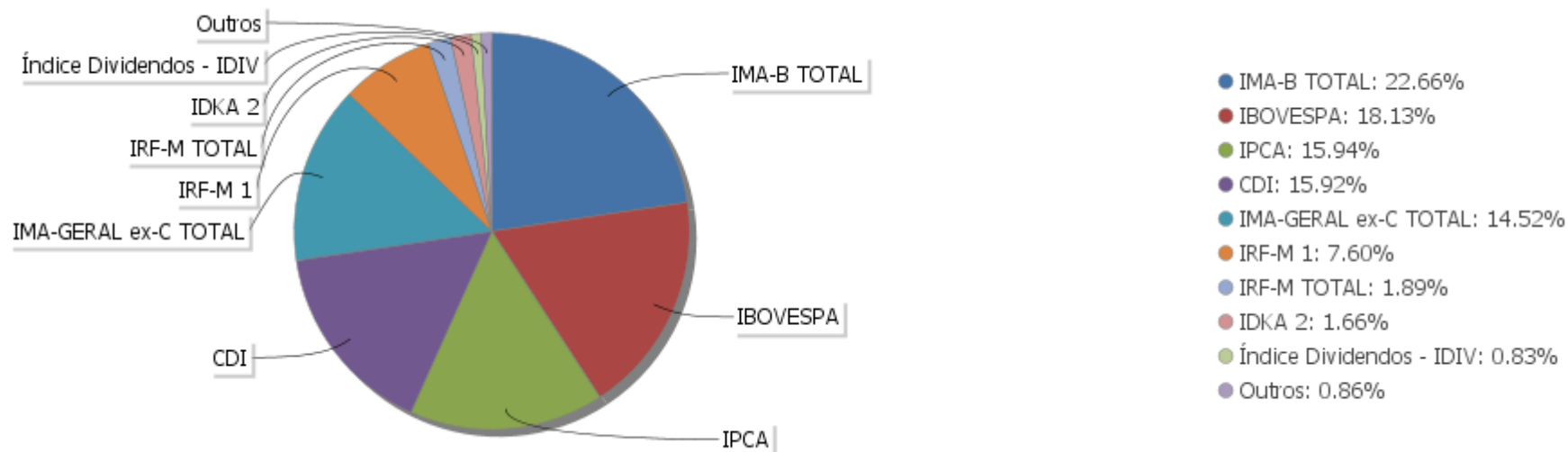
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	3.634.262.898,82	73,28	3.634.262.898,82	73,28
de 31 a 364 dias	605.105.131,16	12,20	4.239.368.029,98	85,48
acima de 365 dias	719.858.642,55	14,52	4.959.226.672,53	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

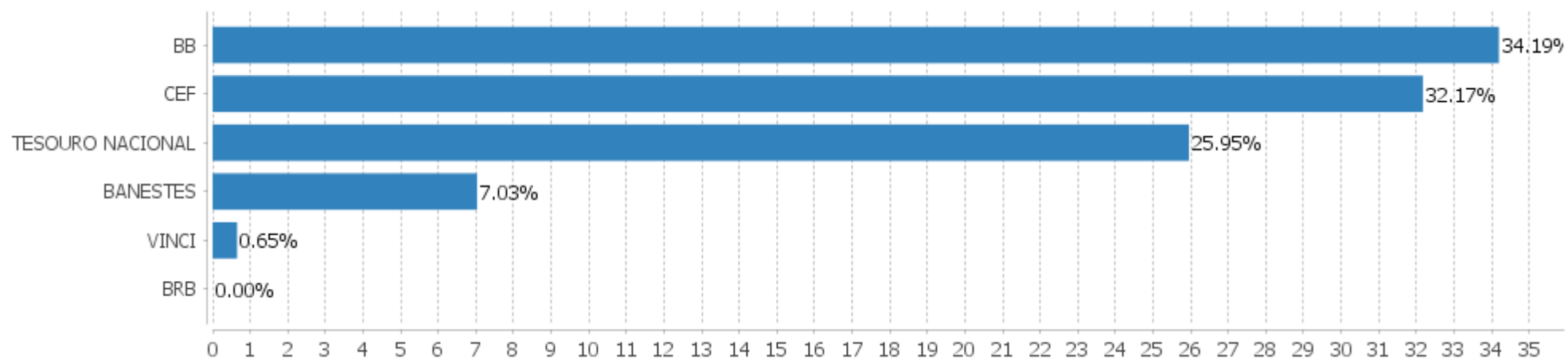


Alocação Por Estratégia



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	-0,83	-0,22	2,51		2,46
IPCA + 5%	0,64	0,60	0,50	0,08	0,01	0,67	0,81	0,65	1,05	1,27	1,28		7,80
p.p. indexador	-0,22	-1,52	-5,98	1,74	1,70	1,29	1,19	-0,91	-1,88	-1,49	1,23		-5,34
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

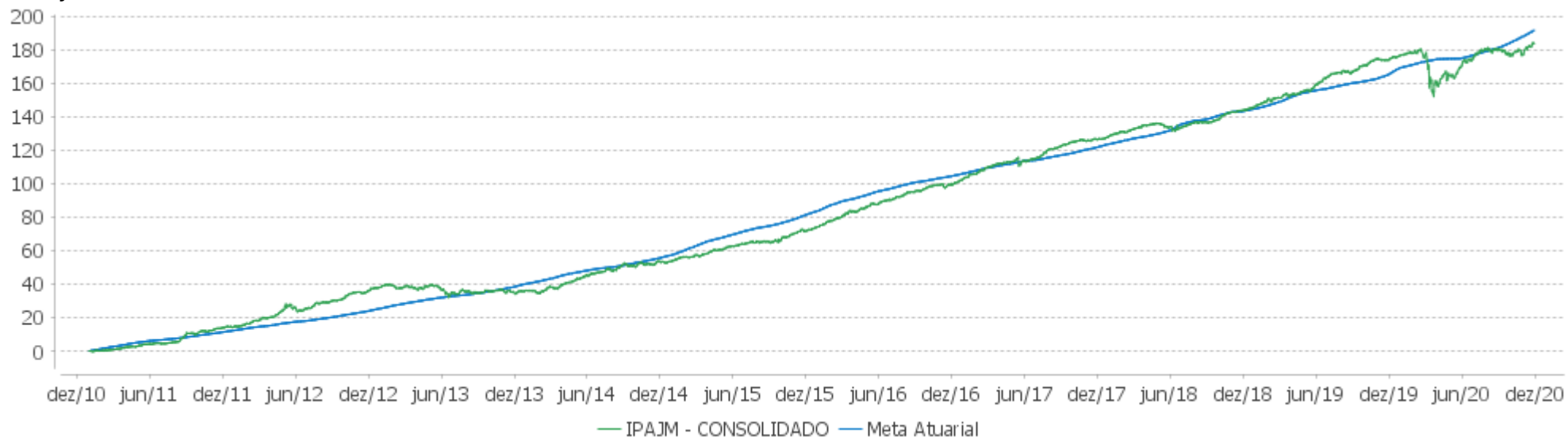
RELATÓRIO TRIMESTRAL

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

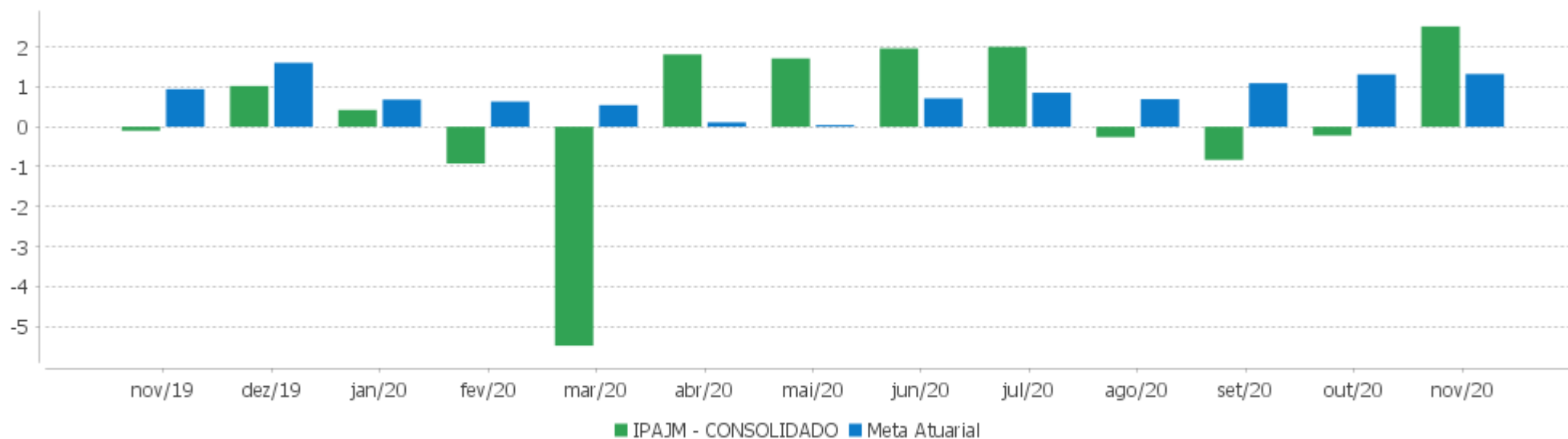
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	62	52,10	03 meses	1,43	3,65	-2,21	4,22
Meses abaixo da Meta Atuarial	57	47,90	06 meses	5,22	5,86	-0,65	3,94
			12 meses	3,50	9,53	-6,03	7,80
			24 meses	16,26	19,36	-3,10	5,67
			36 meses	25,30	31,29	-6,00	4,79
			Desde 31/12/2010	183,34	200,56	-17,22	3,68
	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 RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,64 -0,36	-8,16 -9,64	-2,45 -3,12	2,41 -2,90	-5,98 -9,50	20,89 -5,94	32,59 -9,64
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,20 130,85	-0,48 -18,50	0,27 58,97	1,57 152,20	-0,13 -4,44	5,79 62,67	12,44 76,32
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,25 166,42	-0,12 -4,53	0,43 93,51	1,91 184,62	0,28 9,54	6,54 70,74	13,96 85,63
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	0,61 405,35	-0,86 -33,40	-0,75 -162,18	1,05 101,95	0,26 8,87	18,04 195,22	
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,16 105,63	2,14 82,75	0,34 73,60	1,02 98,87	2,50 84,20	8,51 92,13	15,52 95,17
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO % do CDI	0,01 9,89	0,47 18,19	0,05 9,92	0,11 10,68	0,60 20,21	3,61 39,09	7,13 43,72
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,06 39,20	1,54 59,41	0,11 24,63	0,42 40,72	1,83 61,45	6,86 74,29	12,56 77,02
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,15 103,54	2,05 79,00	0,27 58,73	0,91 88,15	2,40 80,86	8,40 90,87	15,20 93,21
33-BRB TESOIRO % do CDI	0,01 7,13	1,21 46,55	-0,13 -28,51	0,15 14,88	1,49 50,19	6,71 72,64	12,42 76,15
FI BANESTES INVEST MONEY RF % do CDI	0,07 44,34	1,63 62,89	0,21 44,39	0,51 49,22	1,92 64,68	6,96 75,33	12,65 77,60
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,08 55,06	1,81 69,89	0,26 55,22	0,61 58,88	2,12 71,33	7,43 80,43	13,44 82,44
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,95 -0,05	1,14 -0,34	0,57 -0,10	5,14 -0,17	3,16 -0,36	25,88 -0,95	41,04 -1,19
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,99 -0,01	1,17 -0,32	0,62 -0,05	5,19 -0,12	3,18 -0,34	26,04 -0,79	41,07 -1,17
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,29 -0,03	5,82 -0,28	1,31 -0,09	3,83 -0,16	7,10 -0,31	21,07 -0,62	32,11 -0,96
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,20 -0,03	3,15 -0,38	0,35 -0,19	0,93 -0,25	3,56 -0,40	10,43 -0,70	17,92 -0,98
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,33 -0,03	4,38 -0,27	-0,64 -0,11	0,43 -0,15	5,02 -0,28	18,30 -0,74	30,60 -0,84
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,57	-2,17	0,07	6,38	0,33	29,21	47,03

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 5+ p.p.	-0,02	-0,29	-0,07	-0,14	-0,35	-1,12	-1,76
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	0,43	5,03	-1,11	0,20	5,76	21,83	36,19
Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,03	-0,22	-0,05	-0,09	-0,24	-0,72	-0,76
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,40	5,17	-0,18	0,79	5,64	16,93	26,43
Var. IRF-M 1 p.p.	0,17	1,65	-0,72	-0,40	1,68	5,79	7,54
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	1,78	-7,39	-2,47	3,44	-5,01	23,91	38,48
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,22	-8,87	-3,14	-1,87	-8,52	-2,91	-3,75
BB PREV RF IDKA2	1,34	6,29	1,79	4,57	7,52	19,65	30,22
Var. IDKA 2 p.p.	0,09	-0,47	0,48	0,23	-0,53	-1,24	-2,34
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,85	2,65	0,02	1,84	3,63	17,42	28,71
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,15	-0,02	0,04	-0,02	0,03	0,43	0,61
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,82	5,27	0,20	1,37	5,90	24,20	33,20
Var. IPCA p.p.	-0,07	2,15	-2,20	-1,92	1,59	16,47	21,12
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,22	6,28	1,41	4,27	7,44	19,53	30,28
Var. IDKA 2 p.p.	-0,03	-0,49	0,10	-0,06	-0,61	-1,35	-2,28
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,99	1,24	0,60	5,13	3,24	26,17	41,14
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,24	-0,07	-0,18	-0,27	-0,66	-1,09
BB PREV RF IRF-M	0,34	4,35	-0,63	0,45	4,98	18,41	30,51
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,02	-0,30	-0,10	-0,13	-0,32	-0,63	-0,92
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,22	3,34	0,49	1,09	3,75	10,70	18,27
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,01	-0,18	-0,05	-0,09	-0,20	-0,43	-0,63
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,49	-2,25	-0,01	6,20	0,41	29,47	47,47
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,09	-0,37	-0,15	-0,33	-0,27	-0,86	-1,33
35-BRB MILLENium	0,05	1,74	0,01	0,45	2,09	7,97	14,38
% do CDI	35,71	67,23	1,90	43,30	70,27	86,28	88,18
LFT 010921	0,16	2,56	0,44	1,01	2,94	9,22	16,30
NTN-B 150822	1,19	7,24	1,93	4,87	8,52	24,67	37,35
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,81	5,76	1,26	-0,44	5,01	-2,15	-4,88
LFT 010324	0,10	2,05	-0,02	0,55	2,44	8,71	
NTN-B 150523	1,32	6,75	0,68	3,70	8,32	26,15	39,46
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,68	5,27	0,01	-1,61	4,80	-0,68	-2,77
NTN-B 150521	1,21	6,03	2,97	4,95	7,09	19,57	31,14
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,79	4,55	2,30	-0,36	3,57	-7,26	-11,10
NTN-B 150830	2,44	3,85	0,67	5,91	5,01	30,11	47,28
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,45	2,37	-0,01	0,60	1,49	3,29	5,05

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII Var. IPCA p.p.	-2,86 -3,75	5,67 2,54	-5,80 -8,21	15,14 11,85	17,90 13,59	71,01 63,29	67,44 55,35
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	15,76 -0,14	-5,95 -0,11	9,50 -0,09	24,19 -0,39	0,49 -0,12	21,06 -0,60	49,90 -1,40
FIA BRASIL IBX-50 Var. IBOVESPA p.p.	15,69 -0,21	-6,93 -1,10	9,00 -0,58	24,89 0,30	-0,34 -0,95	17,81 -3,86	43,90 -7,40
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	15,71 -0,19	-5,97 -0,13	9,41 -0,17	24,68 0,09	0,37 -0,24	20,59 -1,07	49,19 -2,11
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	15,33 -0,57	-5,95 -0,11	8,62 -0,96	24,08 -0,51	1,16 0,55	24,84 3,18	51,42 0,12
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	8,65 -5,75	2,46 11,58	3,62 -6,19	23,24 1,94	9,81 9,86	46,78 14,01	80,87 20,35
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	15,73 -0,17	-10,06 -4,23	6,25 -3,33	29,26 4,67	1,22 0,61	41,06 19,39	56,65 5,35
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	14,26 -0,14	-5,78 3,34	8,69 -1,13	18,42 -2,89	2,25 2,30	38,18 5,41	59,11 -1,41
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	13,62 -2,29	-14,49 -8,65	6,71 -2,88	17,29 -7,30	-7,46 -8,07	10,30 -11,36	35,23 -16,08
FIP CAIXA CYRELA Var. IPCA p.p.	-98,18 -99,07	-98,37 -101,50	-98,19 -100,59	-98,19 -101,48	-98,37 -102,68	-98,33 -106,06	-98,16 -110,25
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	2,43 -13,47	53,70 59,54	-1,39 -10,98	20,74 -3,84	50,99 50,38	90,52 68,85	137,19 85,89
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	2,01 -13,89	46,20 52,04	-2,36 -11,94	16,50 -8,08	43,23 42,62	72,39 50,72	116,87 65,57
IPAJM - CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,5% p.p.	2,51 1,19	2,46 -5,81	1,43 -2,33	5,22 -0,90	3,50 -6,50	16,26 -3,59	25,30 -6,21
CDI	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
INPC + 6%	1,42	9,58	4,22	6,96	11,46	22,12	33,99
IPCA + 6%	1,36	8,73	3,89	6,37	10,52	20,99	33,37

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	0,23	3,52	0,54	1,19	3,95	11,13	18,89
IRF-M 1+	0,46	5,24	-1,06	0,29	6,00	22,54	36,94
IRF-M TOTAL	0,36	4,65	-0,53	0,58	5,30	19,04	31,44
IMA-B 5	1,32	6,10	1,40	3,99	7,41	21,69	33,06
IMA-B 5+	2,59	-1,87	0,14	6,53	0,68	30,33	48,80
IMA-B TOTAL	2,00	1,48	0,67	5,31	3,52	26,83	42,23
IMA-C TOTAL	1,94	23,44	7,90	19,17	23,94	48,54	75,37
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,70	2,67	-0,02	1,86	3,60	17,00	28,09
IMA-GERAL TOTAL	0,73	3,25	0,22	2,35	4,17	17,84	29,30
IDKA 2	1,25	6,77	1,31	4,33	8,05	20,89	32,56
IDKA 20	3,37	-8,22	-0,40	9,06	-4,60	35,17	60,63
CDI	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Renda Variável							
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
IBRX 100	15,46	-5,18	9,57	25,07	1,72	24,85	55,25
IBRX 50	16,21	-5,30	10,24	25,90	0,92	19,73	48,77
SMALL CAP	16,64	-7,60	7,78	33,38	4,09	49,24	69,17
IFIX	1,51	-12,17	0,95	5,68	-2,83	22,09	26,91
Índice Consumo - ICON	8,93	-3,98	1,63	18,62	3,72	48,84	43,97
Índice Dividendos - IDIV	14,40	-9,12	9,82	21,30	-0,05	32,77	60,52
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,89	3,13	2,41	3,29	4,31	7,73	12,09
INPC	0,95	3,93	2,73	3,87	5,20	8,74	12,61
IGPM	3,28	21,97	11,24	18,66	24,52	29,46	41,99
SELIC	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
921	03/11/2020	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	191.481,90	9.625,45367757	19,8932857000
922	03/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.619,39	0,00	1.240,90415887	2,1108721260
923	03/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.329,04	0,00	629,61653794	2,1108721260
924	03/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	8.250.000,00	0,00	1.016.133,53769286	8,1190116200
925	03/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	15.150.000,00	0,00	1.865.990,67830870	8,1190116200
926	04/11/2020	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	109.748,85	5.517,60006322	19,8906859400
927	04/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.177,29	0,00	557,69787268	2,1109816940
928	04/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	13.853.493,12	1.706.290,38034230	8,1190712200
929	04/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	297.054,79	36.587,28713554	8,1190712200
931	05/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	7.071,06	0,00	3.349,52123806	2,1110658800
933	05/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	553.000,00	0,00	68.110,73788630	8,1191309500
932	05/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	35.155,44	4.329,95110148	8,1191309500
982	05/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	10.879,80	0,00	5.153,69989306	2,1110658800
934	06/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.554,42	0,00	1.210,01646669	2,1110621800
935	06/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.440,50	0,00	682,35792088	2,1110621800
936	09/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	13.359,66	0,00	6.328,24192188	2,1111171420
937	09/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	7.653,42	0,00	3.625,29385402	2,1111171420
938	09/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	563.039,56	0,00	69.346,24892300	8,1192504100
939	10/11/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	14.347,19	719,02396786	19,9537020200
940	10/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.019,82	3.798,82210027	2,1111333430
941	10/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.817,44	0,00	1.808,24201023	2,1111333430
942	10/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.261,22	0,00	1.071,09293096	2,1111333430
943	10/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	442.639,86	54.516,92935013	8,1193101900
944	10/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	493.830,48	0,00	60.821,72850204	8,1193101900
945	11/11/2020	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	45.550,70	2.288,29641181	19,9059439000
947	11/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.760,38	0,00	833,81768078	2,1112289180
948	11/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	958,37	0,00	453,93940554	2,1112289180
949	11/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	931.875,04	0,00	114.771,84067237	8,1193700000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
950	12/11/2020	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	38.723,78	1.945,56023152	19,9036654700
951	12/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.396,51	0,00	1.135,18141885	2,1111251120
952	12/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.685,24	0,00	1.271,94735392	2,1111251120
953	12/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	116.665,49	14.368,68028123	8,1194297400
954	12/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	140.000,00	0,00	37.611,94254400	3,7222220000
955	13/11/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	5.748.571,29	0,00	288.066,87113894	19,9556834400
956	13/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	12.999,94	0,00	6.157,64299882	2,1111876740
957	13/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	4.140.836,47	509.987,28035827	8,1194897000
958	13/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.678.936,52	206.778,57624476	8,1194897000
959	16/11/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	10.290,00	515,62540246	19,9563480600
960	16/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.427,54	0,00	1.623,44442258	2,1112764640
961	16/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.138,34	0,00	1.012,81856567	2,1112764640
962	16/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	8.500,72	1.046,94474950	8,1195497700
963	16/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	10.952.664,69	0,00	1.348.925,12519201	8,1195497700
964	16/11/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.475.539,09	0,00	785.220,41465777	1,8791400000
965	17/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	4.276,38	0,00	2.025,39242916	2,1113834230
966	17/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	16.109,38	0,00	7.629,77478392	2,1113834230
967	17/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.185.555,12	0,00	269.169,97187889	8,1196097200
968	17/11/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.475.539,09	785.188,24063426	1,8792170000
969	17/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.475.539,09	0,00	396.303,95318500	3,7232510000
970	18/11/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	67.581,37	3.386,23421011	19,9576774100
971	18/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	8.694,60	0,00	4.117,80020157	2,1114671850
972	18/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	5.124,54	0,00	2.427,00432969	2,1114671850
973	19/11/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	9.385,83	470,27102022	19,9583423100
974	19/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.674,30	0,00	1.266,52745814	2,1115215330
975	19/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.438,63	0,00	681,32385937	2,1115215330
976	19/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	183.866,87	80.134,87912542	2,2944674280
977	19/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	4.000.000,00	0,00	492.627,22154033	8,1197299400
978	19/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.713.872,07	0,00	211.075,00897992	8,1197299400
979	20/11/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	21.568,45	1.080,63745558	19,9590065000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
981	20/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	4.230,98	0,00	2.003,68658669	2,1115977060
980	20/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.639,96	0,00	1.723,79425762	2,1115977060
983	23/11/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	4.577,73	229,34898946	19,9596693700
984	23/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.570,50	0,00	1.217,27996674	2,1116752680
985	23/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	21.732,56	10.291,62027388	2,1116752680
986	23/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	55.813,40	24.322,28970194	2,2947428340
987	23/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.083,99	986,88942925	2,1116752680
988	23/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	4.460.185,71	549.294,09269774	8,1198501300
989	23/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	52.000.000,00	6.404.059,08575556	8,1198501300
990	23/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	560.000,00	0,00	68.966,79015429	8,1198501300
991	23/11/2020	33-BRB TESOIRO	0,00	2.582,91	651,98563793	3,9616056700
992	23/11/2020	35-BRB MILLENIUM	0,00	1.389.680,33	448.991,69391443	3,0951136710
993	24/11/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	5.049.640,84	252.983,80223085	19,9603326200
994	24/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	5.614,65	0,00	2.658,75470313	2,1117593110
997	24/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	21.758.065,96	0,00	2.679.594,51953818	8,1199098600
998	25/11/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	600.000,00	30.058,62239945	19,9609946200
999	25/11/2020	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	96.620,55	4.850,73452093	19,9187462400
1000	25/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	531.354,51	231.503,92751978	2,2952289220
1001	25/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.544,74	1.678,50999067	2,1118372960
1002	25/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	156.800.000,00	0,00	19.310.416,21905109	8,1199699800
1003	25/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	3.969.787,92	0,00	488.891,94538623	8,1199699800
1019	25/11/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	30.000.000,00	0,00	5.781.644,62735855	5,1888350000
1020	25/11/2020	BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	22.000.000,00	0,00	10.500.362,28517007	2,0951658050
1005	26/11/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	2.582,91	0,00	129,39358807	19,9616537300
1006	26/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	6.875.479,53	846.730,73825585	8,1200306300
1007	26/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	28.033,20	3.452,35150917	8,1200306300
1008	26/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.389.680,33	0,00	171.142,25220601	8,1200306300
1009	27/11/2020	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	1.232.768,06	61.873,41909707	19,9240332600
1010	27/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.182.942,52	950.840,23826389	2,2958036820
1011	27/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	83.276,00	39.430,47277780	2,1119706190

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1012	27/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	26.064,86	0,00	12.341,48797597	2,1119706190
1013	27/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	160.205.135,80	19.729.474,66769312	8,1200913100
1014	27/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	5.383.565,27	662.993,19360733	8,1200913100
1015	30/11/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	2.900,30	145,28394011	19,9629773100
1016	30/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	816,90	0,00	386,77698272	2,1120698400
1017	30/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.305,81	0,00	1.091,72999696	2,1120698400
1018	30/11/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	17.475,85	2.152,15807927	8,1201516600
Total						

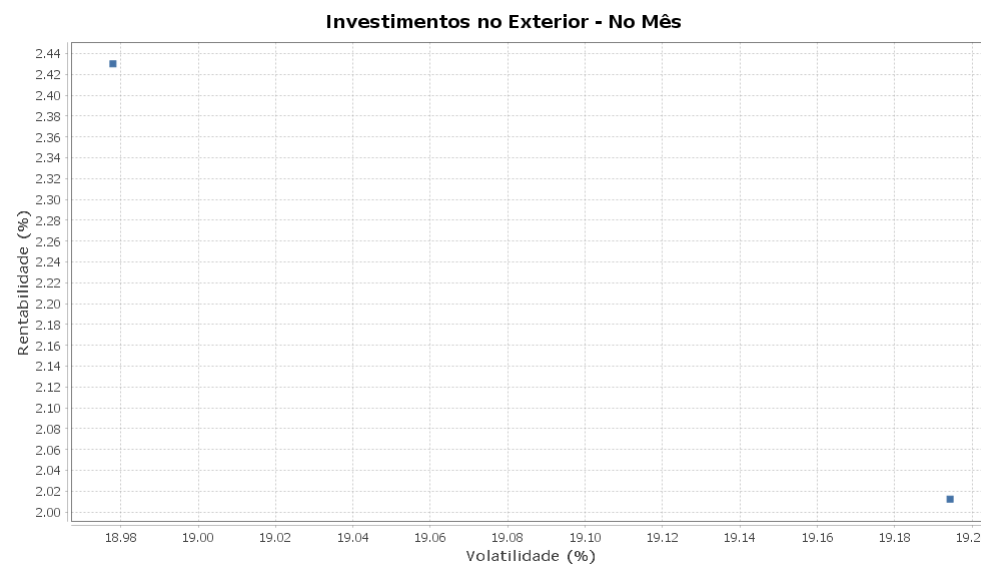
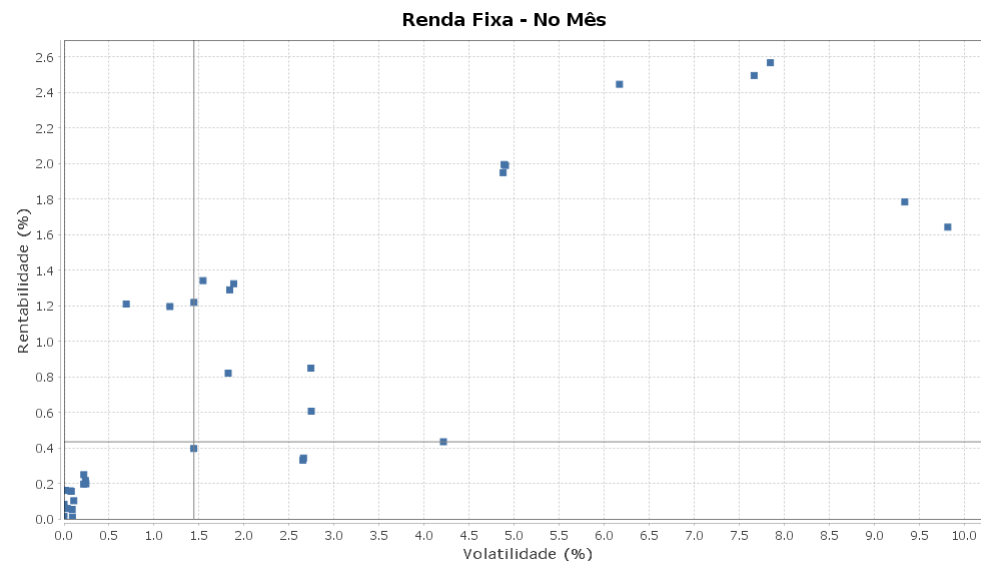
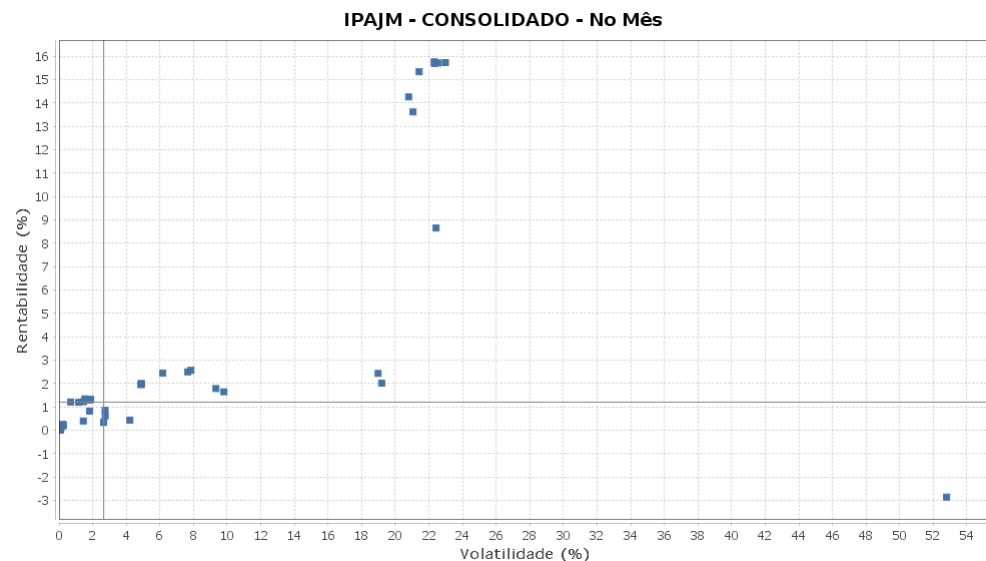
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rendimentos Realizados

Artigo	Ativo	Quantidade	Valor Aplicação	Valor Resgate	Rendimento
Artigo 7º IV, Alínea a	33-BRB TESOIRO	651,987415	2.562,54	2.582,92	20,38
Artigo 7º I, Alínea b	35-BRB MILLENIUM	448.991,693675	1.316.285,18	1.389.680,33	73.395,15
Artigo 7º IV, Alínea a	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	30.732.062,317161	249.524.763,24	249.543.157,77	18.394,53
Artigo 7º IV, Alínea a	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	86.101,064002	1.721.699,20	1.714.893,84	-6.805,36
Artigo 7º IV, Alínea a	BB PREV RF FLUXO FIC	56.186,314572	118.508,67	118.657,13	148,46
Artigo 7º IV, Alínea a	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.286.801,334611	2.796.830,05	2.953.977,30	157.147,25
Artigo 7º IV, Alínea a	FI BANESTES INVEST MONEY RF	289.588,849616	5.778.919,64	5.780.291,71	1.372,07
Artigo 7º IV, Alínea a	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	785.188,240634	1.475.478,62	1.475.539,09	60,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 95.513.625,72

Value-At-Risk: 1,93%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	0,00	0,01	70.151.854,88	1,41
FI BANESTES INVEST MONEY RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	-403,12	0,07	10.049,18	0,00
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	-123,29	0,08	66,25	0,00
LFT 010921	Artigo 7º I, Alínea a	0,02	0,05	0,00	0,64	0,16	248.203.180,52	5,00
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,05	0,00	-2,51	0,06	290.171,68	0,01
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,09	0,00	0,12	0,16	317.537.563,53	6,40
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,08	0,13	0,00	0,07	0,15	132.520.597,27	2,67
35-BRB MILLENIUM	Artigo 7º I, Alínea b	0,09	NaN	0,00	-1,06	0,05	0,00	0,00
33-BRB TESOURO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,09	NaN	0,00	-1,50	0,01	0,00	0,00
LFT 010324	Artigo 7º I, Alínea a	0,11	0,22	0,00	-0,43	0,10	112.117.764,39	2,26
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,22	0,11	-0,00	0,21	0,20	12.786.243,15	0,26
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,22	0,11	-0,00	0,45	0,25	186.289.460,13	3,76
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,24	0,16	0,00	0,28	0,22	40.543.813,51	0,82
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,24	0,17	0,01	0,20	0,20	304.890.404,53	6,15
NTN-B 150521	Artigo 7º I, Alínea a	0,69	0,39	0,01	1,53	1,21	319.047.115,59	6,43
NTN-B 150822	Artigo 7º I, Alínea a	1,17	0,94	0,04	0,89	1,19	415.474.485,58	8,38
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	1,44	0,87	0,00	0,17	0,40	1.409.317,54	0,03
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,44	1,07	0,00	0,74	1,22	33.672.127,85	0,68
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,54	0,91	0,00	0,77	1,34	42.402.041,85	0,86
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,82	1,23	0,12	0,37	0,82	698.553.890,19	14,09
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,84	1,03	0,00	0,62	1,29	35.182.474,59	0,71
NTN-B 150523	Artigo 7º I, Alínea a	1,88	1,42	0,01	0,62	1,32	75.749.384,64	1,53
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,65	1,34	0,01	0,07	0,33	36.627.187,62	0,74
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,66	1,34	0,01	0,07	0,34	49.732.980,05	1,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,74	1,33	0,13	0,25	0,85	662.367.123,64	13,36
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	2,74	1,26	0,00	0,17	0,61	7.163.642,48	0,14
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	4,21	2,01	0,01	0,07	0,43	20.777.526,66	0,42
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	4,87	2,66	0,00	0,37	1,95	2.068.041,80	0,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,89	2,66	0,01	0,38	1,99	25.841.030,28	0,52
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,90	2,67	0,01	0,38	1,99	14.026.957,67	0,28
NTN-B 150830	Artigo 7º I, Alínea a	6,17	2,82	0,04	0,37	2,44	116.517.007,94	2,35
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,66	4,12	0,00	0,31	2,49	7.564.211,25	0,15
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,84	4,17	0,01	0,31	2,57	10.819.416,35	0,22
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	9,33	4,66	0,00	0,17	1,78	33.776.071,98	0,68
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	9,81	4,57	0,00	0,15	1,64	31.410.783,64	0,63
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	18,98	12,80	0,13	0,12	2,43	142.601.356,90	2,88
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	19,19	12,44	0,04	0,10	2,01	46.138.697,58	0,93
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	20,79	9,69	0,06	0,68	14,26	32.190.255,75	0,65
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	21,05	9,69	0,24	0,64	13,62	131.425.750,62	2,65
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	21,42	10,42	0,21	0,71	15,33	107.471.778,98	2,17
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	22,32	10,55	0,14	0,70	15,76	72.030.851,89	1,45
FIA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	22,32	10,77	0,32	0,70	15,69	158.204.064,99	3,19
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	22,42	10,18	0,01	0,38	8,65	5.664.579,30	0,11
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	22,56	11,31	0,02	0,69	15,71	10.008.792,14	0,20
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	22,98	10,78	0,30	0,68	15,73	159.151.674,86	3,21
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	Artigo 8º IV, Alínea b	52,79	25,14	0,01	-0,06	-2,86	28.800.000,00	0,58