



IPAJM - ESTADO DO ESPÍRITO
SETEMBRO 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 20.10.2020.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA **84,03%**

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	13,83	-1,90	1,20	113.545.279,18	2,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822	4,96	0,21	5,43	408.467.452,58	8,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	6,10	-0,29	5,73	77.000.542,86	1,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150521	2,10	0,81	3,81	321.188.979,96	6,66
TESOURO NACIONAL	LFT 010324	0,17	-0,29	1,78	111.821.518,88	2,32
TESOURO NACIONAL	LFT 010921	0,08	0,10	2,21	247.373.001,57	5,13
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		3,42	0,08	3,65	1.279.396.775,03	26,55

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	6,00	-0,66	4,32	49.719.456,07	1,03	4.983.832.924,90	1,00
BRB	BRB	35-BRB MILLENIUM	0,15	-0,22	1,51	1.387.008,44	0,03	48.056.046,64	2,89
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	23,29	-5,05	-9,84	32.883.143,75	0,68	288.574.129,48	11,40
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,54	0,04	2,83	303.944.793,28	6,31	7.413.658.574,68	4,10
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,72	-1,56	-0,93	25.286.533,94	0,52	5.533.318.681,28	0,46
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,79	-1,53	-1,00	13.726.907,34	0,28	5.834.527.804,73	0,24
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,13	2,97	40.398.854,02	0,84	10.130.144.603,43	0,40
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,01	-0,16	4,29	34.672.299,05	0,72	17.747.142.317,32	0,20
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,16	0,11	4,55	41.704.313,48	0,87	7.070.754.781,93	0,59
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,64	-2,65	-4,82	7.365.056,68	0,15	1.936.096.946,75	0,38
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,74	-2,64	-4,82	10.525.871,46	0,22	1.755.979.575,38	0,60

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+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	8,88	-0,98	5,16	20.804.531,71	0,43	3.209.755.140,80	0,65
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	4,08	0,04	4,84	33.216.220,76	0,69	9.208.011.978,57	0,36
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,98	-0,61	4,41	36.637.970,38	0,76	11.234.342.142,99	0,33
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	4,24	-0,23	5,12	1.408.644,62	0,03	194.056.442,06	0,73
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,22	-0,75	1,86	657.259.443,36	13,64	10.452.752.168,75	6,29
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	-0,50	4,53	693.620.264,66	14,39	13.535.810.678,86	5,12
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			5,10	-0,59	2,84	2.004.561.313,00	41,59		

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	12,71	-1,54	-0,98	2.024.585,11	0,04	2.850.384.468,52	0,07
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,71	-1,54	-0,98	2.024.585,11	0,04		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,07	0,07	0,41	1.724.535,92	0,04	95.822.881,15	1,80
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,92	0,10	-0,65	14.477.305,38	0,30	335.581.050,20	4,31
BRB	BRB	33-BRB TESOUREO	0,14	-0,27	1,07	2.580,03	0,00	237.219.771,40	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,05	0,02	0,44	71.423.220,76	1,48	899.876.672,43	7,94
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,30	-0,00	1,77	130.404.672,41	2,71	4.760.770.417,77	2,74
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	26,43	-4,96	-10,53	30.600.017,33	0,63	291.923.457,14	10,48
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,02	1,82	322.348.800,40	6,69	2.533.726.732,47	12,72
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,08	-0,00	1,42	245.235,77	0,01	1.878.414.583,86	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,07	0,23	0,90	5,76	0,00	480.823.075,37	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,92	0,15	-0,40	185.767.873,69	3,85	2.000.048.767,88	9,29
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,82	-1,52	-1,63	7.108.293,73	0,15	183.820.888,05	3,87

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	-0,15	0,31	764.102.541,18	15,85		
		Renda Fixa	3,67	-0,29	2,64	4.050.085.214,32	84,03		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

13,15%

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	45,16	-4,95	-18,85	137.949.873,43	2,86	951.590.330,36	14,50
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	44,49	-5,04	-17,78	93.949.979,40	1,95	900.328.465,10	10,44
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	43,08	-4,69	-18,09	8.719.190,87	0,18	110.541.465,03	7,89
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	43,83	-4,71	-18,15	62.685.708,57	1,30	634.870.630,59	9,87
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			44,61	-4,92	-18,44	303.304.752,27	6,29		

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	38,48	-4,70	-23,62	117.382.870,88	2,44	890.322.162,57	13,18
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,13	-4,93	-17,58	28.158.065,36	0,58	783.577.685,83	3,59
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	47,79	-5,93	-20,37	140.908.963,53	2,92	1.156.431.775,09	12,18
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	45,33	-2,96	-4,05	5.304.872,72	0,11	157.034.448,33	3,38
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			42,49	-5,29	-20,92	291.754.772,49	6,05		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIP CAIXA CYRELA	25,49	-0,23	-10,37	1.636.424,34	0,03	127.132.151,28	1,29
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			25,49	-0,23	-10,37	1.636.424,34	0,03		

Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	45,14	19,85	24,16	36.998.000,00	0,77	156.187.768,35	23,69
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			45,14	19,85	34,45	36.998.000,00	0,77		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			40,68	-3,92	-17,28	633.693.949,10	13,15		
---	--	--	-------	-------	--------	----------------	-------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,82%

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	28,45	-1,99	52,76	111.775.083,52	2,32	1.671.279.124,17	6,69
BB	BB	BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	28,02	-2,46	46,05	24.027.405,36	0,50	440.169.483,64	5,46
Sub-total Artigo 9º A, III			28,27	-2,08	51,39	135.802.488,88	2,82		
Investimentos no Exterior			28,27	-2,08	51,39	135.802.488,88	2,82		
Total			7,61	-0,83	0,17	4.819.581.652,30	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	1.279.396.775,03	26,55	20,00	27,00	60,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	2.004.561.313,00	41,59	15,00	36,30	60,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	2.024.585,11	0,04	0,00	0,10	2,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	764.102.541,18	15,85	5,00	10,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	4.050.085.214,32	84,03				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	303.304.752,27	6,29	0,00	6,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	291.754.772,49	6,05	0,00	5,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	1.636.424,34	0,03	0,00	0,10	2,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	36.998.000,00	0,77	0,00	0,50	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	633.693.949,10	13,15				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	135.802.488,88	2,82	0,00	4,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	135.802.488,88	2,82				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

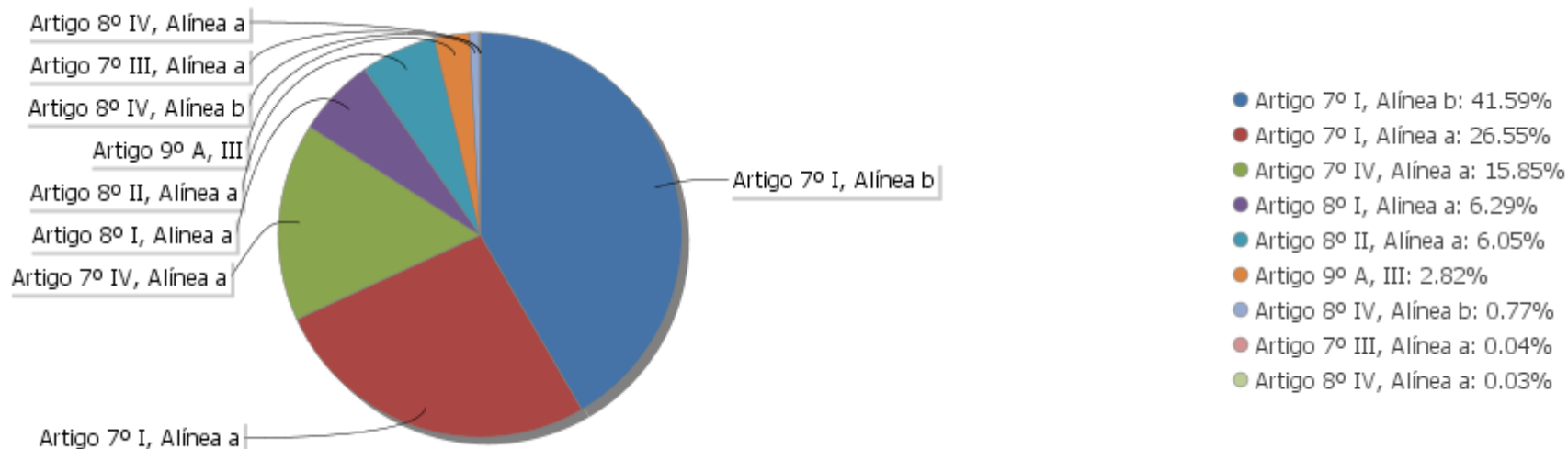
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,08 47,79	3,65 160,34	1,25 244,78	4,02 321,37	5,83 164,41	959.008,86	46.714.944,17
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,59 -376,50	2,84 124,92	0,11 21,14	3,00 239,54	4,57 129,09	-11.917.226,65	58.669.427,32
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-1,54 -980,30	-0,98 -43,25	0,89 173,47	5,76 460,90	1,73 48,71	-31.641,10	-20.120,41
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,15 -96,34	0,31 13,84	0,48 93,98	0,81 64,87	1,53 43,24	-1.325.207,67	2.728.376,06
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,92 -0,13	-18,44 -0,24	-0,45 0,02	30,19 0,63	-9,72 -0,04	-15.705.014,61	-70.017.124,23
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-5,29 -0,49	-20,92 -2,72	-0,06 0,42	26,09 -3,47	-9,59 0,10	-16.282.707,32	-78.984.808,06
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,23 4,57	-10,37 7,82	-3,53 -3,05	-18,69 -48,25	-20,63 -10,95	-3.698,64	-253.945,41
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	19,85 24,65	34,45 52,64	21,23 21,71	64,93 35,37	85,63 95,31	6.138.000,00	9.611.000,00
Artigo 9º A, III % do CDI	-2,08 -1.323,40	51,39 2.258,66	14,58 2.847,92	41,92 3.352,14	60,26 1.700,74	-2.880.957,23	40.198.957,30
						-41.049.444,36	8.646.706,74

Análise de Liquidez

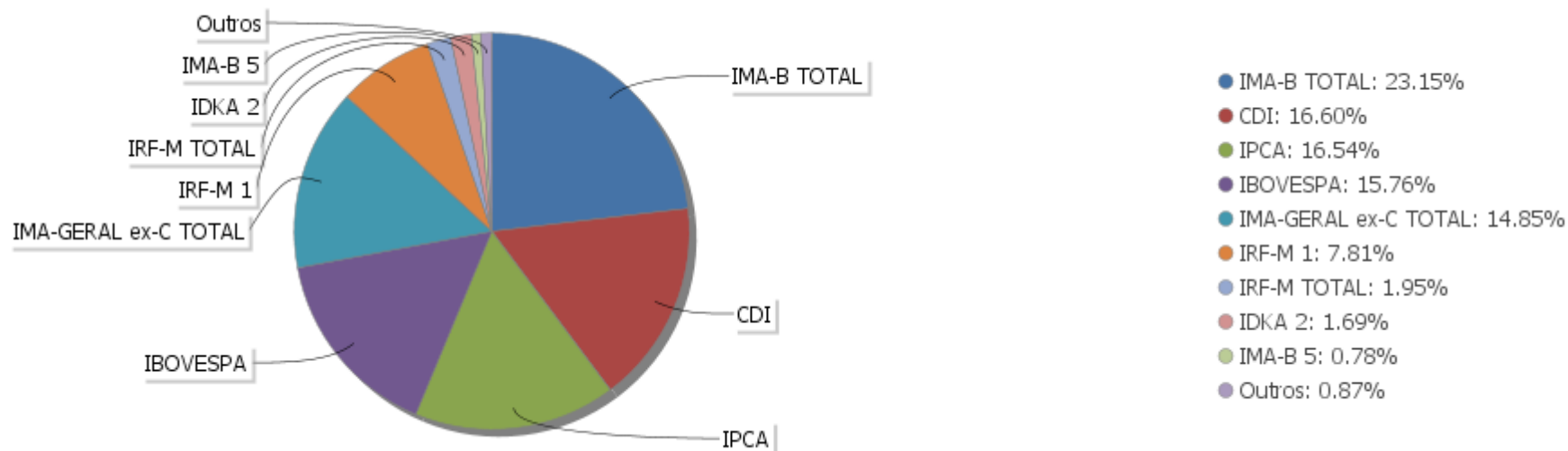
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	3.506.721.939,19	72,76	3.506.721.939,19	72,76
de 31 a 364 dias	602.024.919,61	12,49	4.108.746.858,80	85,25
acima de 365 dias	710.834.793,50	14,75	4.819.581.652,30	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

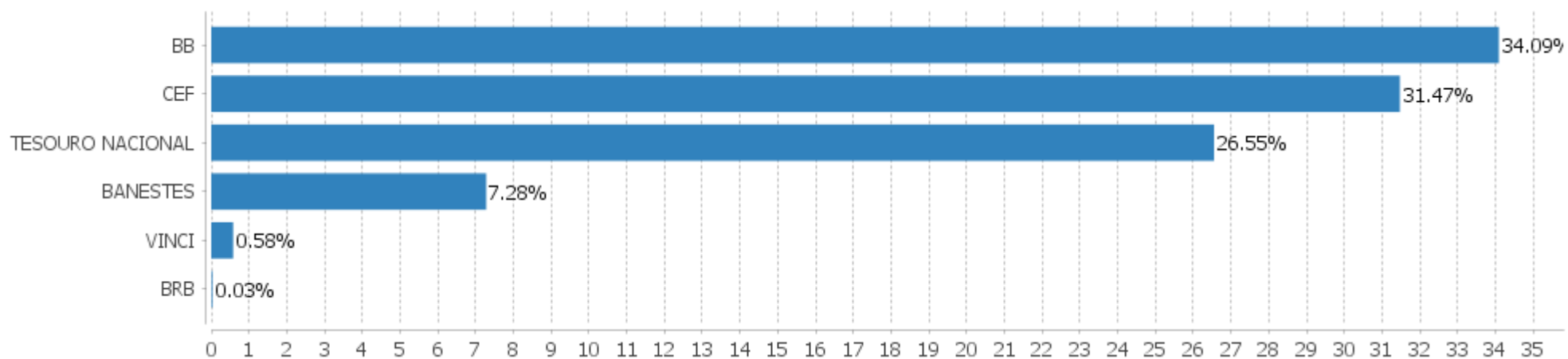


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2020	0,42	-0,92	-5,48	1,81	1,71	1,96	2,00	-0,26	-0,83				0,17
IPCA + 5%	0,64	0,60	0,50	0,08	0,01	0,67	0,81	0,65	1,05				5,10
p.p. indexador	-0,22	-1,52	-5,98	1,74	1,70	1,29	1,19	-0,91	-1,88				-4,93
2019	1,69	0,49	0,60	0,91	1,51	1,74	1,03	0,23	1,43	1,33	-0,10	1,02	12,53
IPCA + 5,5%	0,79	0,86	1,16	1,02	0,60	0,41	0,68	0,58	0,41	0,59	0,94	1,60	10,07
p.p. indexador	0,90	-0,37	-0,55	-0,11	0,91	1,32	0,35	-0,35	1,03	0,74	-1,04	-0,58	2,46
2018	1,29	0,58	1,11	0,44	-1,02	-0,00	1,12	0,18	0,62	1,87	0,52	0,84	7,80
IPCA + 5,75%	0,78	0,72	0,56	0,69	0,87	1,73	0,82	0,42	0,90	0,94	0,23	0,60	9,66
p.p. indexador	0,51	-0,14	0,56	-0,25	-1,89	-1,73	0,30	-0,24	-0,29	0,92	0,29	0,25	-1,86
2017	1,30	1,89	1,24	0,45	0,35	0,70	2,20	1,13	1,07	0,43	0,19	0,82	12,40
IPCA + 6%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	0,41	1,15	0,45	-0,11	-0,47	0,45	1,48	0,40	0,44	-0,48	-0,55	-0,09	3,35
2016	1,92	1,40	1,66	1,65	0,93	1,19	1,45	1,23	1,28	0,82	0,38	1,47	16,48
IPCA + 6%	1,74	1,34	0,94	1,08	1,27	0,86	1,01	0,98	0,57	0,72	0,64	0,81	12,64
p.p. indexador	0,18	0,05	0,72	0,57	-0,34	0,33	0,44	0,26	0,71	0,10	-0,26	0,66	3,84
2015	1,51	0,80	0,65	1,24	1,39	0,73	1,09	-0,17	0,72	1,96	0,91	1,67	13,20
IPCA + 6%	1,73	1,64	1,84	1,18	1,21	1,28	1,16	0,71	1,03	1,31	1,48	1,47	17,26
p.p. indexador	-0,22	-0,85	-1,19	0,06	0,19	-0,55	-0,07	-0,88	-0,31	0,64	-0,56	0,19	-4,06
2014	-1,15	2,71	0,90	1,75	2,50	0,76	1,06	2,33	-0,76	1,18	0,88	0,18	12,97
IPCA + 6%	1,06	1,16	1,36	1,14	0,95	0,87	0,54	0,74	1,08	0,96	0,98	1,29	12,82
p.p. indexador	-2,21	1,56	-0,46	0,61	1,55	-0,11	0,52	1,59	-1,84	0,22	-0,09	-1,12	0,15
2013	0,58	-0,48	-0,65	1,00	-1,62	-1,42	0,81	-0,81	0,75	0,72	-1,14	0,87	-1,43
IPCA + 6%	1,37	1,02	0,94	1,06	0,86	0,72	0,56	0,75	0,84	1,11	1,01	1,41	12,29
p.p. indexador	-0,80	-1,50	-1,58	-0,07	-2,48	-2,15	0,25	-1,56	-0,08	-0,38	-2,14	-0,54	-13,72
2012	1,48	1,67	1,59	3,31	1,29	-0,23	2,31	1,35	1,11	2,72	0,68	1,57	20,51
IPCA + 6%	1,07	0,89	0,72	1,11	0,87	0,54	0,94	0,95	1,01	1,10	1,07	1,26	12,16
p.p. indexador	0,41	0,78	0,87	2,20	0,42	-0,77	1,37	0,41	0,10	1,61	-0,38	0,31	8,35
2011	0,11	0,67	1,40	0,53	1,40	0,17	0,81	4,20	1,08	1,30	1,60	0,51	14,62
IPCA + 6%	1,32	1,27	1,28	1,21	0,98	0,64	0,65	0,91	1,02	0,90	0,99	1,01	12,87
p.p. indexador	-1,21	-0,60	0,12	-0,68	0,42	-0,47	0,17	3,30	0,06	0,40	0,61	-0,51	1,76

PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

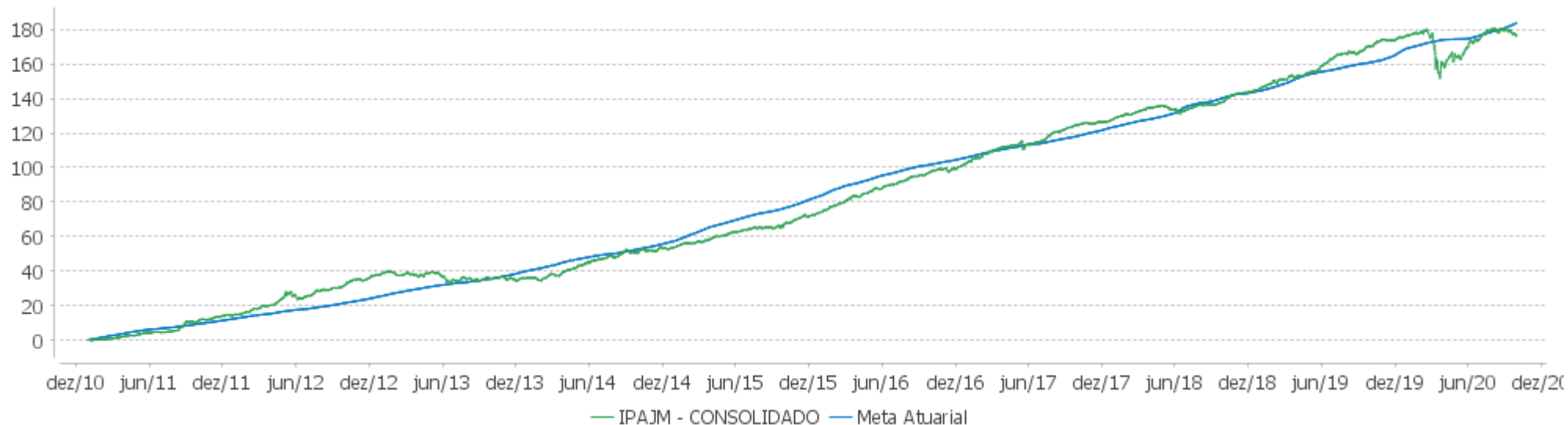
RELATÓRIO TRIMESTRAL

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

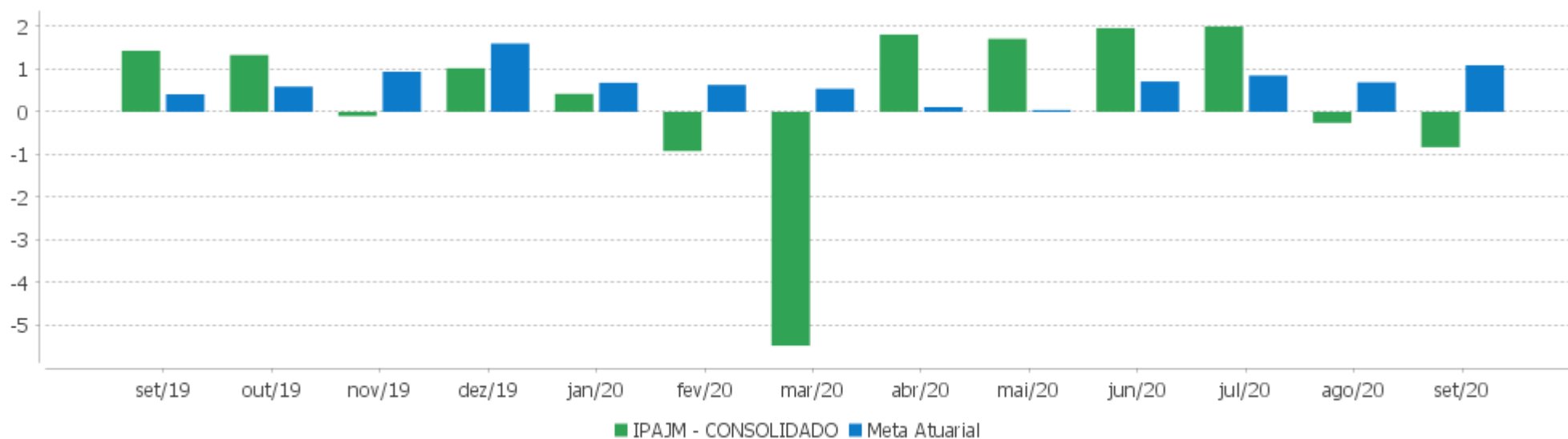
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	61	52,14	03 meses	0,89	2,53	-1,63	3,82
Meses abaixo da Meta Atuarial	56	47,86	06 meses	6,52	3,30	3,22	5,15
			12 meses	2,43	8,42	-5,99	7,61
			24 meses	16,39	17,74	-1,35	5,56
			36 meses	23,26	30,13	-6,87	4,71
			Desde 31/12/2010	177,02	193,03	-16,01	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
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,54 -0,03	-0,98 -0,26	0,89 -0,07	5,76 -0,20	1,73 -0,38	33,13 -1,01	36,52 -1,04
LFT 010921	0,10	2,21	0,46	1,20	3,49	9,99	17,34
NTN-B 150822 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,21 1,72	5,43 6,15	1,88 0,92	5,79 -0,18	8,07 5,96	28,03 -6,11	34,92 -2,64
LFT 010324	-0,29	1,78	0,07	0,79	3,05	9,55	
NTN-B 150523 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,29 1,23	5,73 6,44	1,53 0,57	6,18 0,21	8,61 6,50	31,38 -2,76	37,47 -0,10
NTN-B 150521 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,81 2,32	3,81 4,53	1,83 0,87	3,88 -2,09	6,32 4,21	20,29 -13,85	28,90 -8,66
NTN-B 150830 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,90 -0,39	1,20 1,92	0,30 -0,66	6,64 0,67	3,02 0,91	39,67 5,53	41,24 3,68
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,10 63,53	-0,65 -28,64	0,99 194,25	0,12 9,23	0,22 6,32	6,64 66,14	13,56 78,13
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-4,96 -3,45	-10,53 -9,81	-2,38 -3,34	3,34 -2,63	-8,82 -10,92	28,45 -5,69	27,13 -10,43
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,15 97,35	-0,40 -17,44	1,16 227,25	0,24 18,84	0,64 18,02	7,39 73,64	15,09 86,94
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	-1,52 -968,06	-1,63 -71,67	-0,33 -63,89	-0,92 -73,37	1,86 52,59	22,52 224,33	
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,02 15,30	1,82 79,94	0,44 86,28	1,22 97,65	2,98 84,04	9,27 92,40	16,58 95,53
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO % do CDI	0,02 9,90	0,44 19,36	0,06 11,11	0,16 12,69	0,93 26,15	4,14 41,26	7,88 45,39
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	-0,00 -0,19	1,42 62,49	0,18 34,55	0,66 53,10	2,40 67,81	7,66 76,30	13,60 78,36
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	-0,00 -1,68	1,77 77,58	0,39 76,38	0,97 77,46	2,90 81,81	9,20 91,67	16,28 93,76
33-BRB TESOIRO % do CDI	-0,27 -168,89	1,07 47,06	-0,10 -20,03	0,35 28,36	2,04 57,66	7,60 75,71	13,38 77,09
FI BANESTES INVEST MONEY RF % do CDI	0,07 44,32	1,49 65,47	0,24 47,45	0,73 58,66	2,47 69,69	7,73 76,99	13,67 78,74
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,09	1,64	0,29	0,83	2,68	8,21	14,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	55,34	71,97	57,43	66,45	75,66	81,83	83,39
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,53 -0,02	-1,00 -0,28	0,89 -0,07	5,84 -0,12	1,68 -0,43	33,36 -0,78	36,41 -1,16
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,16 -0,04	4,29 -0,22	1,21 -0,09	4,96 -0,15	6,91 -0,33	23,18 -0,58	30,91 -0,93
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,04 -0,11	2,83 -0,29	0,36 -0,14	1,43 -0,23	4,17 -0,37	11,70 -0,63	18,97 -0,94
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,61 -0,05	4,41 -0,20	-0,30 -0,07	3,01 -0,13	6,31 -0,25	24,12 -0,38	30,74 -0,90
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-2,64 -0,04	-4,82 -0,27	0,65 -0,10	6,56 -0,22	-2,10 -0,43	40,97 -1,45	39,57 -1,69
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,98 -0,06	5,16 -0,24	-0,68 -0,08	3,70 -0,20	7,33 -0,28	29,68 -0,32	35,97 -0,97
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	-0,23 -0,38	5,12 2,00	0,26 -0,25	2,49 0,83	6,68 2,14	19,42 7,10	27,61 7,70
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-5,05 -3,54	-9,84 -9,12	-1,55 -2,51	3,14 -2,83	-7,24 -9,35	33,89 -0,25	32,47 -5,09
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,11 0,10	4,55 -0,86	1,61 -0,38	5,24 -0,17	7,28 -0,72	20,27 -1,61	29,41 -2,85
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,75 -0,04	1,86 -0,10	0,10 -0,15	3,07 0,08	3,70 -0,19	21,50 0,39	27,56 0,18
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,50 -1,14	4,53 3,19	-0,09 -1,34	3,18 2,37	6,41 3,27	25,88 19,76	33,17 22,25
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,04 0,02	4,84 -0,57	1,66 -0,33	5,27 -0,15	7,35 -0,65	20,53 -1,35	29,77 -2,49
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,56 -0,04	-0,93 -0,21	0,83 -0,13	5,77 -0,20	1,83 -0,28	33,39 -0,75	36,49 -1,07
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,66 -0,10	4,32 -0,30	-0,35 -0,11	2,90 -0,25	6,21 -0,35	23,82 -0,67	30,66 -0,98
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,13 -0,02	2,97 -0,15	0,47 -0,04	1,57 -0,10	4,34 -0,21	11,93 -0,39	19,28 -0,63
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-2,65 -0,05	-4,82 -0,26	0,59 -0,16	6,44 -0,34	-1,87 -0,19	41,55 -0,87	40,12 -1,14
35-BRB MILLENIUM % do CDI	-0,22 -136,97	1,51 66,50	0,05 9,59	0,65 52,14	2,69 76,01	8,86 88,29	15,36 88,46
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	19,35	24,16	18,58	58,11	66,65	93,71	61,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	18,71	22,81	17,34	57,30	63,52	87,59	50,10
FIA BRASIL IBX-50	-4,95	-18,85	-0,51	30,59	-10,27	14,44	21,57
Var. IBOVESPA p.p.	-0,16	-0,65	-0,03	1,03	-0,59	-4,79	-5,76
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	-4,71	-18,15	-0,49	29,15	-9,67	18,59	26,05
Var. IBOVESPA p.p.	0,09	0,05	-0,01	-0,41	0,01	-0,64	-1,29
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	-4,69	-18,09	-0,46	28,86	-9,73	18,23	25,46
Var. IBOVESPA p.p.	0,11	0,11	0,02	-0,70	-0,05	-1,00	-1,88
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-5,04	-17,78	-0,39	30,27	-8,20	24,95	26,70
Var. IBOVESPA p.p.	-0,25	0,41	0,09	0,71	1,48	5,72	-0,63
FIP CAIXA CYRELA	-0,23	-10,37	-3,53	-18,69	-20,44	2,16	0,87
Var. IPCA p.p.	-0,87	-11,72	-4,77	-19,50	-23,57	-3,96	-10,05
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	-2,96	-4,05	4,70	48,11	5,50	60,57	61,54
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,67	17,03	8,01	33,33	15,30	22,72	31,05
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-5,93	-20,37	1,37	33,48	-4,18	45,25	33,42
Var. IBOVESPA p.p.	-1,13	-2,18	1,85	3,92	5,51	26,01	6,08
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-4,93	-17,58	-0,96	19,42	-6,98	43,54	33,91
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,30	3,49	2,35	4,64	2,83	5,70	3,42
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-4,70	-23,62	-1,71	18,99	-16,46	13,75	13,73
Var. IBOVESPA p.p.	0,10	-5,43	-1,24	-10,57	-6,77	-5,49	-13,61
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-1,99	52,76	14,98	43,04	61,21	70,33	154,87
Var. IBOVESPA p.p.	2,80	70,95	15,46	13,48	70,90	51,09	127,53
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	-2,46	46,05	12,94	37,50	56,62	52,67	131,20
Var. IBOVESPA p.p.	2,33	64,24	13,41	7,94	66,30	33,44	103,86
CDI	0,16	2,28	0,51	1,25	3,54	10,04	17,36
IBOVESPA	-4,80	-18,20	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34
INPC + 6%	1,36	6,58	3,22	4,50	10,12	20,11	32,29
IPCA + 6%	1,13	5,85	2,78	3,79	9,32	19,21	31,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
761	01/09/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	168.072,11	8.436,25058758	19,9226075900
762	01/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.324,28	0,00	627,70017200	2,1097333690
763	01/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.329,04	0,00	629,95638100	2,1097333690
764	02/09/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	77.114,04	3.870,54861137	19,9232842000
765	02/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	42.728,68	0,00	20.252,32935200	2,1098155800
766	02/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.206,40	0,00	571,80353100	2,1098155800
767	02/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	14.548.933,58	1.792.505,16309373	8,1165365000
768	02/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	194.779,43	23.997,85056545	8,1165365000
769	02/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	494.024,20	0,00	60.866,38064047	8,1165365000
770	03/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	8.860.000,00	0,00	1.091.590,44012121	8,1165972800
771	03/09/2020	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	15.045.000,00	0,00	8.781.856,05149295	1,7131913700
772	04/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	9.850,74	0,00	4.668,70590800	2,1099508500
774	04/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	15.837,64	0,00	7.506,16536800	2,1099508500
775	08/09/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	3.241,73	162,69442738	19,9252675800
776	08/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.628,74	0,00	1.719,75983500	2,1100271820
777	08/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.132,40	0,00	536,67555000	2,1100271820
778	09/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.650,90	0,00	1.730,21248600	2,1100876500
779	09/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.287,44	0,00	610,13579200	2,1100876500
780	09/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	265.000,00	0,00	32.648,43489566	8,1167750000
781	09/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	90.000,00	0,00	11.088,14770041	8,1167750000
782	10/09/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	97.274,45	4.881,64342848	19,9265783000
783	10/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.563,26	0,00	1.688,62777400	2,1101512440
784	10/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.015,00	0,00	481,00817500	2,1101512440
785	10/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.862,71	3.726,13575500	2,1101512440
786	10/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.969,74	3.776,85723700	2,1101512440
787	10/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	710.000,00	0,00	87.472,52259559	8,1168346200
788	10/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	5.803,95	715,05091200	8,1168346200
789	11/09/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	61.153,86	3.068,85848426	19,9272336300

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
790	11/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	4.426,51	0,00	2.097,69806300	2,1101749950
791	11/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.510,00	0,00	1.189,47480900	2,1101749950
792	11/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	140.000,00	0,00	74.637,60775805	1,8757300000
793	14/09/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	5.745.000,00	0,00	288.289,42419930	19,9278902300
794	14/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	793,12	0,00	375,85446600	2,1101784630
795	14/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	5.256,50	0,00	2.491,02153700	2,1101784630
796	14/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	4.071.256,09	501.574,37790059	8,1169538700
797	14/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.674.586,77	206.307,29161607	8,1169538700
800	14/09/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	140.162,11	74.720,96542981	1,8758070000
801	14/09/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	140.162,11	0,00	37.699,95793247	3,7178320000
798	15/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	7.524,48	0,00	3.565,82493400	2,1101652880
799	15/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.208.915,71	0,00	272.134,02576603	8,1170140500
802	16/09/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	67.979,54	3.411,05051392	19,9292094100
803	16/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	14.111,94	0,00	6.687,90974213	2,1100673520
804	16/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	10.496,58	0,00	4.974,52367577	2,1100673520
805	16/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.000,00	123,19710128	8,1170741000
806	17/09/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	22.664,91	1.137,23323849	19,9298694700
807	17/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	166.367,21	72.665,91854909	2,2894805890
808	17/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.326,50	0,00	628,69049139	2,1099412480
809	17/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.868.495,75	230.191,56627605	8,1171338300
810	17/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.712.000,00	0,00	210.911,88538406	8,1171338300
842	17/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	452,43	0,00	214,42777159	2,1099412480
811	18/09/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	54.232,05	2.721,05414415	19,9305295400
812	18/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	13.528,56	0,00	6.411,56347332	2,1100251220
813	18/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	6.390,38	0,00	3.028,58005498	2,1100251220
814	21/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	7.272,58	0,00	3.446,80207326	2,1099499900
815	21/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	5.565.499,67	0,00	685.638,25426415	8,1172537200
816	22/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	6.110,64	0,00	2.895,97223788	2,1100478520
817	22/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	20.367.851,23	0,00	2.509.186,17699442	8,1173136600
818	22/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	5.182,65	638,46861377	8,1173136600

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
819	23/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	92.207,86	43.698,36589588	2,1100985840
820	23/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.083,99	987,62684161	2,1100985840
821	23/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	5.509.645,37	678.747,27784496	8,1173738000
822	23/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	59.612,51	7.343,81728238	8,1173738000
823	24/09/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	2.049.142,99	102.800,68079663	19,9331655600
824	24/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	512.930,01	224.005,81774886	2,2898066450
825	24/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.544,74	1.679,92096890	2,1100635480
826	24/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	11.809.708,05	1.454.857,28696461	8,1174340300
827	24/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	4.558.359,14	0,00	561.551,73213031	8,1174340300
828	25/09/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	695.103,92	34.870,57775530	19,9338228600
829	25/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	110.000.000,00	0,00	13.550.979,57481298	8,1174943400
830	25/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	26.609,88	3.278,09036698	8,1174943400
831	28/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.040,68	0,00	967,20550687	2,1098721890
832	28/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	25.120.000,00	0,00	3.094.527,90073291	8,1175548600
833	29/09/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	1.169.290,34	58.654,75107434	19,9351343000
834	29/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.240.827,31	978.946,71477850	2,2890186730
835	29/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	88.410,33	41.904,80583782	2,1097897540
836	29/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	131.293.102,69	16.173.850,69206775	8,1176156000
837	29/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	5.454.981,53	671.993,08255000	8,1176156000
841	29/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.821,86	2.759,45031440	2,1097897540
838	30/09/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	211.731,70	10.620,68196130	19,9357913900
840	30/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	644,88	0,00	305,68071170	2,1096522460
839	30/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	810,74	0,00	384,30030425	2,1096522460

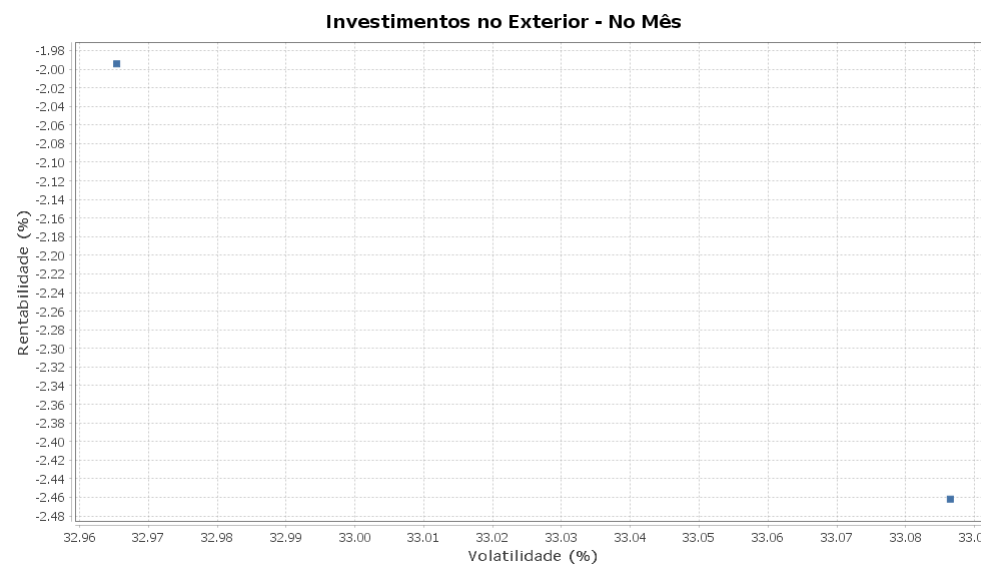
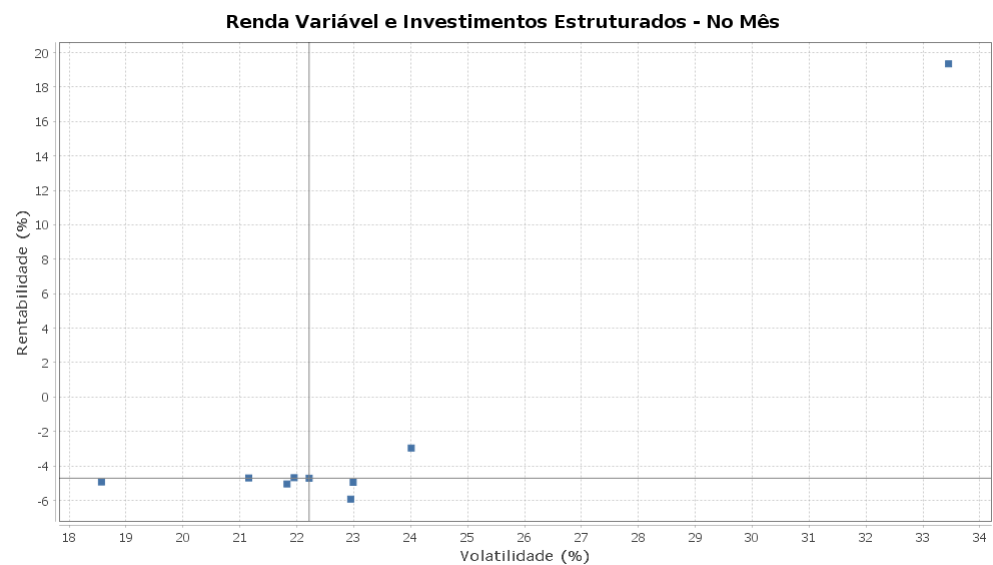
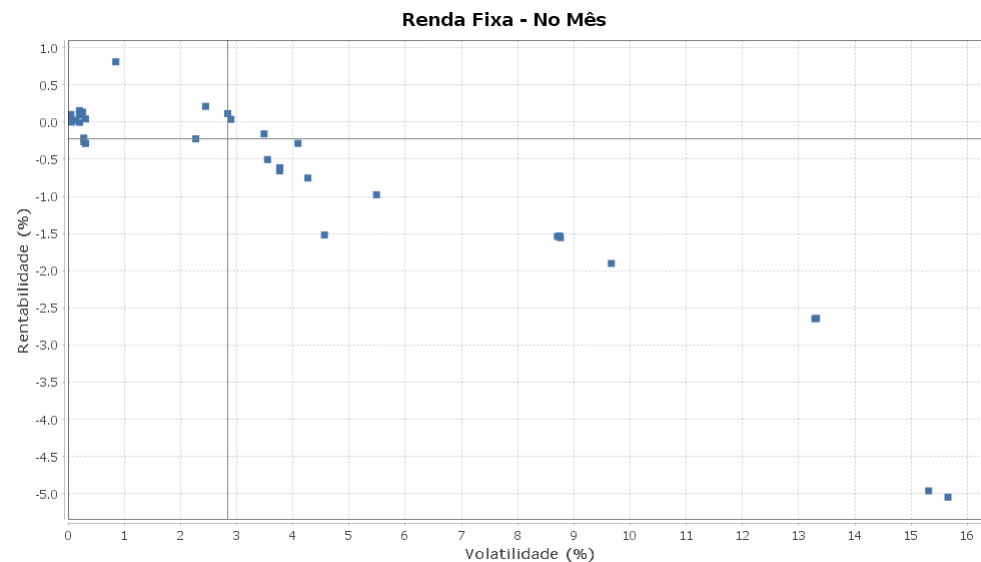
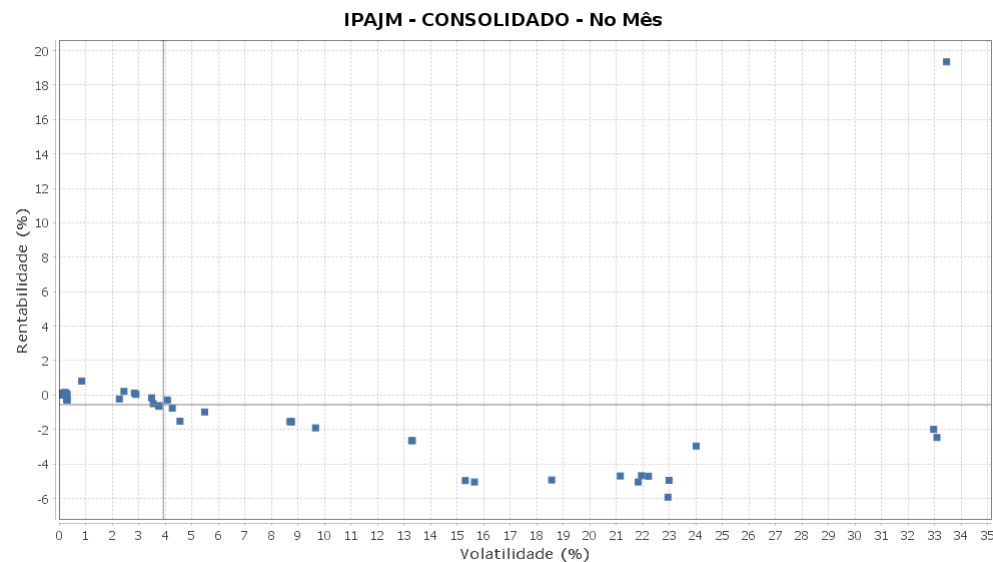
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rendimentos Realizados

Artigo	Ativo	Quantidade	Valor Aplicação	Valor Resgate	Rendimento
Artigo 7º IV, Alínea a	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	21.746.123,213156	176.511.478,63	176.523.698,24	12.219,61
Artigo 7º IV, Alínea a	BB PREV RF FLUXO FIC	98.533,162851	207.706,22	207.901,22	195,00
Artigo 7º IV, Alínea a	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.275.618,451076	2.772.524,33	2.920.124,53	147.600,20
Artigo 7º IV, Alínea a	FI BANESTES INVEST MONEY RF	234.636,025023	4.674.874,54	4.677.001,64	2.127,10
Artigo 7º IV, Alínea a	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	74.720,965430	140.156,04	140.162,11	6,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	-1.392,80	0,02	71.423.220,76	1,48
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,01	0,00	-140,08	0,09	5,76	0,00
FI BANESTES INVEST MONEY RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,01	0,00	-151,46	0,07	1.724.535,92	0,04
LFT 010921	Artigo 7º I, Alínea a	0,05	0,03	0,00	-1,07	0,10	247.373.001,57	5,13
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,04	0,00	-2,43	-0,00	245.235,77	0,01
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,14	0,06	0,00	-0,97	0,02	322.348.800,40	6,69
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,20	0,13	-0,00	-0,28	0,10	14.477.305,38	0,30
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,20	0,13	-0,00	-0,02	0,15	185.767.873,69	3,85
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,21	0,08	0,00	-0,78	-0,00	130.404.672,41	2,71
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,26	0,14	0,00	-0,09	0,13	40.398.854,02	0,84
35-BRB MILLENIUM	Artigo 7º I, Alínea b	0,28	0,07	0,00	-1,32	-0,22	1.387.008,44	0,03
33-BRB TESOURO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,28	0,07	0,00	-1,50	-0,27	2.580,03	0,00
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,31	0,14	0,00	-0,37	0,04	303.944.793,28	6,31
LFT 010324	Artigo 7º I, Alínea a	0,31	0,13	0,00	-1,43	-0,29	111.821.518,88	2,32
NTN-B 150521	Artigo 7º I, Alínea a	0,85	0,37	0,01	0,77	0,81	321.188.979,96	6,66
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	2,27	0,83	0,00	-0,17	-0,23	1.408.644,62	0,03
NTN-B 150822	Artigo 7º I, Alínea a	2,45	0,99	0,05	0,02	0,21	408.467.452,58	8,48
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,84	0,94	0,01	-0,02	0,11	41.704.313,48	0,87
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,90	1,03	0,00	-0,04	0,04	33.216.220,76	0,69
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,49	1,02	0,00	-0,09	-0,16	34.672.299,05	0,72
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,55	1,33	0,15	-0,19	-0,50	693.620.264,66	14,39
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,76	1,34	0,01	-0,22	-0,66	49.719.456,07	1,03
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,77	1,39	0,01	-0,20	-0,61	36.637.970,38	0,76
NTN-B 150523	Artigo 7º I, Alínea a	4,09	1,32	0,01	-0,11	-0,29	77.000.542,86	1,60
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,27	1,43	0,15	-0,21	-0,75	657.259.443,36	13,64
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	4,56	1,15	0,00	-0,37	-1,52	7.108.293,73	0,15
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	5,49	1,97	0,01	-0,21	-0,98	20.804.531,71	0,43
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	8,71	3,22	0,00	-0,19	-1,54	2.024.585,11	0,04
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	8,75	3,24	0,01	-0,19	-1,53	13.726.907,34	0,28
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	8,76	3,22	0,01	-0,20	-1,56	25.286.533,94	0,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150830	Artigo 7º I, Alínea a	9,67	4,05	0,07	-0,21	-1,90	113.545.279,18	2,36
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	13,29	5,16	0,01	-0,21	-2,65	7.365.056,68	0,15
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	13,32	5,13	0,01	-0,21	-2,64	10.525.871,46	0,22
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	15,31	5,43	-0,00	-0,33	-4,96	30.600.017,33	0,63
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	15,66	5,47	-0,00	-0,33	-5,05	32.883.143,75	0,68
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	18,57	10,57	0,06	-0,27	-4,93	28.158.065,36	0,58
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	21,16	11,35	0,26	-0,23	-4,70	117.382.870,88	2,44
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	21,83	11,24	0,21	-0,24	-5,04	93.949.979,40	1,95
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	21,95	11,05	0,02	-0,22	-4,69	8.719.190,87	0,18
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	22,22	11,46	0,14	-0,22	-4,71	62.685.708,57	1,30
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	22,95	15,77	0,42	-0,27	-5,93	140.908.963,53	2,92
FIA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	22,99	11,46	0,31	-0,22	-4,95	137.949.873,43	2,86
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	24,01	11,94	0,01	-0,13	-2,96	5.304.872,72	0,11
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	32,97	12,73	0,03	-0,07	-1,99	111.775.083,52	2,32
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	33,09	12,51	0,01	-0,08	-2,46	24.027.405,36	0,50
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	Artigo 8º IV, Alínea b	33,45	15,73	0,02	0,57	19,35	36.998.000,00	0,77

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 23,69% 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;