



IPAJM CONS
JANEIRO 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 22.04.2020.

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 **86,97%**

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	0,83	-0,02	-0,02	34.690.772,65	0,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830	5,08	1,17	1,17	118.916.346,78	2,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822	2,32	0,66	0,66	410.965.691,07	8,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	2,77	0,68	0,68	75.272.159,72	1,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150521	1,36	0,29	0,29	319.060.072,53	6,84
TESOURO NACIONAL	LFT 010324	0,05	0,37	0,37	110.271.333,43	2,36
TESOURO NACIONAL	LFT 010921	0,04	0,38	0,38	232.417.316,32	4,98
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		1,54	0,52	0,52	1.301.593.692,50	27,89

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	2,06	0,85	0,85	48.068.066,64	1,03	5.205.249.143,09	0,92
BRB	BRB	35-BRB MILLENIUM	0,07	0,33	0,33	1.250.187,96	0,03	71.922.647,37	1,74
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B	7,90	0,55	0,55	36.671.372,77	0,79	304.786.097,11	12,03
BB	BB	BB PREVID RF IRF-M1	0,26	0,42	0,42	381.886.581,99	8,18	7.374.284.212,96	5,18
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	4,90	0,26	0,26	13.735.386,33	0,29	6.477.324.446,92	0,21
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	4,91	0,25	0,25	13.899.622,09	0,30	6.604.088.892,56	0,21
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,25	0,42	0,42	158.903.773,18	3,41	10.529.932.746,92	1,51
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	1,97	0,54	0,54	33.427.969,56	0,72	9.706.276.068,00	0,34
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	1,49	0,38	0,38	28.504.321,39	0,61	6.900.045.813,02	0,41

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 IMA-B5+	7,27	0,05	0,05	7.741.675,38	0,17	2.287.850.661,28	0,34
CEF	CEF	FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	7,28	-0,04	-0,04	11.054.681,88	0,24	2.270.256.483,13	0,49
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	2,93	1,08	1,08	19.996.207,50	0,43	2.361.861.808,09	0,85
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	1,50	0,46	0,46	31.828.694,82	0,68	8.791.015.868,25	0,36
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	2,10	0,84	0,84	35.383.047,69	0,76	15.527.608.259,67	0,23
BANESTES	BANESTES	Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1	1,37	0,72	0,72	15.691.531,52	0,34	197.821.718,73	7,93
BB	BB	BB PREV ALOC FIC	2,35	0,49	0,49	648.415.995,59	13,90	10.446.730.359,40	6,21
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	3,67	0,82	0,82	668.992.798,74	14,34	10.136.705.212,45	6,60
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,91	0,57	0,57	2.155.451.915,03	46,19		

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 NOVO BRASIL IMAB RF LP	4,88	0,23	0,23	2.049.397,58	0,04	3.029.770.455,34	0,07
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			4,88	0,23	0,23	2.049.397,58	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 VIP DI REFERENCIADO LP	0,36	0,34	0,34	22.028.110,85	0,47	512.423.860,26	4,30
BRB	BRB	33-BRB TESOIRO	0,07	0,28	0,28	5.564,01	0,00	220.504.382,10	0,00
BANESTES	BANESTES	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,04	0,12	0,12	10.529.889,24	0,23	599.611.553,61	1,76
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,37	0,37	63.313.731,46	1,36	5.345.385.558,02	1,18
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	7,51	0,74	0,74	34.453.178,11	0,74	354.602.133,24	9,72
BB	BB	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,05	0,35	0,35	324.169.830,31	6,95	2.903.514.199,57	11,16
BB	BB	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,04	0,29	0,29	273.281,49	0,01	1.500.776.659,75	0,02
BANESTES	BANESTES	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,09	0,39	0,39	137.103.590,70	2,94	2.809.844.885,27	4,88
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF	2,59	0,62	0,62	7.270.588,84	0,16	216.119.068,94	3,36
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,52	0,38	0,38	599.147.765,01	12,84		
Renda Fixa			1,52	0,53	0,53	4.058.242.770,12	86,97		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

12,28%

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	FI ACOES CAIXA BRASIL IBX-50	18,10	-1,61	-1,61	147.708.653,91	3,17	1.285.266.984,85	11,49
BB	BB	BB PREV ACOES GV	17,55	-1,09	-1,09	83.907.186,11	1,80	826.438.302,84	10,15
CEF	CEF	FI ACOES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	17,51	-1,71	-1,71	10.462.199,52	0,22	126.776.758,23	8,25
CEF	CEF	FI ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	17,89	-1,67	-1,67	11.798.675,19	0,25	574.803.106,30	2,05
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			17,68	-1,55	-1,55	253.876.714,73	5,44		

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 ACOES DIVIDENDOS FICFI	16,73	-0,42	-0,42	89.352.770,85	1,91	1.176.739.396,25	7,59
VINCI	CEF	FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	15,73	1,53	1,53	34.688.297,37	0,74	943.947.729,59	3,67
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT	16,77	0,50	0,50	150.498.450,69	3,23	1.590.900.361,63	9,46
BANESTES	BANESTES	Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	16,45	3,36	3,36	5.714.767,02	0,12	132.732.358,95	4,31
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			16,06	0,48	0,48	280.254.285,93	6,01		

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	21,03	4,86	4,86	4.000.983,72	0,09	142.989.968,61	2,80
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			21,03	4,86	4,86	4.000.983,72	0,09		

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	23,82	20,64	17,45	35.000.000,00	0,75	183.741.842,71	19,05
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			23,82	20,64	20,64	35.000.000,00	0,75		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			14,69	0,83	0,83	573.131.984,38	12,28		
---	--	--	-------	------	------	----------------	-------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,75%

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 NIVEL I	14,56	6,52	6,52	28.627.760,02	0,61	797.257.804,89	3,59
BB	BB	BB Acoes Globais BDR Nivel I	14,79	2,94	2,94	6.464.944,48	0,14	96.351.953,87	6,71
Sub-total Artigo 9º A, III			14,50	5,84	5,84	35.092.704,50	0,75		
Investimentos no Exterior			14,50	5,84	5,84	35.092.704,50	0,75		
Total						4.666.467.459,00	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	1.301.593.692,50	27,89	20,00	27,00	60,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	2.155.451.915,03	46,19	15,00	36,30	60,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	2.049.397,58	0,04	0,00	0,10	2,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	599.147.765,01	12,84	5,00	10,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	4.058.242.770,12	86,97				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	253.876.714,73	5,44	0,00	6,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	280.254.285,93	6,01	0,00	5,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	4.000.983,72	0,09	0,00	0,10	2,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	35.000.000,00	0,75	0,00	0,50	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	573.131.984,38	12,28				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	35.092.704,50	0,75	0,00	4,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	35.092.704,50	0,75				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

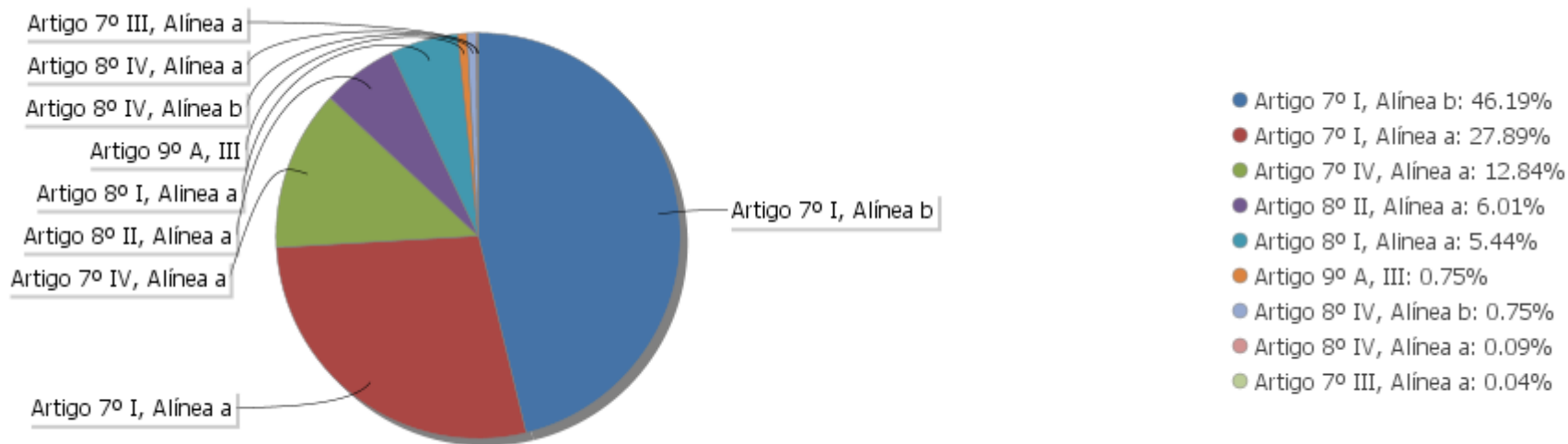
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,52 138,59	0,52 138,59	1,28 113,01	4,32 165,95	10,79 186,59	6.758.572,37	6.758.572,37
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,57 151,14	0,57 151,14	0,86 75,48	3,88 148,87	10,74 185,63	13.851.697,08	13.851.697,08
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,23 60,93	0,23 60,93	-0,36 -31,74	5,45 209,34	17,66 305,34	4.692,06	4.692,06
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,38 99,69	0,38 99,69	0,90 79,34	2,72 104,45	6,84 118,16	2.417.512,42	2.417.512,42
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,55 0,08	-1,55 0,08	6,47 0,37	12,16 0,42	16,94 0,13	-6.445.161,77	-6.445.161,77
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,48 2,11	0,48 2,11	12,17 6,07	18,13 6,40	28,60 11,80	-5.485.294,62	-5.485.294,62
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	4,86 6,49	4,86 6,49	4,66 -1,44	-7,38 -19,11	7,23 -9,57	185.292,58	185.292,58
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	20,64 22,27	20,64 22,27	53,77 47,67	73,88 62,15	86,71 69,91	6.010.200,00	6.010.200,00
Artigo 9º A, III % do CDI	5,84 1.550,63	5,84 1.550,63	13,35 1.175,22	21,33 818,92	40,50 700,19	1.936.347,87	1.936.347,87
						19.233.857,99	19.233.857,99

Análise de Liquidez

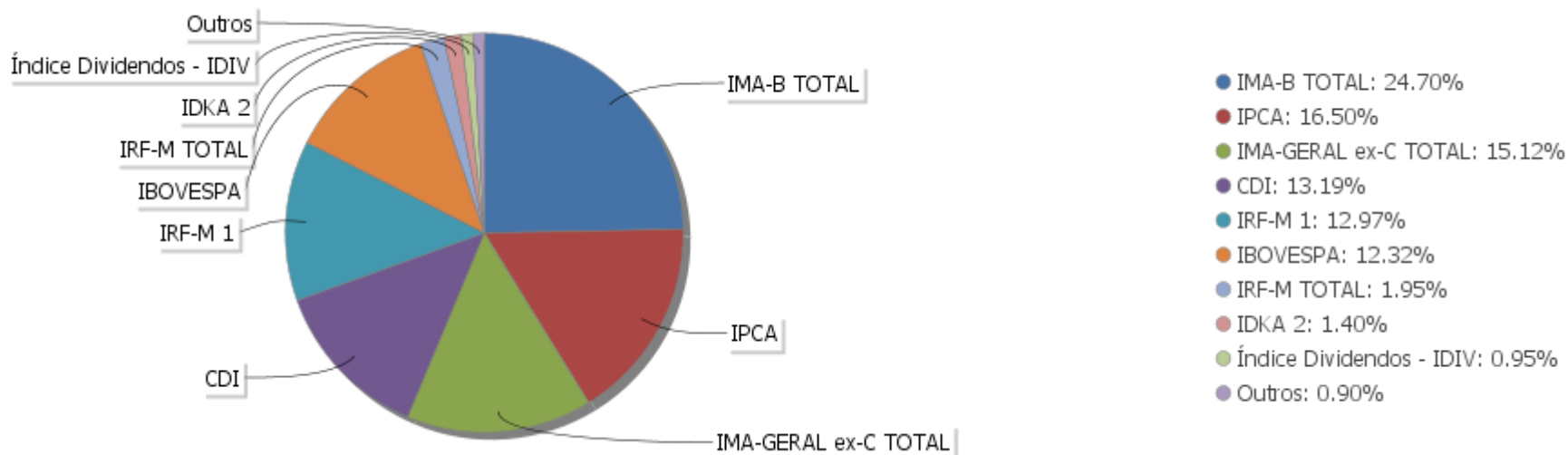
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	3.324.470.702,11	71,24	3.324.470.702,11	71,24
de 31 a 364 dias	75.093.837,04	1,61	3.399.564.539,15	72,85
acima de 365 dias	1.266.902.919,85	27,15	4.666.467.459,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

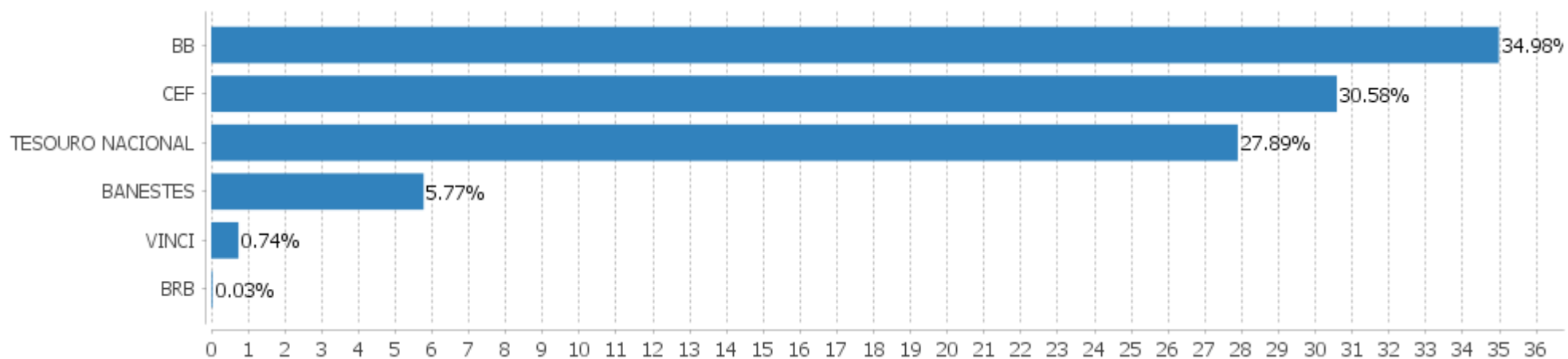


Alocação Por Estratégia



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

PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

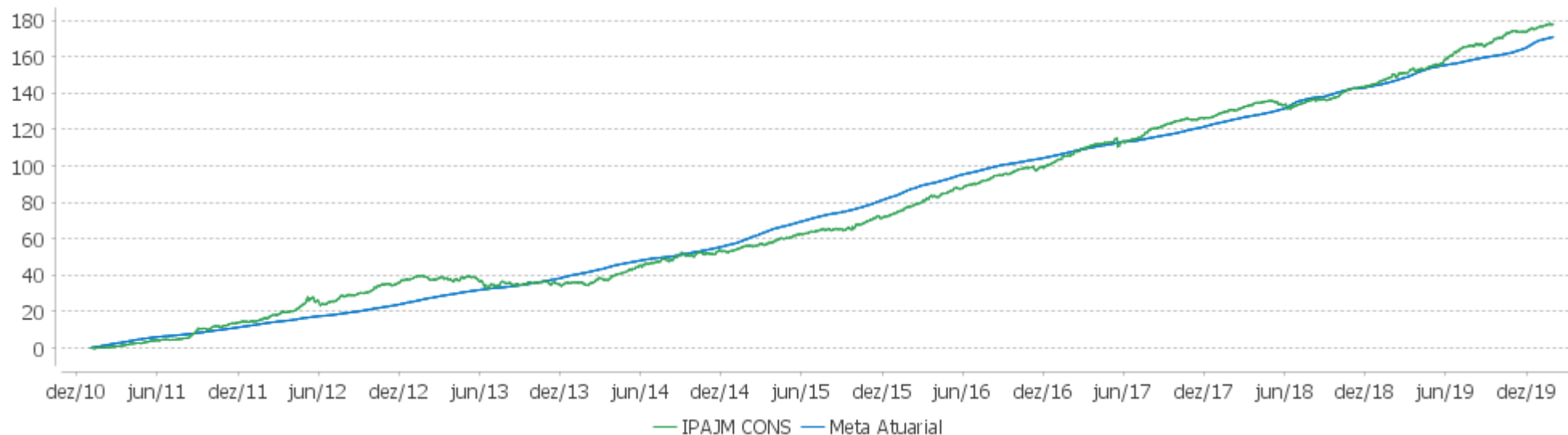
RELATÓRIO TRIMESTRAL

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

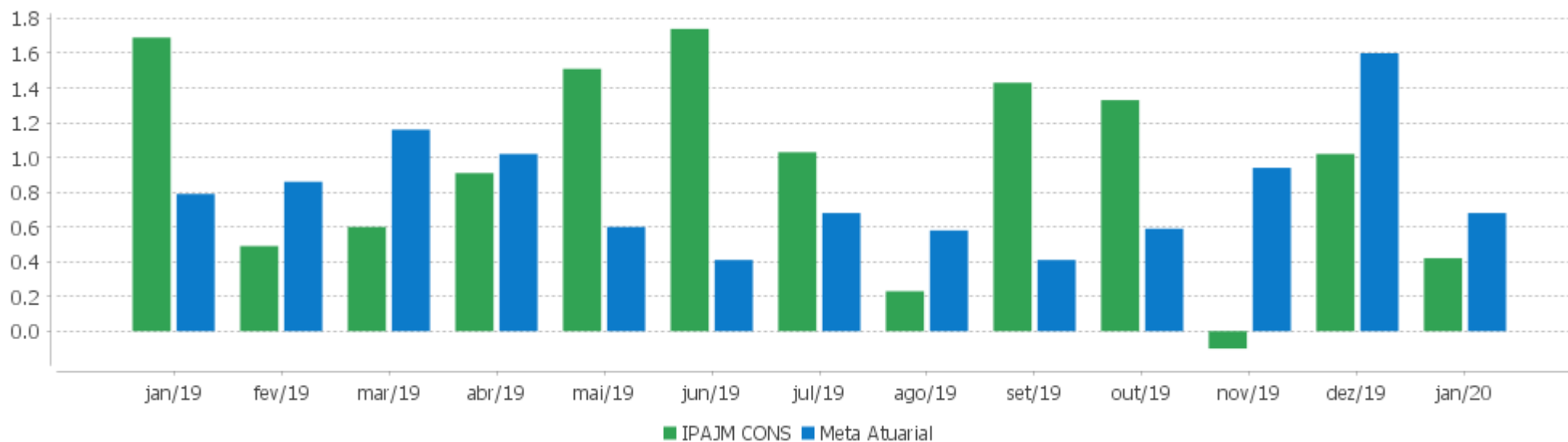
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	57	52,29	03 meses	1,34	3,21	-1,87	1,29
Meses abaixo da Meta Atuarial	52	47,71	06 meses	4,39	4,84	-0,45	1,69
			12 meses	11,12	9,90	1,22	1,92
			24 meses	20,26	20,53	-0,27	2,04
			36 meses	35,16	31,29	3,86	2,32
			Desde 31/12/2010	177,71	180,59	-2,88	2,85
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	4,20	2011-08					
Menor rentabilidade da Carteira	-1,62	2013-05					

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.	0,74 0,47	0,74 0,47	-1,49 -1,25	5,41 -0,23	23,76 5,65	38,46 3,67	58,97 4,65
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP % do CDI	0,34 90,31	0,34 90,31	0,91 79,98	2,48 95,28	5,57 96,36	12,15 96,92	22,67 98,20
Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI % do CDI	0,39 104,85	0,39 104,85	1,07 93,80	2,45 94,07	5,88 101,59	13,19 105,26	24,55 106,35
BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF % do CDI	0,62 163,34	0,62 163,34	1,76 154,64	6,99 268,43	16,65 287,81		
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,35 92,89	0,35 92,89	1,05 92,35	2,45 94,13	5,55 95,98	12,19 97,29	22,86 99,00
Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto % do CDI	0,12 31,20	0,12 31,20	0,39 34,44	1,07 40,98	2,69 46,53	6,08 48,55	12,73 55,12
BB PREVID RF FLUXO FIC % do CDI	0,29 75,83	0,29 75,83	0,87 76,39	2,05 78,56	4,65 80,38	10,14 80,90	19,28 83,49
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,37 98,46	0,37 98,46	1,03 91,06	2,44 93,73	5,55 95,93	12,08 96,40	22,61 97,91
33-BRB TESOIRO % do CDI	0,28 73,81	0,28 73,81	0,86 75,39	2,05 78,72	4,76 82,25	10,32 82,31	19,43 84,16
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,25 -0,01	0,25 -0,01	-0,36 -0,12	5,44 -0,20	17,72 -0,40	34,14 -0,64	53,25 -1,07
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	0,54 -0,01	0,54 -0,01	1,41 -0,10	4,89 -0,15	11,76 -0,30	22,83 -0,53	38,27 -0,85
BB PREVID RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,42 -0,02	0,42 -0,02	1,13 -0,07	2,89 -0,15	6,33 -0,29	13,50 -0,54	24,99 -0,85
FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,84 -0,04	0,84 -0,04	0,96 -0,08	4,33 -0,17	11,12 -0,35	22,99 -0,54	39,91 -1,04
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,04 -0,07	-0,04 -0,07	-1,75 -0,21	5,77 -0,31	21,74 -0,59	42,13 -1,28	64,08 -1,90
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	1,08 -0,04	1,08 -0,04	0,92 -0,07	5,12 -0,15	13,23 -0,34	27,17 -0,54	46,21 -1,16
BANESTES PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,55 0,29	0,55 0,29	-1,35 -1,11	6,31 0,67	25,06 6,94	42,79 8,00	64,13 9,81
Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1	0,72	0,72	1,29	3,71	10,08	19,31	32,09

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IRF-M 1 p.p.	0,28	0,28	0,10	0,66	3,46	5,27	6,25
BB PREV RF IDKA2	0,38	0,38	1,75	4,52	10,29	20,76	35,58
Var. IDKA 2 p.p.	-0,15	-0,15	-0,01	-0,22	-0,73	-1,68	-3,10
BB PREV ALOC FIC	0,49	0,49	0,50	3,93	11,38	22,76	37,70
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,01	-0,01	-0,21	-0,15	0,31	0,53	-0,16
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	0,82	0,82	0,91	4,67	14,10	25,30	39,15
Var. IPCA p.p.	0,61	0,61	-0,97	2,62	9,91	17,17	27,94
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	0,46	0,46	1,57	4,44	10,30	20,93	35,71
Var. IDKA 2 p.p.	-0,08	-0,08	-0,19	-0,31	-0,72	-1,51	-2,96
BB PREV RF IRF-M	0,85	0,85	0,98	4,38	11,22	23,04	39,99
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,02	-0,02	-0,06	-0,12	-0,24	-0,50	-0,96
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,42	0,42	1,14	2,93	6,40	13,64	25,20
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,02	-0,05	-0,11	-0,22	-0,40	-0,64
BB PREV IMAB TPB	0,26	0,26	-0,30	5,54	17,83	34,11	53,19
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,00	-0,00	-0,06	-0,10	-0,29	-0,67	-1,13
BB PREV IMA-B5+	0,05	0,05	-1,45	6,13	22,08	42,79	64,47
Var. IMA-B 5+ p.p.	0,01	0,01	0,09	0,06	-0,25	-0,62	-1,51
35-BRB MILLENIUM	0,33	0,33	1,01	2,41	5,40	11,60	21,47
% do CDI	87,10	87,10	89,27	92,55	93,34	92,57	93,00
NTN-B 150820	-0,02	-0,02	1,68	3,45	7,73	17,82	33,78
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,28	-0,28	1,92	-2,19	-10,38	-16,96	-20,54
NTN-B 150822	0,66	0,66	1,49	5,15	12,91	25,25	43,83
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,39	0,39	1,73	-0,49	-5,20	-9,53	-10,48
LFT 010921	0,38	0,38	1,14	2,61	5,80	12,55	23,45
LFT 010324	0,37	0,37	1,14	2,62	5,81	12,50	
NTN-B 150523	0,68	0,68	1,41	5,58	14,28	27,45	46,11
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,42	0,42	1,65	-0,06	-3,84	-7,34	-8,20
NTN-B 150521	0,29	0,29	1,73	4,16	10,08	21,21	38,31
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,03	0,03	1,97	-1,48	-8,03	-13,57	-16,01
NTN-B 150830	1,17	1,17	-0,37	6,30	18,98	36,26	57,10
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,91	0,91	-0,13	0,66	0,87	1,47	2,78
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP	0,23	0,23	-0,36	5,45	17,66	34,19	52,87
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,03	-0,12	-0,19	-0,45	-0,59	-1,45
FIP CAIXA CYRELA	4,86	4,86	4,81	-7,27	7,33	18,48	32,80
Var. IPCA p.p.	4,65	4,65	2,93	-9,32	3,14	10,36	21,58

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.	17,45 17,24	17,45 17,24	46,57 44,69	62,48 60,43	67,46 63,27	60,15 52,02	60,00 48,79
FI ACOES CAIXA BRASIL IBX-50 Var. IBOVESPA p.p.	-1,61 0,02	-1,61 0,02	6,46 0,36	11,64 -0,10	15,12 -1,69	27,89 -6,09	70,78 -5,13
FI ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-1,67 -0,04	-1,67 -0,04	6,08 -0,02	11,55 -0,18	16,45 -0,36	32,88 -1,09	73,28 -2,63
FI ACOES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-1,71 -0,08	-1,71 -0,08	5,96 -0,14	11,27 -0,47	16,13 -0,68	32,41 -1,56	72,38 -3,52
BB PREV ACOES GV Var. IBOVESPA p.p.	-1,09 0,54	-1,09 0,54	7,44 1,34	14,37 2,63	19,95 3,14	39,21 5,23	81,48 5,57
Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	3,36 4,95	3,36 4,95	11,05 0,26	17,28 0,13	33,66 6,65	61,45 10,69	108,30 17,15
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT Var. IBOVESPA p.p.	0,50 2,13	0,50 2,13	18,51 12,41	24,23 12,50	41,26 24,46	56,18 22,21	119,71 43,80
FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,53 3,11	1,53 3,11	10,76 -0,03	17,94 0,79	28,52 1,51	51,11 0,35	95,52 4,37
BB ACOES DIVIDENDOS FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-0,42 1,21	-0,42 1,21	7,87 1,77	11,61 -0,12	18,23 1,43	36,18 2,20	68,85 -7,06
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I Var. IBOVESPA p.p.	6,52 8,15	6,52 8,15	13,98 7,88	22,36 10,62	42,28 25,48	55,39 21,41	99,23 23,32
BB Acoes Globais BDR Nivel I Var. IBOVESPA p.p.	2,94 4,57	2,94 4,57	10,64 4,54	16,75 5,01	31,72 14,92	45,62 11,64	75,00 -0,91
CDI	0,38	0,38	1,14	2,60	5,78	12,53	23,09
IBOVESPA	-1,63	-1,63	6,10	11,74	16,80	33,97	75,91
INPC + 6%	0,70	0,70	3,46	5,16	10,59	21,35	30,95
IPCA + 6%	0,72	0,72	3,37	5,14	10,47	21,46	32,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,44	0,44	1,20	3,05	6,61	14,04	25,84
IRF-M 1+	1,11	1,11	0,99	5,27	13,57	27,70	47,38
IRF-M TOTAL	0,88	0,88	1,04	4,50	11,47	23,54	40,94
IMA-B 5	0,56	0,56	1,51	5,04	12,06	23,36	39,12
IMA-B 5+	0,03	0,03	-1,54	6,07	22,33	43,41	65,98
IMA-B TOTAL	0,26	0,26	-0,24	5,64	18,11	34,79	54,32
IMA-C TOTAL	2,54	2,54	1,76	6,14	20,05	38,88	56,63
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,50	0,50	0,70	4,08	11,07	22,22	37,86
IMA-GERAL TOTAL	0,56	0,56	0,73	4,13	11,32	22,68	38,34
IDKA 2	0,54	0,54	1,76	4,74	11,02	22,45	38,67
IDKA 20	-1,37	-1,37	-3,65	5,34	28,11	57,81	85,76
CDI	0,38	0,38	1,14	2,60	5,78	12,53	23,09
Renda Variável							
IBOVESPA	-1,63	-1,63	6,10	11,74	16,80	33,97	75,91
IBRX 100	-1,25	-1,25	6,95	12,64	18,97	37,28	80,87
IBRX 50	-1,88	-1,88	5,44	10,57	14,75	29,92	71,82
SMALL CAP	0,45	0,45	18,98	24,82	45,25	64,69	130,34
IFIX	-3,76	-3,76	10,22	15,71	27,70	34,66	59,06
Índice Consumo - ICON			15,32	21,23	43,29	43,57	87,57
Índice Dividendos - IDIV	-1,58	-1,58	10,79	17,15	27,01	50,76	91,15
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,21	0,21	1,88	2,05	4,19	8,13	11,21
INPC	0,19	0,19	1,96	2,07	4,30	8,03	10,05
IGPM	0,48	0,48	2,89	2,88	7,82	15,10	14,63
SELIC	0,38	0,38	1,14	2,60	5,78	12,54	23,11
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,55	0,55	2,88	4,12	8,38	16,93	25,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,64	0,64	3,13	4,63	9,42	19,19	28,64
IPCA + 5,5%	0,68	0,68	3,25	4,89	9,95	20,32	30,48
IPCA + 5,89%	0,71	0,71	3,35	5,09	10,35	21,21	31,93
IPCA + 6%	0,72	0,72	3,37	5,14	10,47	21,46	32,33
INPC + 4%	0,53	0,53	2,96	4,14	8,49	16,82	23,71
INPC + 6%	0,70	0,70	3,46	5,16	10,59	21,35	30,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
02/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	6.003,42	0,00	2.885,76839100	2,0803540640
02/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	9.923,24	0,00	4.769,97650100	2,0803540640
06/01/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	10.972,50	547,59664825	20,0375587308
06/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	5.620,10	0,00	2.700,80517600	2,0808979670
07/01/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	36.000,00	1.796,38895657	20,0402033582
07/01/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	96,33	11,91651838	8,0837369537
07/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	2.093,70	0,00	1.006,02825500	2,0811542710
08/01/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	136.038,01	6.786,91181964	20,0441693682
08/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	874,08	0,00	419,94314900	2,0814245960
08/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	6.406,23	0,00	3.077,81027100	2,0814245960
09/01/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	20.336,60	1.014,38574123	20,0481918993
09/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	963,78	0,00	462,97798200	2,0816972630
10/01/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	885,50	44,16015263	20,0520140281
10/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	880.622,88	0,00	510.674,73384343	1,7244300954
10/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	782,82	0,00	376,00122500	2,0819613020
13/01/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	105.507,88	5.260,96691015	20,0548457730
13/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	4.355,67	0,00	2.091,82167600	2,0822377210
13/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	2.304,30	0,00	1.106,64597800	2,0822377210
13/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	810.000,00	0,00	320.758,16141400	2,5252670000
14/01/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	9.639,14	480,57869047	20,0573604099
14/01/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	7.667.081,31	0,00	382.257,74246025	20,0573604099
14/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	1.424.983,71	0,00	826.089,70162588	1,7249745484
14/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	5.701.998,42	3.305.555,10241521	1,7249745484
14/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	4.390,41	0,00	2.108,25501100	2,0824852670
14/01/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	40.000.000,00	17.768.589,63218200	2,2511634760
14/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	1.960.944,04	1.136.795,92653635	1,7249745484
14/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	22.196,88	0,00	10.658,84131400	2,0824852670
15/01/2020	33-BRB TESOIRO	0,00	4.379,84	1.117,24648000	3,9202089320

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
15/01/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	34.679,91	1.728,80655673	20,0600291947
15/01/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	883,39	109,24408657	8,0863873530
15/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	40.000.000,00	0,00	23.185.094,52206276	1,7252463630
15/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	782,82	0,00	375,85800000	2,0827546540
15/01/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	268,38	33,18911008	8,0863873530
15/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	4.065,39	0,00	1.951,92937900	2,0827546540
16/01/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	132.095,68	6.583,77032471	20,0638347763
16/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	1.899.140,48	0,00	1.100.557,15579217	1,7256173112
16/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	4.150.007,49	2.404.940,80745240	1,7256173112
16/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	770.714,24	446.631,03168804	1,7256173112
16/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	189.392,69	90.920,85525900	2,0830500270
16/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	4.557,41	2.641,03168786	1,7256173112
16/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	2.009.101,71	0,00	1.164.279,99241782	1,7256173112
16/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	7.126,21	0,00	3.421,04601700	2,0830500270
17/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	1.360.351,47	0,00	788.207,87955809	1,7258790546
17/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	25.575,84	0,00	12.276,45546400	2,0833244640
17/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	22.613,07	0,00	10.854,31980900	2,0833244640
17/01/2020	BB PREVID RF IRF-M1	0,00	150.000.000,00	56.811.771,81483100	2,6402978680
17/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,00	50.000.000,00	19.781.493,62405400	2,5276150000
20/01/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	85.682,48	4.269,20033756	20,0699131512
20/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	1.543.637,14	0,00	894.226,77803745	1,7262255816
20/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	7.730,19	4.478,08796394	1,7262255816
20/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	6.108,15	0,00	2.931,54196300	2,0835963040
20/01/2020	BB ACOES DIVIDENDOS FICFI	75.000.000,00	0,00	3.602.673,18177100	20,8178750100
20/01/2020	BB PREV ACOES GV	75.000.000,00	0,00	23.609.840,00498200	3,1766416030
20/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	2.343,33	0,00	1.124,65643921	2,0835963040
20/01/2020	FI ACOES CAIXA BRASIL IBX-50	25.000.000,00	0,00	16.392.905,15065000	1,5250500000
20/01/2020	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT	25.000.000,00	0,00	11.657.430,09622000	2,1445550000
21/01/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	5.046,30	251,40646523	20,0722761659
21/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	15.123,91	8.760,01511724	1,7264707649

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
21/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	4.645,25	0,00	2.229,15378100	2,0838625130
22/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	16.913.006,78	0,00	9.794.418,62838431	1,7268004791
22/01/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	67.180,24	29.813,36528600	2,2533598390
22/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	75.716,89	43.848,08257609	1,7268004791
22/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	703.147,92	0,00	407.196,96832982	1,7268004791
22/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	3.514,76	0,00	1.686,43726900	2,0841332580
23/01/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	4.345.194,16	216.403,32902080	20,0791465624
23/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	1.112.082,40	643.883,62762630	1,7271481247
23/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	55.519,87	32.145,40372783	1,7271481247
23/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	882.010,91	510.674,73384343	1,7271481247
23/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	1.426.779,27	826.089,69541222	1,7271481268
23/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	10.928.685,69	6.327.590,27463863	1,7271481268
23/01/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	503.113,86	223.254,83329500	2,2535407300
23/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	18.305,79	10.598,85357578	1,7271481268
23/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	4.423.806,50	0,00	2.561.335,89896327	1,7271481268
23/01/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.544,74	1.572,96469200	2,2535407300
24/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	1.031.052,17	0,00	596.861,54872825	1,7274561784
24/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	419.478,75	0,00	242.830,32776468	1,7274561784
27/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	7.388.792,36	4.276.495,10487948	1,7277682258
27/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	2.356,75	0,00	1.130,36445900	2,0849470100
27/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	19.360,95	11.205,75648452	1,7277682258
27/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,00	100.000.000,00	39.508.498,47556458	2,5311010000
28/01/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	668.635,61	33.283,74744061	20,0889521588
28/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	166.885.246,81	0,00	96.570.371,72179613	1,7281205802
28/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	1.189,20	688,14642544	1,7281205802
28/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	635,69	0,00	304,85480500	2,0852221760
28/01/2020	FI ACOES CAIXA BRASIL IBX-50	50.000.000,00	0,00	33.446.941,44443900	1,4949050000
28/01/2020	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT	50.000.000,00	0,00	23.743.934,01845600	2,1058010000
29/01/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	524.171,88	26.087,68298625	20,0926958625
29/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	15.123,91	8.749,80100991	1,7284861659

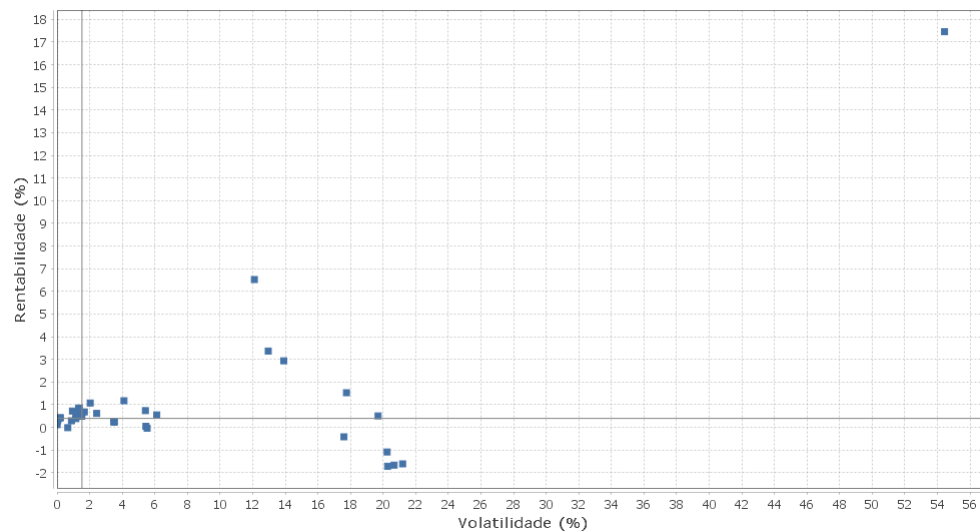
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
29/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	249,64	0,00	119,70305400	2,0854939790
30/01/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	631.800,74	31.439,56193195	20,0957233872
30/01/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	125.188,43	6.229,60556369	20,0957233872
30/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	21.733.598,35	12.571.571,16067141	1,7287893512
30/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	1.902.631,49	1.100.557,15579217	1,7287893512
30/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	1.362.645,39	788.207,87955810	1,7287893512
30/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	1.545.929,73	894.226,77803746	1,7287893512
30/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	16.932.486,62	9.794.418,62838431	1,7287893512
30/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	1.031.847,89	596.861,54872825	1,7287893512
30/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	130.206.644,87	75.316.662,95095563	1,7287893512
30/01/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.866.365,56	1.270.921,81297200	2,2553437440
30/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	1.003.411,41	580.412,76510323	1,7287893512
30/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	142.698,20	82.542,27064793	1,7287893512
30/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	1.991.526,77	1.151.977,69641596	1,7287893512
30/01/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	3.166.331,51	1.831.531,12782961	1,7287893512
30/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.471,02	0,00	705,26938900	2,0857561970
30/01/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	84.553,90	37.490,47134200	2,2553437440
30/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,00	100.000.000,00	39.496.748,23068600	2,5318540000
31/01/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	116.643,67	5.804,11147903	20,0967315017
31/01/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.566,36	0,00	750,88549800	2,0860171140
31/01/2020	FI ACOES CAIXA BRASIL IBX-50	50.000.000,00	0,00	34.303.269,71906300	1,4575870000
31/01/2020	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT	50.000.000,00	0,00	24.754.619,83092500	2,0198250000

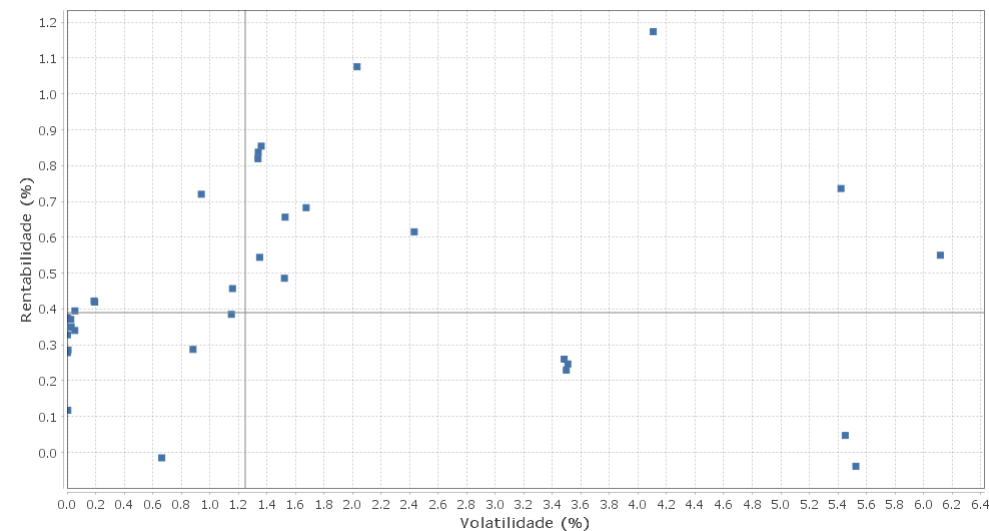
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

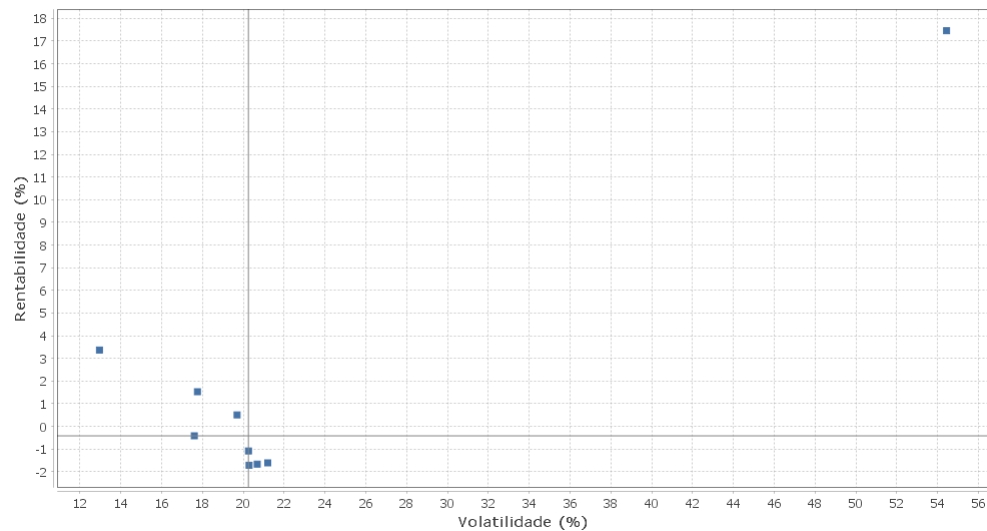
IPAJM CONS - No Mês



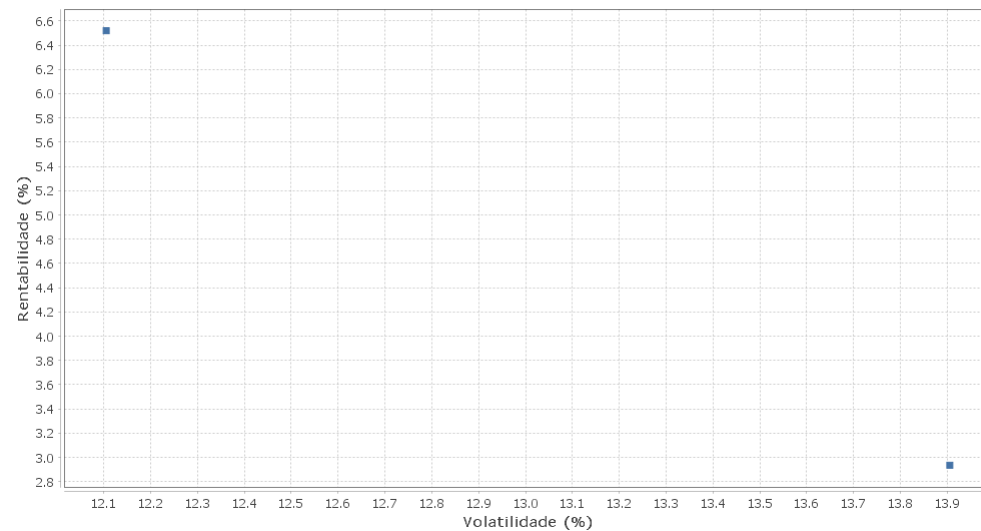
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LFT 010921	Artigo 7º I, Alínea a	0,00	0,02	0,38	232.417.316,32	4,98
35-BRB MILLENIUM	Artigo 7º I, Alínea b	0,00	0,02	0,33	1.250.187,96	0,03
33-BRB TESOIRO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,01	0,28	5.564,01	0,00
Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,01	0,12	10.529.889,24	0,23
LFT 010324	Artigo 7º I, Alínea a	0,01	0,02	0,37	110.271.333,43	2,36
BB PREVID RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,01	0,29	273.281,49	0,01
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	0,37	63.313.731,46	1,36
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	0,35	324.169.830,31	6,95
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,02	0,34	22.028.110,85	0,47
Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,02	0,39	137.103.590,70	2,94
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,19	0,04	0,42	158.903.773,18	3,41
BB PREVID RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	0,19	0,04	0,42	381.886.581,99	8,18
NTN-B 150820	Artigo 7º I, Alínea a	0,66	0,07	-0,02	34.690.772,65	0,74
NTN-B 150521	Artigo 7º I, Alínea a	0,88	0,10	0,29	319.060.072,53	6,84
Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1	Artigo 7º I, Alínea b	0,94	0,13	0,72	15.691.531,52	0,34
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,15	0,14	0,38	28.504.321,39	0,61
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,16	0,14	0,46	31.828.694,82	0,68
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,34	0,18	0,82	668.992.798,74	14,34
FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,34	0,18	0,84	35.383.047,69	0,76
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	1,35	0,16	0,54	33.427.969,56	0,72
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	1,36	0,18	0,85	48.068.066,64	1,03
BB PREV ALOC FIC	Artigo 7º I, Alínea b	1,52	0,18	0,49	648.415.995,59	13,90
NTN-B 150822	Artigo 7º I, Alínea a	1,53	0,19	0,66	410.965.691,07	8,81
NTN-B 150523	Artigo 7º I, Alínea a	1,67	0,20	0,68	75.272.159,72	1,61
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,03	0,26	1,08	19.996.207,50	0,43
BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	2,43	0,28	0,62	7.270.588,84	0,16
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	3,48	0,37	0,26	13.735.386,33	0,29
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP	Artigo 7º III, Alínea a	3,50	0,37	0,23	2.049.397,58	0,04
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	3,51	0,37	0,25	13.899.622,09	0,30
NTN-B 150830	Artigo 7º I, Alínea a	4,11	0,48	1,17	118.916.346,78	2,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	Artigo 7º IV, Alínea a	5,42	0,60	0,74	34.453.178,11	0,74
BB PREV IMA-B5+	Artigo 7º I, Alínea b	5,45	0,57	0,05	7.741.675,38	0,17
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,53	0,57	-0,04	11.054.681,88	0,24
BANESTES PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	6,12	0,66	0,55	36.671.372,77	0,79
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	Artigo 9º A, III	12,11	1,54	6,52	28.627.760,02	0,61
Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	Artigo 8º II, Alínea a	12,95	1,49	3,36	5.714.767,02	0,12
BB Acoes Globais BDR Nivel I	Artigo 9º A, III	13,91	1,57	2,94	6.464.944,48	0,14
BB ACOES DIVIDENDOS FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	17,60	1,80	-0,42	89.352.770,85	1,91
FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	17,75	1,91	1,53	34.688.297,37	0,74
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT	Artigo 8º II, Alínea a	19,70	2,06	0,50	150.498.450,69	3,23
BB PREV ACOES GV	Artigo 8º I, Alínea a	20,25	2,05	-1,09	83.907.186,11	1,80
FI ACOES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	20,28	2,02	-1,71	10.462.199,52	0,22
FI ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	20,68	2,07	-1,67	11.798.675,19	0,25
FI ACOES CAIXA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	21,20	2,12	-1,61	147.708.653,91	3,17
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	Artigo 8º IV, Alínea b	54,44	6,37	17,45	35.000.000,00	0,75