



IPAJM CONS
FEVEREIRO 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 **83,29%**

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	0,80	0,26	0,25	33.806.040,97	0,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830	5,11	0,65	1,83	116.978.861,66	2,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822	2,29	0,74	1,40	403.260.452,87	8,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	2,75	0,79	1,47	75.863.549,84	1,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150521	1,31	0,47	0,75	320.545.888,56	6,90
TESOURO NACIONAL	LFT 010324	0,05	0,27	0,65	110.571.714,69	2,38
TESOURO NACIONAL	LFT 010921	0,05	0,29	0,66	233.080.530,71	5,01
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		1,53	0,54	1,06	1.294.107.039,30	27,84

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	2,05	0,63	1,49	48.372.236,51	1,04	5.100.791.923,15	0,95
BRB	BRB	35-BRB MILLENIUM	0,08	0,24	0,57	1.253.155,20	0,03	70.874.553,36	1,77
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B	7,95	0,08	0,63	36.699.440,20	0,79	297.383.588,49	12,34
BB	BB	BB PREVID RF IRF-M1	0,26	0,35	0,77	283.154.378,01	6,09	7.492.585.716,79	3,78
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	4,90	0,44	0,70	13.795.390,85	0,30	6.284.654.664,10	0,22
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	4,91	0,44	0,69	13.960.630,59	0,30	6.609.422.706,56	0,21
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,25	0,36	0,79	39.543.521,44	0,85	10.513.960.188,40	0,38
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	1,98	0,63	1,18	33.638.412,52	0,72	9.698.235.388,71	0,35
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	1,50	0,63	1,02	28.683.376,66	0,62	6.830.764.502,36	0,42

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+	7,26	0,30	0,35	7.764.825,45	0,17	2.259.425.476,17	0,34
CEF	CEF	FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	7,29	0,29	0,25	11.086.894,67	0,24	2.293.876.669,47	0,48
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	2,93	0,78	1,86	20.151.763,54	0,43	2.655.596.398,85	0,76
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	1,51	0,60	1,06	32.020.130,39	0,69	8.419.154.798,69	0,38
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	2,09	0,63	1,48	35.606.821,63	0,77	15.973.064.296,15	0,22
BANESTES	BANESTES	Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1	1,36	0,71	1,44	15.803.229,92	0,34	202.735.948,95	7,79
BB	BB	BB PREV ALOC FIC	2,33	0,46	0,94	651.372.719,28	14,01	10.908.803.618,87	5,97
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	3,44	0,62	1,44	673.121.134,68	14,48	10.626.779.468,55	6,33
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,79	0,47	1,05	1.946.028.061,54	41,87		

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	0,44	0,67	2.058.320,33	0,04	3.035.883.583,88	0,07
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			4,88	0,44	0,67	2.058.320,33	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	0,37	0,25	0,59	24.614.166,59	0,53	520.194.517,94	4,73
BRB	BRB	33-BRB TESOIRO	0,08	0,20	0,47	26.212,55	0,00	223.344.331,53	0,01
BANESTES	BANESTES	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,05	0,08	0,20	10.538.569,75	0,23	571.609.197,48	1,84
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,27	0,65	63.487.134,29	1,37	5.421.482.050,58	1,17
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	7,55	0,20	0,93	34.520.556,56	0,74	329.955.502,48	10,46
BB	BB	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,27	0,62	321.556.132,24	6,92	2.774.667.818,45	11,59
BB	BB	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,05	0,22	0,50	393.974,67	0,01	1.376.949.540,95	0,03
BANESTES	BANESTES	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,10	0,29	0,69	166.743.412,75	3,59	2.995.405.175,98	5,57
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF	2,60	0,42	1,04	7.301.399,17	0,16	238.856.359,80	3,06
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,51	0,31	0,68	629.181.558,57	13,54		

Renda Fixa			1,45	0,48	1,01	3.871.374.979,74	83,29		
-------------------	--	--	-------------	-------------	-------------	-------------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

14,97%

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	19,49	-8,68	-10,15	152.730.495,69	3,29	1.204.220.398,60	12,68
BB	BB	BB PREV ACOES GV	19,01	-7,77	-8,77	104.252.918,54	2,24	843.490.895,06	12,36
CEF	CEF	FI ACOES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	18,73	-8,44	-10,00	9.579.710,47	0,21	117.475.605,30	8,15
CEF	CEF	FI ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	19,17	-8,30	-9,83	55.610.311,61	1,20	613.653.165,94	9,06
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			19,10	-8,31	-9,74	322.173.436,31	6,93		

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	17,97	-8,73	-9,11	139.689.820,87	3,01	1.122.348.597,47	12,45
VINCI	CEF	FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,49	-6,37	-4,94	32.479.227,79	0,70	909.648.393,83	3,57
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT	19,36	-8,60	-8,14	162.556.399,83	3,50	1.542.999.030,98	10,54
BANESTES	BANESTES	Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	17,86	-8,31	-5,23	5.239.660,36	0,11	151.383.918,69	3,46
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			18,04	-8,29	-7,85	339.965.108,85	7,31		

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	16,07	-0,09	4,76	3.997.427,54	0,09	142.989.968,61	2,80
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			16,07	-0,09	4,76	3.997.427,54	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	29,20	-15,36	-1,07	29.480.000,00	0,63	176.343.450,14	16,72
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			29,20	-15,36	2,11	29.480.000,00	0,63		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			16,37	-8,65	-7,89	695.615.972,70	14,97		
---	--	--	-------	-------	-------	----------------	-------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,74%

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	16,34	-5,69	0,46	64.815.803,48	1,39	866.229.995,42	7,48
BB	BB	BB Acoes Globais BDR Nivel I	16,25	-4,48	-1,68	16.174.992,10	0,35	147.380.154,47	10,98
Sub-total Artigo 9º A, III			16,23	-5,50	0,02	80.990.795,58	1,74		
Investimentos no Exterior			16,23	-5,50	0,02	80.990.795,58	1,74		
Total						4.647.981.748,02	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	1.294.107.039,30	27,84	20,00	27,00	60,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	1.946.028.061,54	41,87	15,00	36,30	60,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	2.058.320,33	0,04	0,00	0,10	2,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	629.181.558,57	13,54	5,00	10,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	3.871.374.979,74	83,29				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	322.173.436,31	6,93	0,00	6,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	339.965.108,85	7,31	0,00	5,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	3.997.427,54	0,09	0,00	0,10	2,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	29.480.000,00	0,63	0,00	0,50	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	695.615.972,70	14,97				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	80.990.795,58	1,74	0,00	4,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	80.990.795,58	1,74				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

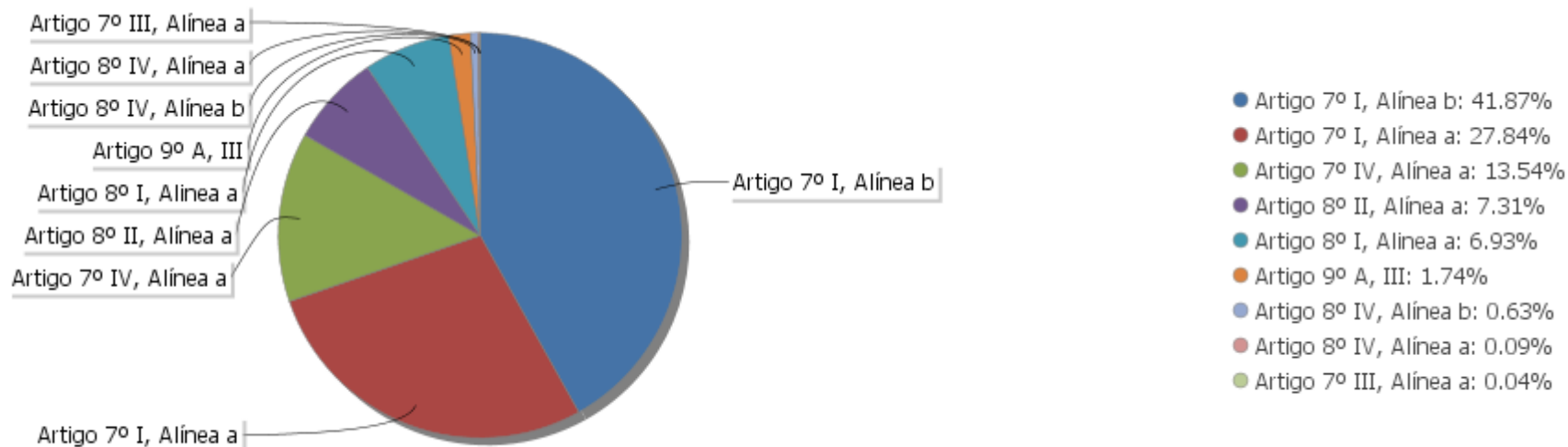
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,54 182,23	1,06 157,87	2,00 190,56	4,67 195,34	10,73 192,44	6.960.523,83	13.719.096,20
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,47 161,48	1,05 155,82	1,75 166,50	4,23 176,85	10,68 191,56	10.406.146,51	24.257.843,59
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,44 148,23	0,67 99,17	2,67 254,69	6,36 266,11	17,53 314,53	8.922,75	13.614,81
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,31 104,51	0,68 101,81	1,23 116,95	2,66 111,42	6,56 117,76	1.761.563,71	4.179.076,13
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-8,31 0,12	-9,74 0,18	-3,35 0,40	3,05 0,05	9,25 0,27	-31.703.278,42	-38.148.440,19
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-8,29 0,14	-7,85 2,07	1,08 4,83	7,29 4,28	19,92 10,93	-25.289.177,08	-30.774.471,70
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,09 8,34	4,76 14,68	4,66 8,42	-7,32 -10,32	-5,11 -14,09	-3.556,18	181.736,40
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-15,36 -6,93	2,11 12,03	13,93 17,69	43,56 40,55	58,74 49,75	-5.350.000,00	660.200,00
Artigo 9º A, III % do CDI	-5,50 -1.871,77	0,02 3,14	-1,79 -170,81	8,48 354,43	25,55 458,38	-3.549.083,87	-1.612.736,00
						-46.757.938,75	-27.524.080,76

Análise de Liquidez

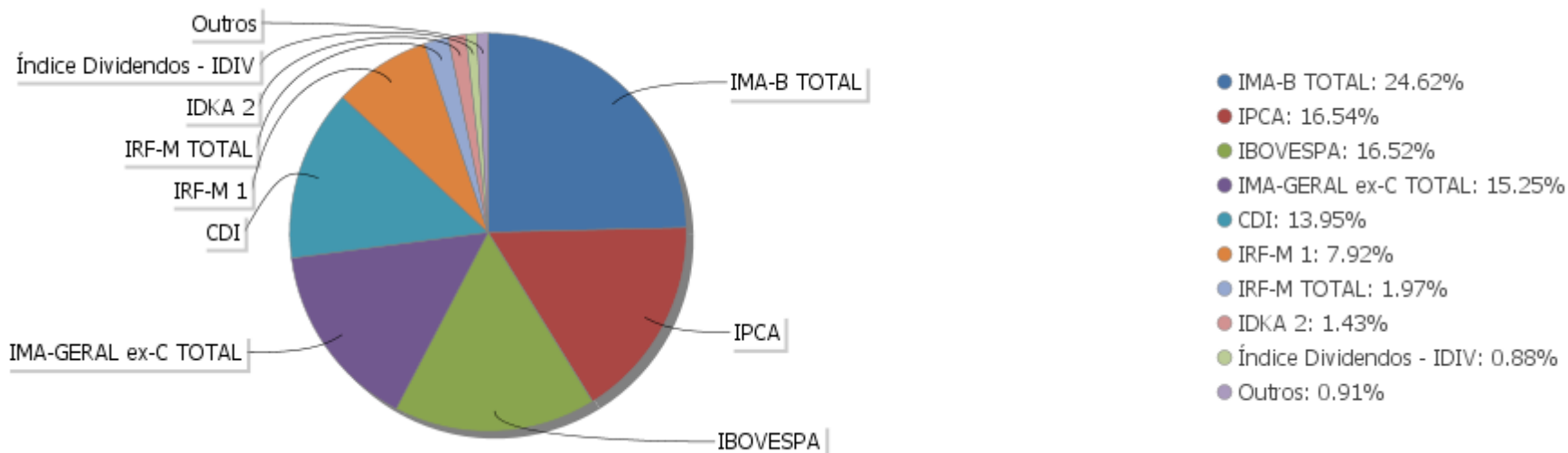
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	3.316.155.820,57	71,35	3.316.155.820,57	71,35
de 31 a 364 dias	71.524.929,12	1,54	3.387.680.749,69	72,88
acima de 365 dias	1.260.300.998,33	27,12	4.647.981.748,02	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

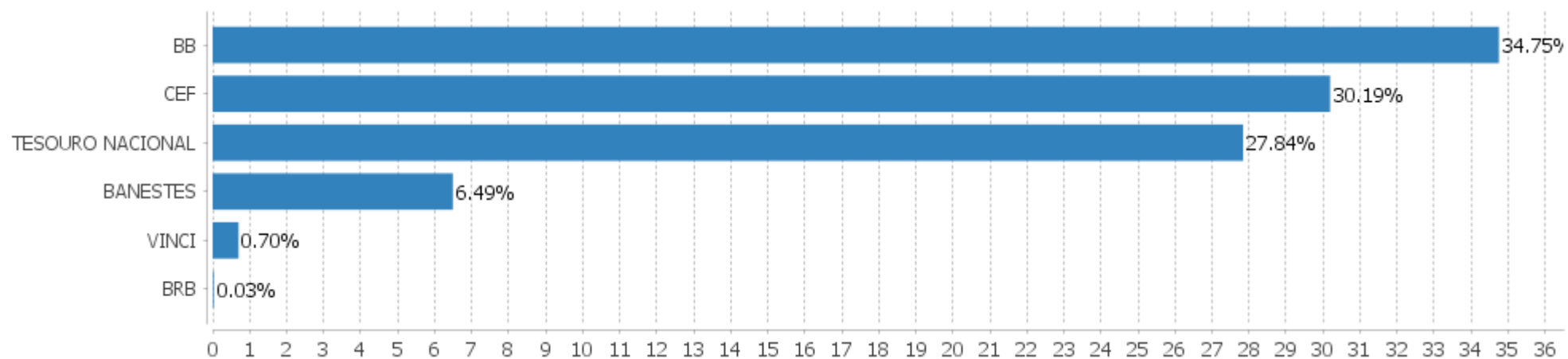


Alocação Por Estratégia



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											-0,51
IPCA + 5%	0,64	0,60											1,24
p.p. indexador	-0,22	-1,52											-1,75
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

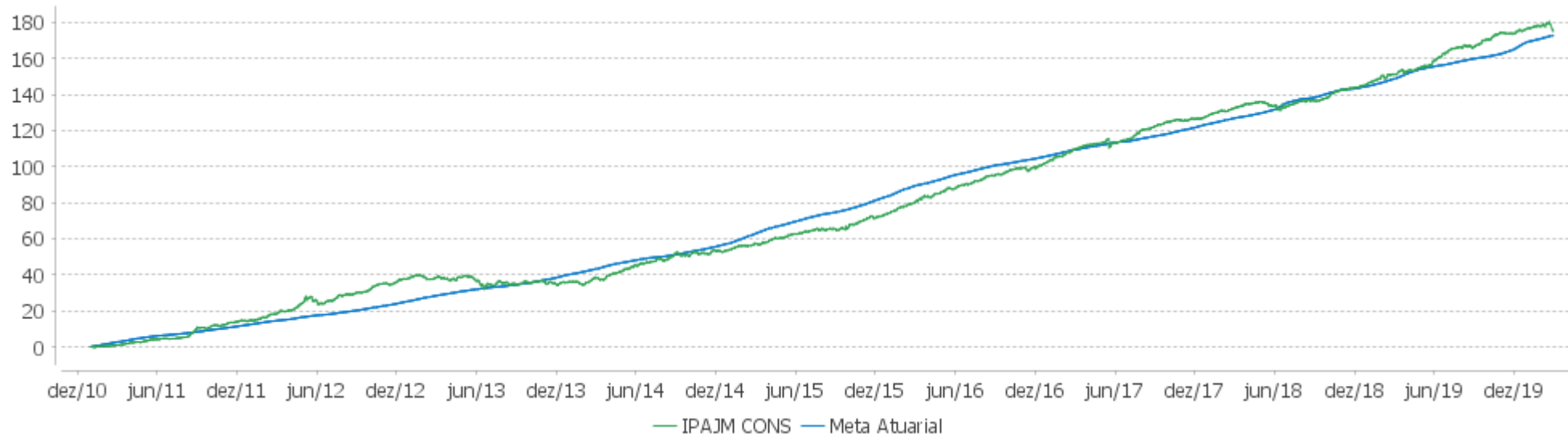
RELATÓRIO TRIMESTRAL

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

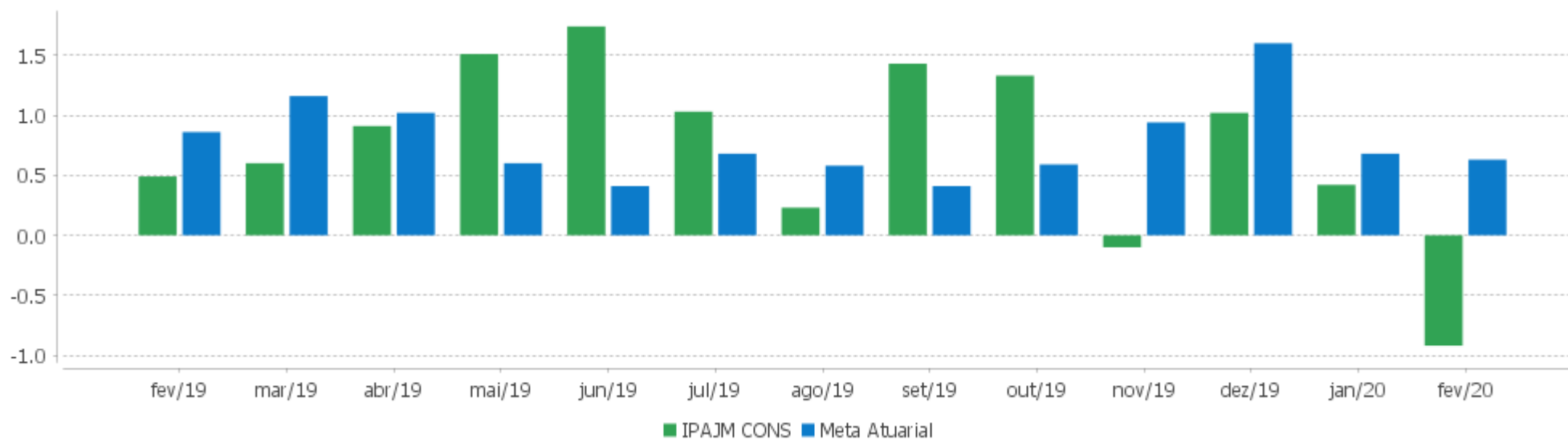
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	57	51,82	03 meses	0,50	2,86	-2,36	3,04
Meses abaixo da Meta Atuarial	53	48,18	06 meses	3,20	4,87	-1,67	2,38
			12 meses	9,56	9,62	-0,06	2,29
			24 meses	18,45	20,38	-1,93	2,26
			36 meses	31,42	31,10	0,32	2,44
			Desde 31/12/2010	175,14	182,27	-7,14	2,88
	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
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP % do CDI	0,25 83,47	0,59 87,29	0,94 89,32	1,90 79,60	5,33 95,53	11,90 96,42	21,90 97,82
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,20 -0,25	0,93 0,22	3,33 0,60	7,69 1,14	22,29 4,29	37,68 3,03	51,75 2,48
Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI % do CDI	0,29 100,18	0,69 102,80	1,09 104,36	2,22 92,94	5,62 100,90	12,94 104,90	23,83 106,41
BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF % do CDI	0,42 144,27	1,04 155,12	2,19 209,01	6,79 283,69	16,16 289,87		
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,27 92,98	0,62 92,92	0,98 93,45	2,23 93,12	5,33 95,61	11,98 97,04	22,11 98,72
Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto % do CDI	0,08 28,07	0,20 29,79	0,33 31,42	0,90 37,81	2,51 45,07	5,90 47,83	12,09 53,97
BB PREVID RF FLUXO FIC % do CDI	0,22 73,69	0,50 74,86	0,79 75,23	1,85 77,44	4,45 79,85	9,95 80,64	18,58 82,98
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,27 93,24	0,65 96,16	1,00 95,34	2,22 92,84	5,33 95,61	11,90 96,39	21,87 97,66
33-BRB TESOURO % do CDI	0,20 66,86	0,47 70,73	0,76 72,48	1,84 76,86	4,54 81,43	10,12 82,00	18,69 83,45
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,44 -0,01	0,69 -0,03	2,69 -0,04	6,35 -0,19	17,63 -0,37	34,00 -0,65	48,25 -1,02
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	0,63 -0,01	1,18 -0,03	2,40 -0,05	5,51 -0,15	11,87 -0,29	22,95 -0,54	37,12 -0,84
BB PREVID RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,35 -0,03	0,77 -0,05	1,17 -0,07	2,72 -0,15	6,24 -0,28	13,31 -0,55	24,21 -0,86
FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,63 -0,02	1,48 -0,06	2,09 -0,07	4,79 -0,12	11,51 -0,35	22,34 -0,65	37,98 -1,08
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	0,29 -0,03	0,25 -0,10	2,82 -0,15	6,92 -0,32	21,46 -0,58	41,77 -1,29	56,76 -1,73
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	0,78 -0,02	1,86 -0,06	2,58 -0,08	5,89 -0,11	13,88 -0,34	26,38 -0,68	43,90 -1,22
BANESTES PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,08 -0,37	0,63 -0,09	3,21 0,48	8,70 2,15	23,37 5,36	41,76 7,10	56,38 7,11
Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1	0,71	1,44	1,89	3,96	10,48	19,23	31,51

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.	0,33	0,61	0,64	1,09	3,96	5,38	6,45
BB PREV RF IDKA2	0,63	1,02	2,18	5,12	10,31	20,84	34,64
Var. IDKA 2 p.p.	-0,06	-0,21	-0,26	-0,25	-0,88	-1,68	-3,12
BB PREV ALOC FIC	0,46	0,94	1,91	4,31	11,46	22,39	35,25
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,01	-0,00	0,05	-0,05	0,39	0,50	-0,19
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	0,62	1,44	2,04	5,45	14,23	25,27	37,87
Var. IPCA p.p.	0,37	0,98	0,43	3,26	10,23	17,21	26,74
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	0,60	1,06	2,17	4,96	10,35	20,98	34,79
Var. IDKA 2 p.p.	-0,08	-0,16	-0,27	-0,41	-0,84	-1,54	-2,98
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,36	0,79	1,19	2,77	6,31	13,44	24,42
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,04	-0,05	-0,11	-0,21	-0,41	-0,64
BB PREV IMAB TPB	0,44	0,70	2,69	6,44	17,76	33,99	48,16
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,01	-0,05	-0,10	-0,24	-0,66	-1,11
BB PREV RF IRF-M	0,63	1,49	2,11	4,80	11,62	22,46	38,10
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,02	-0,04	-0,06	-0,11	-0,24	-0,52	-0,96
35-BRB MILLENIUM	0,24	0,57	0,91	2,19	5,18	11,40	20,72
% do CDI	80,80	84,32	86,86	91,60	92,85	92,41	92,54
BB PREV IMA-B5+	0,30	0,35	3,08	7,29	21,88	42,45	57,12
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,02	-0,01	0,11	0,06	-0,16	-0,62	-1,37
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP	0,44	0,67	2,67	6,36	17,53	33,98	47,95
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,05	-0,06	-0,18	-0,47	-0,67	-1,32
NTN-B 150820	0,26	0,25	1,05	3,46	7,42	17,33	31,61
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,18	-0,46	-1,68	-3,08	-10,58	-17,32	-17,65
LFT 010921	0,29	0,66	1,04	2,39	5,58	12,36	22,72
NTN-B 150822	0,74	1,40	2,62	5,85	13,18	25,48	41,41
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,29	0,69	-0,11	-0,69	-4,82	-9,17	-7,86
LFT 010324	0,27	0,65	1,03	2,38	5,58	12,31	
NTN-B 150523	0,79	1,47	2,97	6,46	14,78	27,71	43,37
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,34	0,76	0,23	-0,09	-3,22	-6,94	-5,89
NTN-B 150521	0,47	0,75	1,76	4,54	9,86	20,83	36,06
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,02	0,04	-0,97	-2,00	-8,14	-13,82	-13,21
NTN-B 150830	0,65	1,83	2,97	6,83	18,96	36,68	50,73
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,20	1,12	0,24	0,28	0,96	2,03	1,46
Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	-8,31	-5,23	1,58	5,50	24,87	47,72	86,40
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-2,14	2,43	0,02	-2,02	3,23	5,41	18,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT Var. IBOVESPA p.p.	-8,60 -0,17	-8,14 1,78	3,39 7,14	12,78 9,78	32,42 23,44	43,20 21,15	89,76 33,49
FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-6,37 -0,19	-4,94 2,72	3,17 1,61	8,42 0,89	19,87 -1,76	41,01 -1,30	75,29 7,68
BB ACOES DIVIDENDOS FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-8,73 -0,30	-9,11 0,81	-1,64 2,12	1,17 -1,84	10,05 1,07	23,89 1,84	46,59 -9,68
FI ACOES CAIXA BRASIL IBX-50 Var. IBOVESPA p.p.	-8,68 -0,25	-10,15 -0,23	-3,79 -0,04	2,67 -0,33	7,32 -1,66	15,99 -6,06	51,26 -5,00
FI ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-8,30 0,13	-9,83 0,09	-3,66 0,09	3,01 0,00	8,77 -0,21	21,22 -0,83	54,13 -2,14
FI ACOES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-8,44 -0,01	-10,00 -0,08	-3,94 -0,18	2,67 -0,33	8,29 -0,70	20,64 -1,41	53,09 -3,18
BB PREV ACOES GV Var. IBOVESPA p.p.	-7,77 0,66	-8,77 1,15	-1,87 1,88	4,96 1,96	12,66 3,68	28,85 6,81	61,57 5,30
FIP CAIXA CYRELA Var. IPCA p.p.	-0,09 -0,34	4,76 4,30	4,66 3,05	-7,14 -9,33	-5,02 -9,03	18,50 10,45	32,79 21,67
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII Var. IPCA p.p.	-15,77 -16,02	-1,07 -1,53	8,78 7,17	34,37 32,17	42,66 38,66	34,67 26,62	30,62 19,49
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-5,69 2,74	0,46 10,38	-1,30 2,45	8,85 5,84	26,84 17,86	48,66 26,61	81,60 25,33
BB Acoes Globais BDR Nivel I Var. IBOVESPA p.p.	-4,48 3,94	-1,68 8,24	-3,68 0,07	7,47 4,47	19,26 10,27	38,40 16,36	63,36 7,09
CDI	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,34	22,39
IBOVESPA	-8,43	-9,92	-3,75	3,00	8,98	22,05	56,27
INPC + 6%	0,59	1,29	3,03	5,12	10,13	21,34	30,86
IPCA + 6%	0,67	1,39	3,06	5,19	10,22	21,38	32,23

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	0,38	0,82	1,25	2,87	6,52	13,85	25,06
IRF-M 1+	0,80	1,92	2,66	6,01	14,22	27,05	45,12
IRF-M TOTAL	0,65	1,53	2,17	4,91	11,86	22,99	39,06
IMA-B 5	0,64	1,20	2,45	5,66	12,17	23,49	37,96
IMA-B 5+	0,32	0,35	2,96	7,23	22,04	43,07	58,49
IMA-B TOTAL	0,45	0,71	2,73	6,54	18,00	34,65	49,27
IMA-C TOTAL	0,63	3,18	3,59	6,91	18,59	39,02	52,96
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,44	0,95	1,87	4,36	11,07	21,89	35,44
IMA-GERAL TOTAL	0,45	1,01	1,91	4,43	11,28	22,36	35,89
IDKA 2	0,69	1,22	2,44	5,37	11,19	22,52	37,76
IDKA 20	-0,09	-1,46	2,43	6,69	27,19	57,08	70,16
CDI	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,34	22,39
Renda Variável							
IBOVESPA	-8,43	-9,92	-3,75	3,00	8,98	22,05	56,27
IBRX 100	-8,22	-9,37	-2,78	3,55	11,15	25,47	60,69
IBRX 50	-8,66	-10,38	-4,50	2,05	6,61	18,16	52,61
SMALL CAP	-8,27	-7,86	3,80	13,95	35,70	51,63	99,83
IFIX	-3,69	-7,31	2,54	11,56	21,74	28,23	46,08
Índice Consumo - ICON	-10,00		0,78	4,44	34,77	34,01	67,27
Índice Dividendos - IDIV	-6,18	-7,66	1,56	7,52	21,63	42,31	67,61
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,25	0,46	1,62	2,20	4,00	8,05	11,13
INPC	0,17	0,36	1,58	2,12	3,92	8,02	9,97
IGPM	-0,04	0,44	2,54	3,54	6,84	14,98	14,49
SELIC	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,34	22,41
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,53	1,09	2,59	4,20	8,15	16,85	24,92

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,60	1,24	2,82	4,70	9,18	19,10	28,54
IPCA + 5,5%	0,63	1,32	2,94	4,95	9,70	20,24	30,38
IPCA + 5,89%	0,66	1,38	3,03	5,14	10,11	21,13	31,82
IPCA + 6%	0,67	1,39	3,06	5,19	10,22	21,38	32,23
INPC + 4%	0,45	0,99	2,55	4,13	8,06	16,81	23,63
INPC + 6%	0,59	1,29	3,03	5,12	10,13	21,34	30,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
03/02/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	324.975,30	16.168,19769000	20,0996614600
03/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	4.545,93	0,00	2.178,91703600	2,0863250000
03/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	3.157,50	0,00	1.513,42641500	2,0863250000
04/02/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	62.885,99	3.128,42624400	20,1014775800
04/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	23.788.583,10	13.755.318,01151830	1,7294098966
04/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	248.825,18	143.878,66085951	1,7294099000
04/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	3.392,25	0,00	1.625,73029300	2,0866000000
05/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	30.396,30	17.572,62986600	1,7297524700
05/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	19.187.717,02	0,00	11.092.753,03810100	1,7297524748
05/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	25.128.360,31	0,00	14.527.142,27965200	1,7297524748
05/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	2.125,88	0,00	1.018,69126100	2,0868730000
05/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	232,36	0,00	111,34358500	2,0868730000
06/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	2.985,60	0,00	1.430,47173900	2,0871430000
06/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	830,52	0,00	397,92182100	2,0871430000
07/02/2020	33-BRB TESOURO	0,00	3.229,51	822,05632200	3,9285751030
07/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	164.341,76	0,00	94.977,86546580	1,7303164200
07/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	437.005,84	0,00	252.558,33866740	1,7303164200
07/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	3.284,04	0,00	1.573,28519000	2,0873770000
10/02/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	66.388,76	3.300,93511600	20,1121069200
10/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	2.112,42	0,00	1.011,88039700	2,0876180000
10/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.429,95	0,00	684,96718100	2,0876180000
11/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	963.613,04	0,00	556.728,56580000	1,7308489300
11/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	6.382,41	0,00	3.056,89329200	2,0878740000
11/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	4.979,73	0,00	2.385,07134900	2,0878740000
12/02/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	54.350,52	2.701,52235400	20,1184787200
12/02/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	25.000,00	1.242,63868800	20,1184787200
12/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	1.293,85	747,38094600	1,7311787300
12/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	170.000,00	0,00	67.023,47000000	2,5364250000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
12/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	2.213,60	0,00	1.060,09087400	2,0881220000
12/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	7.759,11	0,00	3.715,83018700	2,0881220000
13/02/2020	33-BRB TESOIRO	25.000,00	0,00	6.360,75784100	3,9303492800
13/02/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	7.784,00	386,85062260	20,1214617400
13/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	3.382.721,99	0,00	1.953.657,89439140	1,7314812400
13/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	11.348,69	0,00	5.434,20951700	2,0883790000
13/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	9.794,83	0,00	4.690,15881200	2,0883790000
14/02/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	10.121,82	502,97899000	20,1237431400
14/02/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	7.600.000,00	0,00	377.663,33765380	20,1237431400
14/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	5.459.653,64	3.152.730,18308870	1,7317224500
14/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	2.110.254,59	1.218.587,07332270	1,7317224500
14/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.762,95	0,00	844,07328600	2,0886210000
14/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	2.325,46	0,00	1.113,39440300	2,0886210000
17/02/2020	33-BRB TESOIRO	0,00	1.150,04	292,53940689	3,9312310510
17/02/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	70.846,44	3.519,78348905	20,1280676000
17/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	12.297,26	0,00	5.887,04263300	2,0888680000
17/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	18.795,61	0,00	8.997,98470500	2,0888688540
18/02/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	74.796,28	3.715,64920923	20,1300703600
18/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	25.992.602,58	0,00	15.004.167,50573380	1,7323588643
18/02/2020	BB PREVID RF IRF-M1	0,00	50.000.000,00	18.861.875,97309200	2,6508497920
18/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,00	70.000.000,00	27.580.359,32255400	2,5380379995
18/02/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	14.447.174,95	0,00	3.761.186,17164464	3,8411220000
18/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	9.116,07	0,00	4.363,60213300	2,0891150000
18/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	11.581,83	0,00	5.543,89096300	2,0891157630
19/02/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	13.244,99	657,88717533	20,1326161900
19/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	1.886.247,56	0,00	1.088.665,79876425	1,7326231449
19/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	4.926.167,32	2.843.184,52890361	1,7326231449
19/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	170.620,35	75.485,61020700	2,2603029840
19/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	2.000.000,00	0,00	1.154.319,10619861	1,7326231400
19/02/2020	BB ACOES DIVIDENDOS FICFI	12.000.000,00	0,00	594.570,08186000	20,1826502310

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
19/02/2020	BB ACOES DIVIDENDOS FICFI	8.000.000,00	0,00	396.380,05457300	20,1826502310
19/02/2020	BB PREV ACOES GV	30.000.000,00	0,00	9.571.810,84553300	3,1342031810
19/02/2020	FI ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	50.000.000,00	0,00	18.928.008,45551900	2,6415880000
19/02/2020	FI ACOES CAIXA BRASIL IBX-50	20.000.000,00	0,00	13.409.679,10637800	1,4914600000
19/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	807,07	0,00	386,27426800	2,0893703410
20/02/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	3.058.968,14	151.920,38633776	20,1353367600
20/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	187.100.000,00	0,00	107.969.124,78321600	1,7329028125
20/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	22.642.902,18	13.066.458,20805580	1,7329028126
20/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	671.848,64	297.199,93140400	2,2605948690
20/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	5.390.000,00	0,00	3.110.387,93469555	1,7329028100
20/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	15.105,94	0,00	7.229,08956700	2,0896040000
20/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	7.343,33	0,00	3.514,21959100	2,0896047640
20/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	3.544,74	1.696,36864400	2,0896047640
21/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.544,46	0,00	739,04234600	2,0898120000
21/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	5.909,44	0,00	2.827,73681600	2,0898125900
26/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	32.705,59	0,00	15.648,21060200	2,0900530000
26/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	14.954,85	0,00	7.155,24906600	2,0900530310
27/02/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	1.290.505,32	64.070,35639899	20,1420031400
27/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.655.708,81	1.174.296,43593600	2,2615318660
27/02/2020	BB PREVID RF IRF-M1	0,00	50.000.000,00	18.844.865,03409200	2,6532426690
27/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,00	50.000.000,00	19.681.746,16365500	2,5404250000
27/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	6.142.952,07	3.543.440,87290910	1,7336121274
27/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	281.117,86	162.157,29778367	1,7336121300
27/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	3.386.885,02	1.953.657,89439138	1,7336121300
27/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	26.011.406,75	15.004.167,50573382	1,7336121274
27/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	1.887.324,23	1.088.665,79876426	1,7336121300
27/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	145.592.179,39	83.981.980,21858162	1,7336121274
27/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.402,20	0,00	670,81009700	2,0903084270
27/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	79.362,62	37.966,94256800	2,0903084270
28/02/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	13.356,01	662,96069483	20,1460058000

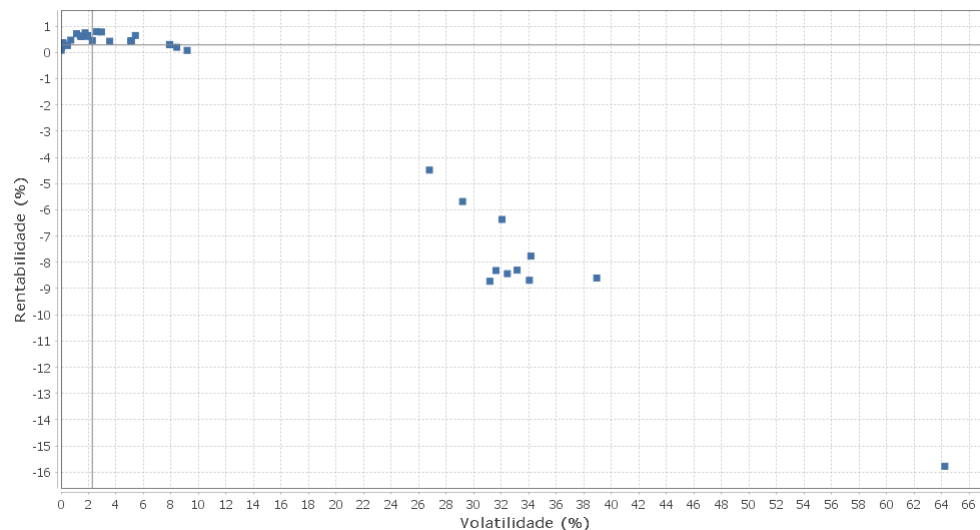
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
28/02/2020	BB ACOES DIVIDENDOS FICFI	40.000.000,00	0,00	2.185.876,07236300	18,2992990800
28/02/2020	BB Acoes Globais BDR Nivel I	10.000.000,00	0,00	7.069.692,95610100	1,4144885870
28/02/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	25.000.000,00	0,00	7.337.146,88880025	3,4073190000
28/02/2020	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT	25.000.000,00	0,00	13.541.834,24686500	1,8461310000
28/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	14.924,28	8.606,83207300	1,7340038600
28/02/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	4.688,78	2.704,01936223	1,7340038600
28/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	635,69	0,00	304,08044700	2,0905323110

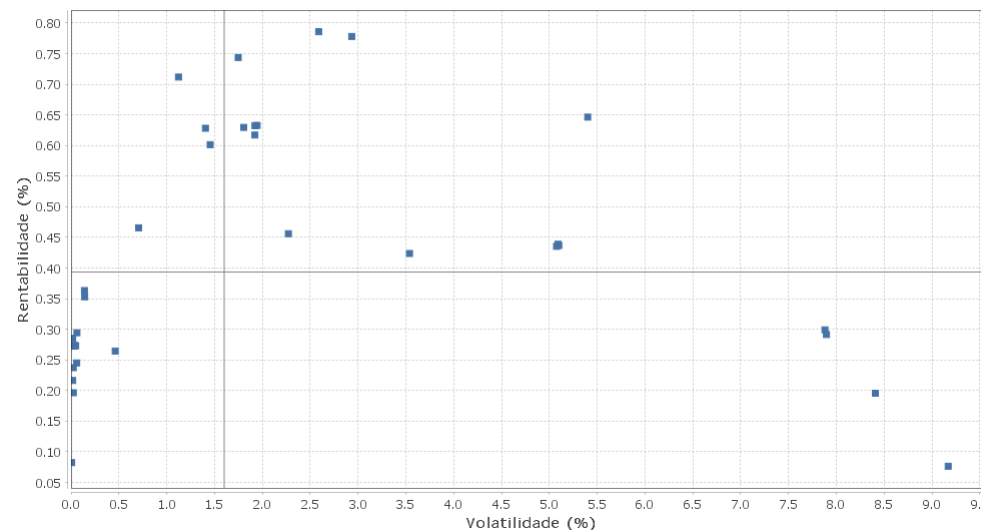
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

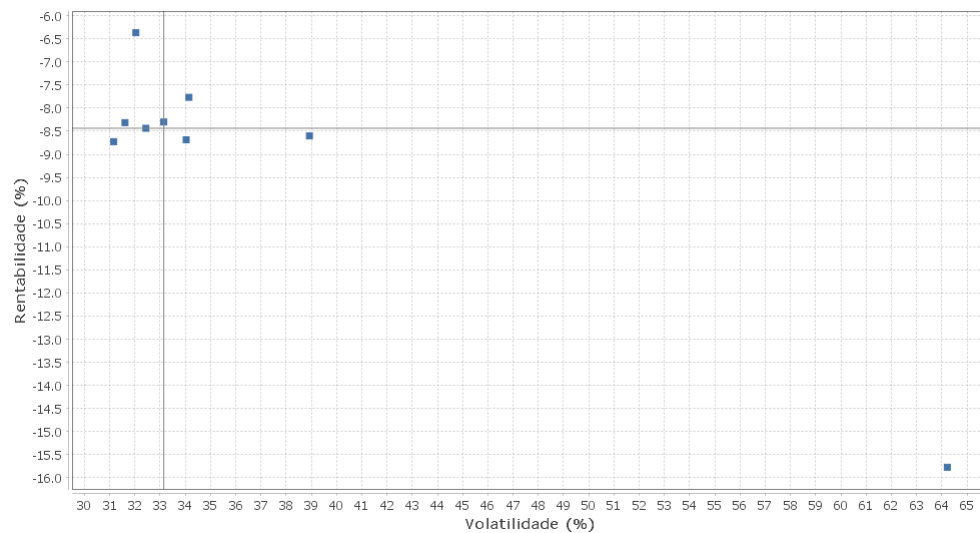
IPAJM CONS - No Mês



Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,01	0,08	10.538.569,75	0,23
LFT 010921	Artigo 7º I, Alínea a	0,02	0,02	0,29	233.080.530,71	5,01
BB PREVID RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,22	393.974,67	0,01
33-BRB TESOURO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,20	26.212,55	0,00
35-BRB MILLENIUM	Artigo 7º I, Alínea b	0,02	0,02	0,24	1.253.155,20	0,03
LFT 010324	Artigo 7º I, Alínea a	0,03	0,02	0,27	110.571.714,69	2,38
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	0,27	63.487.134,29	1,37
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,02	0,27	321.556.132,24	6,92
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,02	0,25	24.614.166,59	0,53
Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,02	0,29	166.743.412,75	3,59
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,14	0,03	0,36	39.543.521,44	0,85
BB PREVID RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	0,14	0,03	0,35	283.154.378,01	6,09
NTN-B 150820	Artigo 7º I, Alínea a	0,46	0,06	0,26	33.806.040,97	0,73
NTN-B 150521	Artigo 7º I, Alínea a	0,71	0,10	0,47	320.545.888,56	6,90
Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1	Artigo 7º I, Alínea b	1,12	0,16	0,71	15.803.229,92	0,34
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,41	0,18	0,63	28.683.376,66	0,62
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,46	0,18	0,60	32.020.130,39	0,69
NTN-B 150822	Artigo 7º I, Alínea a	1,75	0,22	0,74	403.260.452,87	8,68
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	0,22	0,63	33.638.412,52	0,72
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,92	0,23	0,62	673.121.134,68	14,48
FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,92	0,23	0,63	35.606.821,63	0,77
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	1,94	0,24	0,63	48.372.236,51	1,04
BB PREV ALOC FIC	Artigo 7º I, Alínea b	2,27	0,26	0,46	651.372.719,28	14,01
NTN-B 150523	Artigo 7º I, Alínea a	2,59	0,31	0,79	75.863.549,84	1,63
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,93	0,35	0,78	20.151.763,54	0,43
BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	3,54	0,39	0,42	7.301.399,17	0,16
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP	Artigo 7º III, Alínea a	5,07	0,55	0,44	2.058.320,33	0,04
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	5,09	0,55	0,44	13.960.630,59	0,30
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	5,10	0,55	0,44	13.795.390,85	0,30
NTN-B 150830	Artigo 7º I, Alínea a	5,40	0,60	0,65	116.978.861,66	2,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV IMA-B5+	Artigo 7º I, Alínea b	7,88	0,83	0,30	7.764.825,45	0,17
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,90	0,83	0,29	11.086.894,67	0,24
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	Artigo 7º IV, Alínea a	8,41	0,88	0,20	34.520.556,56	0,74
BANESTES PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	9,17	0,95	0,08	36.699.440,20	0,79
BB Acoes Globais BDR Nivel I	Artigo 9º A, III	26,77	2,52	-4,48	16.174.992,10	0,35
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	Artigo 9º A, III	29,18	2,70	-5,69	64.815.803,48	1,39
BB ACOES DIVIDENDOS FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	31,16	2,72	-8,73	139.689.820,87	3,01
Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	Artigo 8º II, Alínea a	31,61	2,79	-8,31	5.239.660,36	0,11
FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	32,04	2,95	-6,37	32.479.227,79	0,70
FI ACOES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	32,43	2,87	-8,44	9.579.710,47	0,21
FI ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	33,14	2,95	-8,30	55.610.311,61	1,20
FI ACOES CAIXA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	34,04	3,02	-8,68	152.730.495,69	3,29
BB PREV ACOES GV	Artigo 8º I, Alínea a	34,14	3,09	-7,77	104.252.918,54	2,24
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT	Artigo 8º II, Alínea a	38,92	3,53	-8,60	162.556.399,83	3,50
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	Artigo 8º IV, Alínea b	64,22	5,70	-15,77	29.480.000,00	0,63