



IPAJM CONS
MARÇO 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 **87,13%**

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150820	1,14	-1,12	-0,87	33.429.080,27	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830	11,75	-6,81	-5,10	109.015.580,21	2,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822	4,71	-1,72	-0,34	396.339.057,18	8,97
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	5,55	-1,87	-0,43	74.442.139,70	1,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150521	2,17	-0,82	-0,07	317.931.637,41	7,20
TESOURO NACIONAL	LFT 010324	0,06	0,33	0,98	110.941.533,01	2,51
TESOURO NACIONAL	LFT 010921	0,06	0,34	1,00	233.869.459,07	5,29
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		3,20	-1,40	-0,36	1.275.968.486,85	28,88

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	5,03	-0,11	1,38	48.318.649,03	1,09	4.885.428.546,31	0,99
BRB	BRB	35-BRB MILLENIUM	0,07	0,29	0,86	1.256.759,52	0,03	67.047.085,80	1,87
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B	20,16	-13,12	-12,58	31.882.964,33	0,72	244.950.986,31	13,02
BB	BB	BB PREVID RF IRF-M1	0,45	0,60	1,38	284.846.532,48	6,45	6.969.533.398,64	4,09
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	11,10	-6,98	-6,33	12.832.061,05	0,29	5.743.378.118,49	0,22
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	11,16	-7,10	-6,46	12.969.128,09	0,29	5.890.819.394,91	0,22
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,44	0,59	1,38	39.775.960,79	0,90	10.517.651.272,61	0,38
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	4,58	-1,80	-0,64	33.033.888,24	0,75	9.363.308.744,85	0,35
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	3,77	-1,66	-0,66	28.206.473,52	0,64	6.723.745.548,10	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+	16,80	-10,89	-10,58	6.919.504,99	0,16	1.940.264.057,52	0,36
CEF	CEF	FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	16,90	-10,91	-10,68	9.877.468,53	0,22	1.935.373.241,51	0,51
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	7,48	-0,45	1,41	20.061.892,78	0,45	2.758.205.111,21	0,73
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	3,65	-1,45	-0,41	31.554.656,52	0,71	8.199.299.170,30	0,38
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	5,02	-0,11	1,36	35.566.513,14	0,81	15.907.113.181,36	0,22
BANESTES	BANESTES	Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1	3,98	1,11	2,57	15.979.420,88	0,36	145.422.021,85	10,99
BB	BB	BB PREV ALOC FIC	5,33	-2,10	-1,18	637.685.746,86	14,43	10.536.452.770,12	6,05
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	5,32	-0,13	1,31	672.241.532,26	15,22	11.020.077.699,37	6,10
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,33	-1,18	-0,15	1.923.009.153,01	43,53		

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	11,08	-7,00	-6,38	1.914.241,72	0,04	2.791.754.446,71	0,07
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			11,08	-7,00	-6,38	1.914.241,72	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	0,66	-1,34	-0,77	26.584.024,58	0,60	445.586.463,98	5,97
BRB	BRB	33-BRB TESOIRO	0,07	0,24	0,71	21.876,77	0,00	231.838.362,29	0,01
BANESTES	BANESTES	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,05	0,08	0,28	19.771.179,06	0,45	653.242.969,82	3,03
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,11	0,14	0,79	93.914.345,65	2,13	5.503.080.783,31	1,71
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	22,83	-14,22	-13,42	29.612.063,74	0,67	196.839.318,27	15,04
BB	BB	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,16	-0,03	0,59	318.491.108,69	7,21	2.725.355.805,79	11,69
BB	BB	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,05	0,25	0,75	282.280,21	0,01	1.561.401.900,27	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,05	1,71	0,07	19,53	0,00	579.404.055,27	0,00
BANESTES	BANESTES	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,57	-1,31	-0,63	152.413.366,88	3,45	2.377.431.261,25	6,41
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF	2,55	-1,74	-0,72	7.174.127,21	0,16	221.275.689,72	3,24
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,14	-1,17	-0,49	648.264.392,32	14,67		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

3,24

-1,26

-0,27

3.849.156.273,90

87,13

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

10,92%

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	41,51	-30,83	-37,86	105.639.623,67	2,39	861.718.774,51	12,26
BB	BB	BB PREV ACOES GV	40,98	-30,82	-36,89	72.118.550,30	1,63	598.696.495,88	12,05
CEF	CEF	FI ACOES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	39,50	-29,37	-36,43	6.766.375,92	0,15	86.348.577,23	7,84
CEF	CEF	FI ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	40,32	-29,71	-36,62	39.086.685,12	0,88	477.022.607,99	8,19
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			41,00	-30,59	-37,35	223.611.235,01	5,06		

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	34,90	-29,38	-35,81	98.653.299,45	2,23	751.642.834,81	13,13
VINCI	CEF	FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	35,44	-27,40	-30,98	23.579.646,55	0,53	668.247.605,13	3,53
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT	43,23	-35,06	-40,34	105.567.342,49	2,39	894.019.781,17	11,81
BANESTES	BANESTES	Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	41,50	-31,64	-35,22	3.581.688,71	0,08	109.237.299,41	3,28
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			38,47	-31,94	-37,28	231.381.977,20	5,24		

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	16,41	5,22	10,23	4.025.166,36	0,09	142.989.968,61	2,81
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			16,41	5,22	10,23	4.025.166,36	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	36,96	-20,17	-21,48	23.399.800,00	0,53	176.343.450,14	13,27
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			36,96	-20,17	-18,48	23.399.800,00	0,53		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

36,86

-30,60

-36,07

482.418.178,57

10,92

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,96%

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	23,76	6,30	6,80	68.901.708,23	1,56	876.229.505,18	7,86
BB	BB	BB Acoes Globais BDR Nivel I	23,32	8,04	6,22	17.475.095,29	0,40	157.202.985,28	11,12
Sub-total Artigo 9º A, III			23,54	6,65	6,67	86.376.803,52	1,96		
Investimentos no Exterior			23,54	6,65	6,67	86.376.803,52	1,96		
Total						4.417.951.255,99	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	1.275.968.486,85	28,88	20,00	27,00	60,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	1.923.009.153,01	43,53	15,00	36,30	60,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	1.914.241,72	0,04	0,00	0,10	2,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	648.264.392,32	14,67	5,00	10,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	3.849.156.273,90	87,13				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alinea a	Fundos de Ações Referenciados	223.611.235,01	5,06	0,00	6,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	231.381.977,20	5,24	0,00	5,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	4.025.166,36	0,09	0,00	0,10	2,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	23.399.800,00	0,53	0,00	0,50	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	482.418.178,57	10,92				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	86.376.803,52	1,96	0,00	4,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	86.376.803,52	1,96				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

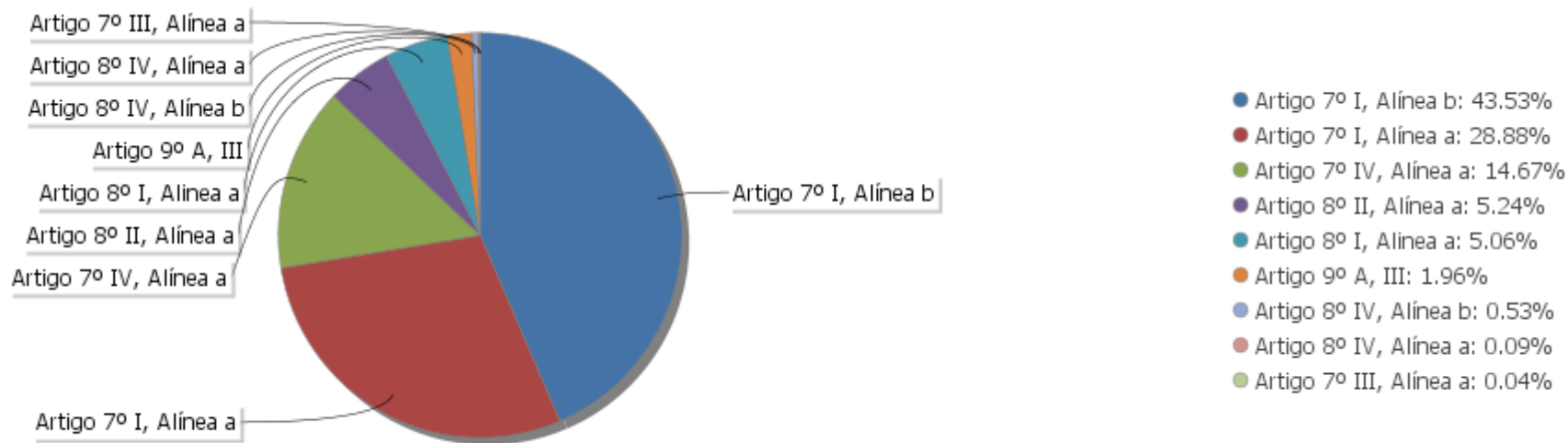
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	-1,40 -414,23	-0,36 -35,22	-0,36 -35,22	1,74 76,68	8,42 154,87	-18.138.552,45	-4.419.456,25
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-1,18 -349,58	-0,15 -14,72	-0,15 -14,72	1,53 67,67	8,81 161,98	-23.018.908,53	1.238.935,06
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-7,00 -2.068,69	-6,38 -630,43	-6,38 -630,43	-3,82 -168,66	8,70 159,95	-144.078,61	-130.463,80
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-1,17 -345,17	-0,49 -48,65	-0,49 -48,65	0,71 31,58	4,78 87,96	-7.655.317,54	-3.476.241,41
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-30,59 -0,69	-37,35 -0,49	-37,35 -0,49	-30,66 -0,37	-23,98 -0,51	-98.562.201,30	-136.710.641,49
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-31,94 -2,04	-37,28 -0,42	-37,28 -0,42	-28,30 1,99	-17,71 5,76	-108.583.131,65	-139.357.603,35
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	5,22 35,12	10,23 47,09	10,23 47,09	-2,39 27,90	2,32 25,79	207.382,47	389.118,87
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-20,17 9,74	-18,48 18,38	-18,48 18,38	12,55 42,83	27,25 50,72	-5.910.200,00	-5.250.000,00
Artigo 9º A, III % do CDI	6,65 1.965,35	6,67 659,29	6,67 659,29	12,92 570,57	26,24 482,65	5.386.007,94	3.773.271,94
						-256.418.999,67	-283.943.080,43

Análise de Liquidez

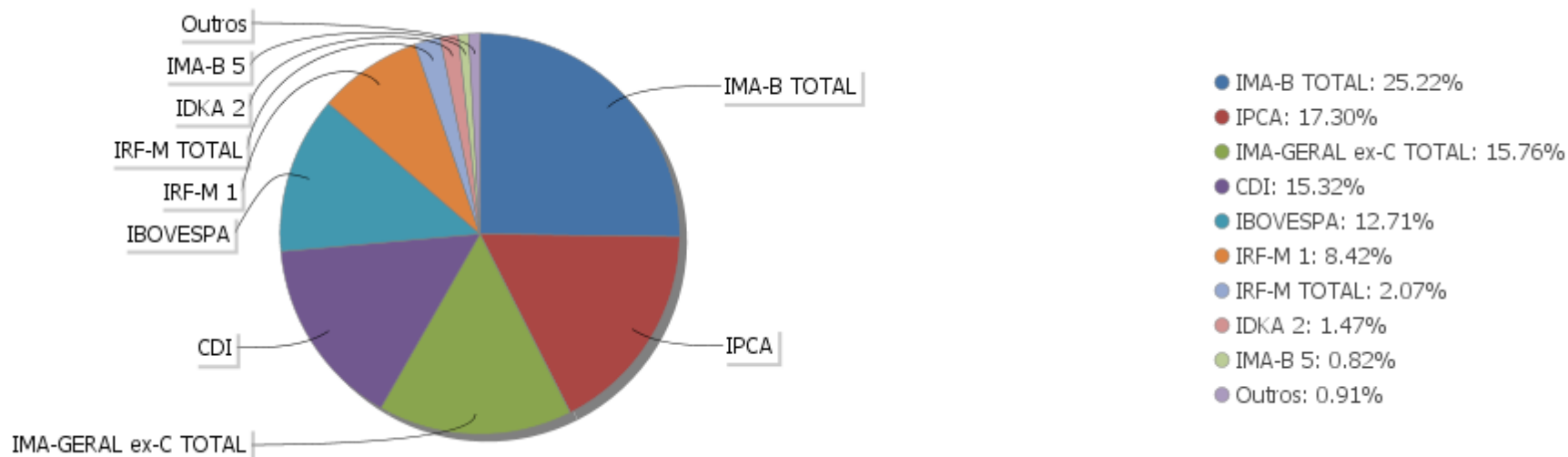
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	3.114.821.433,88	70,50	3.114.821.433,88	70,50
de 31 a 364 dias	60.590.415,53	1,37	3.175.411.849,41	71,88
acima de 365 dias	1.242.539.406,58	28,12	4.417.951.255,99	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

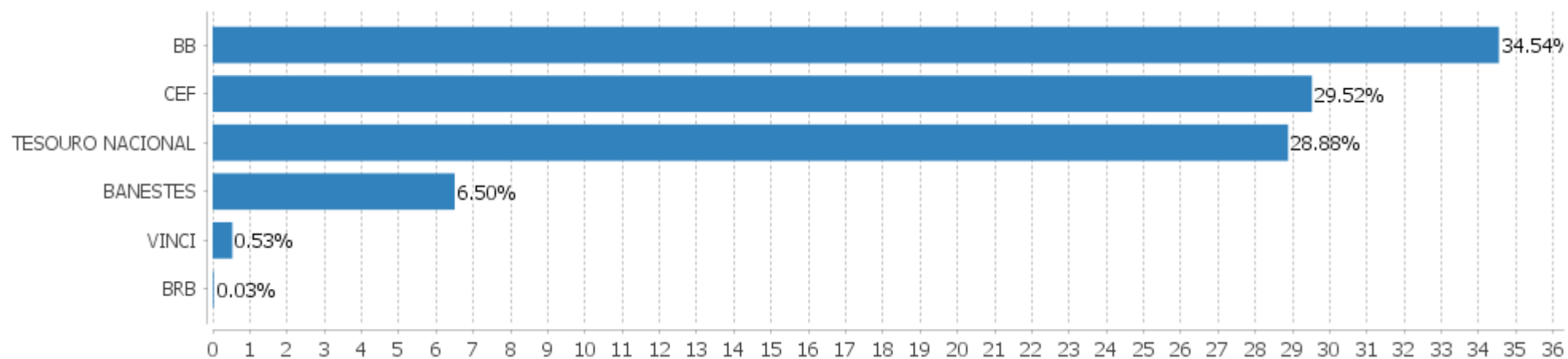


Alocação Por Estratégia



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										-5,96
IPCA + 5%	0,64	0,60	0,50										1,74
p.p. indexador	-0,22	-1,52	-5,98										-7,71
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

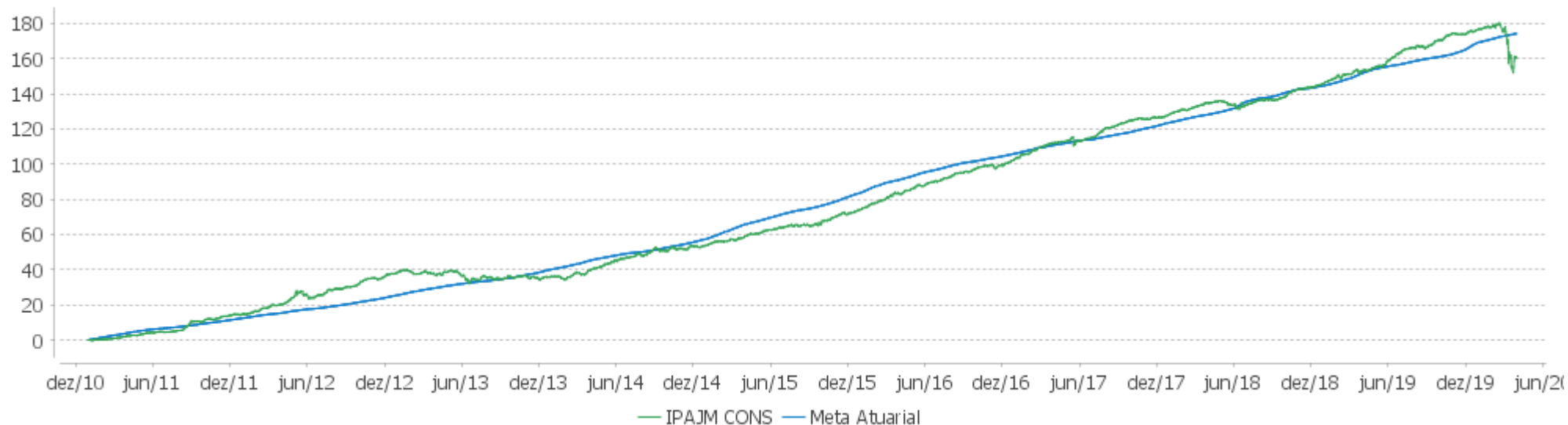
RELATÓRIO TRIMESTRAL

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

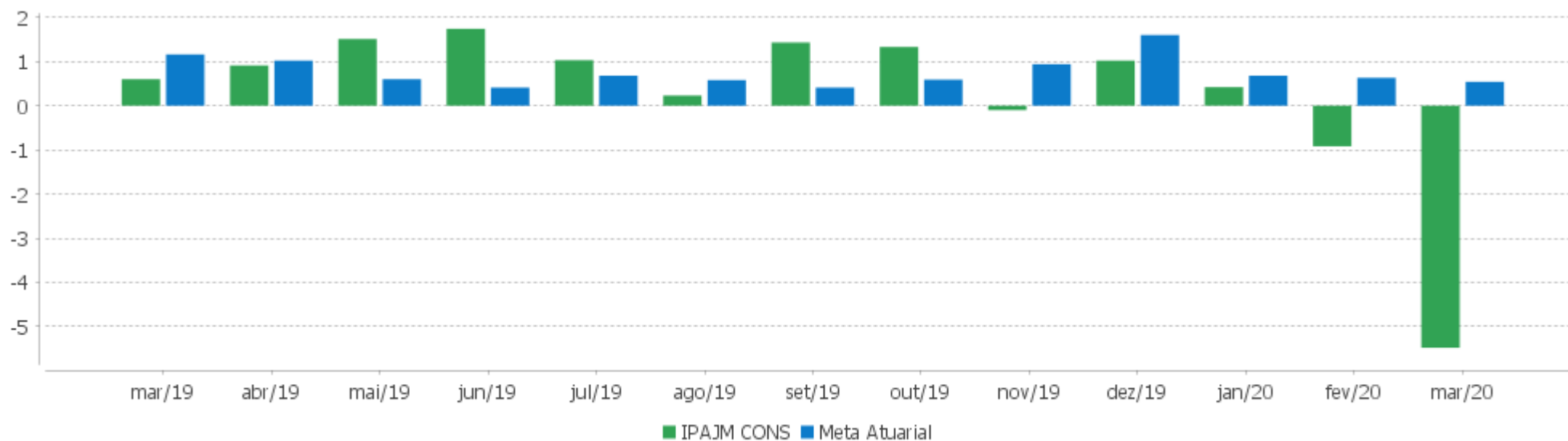
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	57	51,35	03 meses	-5,96	1,74	-7,71	13,35
Meses abaixo da Meta Atuarial	54	48,65	06 meses	-3,84	4,96	-8,80	9,44
			12 meses	2,93	8,90	-5,97	6,81
			24 meses	10,73	20,31	-9,58	5,11
			36 meses	22,70	30,72	-8,02	4,47
			Desde 31/12/2010	160,06	183,68	-23,61	3,58
	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 NOVO BRASIL IMAB RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-7,00 -0,03	-6,38 -0,07	-6,38 -0,07	-3,82 -0,18	8,70 -0,44	23,48 -0,62	36,30 -1,12
NTN-B 150820 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,12 5,86	-0,87 5,44	-0,87 5,44	1,57 5,22	5,58 -3,56	14,13 -9,97	28,02 -9,41
LFT 010921	0,34	1,00	1,00	2,26	5,44	12,14	21,85
NTN-B 150822 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,72 5,26	-0,34 5,97	-0,34 5,97	2,15 5,80	10,34 1,20	20,78 -3,33	36,64 -0,79
LFT 010324	0,33	0,98	0,98	2,24	5,43	12,08	
NTN-B 150523 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,87 5,10	-0,43 5,88	-0,43 5,88	2,29 5,93	11,49 2,35	22,82 -1,28	38,41 0,99
NTN-B 150521 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,82 6,16	-0,07 6,24	-0,07 6,24	2,34 5,99	8,22 -0,92	17,55 -6,55	32,76 -4,66
NTN-B 150830 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-6,81 0,16	-5,10 1,21	-5,10 1,21	-3,39 0,25	10,20 1,06	26,44 2,33	39,38 1,95
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-14,22 -7,25	-13,42 -7,11	-13,42 -7,11	-11,76 -8,12	4,77 -4,37	17,76 -6,34	29,41 -8,01
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP % do CDI	-1,34 -397,33	-0,77 -75,70	-0,77 -75,70	0,11 4,79	3,40 62,59	9,80 80,86	19,00 88,24
Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI % do CDI	-1,31 -387,82	-0,63 -62,35	-0,63 -62,35	0,40 17,76	3,68 67,66	10,81 89,12	20,84 96,79
BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF % do CDI	-1,74 -515,15	-0,72 -71,11	-0,72 -71,11	2,81 123,97	12,99 238,97		
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	-0,03 -9,77	0,59 58,36	0,59 58,36	1,74 76,63	4,81 88,50	11,34 93,51	20,78 96,50
BB PREVID RF FLUXO FIC % do CDI	0,25 73,55	0,75 74,38	0,75 74,38	1,73 76,27	4,31 79,23	9,74 80,32	17,73 82,36
Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto % do CDI	0,08 23,94	0,28 27,79	0,28 27,79	0,77 33,86	2,35 43,13	5,69 46,90	11,31 52,53
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,14 42,04	0,79 77,94	0,79 77,94	1,91 84,42	4,99 91,77	11,48 94,69	20,75 96,38
33-BRB TESOIRO % do CDI	0,24 70,18	0,71 70,50	0,71 70,50	1,68 74,31	4,38 80,64	9,91 81,72	17,86 82,93
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,26	0,80	0,80	1,83	4,55	10,26	18,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	78,23	79,03	79,03	81,02	83,67	84,64	86,21
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	-7,10 -0,13	-6,46 -0,15	-6,46 -0,15	-3,94 -0,30	8,66 -0,48	23,36 -0,75	36,31 -1,12
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	-1,80 -0,04	-0,64 -0,07	-0,64 -0,07	1,86 -0,17	9,03 -0,31	18,84 -0,55	32,82 -0,85
BB PREVID RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,60 -0,01	1,38 -0,06	1,38 -0,06	2,70 -0,13	6,40 -0,26	13,27 -0,53	23,59 -0,83
FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,11 -0,01	1,36 -0,06	1,36 -0,06	3,20 -0,11	10,78 -0,31	20,64 -0,61	35,89 -0,97
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-10,91 0,02	-10,68 -0,07	-10,68 -0,07	-8,13 -0,22	7,75 -0,49	25,87 -1,08	38,51 -1,44
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,45 0,03	1,41 -0,03	1,41 -0,03	3,50 -0,07	12,70 -0,26	23,91 -0,60	41,11 -1,00
Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1 Var. IRF-M 1 p.p.	1,11 0,51	2,57 1,14	2,57 1,14	4,09 1,26	11,15 4,49	19,40 5,61	31,38 6,96
BANESTES PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-13,12 -6,15	-12,58 -6,27	-12,58 -6,27	-10,06 -6,42	6,89 -2,25	23,16 -0,94	35,15 -2,28
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	-1,66 -0,45	-0,66 -0,66	-0,66 -0,66	1,94 -0,52	7,78 -1,34	17,10 -2,04	30,56 -3,36
BB PREV ALOC FIC Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-2,10 -0,17	-1,18 -0,17	-1,18 -0,17	0,61 -0,26	8,55 0,22	18,63 0,23	30,83 -0,39
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,13 -0,20	1,31 0,78	1,31 0,78	3,13 0,82	13,46 10,16	23,65 15,62	35,73 24,81
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-1,45 -0,24	-0,41 -0,41	-0,41 -0,41	1,98 -0,48	8,03 -1,08	17,44 -1,70	30,97 -2,96
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,11 -0,00	1,38 -0,04	1,38 -0,04	3,22 -0,09	10,87 -0,23	20,76 -0,49	35,94 -0,91
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,59 -0,02	1,38 -0,05	1,38 -0,05	2,73 -0,11	6,46 -0,20	13,39 -0,41	23,77 -0,64
BB PREV IMAB TPB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-6,98 -0,01	-6,33 -0,02	-6,33 -0,02	-3,73 -0,09	8,93 -0,22	23,52 -0,58	36,42 -1,00
BB PREV IMA-B5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	-10,89 0,04	-10,58 0,04	-10,58 0,04	-7,80 0,11	8,16 -0,07	26,53 -0,41	38,86 -1,08
35-BRB MILLENIUM % do CDI	0,29 85,00	0,86 84,52	0,86 84,52	2,03 89,57	5,03 92,49	11,20 92,34	19,88 92,32
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	-20,62	-21,48	-21,48	5,40	14,48	5,97	4,48

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.	-20,69	-22,01	-22,01	3,09	11,18	-2,06	-6,45
FI ACOES CAIXA BRASIL IBX-50 Var. IBOVESPA p.p.	-30,83 -0,93	-37,86 -1,00	-37,86 -1,00	-31,29 -1,00	-25,49 -2,02	-19,51 -5,05	7,13 -5,24
FI ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-29,71 0,19	-36,62 0,24	-36,62 0,24	-30,06 0,23	-23,40 0,08	-14,79 -0,32	11,23 -1,13
FI ACOES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-29,37 0,54	-36,43 0,43	-36,43 0,43	-29,95 0,34	-23,37 0,10	-14,82 -0,36	11,01 -1,35
BB PREV ACOES GV Var. IBOVESPA p.p.	-30,82 -0,92	-36,89 -0,03	-36,89 -0,03	-29,53 0,76	-21,90 1,57	-9,95 4,51	13,11 0,75
Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-31,64 -6,11	-35,22 -3,98	-35,22 -3,98	-28,77 -7,35	-13,41 -5,64	-0,89 -5,77	26,00 -1,17
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT Var. IBOVESPA p.p.	-35,06 -5,15	-40,34 -3,49	-40,34 -3,49	-28,21 2,08	-13,79 9,68	-6,52 7,94	25,26 12,89
FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-27,40 -1,87	-30,98 0,25	-30,98 0,25	-22,11 -0,69	-12,36 -4,59	1,73 -3,15	28,59 1,41
BB ACOES DIVIDENDOS FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-29,38 0,53	-35,81 1,05	-35,81 1,05	-29,79 0,50	-21,20 2,27	-13,42 1,04	5,74 -6,63
FIP CAIXA CYRELA Var. IPCA p.p.	5,22 5,15	10,23 9,70	10,23 9,70	-2,15 -4,46	2,41 -0,89	24,86 16,83	23,18 12,25
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I Var. IBOVESPA p.p.	6,30 36,21	6,80 43,65	6,80 43,65	12,71 43,00	27,06 50,53	62,46 76,92	91,78 79,42
BB Acoes Globais BDR Nivel I Var. IBOVESPA p.p.	8,04 37,94	6,22 43,08	6,22 43,08	13,91 44,20	21,84 45,31	52,72 67,18	76,66 64,30
CDI	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,12	21,53
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
INPC + 6%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65
IPCA + 6%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96

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	0,60	1,43	1,43	2,83	6,66	13,79	24,42
IRF-M 1+	-0,47	1,44	1,44	3,57	12,96	24,50	42,11
IRF-M TOTAL	-0,11	1,42	1,42	3,31	11,09	21,25	36,85
IMA-B 5	-1,75	-0,57	-0,57	2,03	9,34	19,39	33,68
IMA-B 5+	-10,93	-10,62	-10,62	-7,92	8,24	26,94	39,94
IMA-B TOTAL	-6,97	-6,31	-6,31	-3,64	9,14	24,10	37,42
IMA-C TOTAL	-3,52	-0,45	-0,45	1,38	13,06	32,40	46,04
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-1,93	-1,00	-1,00	0,87	8,34	18,40	31,22
IMA-GERAL TOTAL	-1,98	-0,99	-0,99	0,89	8,47	18,79	31,60
IDKA 2	-1,21	-0,00	-0,00	2,46	9,11	19,14	33,92
IDKA 20	-16,46	-17,67	-17,67	-14,94	5,94	33,16	42,21
CDI	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,12	21,53
Renda Variável							
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
IBRX 100	-30,09	-36,64	-36,64	-29,86	-22,20	-12,35	15,05
IBRX 50	-30,37	-37,60	-37,60	-31,47	-25,64	-17,77	8,61
SMALL CAP	-35,07	-40,17	-40,17	-27,52	-11,98	-1,62	31,66
IFIX	-15,85	-22,00	-22,00	-7,08	0,45	5,79	22,69
Índice Consumo - ICON	-31,51			-30,32	-6,98	-7,63	14,29
Índice Dividendos - IDIV	-25,53	-31,24	-31,24	-21,42	-7,78	4,87	27,17
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,07	0,53	0,53	2,31	3,30	8,03	10,93
INPC	0,18	0,54	0,54	2,36	3,31	8,13	9,82
IGPM	1,24	1,69	1,69	4,83	6,82	15,66	15,90
SELIC	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,13	21,55
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,41	1,51	1,51	4,33	7,47	16,84	24,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,50	1,74	1,74	4,83	8,51	19,10	28,29
IPCA + 5,5%	0,54	1,86	1,86	5,08	9,03	20,24	30,12
IPCA + 5,89%	0,57	1,96	1,96	5,28	9,44	21,13	31,55
IPCA + 6%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96
INPC + 4%	0,52	1,52	1,52	4,39	7,48	16,96	23,44
INPC + 6%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
02/03/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	257.982,10	12.804,48788827	20,1477874200
02/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	855,42	0,00	409,13791600	2,0907864230
02/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	4.544,07	2.620,26725178	1,7342009700
02/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	760,02	0,00	363,50915200	2,0907864230
03/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.582,05	0,00	756,57977800	2,0910550930
03/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	160.000,00	0,00	92.239,58144421	1,7346132500
03/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	4.958,58	0,00	2.371,32919900	2,0910550930
04/03/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	151.003,60	7.492,38187394	20,1542850500
04/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	18.750.000,00	0,00	10.807.843,42614490	1,7348511873
04/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	23.972.603,56	13.818.247,77565460	1,7348511873
04/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	2.722,96	0,00	1.302,04599200	2,0912932530
04/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	25.500.000,00	0,00	14.698.667,05955700	1,7348511873
04/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	431.632,59	248.800,93068487	1,7348511900
04/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.336,13	0,00	638,90131000	2,0912932530
05/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.149,63	0,00	549,65557900	2,0915461290
05/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	806,34	0,00	385,52341100	2,0915461290
06/03/2020	33-BRB TESOIRO	0,00	1.190,94	302,57682000	3,9360022070
06/03/2020	33-BRB TESOIRO	0,00	2.049,95	520,82027000	3,9360022070
06/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	109.000,00	0,00	62.815,38510635	1,7352436800
06/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	2.692,83	0,00	1.287,32946100	2,0917955200
06/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	320.000,00	0,00	184.412,13976177	1,7352436800
06/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	4.022,43	0,00	1.922,95564300	2,0917955200
09/03/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	9.239,29	458,29788546	20,1600101000
09/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	5.923,31	0,00	2.831,35368400	2,0920417090
09/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.353,33	0,00	646,89436800	2,0920417090
10/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.638,24	0,00	782,99354500	2,0922777830
11/03/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	15.783,88	782,87737743	20,1613694000
11/03/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	7.620.000,00	0,00	377.950,51761923	20,1613694000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
11/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	5.390.710,70	3.105.826,58844228	1,7356766537
11/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	2.759,46	0,00	1.318,71472800	2,0925374840
11/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	1.984.774,93	1.143.516,52179511	1,7356766500
11/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	12.113,46	0,00	5.788,88554800	2,0925374840
11/03/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	170.000,00	0,00	46.209,43966400	3,6789020000
12/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	900.000,00	0,00	518.691,36043966	1,7351359000
12/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	3.077,96	0,00	1.470,74902000	2,0927839870
12/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.518,41	0,00	725,54549700	2,0927839870
13/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	9.920,34	0,00	4.739,69230800	2,0930346010
13/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	11.715,51	0,00	5.597,37999200	2,0930346010
16/03/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	270.961,78	13.445,13666204	20,1531443500
16/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	18.691,56	0,00	8.929,26231700	2,0932927420
16/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	11.383,21	0,00	5.437,94461700	2,0932927420
17/03/2020	33-BRB TESOIRO	0,00	1.150,04	291,95017000	3,9391655000
17/03/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	16.528,45	820,07953917	20,1546913600
17/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	3.465.945,37	0,00	1.997.364,25364478	1,7352595400
17/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	15.387,47	0,00	7.349,98890700	2,0935364930
17/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	24.834,41	0,00	11.862,42039800	2,0935364930
18/03/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	93.801,19	4.653,02072100	20,1592031600
18/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	3.077.551,99	0,00	1.773.095,20511029	1,7356947200
18/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	3.091,52	0,00	1.476,51710800	2,0937921997
18/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	747,70	0,00	357,10325000	2,0937921997
19/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	25.200.000,00	0,00	14.532.296,34085270	1,7340686846
19/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	4.967.434,23	2.864.612,15412920	1,7340686846
19/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	203.320,36	97.094,83439000	2,0940388980
19/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.679,33	0,00	801,95740400	2,0940388980
19/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	2.300.000,00	0,00	1.326.360,38031592	1,7340686800
19/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	3.369,42	1.943,07182289	1,7340686800
19/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	5.023,10	0,00	2.398,76155300	2,0940388980
20/03/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	368,84	18,32437776	20,1283778800

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

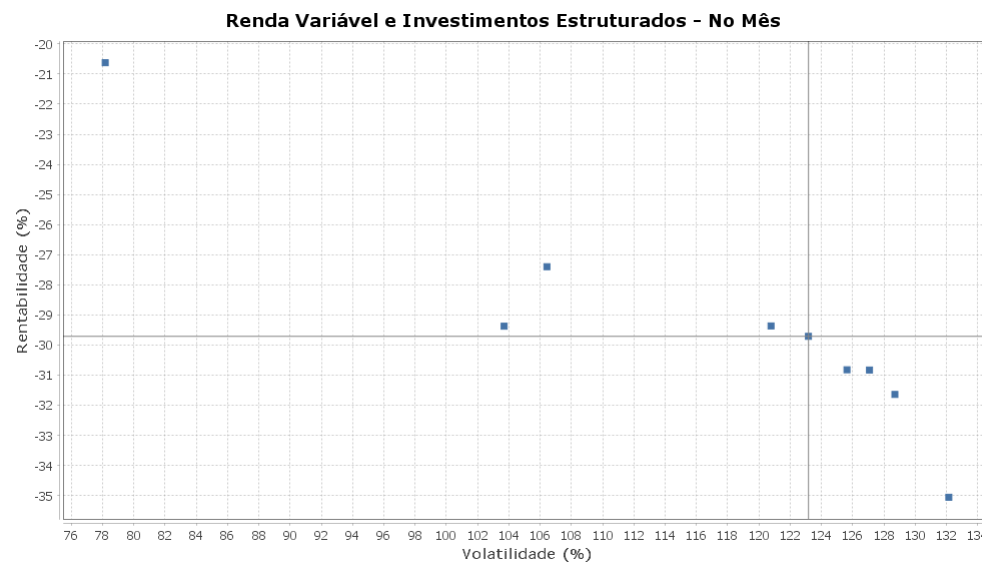
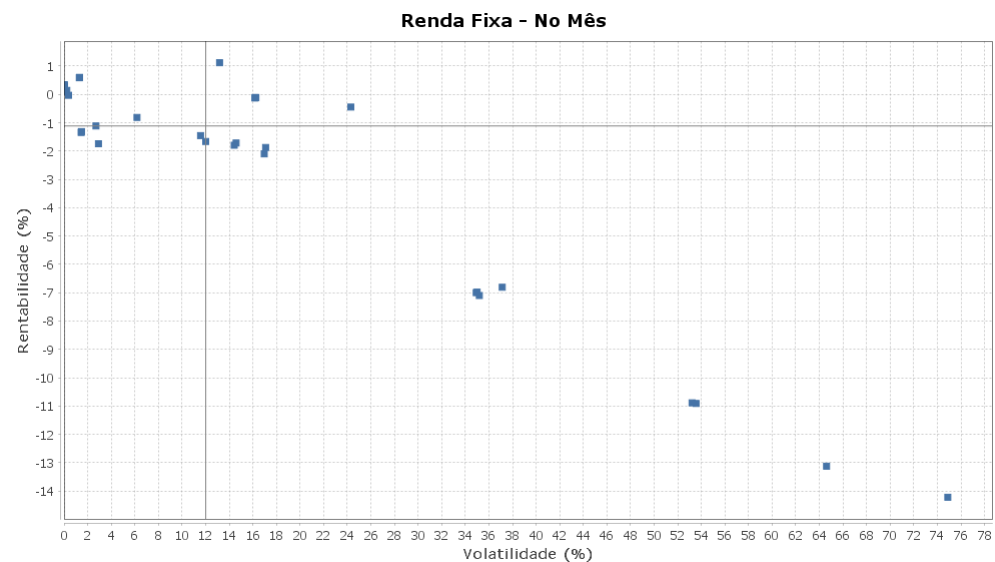
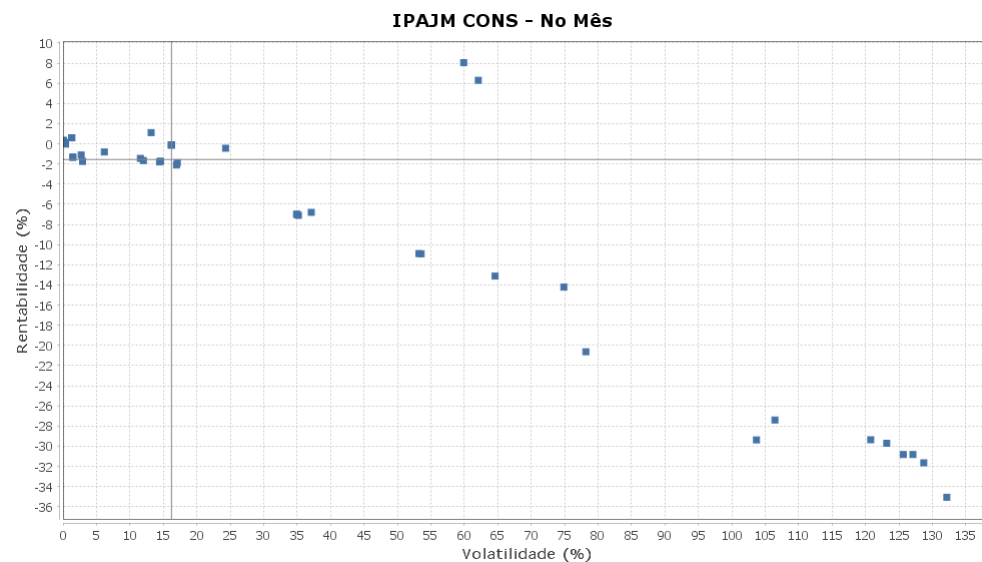
Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
20/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	1.037.864,25	0,00	598.852,67489134	1,7330877800
20/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	2.831.365,14	1.633.711,33333004	1,7330877800
20/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	63.405,97	27.981,85279400	2,2659675350
23/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	964.794,27	0,00	557.254,93028774	1,7313337500
23/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	3.355.897,00	1.938.330,48862098	1,7313337500
23/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	23.699,58	10.460,02068100	2,2657297460
23/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	1.077.066,35	0,00	622.102,09207038	1,7313337500
23/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	15.161.195,88	8.756.945,82498880	1,7313337530
23/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	294.925,23	170.345,68201877	1,7313337500
23/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	76.880,24	44.405,21073429	1,7313337500
23/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	4.002.209,20	2.311.633,55709184	1,7313337500
23/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	2.263.734,52	1.307.509,03315163	1,7313337500
23/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	8.201.054,93	4.736.842,28379907	1,7313337533
23/03/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	179.643,65	0,00	96.579,49205900	1,8600600000
24/03/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	1.230.686,10	61.307,07945999	20,0741269800
24/03/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	1.123.695,00	55.977,27866751	20,0741269800
24/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	1.078.047,14	623.712,20509588	1,7284368200
24/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	15.600.074,52	9.025.539,32112791	1,7284368241
24/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	637.124,04	281.273,82445900	2,2651380420
24/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	4.302.928,69	0,00	2.489.491,44683985	1,7284368241
24/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	19.398,94	11.223,40124297	1,7284368200
24/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	3.544,74	1.692,26173400	2,0946759760
24/03/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	179.643,96	96.569,17256400	1,8602620000
24/03/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	30.000.000,00	0,00	8.148.664,23021600	3,6815850000
24/03/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	179.643,96	0,00	48.795,27703400	3,6815850000
25/03/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	44.491,24	2.221,01005659	20,0319849400
25/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	3.074.114,16	1.782.304,10501699	1,7247977800
25/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	108.343,84	62.815,38510635	1,7247977800
25/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	559.222,66	324.225,05845150	1,7247977800
25/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	9.984,95	5.789,05546743	1,7247977800

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
26/03/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	751.680,11	37.608,93669950	19,9867418700
26/03/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	149.151.825,45	0,00	18.404.252,79667440	8,1042043433
26/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	20.733,46	0,00	9.896,14217500	2,0951053080
26/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	3.392,22	0,00	1.619,11670300	2,0951053080
27/03/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	475.266,24	23.817,00560010	19,9549115400
27/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	5.521,90	3.213,86151014	1,7181512000
27/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	3.392,22	1.974,34312319	1,7181512000
30/03/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	779.925,15	39.169,07034692	19,9117605600
30/03/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	2.244.134,76	276.896,18032139	8,1046071300
30/03/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	137.691.261,93	16.989.258,04993370	8,1046071300
30/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.236.089,66	988.804,06660000	2,2614082360
30/03/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,00	5.881.733,76	3.430.752,78616377	1,7144149200
30/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	83.330,56	39.766,05430100	2,0955199470
31/03/2020	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,00	32.073,33	1.613,74005258	19,8751527200
31/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	855,42	0,00	408,17181400	2,0957351030
31/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	760,02	0,00	362,65079400	2,0957351030

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
33-BRB TESOURO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,01	0,24	21.876,77	0,00
35-BRB MILLENIUM	Artigo 7º I, Alínea b	0,01	0,01	0,29	1.256.759,52	0,03
LFT 010921	Artigo 7º I, Alínea a	0,01	0,02	0,34	233.869.459,07	5,29
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,01	0,26	19,53	0,00
Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,01	0,08	19.771.179,06	0,45
BB PREVID RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,25	282.280,21	0,01
LFT 010324	Artigo 7º I, Alínea a	0,02	0,02	0,33	110.941.533,01	2,51
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,24	0,03	0,14	93.914.345,65	2,13
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,38	0,04	-0,03	318.491.108,69	7,21
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,30	0,16	0,59	39.775.960,79	0,90
BB PREVID RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	1,31	0,16	0,60	284.846.532,48	6,45
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	Artigo 7º IV, Alínea a	1,46	0,09	-1,34	26.584.024,58	0,60
Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	Artigo 7º IV, Alínea a	1,48	0,09	-1,31	152.413.366,88	3,45
NTN-B 150820	Artigo 7º I, Alínea a	2,71	0,23	-1,12	33.429.080,27	0,76
BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	2,92	0,22	-1,74	7.174.127,21	0,16
NTN-B 150521	Artigo 7º I, Alínea a	6,18	0,60	-0,82	317.931.637,41	7,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	11,57	1,13	-1,45	31.554.656,52	0,71
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	12,01	1,17	-1,66	28.206.473,52	0,64
Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1	Artigo 7º I, Alínea b	13,18	1,42	1,11	15.979.420,88	0,36
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	14,42	1,41	-1,80	33.033.888,24	0,75
NTN-B 150822	Artigo 7º I, Alínea a	14,58	1,43	-1,72	396.339.057,18	8,97
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	16,18	1,67	-0,13	672.241.532,26	15,22
FI CAIXA BRASIL IRF-M TIT PUB RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	16,19	1,67	-0,11	35.566.513,14	0,81
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	16,25	1,68	-0,11	48.318.649,03	1,09
BB PREV ALOC FIC	Artigo 7º I, Alínea b	16,96	1,66	-2,10	637.685.746,86	14,43
NTN-B 150523	Artigo 7º I, Alínea a	17,08	1,68	-1,87	74.442.139,70	1,68
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	24,29	2,50	-0,45	20.061.892,78	0,45
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP	Artigo 7º III, Alínea a	34,92	3,29	-7,00	1.914.241,72	0,04
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	34,99	3,30	-6,98	12.832.061,05	0,29
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	35,19	3,31	-7,10	12.969.128,09	0,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150830	Artigo 7º I, Alínea a	37,13	3,53	-6,81	109.015.580,21	2,47
BB PREV IMA-B5+	Artigo 7º I, Alínea b	53,21	4,99	-10,89	6.919.504,99	0,16
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	53,55	5,02	-10,91	9.877.468,53	0,22
BB Acoes Globais BDR Nivel I	Artigo 9º A, III	59,90	6,56	8,04	17.475.095,29	0,40
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	Artigo 9º A, III	62,09	6,71	6,30	68.901.708,23	1,56
BANESTES PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	64,61	6,05	-13,12	31.882.964,33	0,72
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	Artigo 7º IV, Alínea a	74,88	7,06	-14,22	29.612.063,74	0,67
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	Artigo 8º IV, Alínea b	78,18	7,05	-20,62	23.399.800,00	0,53
BB ACOES DIVIDENDOS FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	103,70	9,16	-29,38	98.653.299,45	2,23
FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	106,44	9,57	-27,40	23.579.646,55	0,53
FI ACOES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	120,77	10,93	-29,37	6.766.375,92	0,15
FI ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	123,17	11,16	-29,71	39.086.685,12	0,88
BB PREV ACOES GV	Artigo 8º I, Alínea a	125,63	11,34	-30,82	72.118.550,30	1,63
FI ACOES CAIXA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	127,07	11,49	-30,83	105.639.623,67	2,39
Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	Artigo 8º II, Alínea a	128,70	11,61	-31,64	3.581.688,71	0,08
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT	Artigo 8º II, Alínea a	132,15	11,73	-35,06	105.567.342,49	2,39

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 15,04% do patrimônio líquido do fundo BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA (Art. 7, Inciso IV, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- O Instituto está com 13,27% 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;