



IPAJM - ESTADO DO ESPÍRITO
ABRIL 2020
SANTO



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 17.06.2020.

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 **86,07%**

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	1,19	-0,01	-0,88	33.426.878,96	0,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830	13,10	1,52	-3,67	110.668.173,48	2,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822	5,04	0,48	0,14	398.232.416,34	8,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	6,06	0,83	0,40	75.063.729,22	1,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150521	2,24	0,07	0,00	318.150.335,34	7,03
TESOURO NACIONAL	LFT 010324	0,06	0,26	1,25	111.233.132,03	2,46
TESOURO NACIONAL	LFT 010921	0,06	0,28	1,28	234.520.328,83	5,19
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		3,45	0,42	0,06	1.281.294.994,20	28,33

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	5,80	1,07	2,47	48.836.640,51	1,08	4.883.028.533,44	1,00
BRB	BRB	35-BRB MILLENIUM	0,08	0,23	1,09	1.259.621,16	0,03	64.656.829,24	1,95
BANESTES	BANESTES	Banestes Previdenciario FI Renda Fixa IMA-B	22,33	1,69	-11,10	32.422.976,92	0,72	248.411.318,97	13,05
BB	BB	BB PREVID RF IRF-M1	0,53	0,41	1,79	286.020.980,75	6,32	7.168.032.689,23	3,99
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	12,26	1,30	-5,12	12.998.647,40	0,29	5.412.184.320,85	0,24
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS P	12,33	1,30	-5,25	13.138.132,57	0,29	5.880.207.997,15	0,22
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS	0,52	0,43	1,82	39.948.290,79	0,88	10.765.141.210,50	0,37
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	0,47	-0,18	33.187.582,17	0,73	9.104.032.681,09	0,36
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,07	0,32	-0,34	28.297.778,89	0,63	6.681.370.754,80	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+	18,74	1,92	-8,86	7.052.288,81	0,16	1.959.264.029,83	0,36
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULO	18,85	1,95	-8,95	10.069.611,21	0,22	1.937.305.372,80	0,52
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO	8,58	1,44	2,87	20.351.043,63	0,45	2.809.224.859,68	0,72
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	3,97	0,43	0,02	31.689.019,82	0,70	8.182.089.077,85	0,39
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS P	5,78	1,13	2,50	35.967.837,86	0,80	16.130.391.856,09	0,22
BANESTES	BANESTES	Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1	4,20	0,92	3,51	16.126.319,45	0,36	224.491.001,93	7,18
BB	BB	BB PREV ALOC FIC	6,01	0,91	-0,28	643.505.251,98	14,23	10.512.346.440,60	6,12
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	6,00	1,11	2,43	679.712.077,03	15,03	11.368.843.034,79	5,98
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,96	0,91	0,76	1.940.584.100,95	42,91		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	12,25	1,25	-5,21	1.938.128,68	0,04	2.806.802.535,15	0,07
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,25	1,25	-5,21	1.938.128,68	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	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,97	-1,63	-2,38	30.818.559,77	0,68	345.886.868,82	8,91
BRB	BRB	33-BRB TESOURO	0,08	0,18	0,90	17.579,97	0,00	253.563.174,23	0,01
BANESTES	BANESTES	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,06	0,05	0,33	22.469.663,74	0,50	687.184.174,78	3,27
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,29	0,00	0,79	94.088.012,81	2,08	4.876.604.207,95	1,93
BANESTES	BANESTES	Banestes Institucional FI Renda Fixa	25,49	2,06	-11,64	30.221.869,38	0,67	199.092.846,68	15,18
BB	BB	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,26	0,85	316.387.645,06	7,00	2.594.654.169,89	12,19
BB	BB	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,06	0,20	0,95	330.657,75	0,01	1.637.982.393,12	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,06	0,22	0,28	38,12	0,00	577.158.987,32	0,00
BANESTES	BANESTES	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	0,91	-1,61	-2,24	167.553.663,24	3,70	2.039.086.693,71	8,22
BANESTES	BANESTES	Banestes Estrategia FIC de FI Renda Fixa	2,62	-1,55	-2,26	7.062.891,01	0,16	175.932.315,10	4,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
		Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a	1,27	-0,33	-0,82	668.950.580,85	14,79		
		Renda Fixa	3,63	0,51	0,24	3.892.767.804,68	86,07		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

11,71%

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA BRASIL IBX-50	43,44	9,94	-31,68	116.144.755,00	2,57	880.179.064,16	13,20
BB	BB	BB PREV ACOES GV	42,94	10,99	-29,95	80.042.710,04	1,77	669.048.657,55	11,96
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	41,45	10,01	-30,07	7.443.700,53	0,16	98.260.621,40	7,58
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBOVES	42,24	10,14	-30,20	43.049.577,76	0,95	529.649.188,40	8,13
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			42,95	10,32	-30,89	246.680.743,33	5,45		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	36,80	8,38	-30,43	106.918.729,65	2,36	816.453.425,74	13,10
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	37,40	7,24	-25,99	25.286.562,21	0,56	714.263.825,61	3,54
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT	45,48	11,33	-33,59	117.525.396,62	2,60	965.556.817,86	12,17
BANESTES	BANESTES	Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	43,83	16,41	-21,97	4.169.378,05	0,09	126.854.958,61	3,29
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			40,52	9,73	-31,18	253.900.066,53	5,61		

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	16,44	-0,10	10,13	4.021.332,66	0,09	150.839.883,53	2,67
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			16,44	-0,10	10,13	4.021.332,66	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	40,53	7,66	-16,00	25.031.200,00	0,55	158.643.925,54	15,78
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			40,53	7,66	-12,24	25.031.200,00	0,55		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados

38,80

9,82

-29,79

529.633.342,52

11,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,22%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	25,47	15,96	23,85	79.901.729,35	1,77	1.075.121.854,10	7,43
BB	BB	BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	25,04	16,38	23,62	20.337.926,50	0,45	234.830.455,38	8,66
Sub-total Artigo 9º A, III			25,27	16,05	23,79	100.239.655,85	2,22		
Investimentos no Exterior			25,27	16,05	23,79	100.239.655,85	2,22		
Total						4.522.640.803,05	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	1.281.294.994,20	28,33	20,00	27,00	60,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	1.940.584.100,95	42,91	15,00	36,30	60,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	1.938.128,68	0,04	0,00	0,10	2,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	668.950.580,85	14,79	5,00	10,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	3.892.767.804,68	86,07				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	246.680.743,33	5,45	0,00	6,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	253.900.066,53	5,61	0,00	5,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	4.021.332,66	0,09	0,00	0,10	2,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	25.031.200,00	0,55	0,00	0,50	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	529.633.342,52	11,71				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	100.239.655,85	2,22	0,00	4,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	100.239.655,85	2,22				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

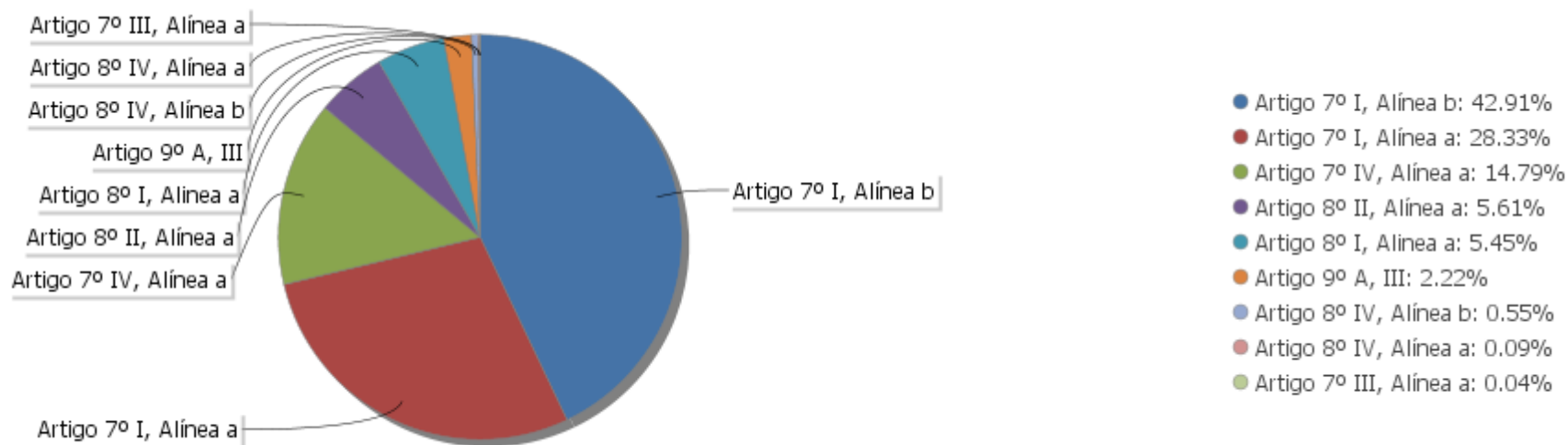
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,42 146,51	0,06 4,58	-0,46 -50,02	0,82 39,58	7,77 149,65	5.326.507,35	907.051,10
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,91 320,76	0,76 58,74	0,19 21,01	1,05 50,93	8,93 171,93	17.574.947,94	18.813.883,00
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,25 437,96	-5,21 -400,98	-5,43 -590,26	-5,77 -279,27	8,45 162,65	23.886,96	-106.576,84
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,33 -116,89	-0,82 -63,37	-1,19 -129,89	-0,30 -14,72	3,83 73,73	-1.754.975,38	-5.231.216,79
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	10,32 0,06	-30,89 -0,50	-29,80 -0,57	-25,25 -0,34	-16,67 -0,22	23.069.508,32	-113.641.133,17
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	9,73 -0,52	-31,18 -0,79	-31,51 -2,27	-23,17 1,74	-11,73 4,72	22.518.089,33	-116.839.514,02
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,10 -10,35	10,13 40,51	5,03 34,26	9,92 34,84	2,33 18,77	-3.833,70	385.285,17
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	7,66 -2,60	-12,24 18,14	-27,26 1,97	11,85 36,77	36,99 53,43	1.801.400,00	-3.448.600,00
Artigo 9º A, III % do CDI	16,05 5.632,78	23,79 1.830,34	16,96 1.844,07	32,58 1.576,62	39,09 752,79	13.862.852,33	17.636.124,27
						82.418.383,15	-201.524.697,28

Análise de Liquidez

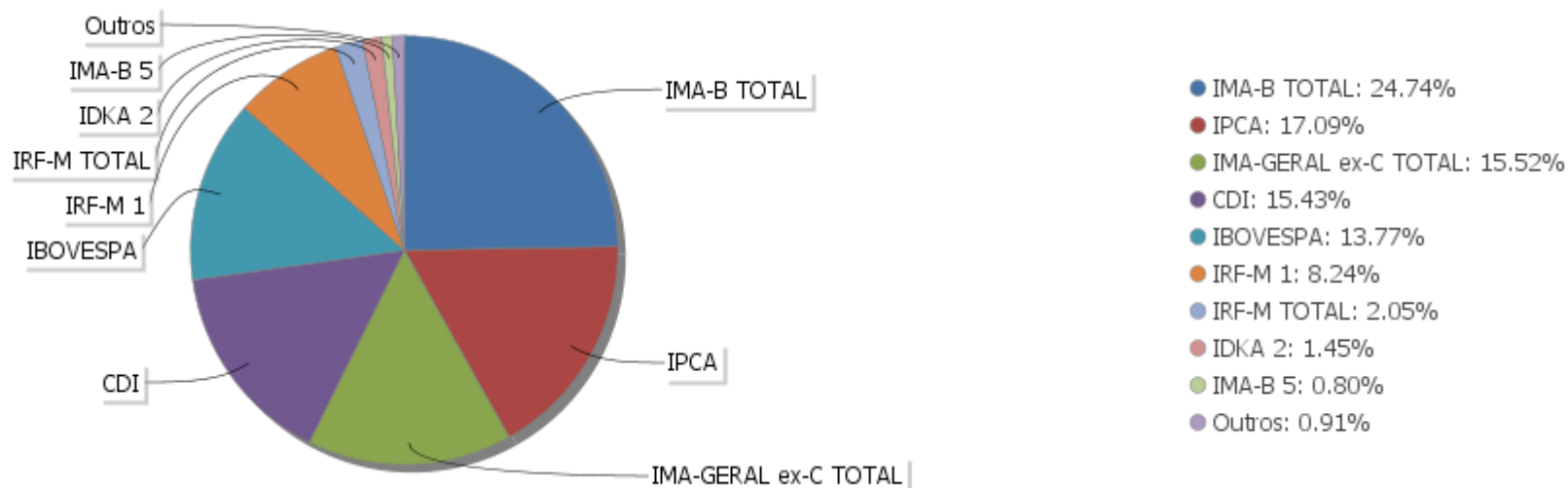
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	3.211.889.868,59	71,02	3.211.889.868,59	71,02
de 31 a 364 dias	62.882.819,22	1,39	3.274.772.687,81	72,41
acima de 365 dias	1.247.868.115,24	27,59	4.522.640.803,05	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

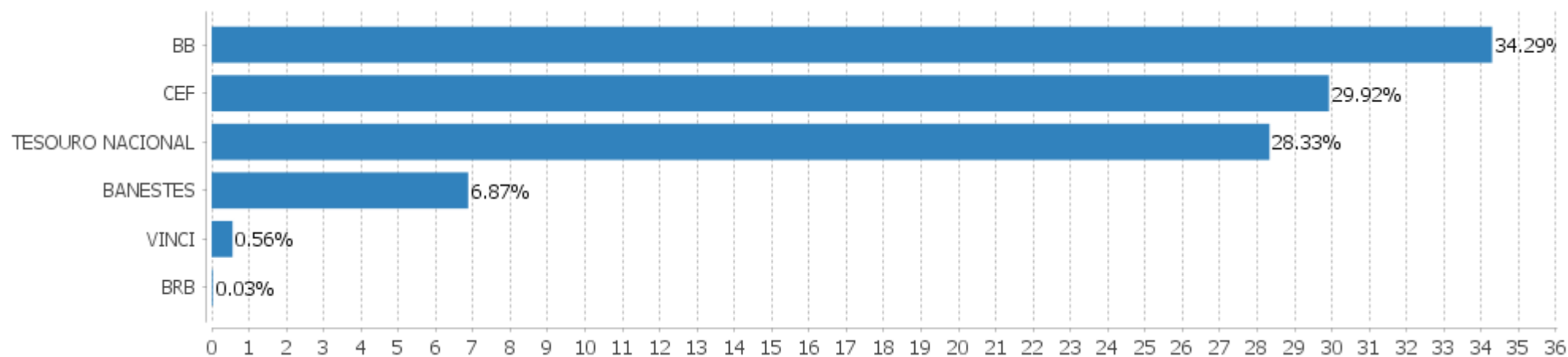


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2020	0,42	-0,92	-5,48	1,81									-4,26
IPCA + 5%	0,64	0,60	0,50	0,08									1,82
p.p. indexador	-0,22	-1,52	-5,98	1,74									-6,08
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

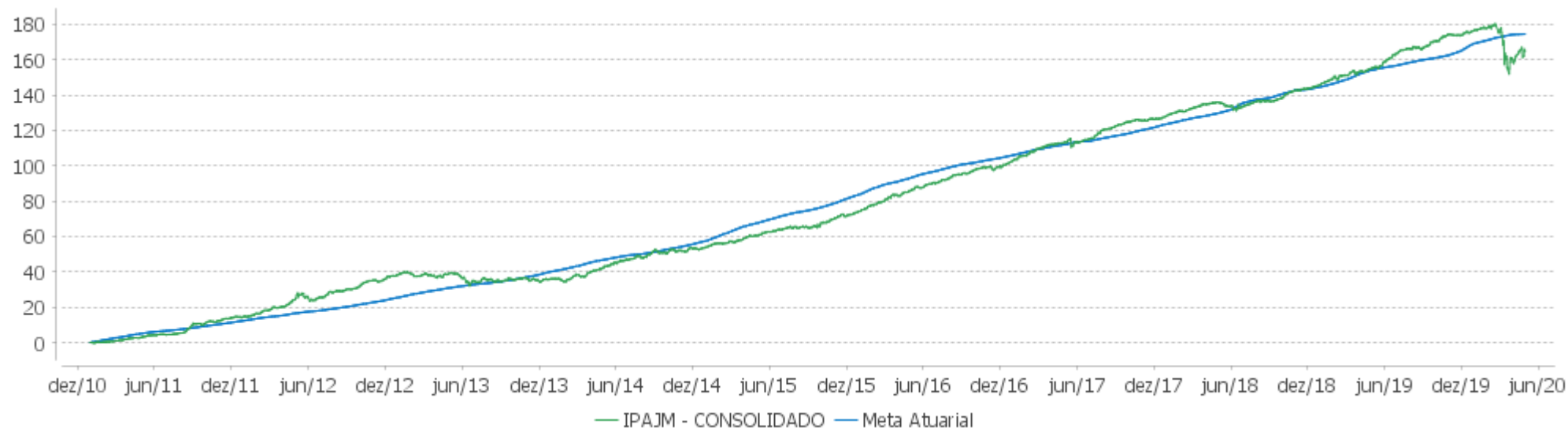
RELATÓRIO TRIMESTRAL

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

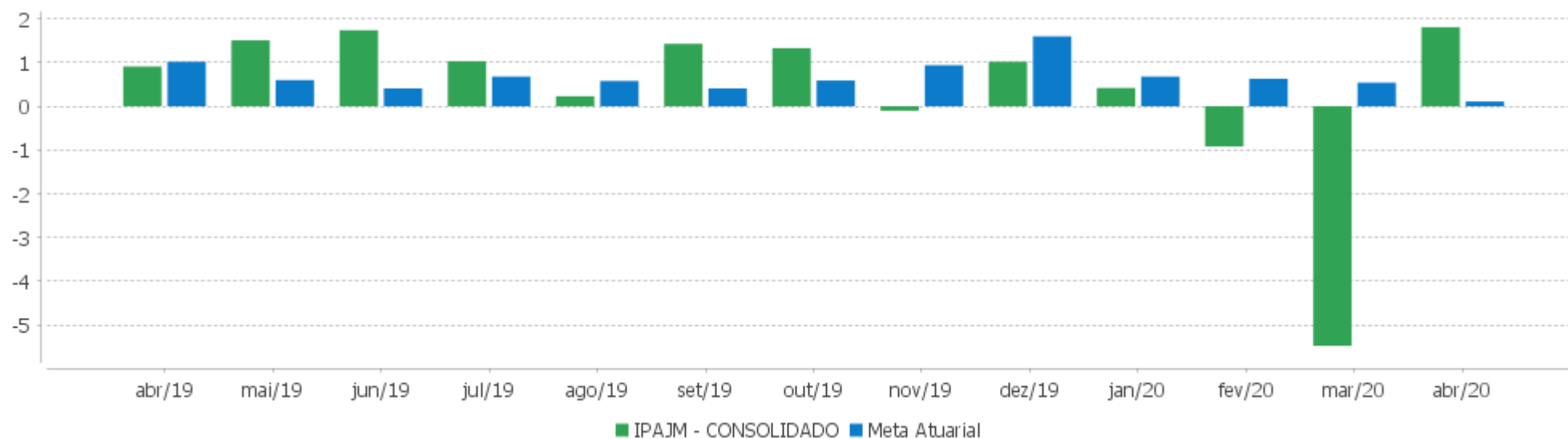
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	58	51,79	03 meses	-4,65	1,18	-5,83	14,54
Meses abaixo da Meta Atuarial	54	48,21	06 meses	-3,38	4,42	-7,80	10,19
			12 meses	3,85	7,89	-4,03	7,25
			24 meses	12,24	19,58	-7,34	5,41
			36 meses	24,37	30,10	-5,73	4,68
			Desde 31/12/2010	164,78	183,89	-19,11	3,65
	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
NTN-B 150820	-0,01	-0,88	-0,86	0,80	4,57	13,05	27,12
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,32	4,20	4,47	6,35	-4,36	-12,86	-12,56
LFT 010921	0,28	1,28	0,90	2,05	5,19	11,87	21,22
NTN-B 150822	0,48	0,14	-0,51	0,97	9,48	21,11	36,86
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,84	5,22	4,81	6,52	0,54	-4,81	-2,82
LFT 010324	0,26	1,25	0,87	2,02	5,16	11,82	
NTN-B 150523	0,83	0,40	-0,28	1,13	11,16	23,87	39,32
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,48	5,48	5,05	6,68	2,23	-2,04	-0,36
NTN-B 150521	0,07	0,00	-0,29	1,44	7,12	16,87	32,30
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,25	5,08	5,04	6,99	-1,82	-9,05	-7,38
NTN-B 150830	1,52	-3,67	-4,78	-5,13	10,39	28,76	43,24
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,20	1,41	0,54	0,42	1,45	2,84	3,56
Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	-1,63	-2,38	-2,72	-1,83	1,21	7,44	16,15
% do CDI	-572,26	-183,42	-295,18	-88,63	23,36	62,73	77,16
Banestes Institucional FI Renda Fixa	2,06	-11,64	-12,28	-13,59	5,28	20,20	33,24
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,75	-6,56	-6,96	-8,04	-3,66	-5,71	-6,44
Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	-1,61	-2,24	-2,62	-1,58	1,44	8,38	17,91
% do CDI	-566,65	-171,96	-284,83	-76,58	27,82	70,64	85,56
Banestes Estrategia FIC de FI Renda Fixa	-1,55	-2,26	-2,86	-1,15	10,27		
% do CDI	-544,18	-173,79	-310,57	-55,67	197,82		
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,26	0,85	0,50	1,55	4,55	11,05	20,15
% do CDI	90,62	65,42	54,23	75,16	87,67	93,13	96,28
Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,05	0,33	0,21	0,61	2,12	5,45	10,72
% do CDI	17,30	25,44	23,15	29,28	40,82	45,97	51,25
BB PREVID RF FLUXO FIC	0,20	0,95	0,67	1,54	4,07	9,49	17,11
% do CDI	69,79	73,32	72,37	74,49	78,35	79,98	81,78
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	0,79	0,42	1,46	4,46	10,92	19,81
% do CDI	1,22	60,96	45,66	70,60	85,97	92,02	94,64
33-BRB TESOIRO	0,18	0,90	0,62	1,48	4,12	9,66	17,26
% do CDI	63,99	69,02	67,13	71,58	79,26	81,43	82,49
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,22	1,02	0,72	1,65	4,31	10,01	17,96
% do CDI	76,58	78,45	77,75	79,67	83,00	84,36	85,82
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	1,25	-5,21	-5,43	-5,77	8,45	25,19	38,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,07	-0,13	-0,10	-0,22	-0,49	-0,73	-0,95
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS P	1,30	-5,25	-5,48	-5,82	8,47	25,17	38,56
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,17	-0,15	-0,27	-0,47	-0,75	-1,12
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,47	-0,18	-0,72	0,68	8,37	18,91	32,52
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,09	-0,08	-0,18	-0,30	-0,56	-0,86
BB PREVID RF IRF-M1	0,41	1,79	1,37	2,51	6,31	13,19	23,04
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,09	-0,07	-0,14	-0,29	-0,53	-0,85
FI CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS P	1,13	2,50	1,65	2,62	11,40	21,56	36,77
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,02	-0,09	-0,05	-0,13	-0,29	-0,51	-0,92
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULO	1,95	-8,95	-8,91	-10,50	7,94	29,14	42,37
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,07	-0,13	-0,06	-0,25	-0,53	-1,18	-1,57
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO	1,44	2,87	1,77	2,71	13,65	25,31	42,67
Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,06	-0,09	-0,05	-0,13	-0,27	-0,49	-0,98
Banestes Previdenciario FI Renda Fixa IMA-B	1,69	-11,10	-11,59	-12,78	7,09	25,47	38,78
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,38	-6,02	-6,26	-7,22	-1,85	-0,45	-0,90
Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1	0,92	3,51	2,77	4,10	11,55	19,86	31,52
Var. IRF-M 1 p.p.	0,47	1,63	1,34	1,45	4,94	6,14	7,63
BB PREV RF IDKA2	0,32	-0,34	-0,72	1,02	6,95	16,67	30,00
Var. IDKA 2 p.p.	-0,25	-0,91	-0,76	-0,78	-1,67	-2,17	-3,46
BB PREV ALOC FIC	0,91	-0,28	-0,76	-0,26	8,60	19,45	31,58
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,07	-0,10	-0,09	-0,29	0,26	0,41	-0,29
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,11	2,43	1,60	2,52	13,47	24,61	36,68
Var. IPCA p.p.	1,42	2,22	1,59	0,63	11,07	17,15	26,25
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	0,43	0,02	-0,44	1,13	7,34	17,02	30,50
Var. IDKA 2 p.p.	-0,15	-0,55	-0,47	-0,67	-1,27	-1,82	-2,96
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS	0,43	1,82	1,39	2,55	6,39	13,32	23,25
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,01	-0,07	-0,04	-0,10	-0,21	-0,40	-0,64
BB PREV IMAB TPB	1,30	-5,12	-5,36	-5,65	8,71	25,32	38,67
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,04	-0,04	-0,09	-0,22	-0,60	-1,01
BB PREV RF IRF-M	1,07	2,47	1,60	2,60	11,40	21,53	36,72
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,08	-0,12	-0,10	-0,16	-0,29	-0,54	-0,97
BB PREV IMA-B5+	1,92	-8,86	-8,90	-10,22	8,35	29,79	42,72
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,10	-0,05	-0,06	0,03	-0,13	-0,53	-1,22
35-BRB MILLENIUM	0,23	1,09	0,75	1,78	4,76	10,94	19,28
% do CDI	79,92	83,47	82,03	85,96	91,65	92,24	92,11
Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	20,45	-21,97	-24,51	-16,17	0,28	20,54	49,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	16,69	6,68	2,99	3,51	7,46	10,16	18,25
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT	11,33	-33,59	-33,92	-21,69	-5,18	2,17	34,95
Var. IBOVESPA p.p.	1,08	-3,20	-4,69	3,23	11,27	8,68	11,86
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	7,24	-25,99	-27,10	-19,26	-7,99	9,76	35,45
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	3,48	2,66	0,40	0,43	-0,81	-0,62	4,69
BB AÇÕES DIVIDENDOS	8,38	-30,43	-30,14	-24,64	-16,90	-6,36	15,49
Var. IBOVESPA p.p.	-1,87	-0,05	-0,91	0,27	-0,45	0,15	-7,60
FIP CAIXA CYRELA	-0,10	10,13	5,03	10,08	2,45	24,86	23,22
Var. IPCA p.p.	0,21	9,91	5,02	8,19	0,05	17,40	12,79
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	6,97	-16,00	-28,48	4,82	23,31	13,78	12,76
Var. IPCA p.p.	7,28	-16,22	-28,49	2,93	20,91	6,32	2,33
FIA BRASIL IBX-50	9,94	-31,68	-30,56	-26,07	-18,29	-11,92	17,24
Var. IBOVESPA p.p.	-0,31	-1,29	-1,33	-1,16	-1,85	-5,40	-5,85
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBOVES	10,14	-30,20	-29,01	-24,69	-16,42	-6,92	21,69
Var. IBOVESPA p.p.	-0,11	0,19	0,22	0,22	0,03	-0,41	-1,40
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	10,01	-30,07	-28,85	-24,61	-16,46	-7,02	21,28
Var. IBOVESPA p.p.	-0,24	0,31	0,38	0,31	-0,01	-0,50	-1,81
BB PREV ACOES GV	10,99	-29,95	-29,18	-23,91	-13,93	-0,75	23,50
Var. IBOVESPA p.p.	0,74	0,43	0,05	1,00	2,51	5,76	0,41
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	15,96	23,85	16,27	32,52	39,65	76,46	116,33
Var. IBOVESPA p.p.	5,71	54,23	45,50	57,44	56,10	82,98	93,24
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	16,38	23,62	20,10	32,88	36,06	66,55	100,95
Var. IBOVESPA p.p.	6,13	54,01	49,33	57,80	52,51	73,07	77,85
CDI	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,93
IBOVESPA	10,25	-30,39	-29,23	-24,92	-16,45	-6,51	23,09
INPC + 6%	0,23	2,23	1,52	5,03	8,63	20,94	30,30
IPCA + 6%	0,15	2,14	1,41	4,83	8,57	20,71	31,43

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	0,45	1,88	1,44	2,65	6,60	13,72	23,89
IRF-M 1+	1,50	2,96	1,83	2,84	13,92	25,80	43,65
IRF-M TOTAL	1,15	2,59	1,70	2,75	11,69	22,07	37,69
IMA-B 5	0,49	-0,09	-0,64	0,86	8,67	19,47	33,38
IMA-B 5+	2,01	-8,82	-8,85	-10,25	8,47	30,32	43,94
IMA-B TOTAL	1,31	-5,08	-5,33	-5,55	8,94	25,91	39,68
IMA-C TOTAL	1,39	0,93	-1,57	0,17	12,99	32,94	49,94
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,84	-0,17	-0,67	0,03	8,34	19,04	31,87
IMA-GERAL TOTAL	0,86	-0,14	-0,69	0,03	8,47	19,43	32,35
IDKA 2	0,57	0,57	0,03	1,79	8,62	18,84	33,46
IDKA 20	1,77	-16,22	-15,05	-18,15	5,61	37,31	48,42
CDI	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,93
Renda Variável							
IBOVESPA	10,25	-30,39	-29,23	-24,92	-16,45	-6,51	23,09
IBRX 100	10,27	-30,14	-29,25	-24,33	-15,12	-4,14	25,76
IBRX 50	10,48	-31,05	-29,73	-25,91	-18,39	-9,72	19,28
SMALL CAP	10,19	-34,07	-34,37	-21,91	-4,59	5,90	40,30
IFIX	4,39	-18,58	-15,39	-6,75	3,79	11,40	27,89
Índice Consumo - ICON	17,67	-24,81	-27,47	-16,35	1,02	9,88	26,19
Índice Dividendos - IDIV	3,76	-28,65	-27,50	-19,68	-7,18	10,38	30,76
Indicadores Econômicos							
IPCA	-0,31	0,22	0,01	1,89	2,40	7,46	10,43
INPC	-0,23	0,31	0,12	2,08	2,46	7,66	9,48
IGPM	0,80	2,50	2,01	4,95	6,69	15,93	18,12
SELIC	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,94
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
01/04/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	198.115,99	9.991,32605418	19,8287983900
01/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	2.752,95	0,00	1.313,45861900	2,0959548780
01/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.566,36	0,00	747,32524800	2,0959548780
02/04/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	1.000,00	50,50645831	19,7994481000
02/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.754,01	0,00	836,76717000	2,0961744930
03/04/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	1.810.000,00	0,00	91.526,55667422	19,7756811300
03/04/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	4.500.000,00	555.185,14283441	8,1054042200
03/04/2020	Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	17.800.000,00	0,00	10.454.280,29352550	1,7026518800
03/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.549,59	0,00	739,18027500	2,0963627580
06/04/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	3.574,46	180,97945602	19,7506395400
06/04/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	187.508,46	0,00	23.133,19071142	8,1056030000
06/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	3.750,87	0,00	1.789,04755800	2,0965736670
06/04/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	192.611,44	0,00	23.762,75275644	8,1056030000
07/04/2020	33-BRB TESOIRO	0,00	3.180,99	806,38213000	3,9447671690
07/04/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	200.931,30	10.184,73259089	19,7286770400
07/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.917,33	0,00	914,42451600	2,0967613680
07/04/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	153.000,00	0,00	18.875,36905370	8,1058017800
07/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	2.773,38	0,00	1.322,69701300	2,0967613680
08/04/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	185.393,95	9.407,19153726	19,7076831300
08/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	7.922,52	0,00	3.778,11626700	2,0969497600
08/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	4.033,96	0,00	1.923,72753800	2,0969497600
09/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	5.153,10	0,00	2.457,14807100	2,0971874100
09/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	3.962,58	0,00	1.889,47348200	2,0971874100
13/04/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	31.424,69	1.600,28635982	19,6369167300
13/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	2.874,27	0,00	1.370,41983500	2,0973645630
13/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	9.067,63	0,00	4.323,34471500	2,0973645630
13/04/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	170.000,00	0,00	91.255,86318900	1,8628940000
14/04/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	15.974,45	816,72747126	19,5590947600

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
14/04/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	3.299.000,00	0,00	406.952,41341933	8,1065989300
14/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.358,18	0,00	647,49474800	2,0975923010
14/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	2.282,33	1.088,07130900	2,0975923010
14/04/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	170.000,00	91.245,92253800	1,8630970000
14/04/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	170.000,00	0,00	46.302,58850500	3,6715010000
15/04/2020	33-BRB TESOIRO	0,00	1.150,04	291,40640000	3,9465158130
15/04/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	60.457,60	3.099,59138419	19,5050226000
15/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	3.187,29	0,00	1.519,34954700	2,0977990250
15/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	7.843,20	0,00	3.738,77569100	2,0977990250
16/04/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	5.789.293,53	0,00	296.824,22316668	19,5041141500
16/04/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	101.019,07	5.179,37237461	19,5041141500
16/04/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	4.555.253,00	561.891,44575309	8,1069983100
16/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	20.398,71	0,00	9.722,88490800	2,0980100240
16/04/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	181.321,57	80.147,91534800	2,2623366960
16/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	25.719,88	0,00	12.259,17879500	2,0980100240
17/04/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	96.202,79	4.931,69016864	19,5070628300
17/04/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	23.953.295,67	0,00	2.954.571,37165411	8,1071981900
20/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	6.305,59	0,00	3.004,90130400	2,0984349770
20/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	804,91	0,00	383,57633600	2,0984349770
22/04/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	9.006,80	461,61004426	19,5117071500
22/04/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	96.535,12	0,00	11.906,74604574	8,1075988000
23/04/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	2.415.460,63	297.918,15815313	8,1077992900
23/04/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	187.559,27	23.133,19071142	8,1077992900
23/04/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	3.299.488,49	406.952,41341933	8,1077992900
23/04/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	12.168.929,17	1.500.891,76204134	8,1077992900
23/04/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	85.210,20	37.621,11014200	2,2649570860
23/04/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	523.095,66	230.951,68700300	2,2649570860
23/04/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	4.500.000,00	0,00	555.021,13906922	8,1077992900
23/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	3.544,74	1.688,89380300	2,0988531030
24/04/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	901.519,58	0,00	111.188,89972893	8,1079998300

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
24/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.258,95	0,00	599,76463500	2,0990734120
27/04/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	751.616,51	38.521,28101143	19,5117215800
27/04/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	132.460.000,00	0,00	16.336.547,11128480	8,1082005333
27/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	8.628,61	0,00	4.110,27008100	2,0992805410
27/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	4.949,90	0,00	2.357,90305400	2,0992805410
28/04/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	465.840,23	23.849,59793822	19,5324143900
29/04/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	807.377,04	41.311,79162324	19,5435009800
29/04/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	117.773.292,12	14.524.486,28859250	8,1086029330
29/04/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	901.586,64	111.188,89972893	8,1086029300
29/04/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	11.787.310,75	1.453.679,60961277	8,1086029300
29/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	635,69	0,00	302,75381000	2,0996928110
29/04/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.134.712,19	941.927,33115300	2,2663236530
29/04/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	48.743,95	6.011,38666694	8,1086029300
29/04/2020	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	0,00	5.424.965,26	669.038,21839909	8,1086029300
29/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	81.728,02	38.923,79855500	2,0996928110
29/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.399,37	0,00	666,46415700	2,0996928110
30/04/2020	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	0,00	100,00	5,11480647	19,5510818800
30/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.915,56	0,00	912,21387300	2,0999022880
30/04/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.765,62	0,00	840,81055100	2,0999022880

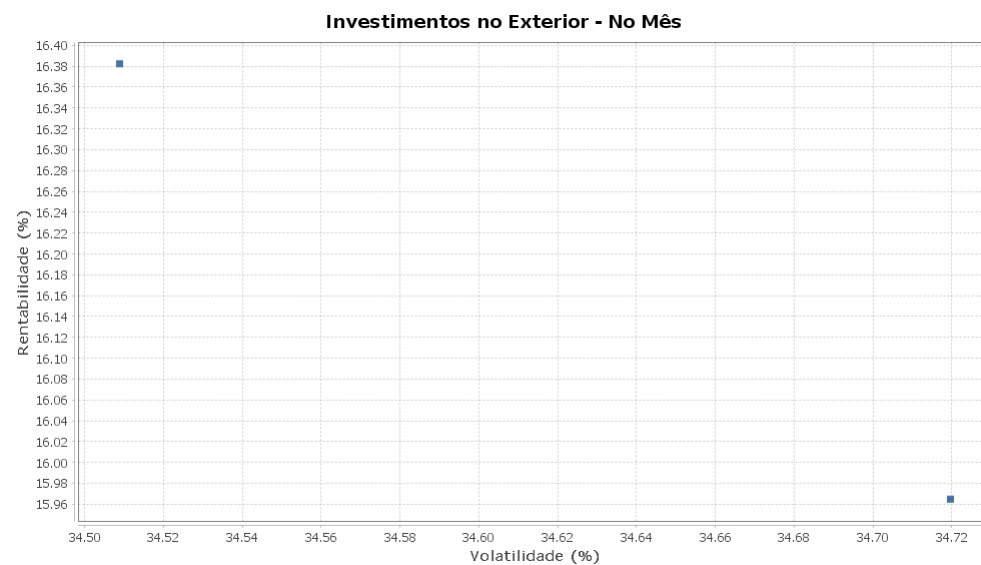
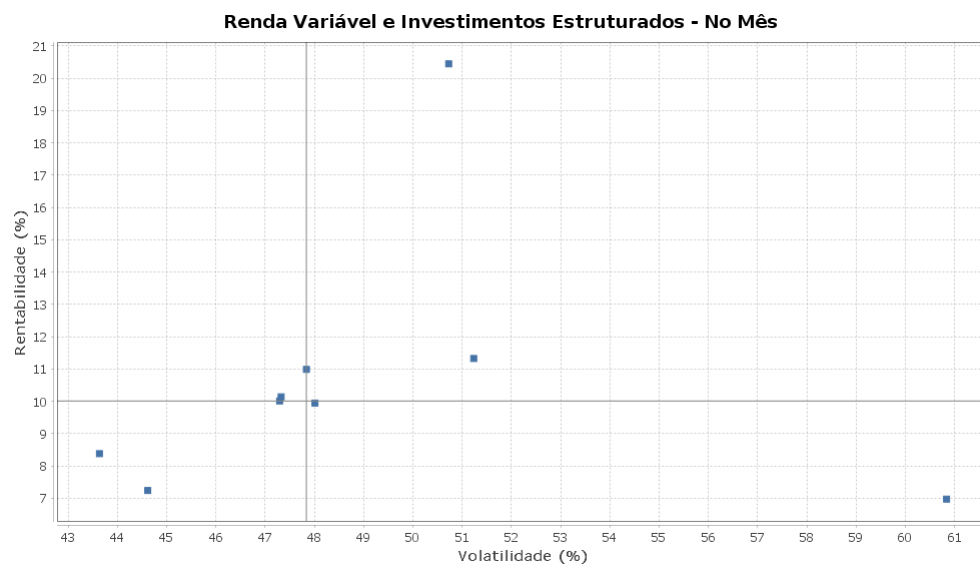
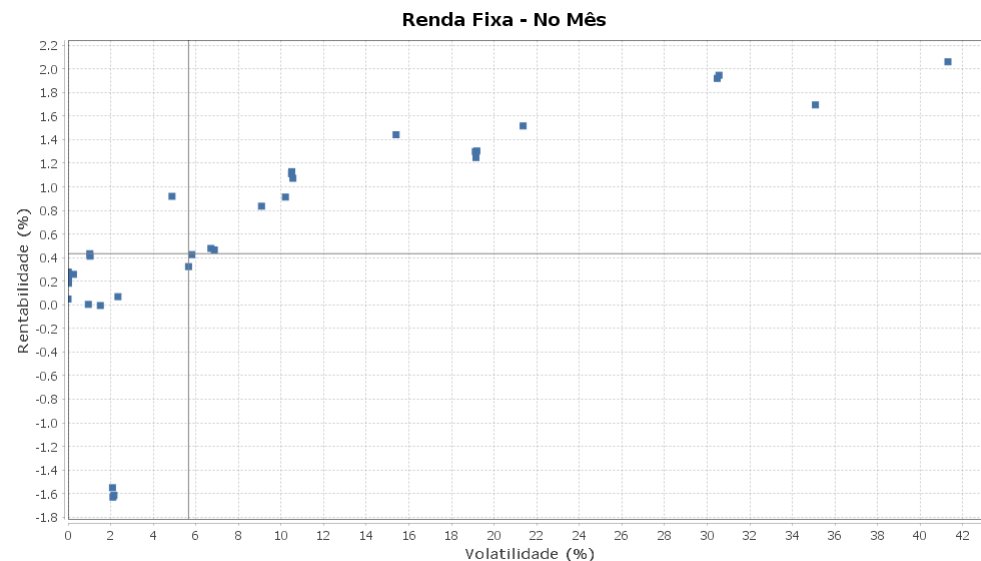
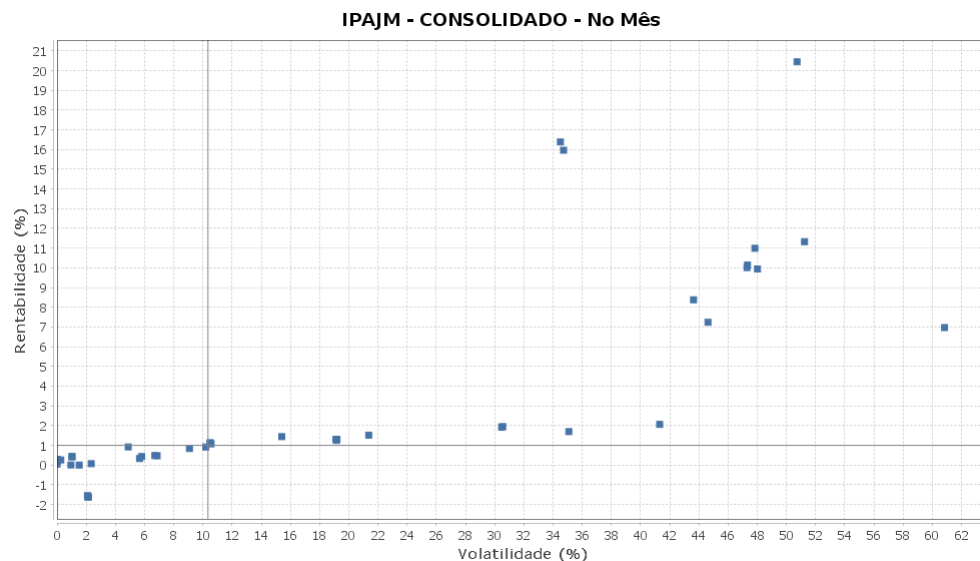
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rendimentos Realizados

Artigo	Ativo	Quantidade	Valor Aplicação	Valor Resgate	Rendimento
Artigo 7º IV, Alínea a	33-BRB TESOIRO	1.097,788530	4.314,69	4.331,03	16,34
Artigo 7º IV, Alínea a	BB PREVID RF FLUXO FIC	41.700,763667	87.139,76	87.555,10	415,34
Artigo 7º IV, Alínea a	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.290.648,043646	2.805.190,77	2.924.339,62	119.148,85
Artigo 7º IV, Alínea a	Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	20.110.376,515913	163.045.184,60	163.062.589,28	17.404,68
Artigo 7º IV, Alínea a	Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	149.591,799279	2.991.635,92	2.928.034,88	-63.601,04
Artigo 7º IV, Alínea a	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	91.245,922538	169.981,45	170.000,01	18,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Banestes Investidor Automatico FI Renda Fixa Curto	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,00	0,05	22.469.663,74	0,50
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,01	0,22	38,12	0,00
LFT 010921	Artigo 7º I, Alínea a	0,01	0,01	0,28	234.520.328,83	5,19
BB PREVID RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,01	0,20	330.657,75	0,01
35-BRB MILLENIUM	Artigo 7º I, Alínea b	0,02	0,01	0,23	1.259.621,16	0,03
33-BRB TESOURO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,18	17.579,97	0,00
LFT 010324	Artigo 7º I, Alínea a	0,03	0,02	0,26	111.233.132,03	2,46
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,25	0,04	0,26	316.387.645,06	7,00
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,95	0,10	0,00	94.088.012,81	2,08
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS	Artigo 7º I, Alínea b	1,02	0,13	0,43	39.948.290,79	0,88
BB PREVID RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	1,03	0,13	0,41	286.020.980,75	6,32
NTN-B 150820	Artigo 7º I, Alínea a	1,52	0,16	-0,01	33.426.878,96	0,74
Banestes Estrategia FIC de FI Renda Fixa	Artigo 7º IV, Alínea a	2,08	0,14	-1,55	7.062.891,01	0,16
Banestes VIP DI FIC Renda Fixa Referenciado DI	Artigo 7º IV, Alínea a	2,11	0,14	-1,63	30.818.559,77	0,68
Banestes Liquidez FI Renda Fixa Referenciado DI	Artigo 7º IV, Alínea a	2,15	0,14	-1,61	167.553.663,24	3,70
NTN-B 150521	Artigo 7º I, Alínea a	2,34	0,25	0,07	318.150.335,34	7,03
Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1	Artigo 7º I, Alínea b	4,88	0,55	0,92	16.126.319,45	0,36
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	5,66	0,60	0,32	28.297.778,89	0,63
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,81	0,62	0,43	31.689.019,82	0,70
NTN-B 150822	Artigo 7º I, Alínea a	6,71	0,72	0,48	398.232.416,34	8,81
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,87	0,73	0,47	33.187.582,17	0,73
NTN-B 150523	Artigo 7º I, Alínea a	9,08	0,98	0,83	75.063.729,22	1,66
BB PREV ALOC FIC	Artigo 7º I, Alínea b	10,20	1,10	0,91	643.505.251,98	14,23
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	10,49	1,14	1,11	679.712.077,03	15,03
FI CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS P	Artigo 7º I, Alínea b	10,50	1,14	1,13	35.967.837,86	0,80
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	10,56	1,15	1,07	48.836.640,51	1,08
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO	Artigo 7º I, Alínea b	15,40	1,67	1,44	20.351.043,63	0,45
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	19,12	2,05	1,30	12.998.647,40	0,29
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	19,15	2,05	1,25	1.938.128,68	0,04
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS P	Artigo 7º I, Alínea b	19,19	2,05	1,30	13.138.132,57	0,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150830	Artigo 7º I, Alínea a	21,36	2,29	1,52	110.668.173,48	2,45
BB PREV IMA-B5+	Artigo 7º I, Alínea b	30,47	3,25	1,92	7.052.288,81	0,16
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULO	Artigo 7º I, Alínea b	30,55	3,26	1,95	10.069.611,21	0,22
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	34,51	4,33	16,38	20.337.926,50	0,45
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	34,72	4,34	15,96	79.901.729,35	1,77
Banestes Previdenciario FI Renda Fixa IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	35,08	3,72	1,69	32.422.976,92	0,72
Banestes Institucional FI Renda Fixa	Artigo 7º IV, Alínea a	41,30	4,38	2,06	30.221.869,38	0,67
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	43,63	4,92	8,38	106.918.729,65	2,36
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	44,62	4,97	7,24	25.286.562,21	0,56
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	47,30	5,38	10,01	7.443.700,53	0,16
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBOVES	Artigo 8º I, Alínea a	47,32	5,39	10,14	43.049.577,76	0,95
BB PREV ACOES GV	Artigo 8º I, Alínea a	47,84	5,48	10,99	80.042.710,04	1,77
FIA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	48,01	5,45	9,94	116.144.755,00	2,57
Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	Artigo 8º II, Alínea a	50,73	6,19	20,45	4.169.378,05	0,09
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT	Artigo 8º II, Alínea a	51,24	5,85	11,33	117.525.396,62	2,60
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	Artigo 8º IV, Alínea b	60,84	6,64	6,97	25.031.200,00	0,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 15,18% 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 15,78% 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;