



IPAJM - ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

OUTUBRO 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 15.12.2020.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA **84,40%**

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830	13,89	0,17	1,37	113.736.373,07	2,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822	4,97	0,51	5,97	410.569.229,29	8,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	6,15	-0,35	5,35	76.729.645,82	1,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150521	2,10	0,92	4,77	324.145.971,09	6,72
TESOURO NACIONAL	LFT 010324	0,58	0,16	1,95	112.003.122,62	2,32
TESOURO NACIONAL	LFT 010921	0,11	0,17	2,39	247.805.429,95	5,14
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		3,43	0,44	4,10	1.284.989.771,84	26,64

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	6,05	-0,31	3,99	49.563.395,77	1,03	4.799.950.020,87	1,03
BRB	BRB	35-BRB MILLENIUM	0,37	0,17	1,69	1.389.377,76	0,03	42.069.211,75	3,30
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	23,41	0,92	-9,01	33.184.464,13	0,69	273.991.442,96	12,11
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,56	0,11	2,94	304.289.464,86	6,31	7.887.722.403,08	3,86
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,77	0,20	-0,73	25.336.046,59	0,53	5.529.359.748,67	0,46
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,83	0,19	-0,81	13.753.472,41	0,29	5.818.645.931,87	0,24
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,55	0,14	3,11	40.456.582,63	0,84	11.237.812.745,76	0,36
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,03	0,18	4,48	34.735.139,04	0,72	18.309.382.329,52	0,19
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,19	0,33	4,89	41.841.348,27	0,87	7.253.634.171,13	0,58
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,71	0,20	-4,62	7.380.141,23	0,15	1.936.566.655,94	0,38
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,82	0,22	-4,61	10.548.800,78	0,22	1.789.450.540,00	0,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	8,97	-0,56	4,57	20.687.846,07	0,43	3.143.067.959,97	0,66
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,13	0,15	5,00	33.266.967,53	0,69	9.550.097.040,26	0,35
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,03	-0,36	4,04	36.506.531,74	0,76	9.226.615.794,13	0,40
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	4,30	-0,35	4,76	1.403.756,75	0,03	192.524.615,09	0,73
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,26	-0,07	1,78	656.797.802,03	13,62	9.938.464.189,22	6,61
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	-0,11	4,42	692.872.462,38	14,37	13.635.004.724,81	5,08
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			5,14	-0,03	2,81	2.004.013.599,97	41,55		

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	12,75	0,20	-0,79	2.028.541,83	0,04	2.817.438.384,20	0,07
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,75	0,20	-0,79	2.028.541,83	0,04		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,07	0,07	0,48	37.824,25	0,00	95.342.305,05	0,04
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,94	-0,02	-0,67	14.474.156,09	0,30	325.295.283,02	4,45
BRB	BRB	33-BRB TESOUREO	0,37	0,12	1,19	2.583,19	0,00	212.802.977,03	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,04	0,02	0,46	90.407.030,76	1,87	920.878.445,49	9,82
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,36	0,12	1,89	130.701.570,26	2,71	4.647.429.126,31	2,81
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	26,58	0,99	-9,64	30.903.729,98	0,64	266.751.360,36	11,59
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,23	0,16	1,98	319.986.776,95	6,63	2.401.972.433,04	13,32
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	0,06	1,48	244.554,47	0,01	1.611.170.285,08	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,07	-0,35	0,98	5,76	0,00	622.243.810,38	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,93	0,03	-0,37	185.827.141,80	3,85	2.005.878.357,97	9,26
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,78	0,17	-1,46	7.120.494,72	0,15	183.656.652,38	3,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
		Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a	1,29	0,13	0,45	779.705.868,23	16,17		
		Renda Fixa	3,69	0,15	2,79	4.070.737.781,87	84,40		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

12,83%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA BRASIL IBX-50	45,64	-0,87	-19,55	136.750.647,57	2,84	1.041.103.761,67	13,14
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	44,95	-0,82	-18,46	93.182.915,14	1,93	897.089.282,83	10,39
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	43,53	-0,80	-18,74	8.649.734,91	0,18	109.890.635,80	7,87
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	44,29	-0,74	-18,75	62.224.390,06	1,29	629.629.945,87	9,88
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			45,08	-0,82	-19,11	300.807.687,68	6,24		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	38,79	-1,45	-24,73	115.676.210,61	2,40	871.977.000,93	13,27
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,50	0,05	-17,54	28.172.671,26	0,58	793.160.820,76	3,55
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	48,35	-2,40	-22,29	137.521.937,11	2,85	1.154.693.546,75	11,91
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	45,61	-1,72	-5,70	5.213.624,70	0,11	158.100.669,26	3,30
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			42,93	-1,77	-22,32	286.584.443,68	5,94		

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	22,63	-0,14	-10,50	1.634.113,40	0,03	127.132.151,28	1,29
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			22,63	-0,14	-10,50	1.634.113,40	0,03		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	48,27	-19,09	8,78	29.800.000,00	0,62	152.680.290,96	19,52
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			48,27	-19,09	8,78	29.800.000,00	0,62		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			41,20	-2,33	-19,20	618.826.244,76	12,83		
---	--	--	-------	-------	--------	----------------	-------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,77%

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	29,24	-1,77	50,05	109.794.625,31	2,28	1.678.449.679,91	6,54
BB	BB	BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	28,76	-1,87	43,32	23.578.075,38	0,49	477.332.700,33	4,94
Sub-total Artigo 9º A, III			29,06	-1,79	48,69	133.372.700,69	2,77		
Investimentos no Exterior			29,06	-1,79	48,69	133.372.700,69	2,77		
Total			7,73	-0,22	-0,05	4.822.936.727,32	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	1.284.989.771,84	26,64	20,00	27,00	60,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	2.004.013.599,97	41,55	15,00	36,30	60,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	2.028.541,83	0,04	0,00	0,10	2,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	779.705.868,23	16,17	5,00	10,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	4.070.737.781,87	84,40				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alinea a	Fundos de Ações Referenciados	300.807.687,68	6,24	0,00	6,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	286.584.443,68	5,94	0,00	5,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	1.634.113,40	0,03	0,00	0,10	2,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	29.800.000,00	0,62	0,00	0,50	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	618.826.244,76	12,83				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	133.372.700,69	2,77	0,00	4,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	133.372.700,69	2,77				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

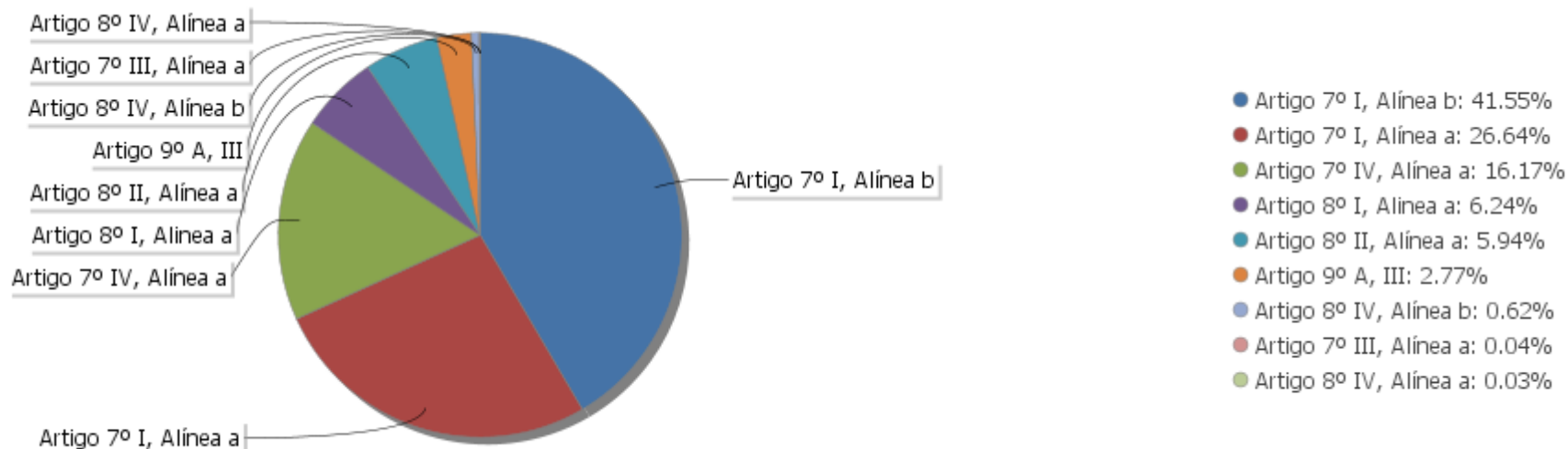
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,44 278,50	4,10 168,38	0,86 181,85	4,04 360,21	4,89 152,31	5.592.996,81	52.307.940,98
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,03 -17,41	2,81 115,53	-1,23 -260,03	2,04 181,48	3,11 96,83	-547.713,03	58.121.714,29
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,20 124,50	-0,79 -32,45	-3,17 -668,25	4,66 415,96	-1,37 -42,81	3.956,72	-16.163,69
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,13 85,87	0,45 18,48	0,02 4,60	1,28 114,54	0,98 30,41	1.059.380,82	3.787.756,88
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,82 -0,14	-19,11 -0,35	-8,81 -0,10	17,05 0,34	-12,51 -0,14	-2.497.064,59	-72.514.188,82
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,77 -1,08	-22,32 -3,56	-9,22 -0,51	12,87 -3,83	-13,28 -0,91	-5.170.328,81	-84.155.136,87
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,14 0,55	-10,50 8,26	-0,52 8,19	-18,73 -35,43	-10,66 1,71	-2.310,94	-256.256,35
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-19,09 -18,40	8,78 27,54	-12,69 -3,98	23,96 7,26	38,65 51,03	-7.058.000,00	2.553.000,00
Artigo 9º A, III % do CDI	-1,79 -1.139,83	48,69 1.998,61	10,66 2.245,22	20,11 1.793,02	59,24 1.844,84	-2.429.788,19	37.769.169,11
IPAJM - CONSOLIDADO (Total)						-11.048.871,21	-2.402.164,47

Análise de Liquidez

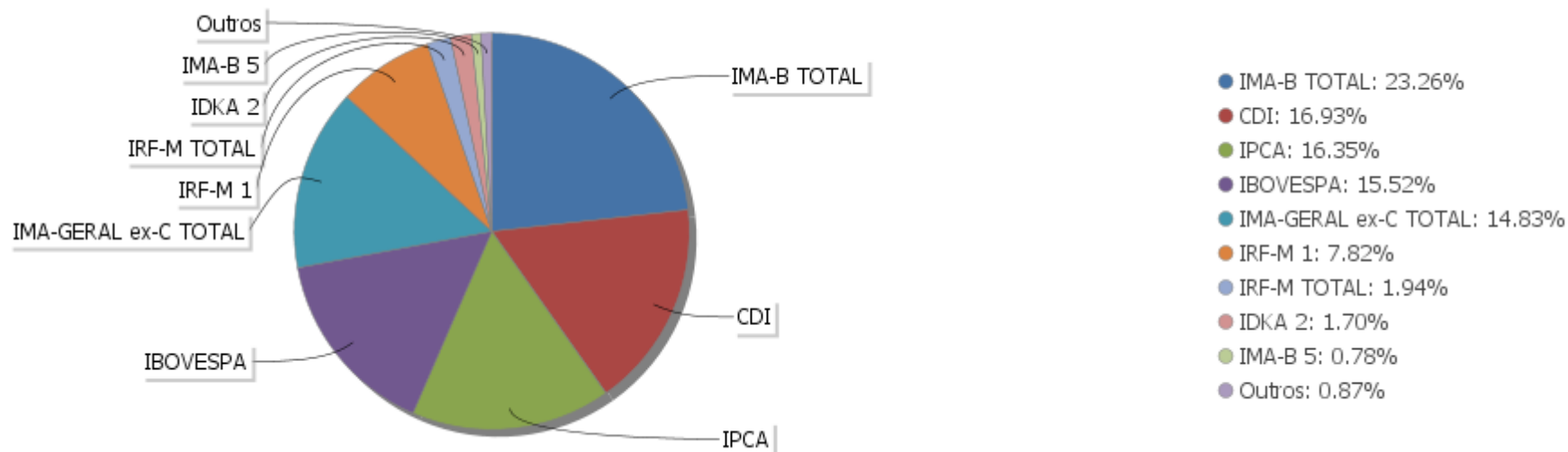
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	3.504.560.659,52	72,66	3.504.560.659,52	72,66
de 31 a 364 dias	605.337.697,00	12,55	4.109.898.356,52	85,22
acima de 365 dias	713.038.370,80	14,78	4.822.936.727,32	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

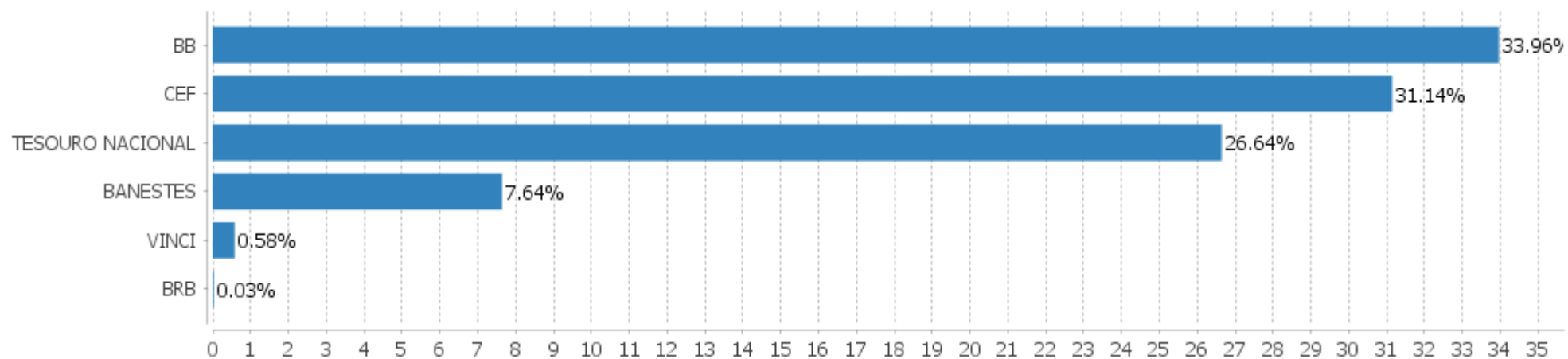


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

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

PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

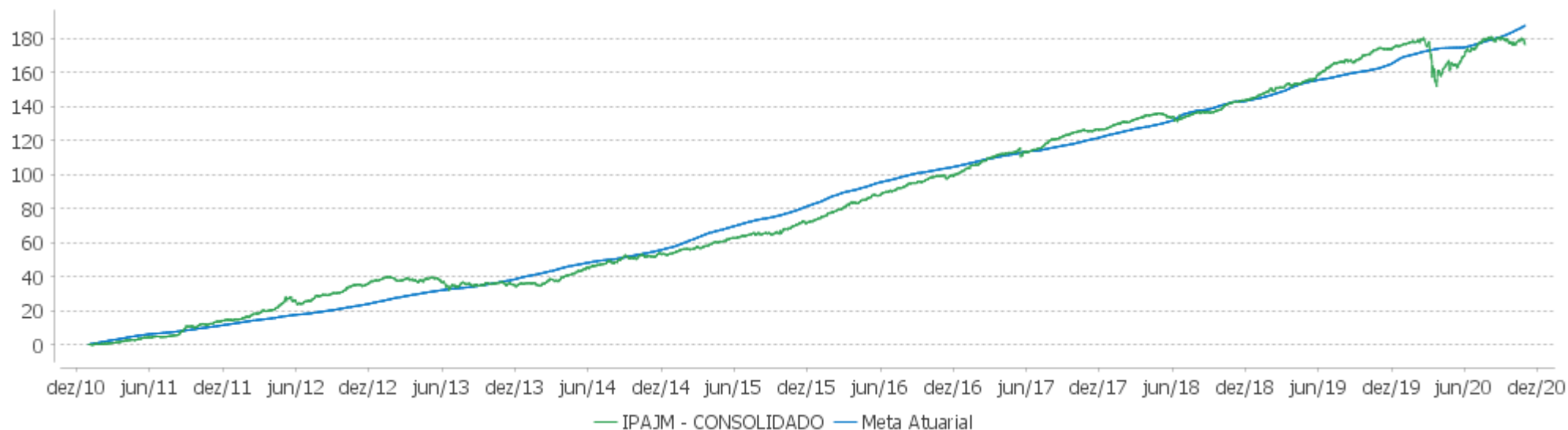
RELATÓRIO TRIMESTRAL

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

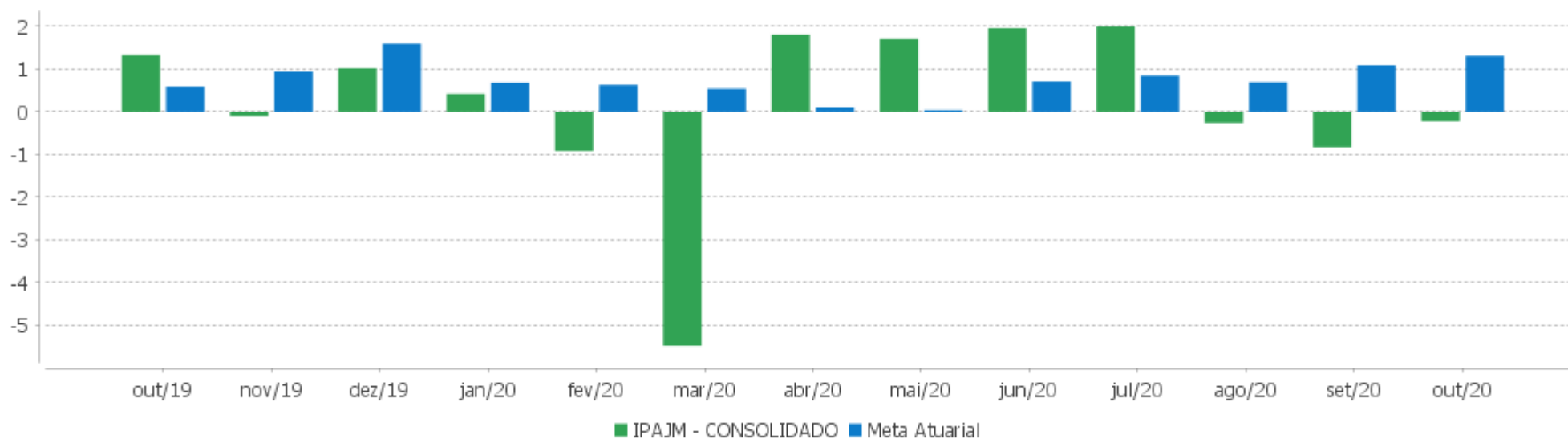
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	61	51,69	03 meses	-1,30	3,00	-4,30	4,13
Meses abaixo da Meta Atuarial	57	48,31	06 meses	4,39	4,53	-0,14	4,14
			12 meses	0,86	9,16	-8,29	7,73
			24 meses	14,01	18,12	-4,11	5,62
			36 meses	22,47	30,60	-8,13	4,76
			Desde 31/12/2010	176,41	196,76	-20,35	3,68
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	4,20	2011-08					
Menor rentabilidade da Carteira	-5,48	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,20 -0,02	-0,79 -0,28	-3,17 -0,09	4,66 -0,15	-1,37 -0,37	24,61 -0,86	37,33 -1,06
LFT 010921	0,17	2,39	0,44	1,09	3,17	9,59	16,77
NTN-B 150822 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,51 0,30	5,97 6,48	1,58 4,66	5,83 1,01	6,85 7,86	23,59 -1,88	35,60 -2,78
LFT 010324	0,16	1,95	0,03	0,69	2,73	9,13	
NTN-B 150523 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,35 -0,56	5,35 5,86	0,04 3,11	4,93 0,12	6,11 7,12	24,68 -0,79	37,00 -1,39
NTN-B 150521 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,92 0,71	4,77 5,28	2,44 5,52	4,77 -0,05	6,27 7,28	18,31 -7,16	29,62 -8,77
NTN-B 150830 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,17 -0,04	1,37 1,88	-3,61 -0,54	5,23 0,41	-0,18 0,83	28,20 2,73	42,35 3,96
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,99 0,78	-9,64 -9,13	-7,50 -4,43	2,26 -2,56	-11,64 -10,63	20,12 -5,35	29,19 -9,20
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	-0,02 -13,86	-0,67 -27,64	0,42 88,81	1,75 156,29	-0,11 -3,44	6,07 63,09	12,83 76,42
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,03 20,33	-0,37 -14,99	0,58 122,66	1,91 170,58	0,30 9,36	6,81 70,85	14,35 85,48
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	0,17 109,35	-1,46 -60,01	-1,98 -417,96	0,82 72,72	-0,34 -10,71	18,19 189,13	
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,16 101,53	1,98 81,34	0,36 76,91	1,12 100,00	2,69 83,84	8,87 92,26	15,98 95,19
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,06 35,66	1,48 60,70	0,13 27,58	0,52 46,41	2,07 64,40	7,24 75,26	13,03 77,62
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO % do CDI	0,02 10,01	0,46 18,73	0,06 11,69	0,13 11,16	0,73 22,76	3,86 40,18	7,47 44,48
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,12 76,62	1,89 77,49	0,26 55,37	1,09 96,90	2,56 79,77	8,75 91,05	15,66 93,26
33-BRB TESOIRO % do CDI	0,12 78,01	1,19 49,04	-0,07 -15,70	0,29 26,28	1,78 55,38	7,15 74,35	12,91 76,91
FI BANESTES INVEST MONEY RF % do CDI	0,07 44,62	1,56 64,08	0,21 44,87	0,60 53,47	2,15 66,95	7,32 76,17	13,12 78,13
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,09	1,73	0,26	0,70	2,36	7,80	13,92

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	55,36	70,85	55,74	62,32	73,40	81,13	82,88
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,19 -0,02	-0,81 -0,30	-3,15 -0,07	4,68 -0,13	-1,41 -0,40	24,69 -0,78	37,24 -1,15
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,18 -0,02	4,48 -0,24	0,41 -0,09	4,66 -0,15	5,38 -0,33	19,69 -0,58	30,54 -0,92
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,11 -0,05	2,94 -0,34	0,24 -0,19	1,13 -0,25	3,67 -0,39	10,79 -0,70	18,38 -0,98
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,36 -0,03	4,04 -0,23	-1,73 -0,10	1,50 -0,14	4,16 -0,28	19,08 -0,70	30,28 -0,80
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	0,22 -0,00	-4,61 -0,27	-5,99 -0,06	4,76 -0,14	-6,25 -0,40	27,85 -1,13	41,32 -1,69
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,56 0,05	4,57 -0,19	-2,69 -0,06	1,65 -0,09	4,41 -0,22	22,74 -0,67	35,49 -0,71
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,92 0,70	-9,01 -8,50	-7,58 -4,50	2,35 -2,47	-10,73 -9,72	23,19 -2,27	34,63 -3,75
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	-0,35 -0,51	4,76 1,47	-0,75 -1,19	1,20 -0,17	5,35 1,29	17,23 5,74	26,57 7,20
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,33 0,29	4,89 -0,56	1,13 0,04	5,25 0,40	6,32 -0,41	18,19 -1,41	28,86 -2,40
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,07 -0,07	1,78 -0,17	-1,70 -0,31	2,07 -0,07	1,80 -0,37	17,32 0,22	27,46 0,26
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,11 -0,97	4,42 2,20	-1,16 -2,91	1,94 -0,06	4,51 0,59	23,65 17,10	32,48 21,07
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,15 0,12	5,00 -0,45	0,98 -0,11	4,98 0,13	6,16 -0,57	18,25 -1,35	29,01 -2,25
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,31 0,01	3,99 -0,28	-1,76 -0,13	1,49 -0,15	4,12 -0,31	19,16 -0,62	30,15 -0,92
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,20 -0,02	-0,73 -0,23	-3,19 -0,11	4,62 -0,19	-1,29 -0,28	24,83 -0,64	37,31 -1,07
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,14 -0,02	3,11 -0,17	0,37 -0,06	1,27 -0,10	3,85 -0,21	11,05 -0,44	18,71 -0,65
35-BRB MILLENIUM % do CDI	0,17 108,82	1,69 69,23	0,07 14,98	0,59 53,05	2,38 74,18	8,41 87,52	14,88 88,63
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	0,20 -0,02	-4,62 -0,28	-6,05 -0,12	4,65 -0,25	-6,05 -0,20	28,32 -0,66	41,82 -1,20
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	-1,72	-5,70	-5,04	20,85	1,31	39,71	62,86

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.	-2,37	14,86	3,60	9,52	11,89	15,21	31,90
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-2,40	-22,29	-9,46	17,01	-8,36	26,57	31,88
Var. IBOVESPA p.p.	-1,72	-3,53	-0,75	0,31	4,01	19,10	5,45
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	0,05	-17,54	-8,51	11,41	-10,04	27,58	34,92
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,60	3,02	0,13	0,08	0,54	3,08	3,96
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-1,45	-24,73	-9,28	8,19	-18,47	2,43	13,58
Var. IBOVESPA p.p.	-0,77	-5,97	-0,58	-8,51	-6,10	-5,04	-12,86
FIP CAIXA CYRELA	-0,14	-10,50	-0,52	-18,73	-10,54	-8,67	0,82
Var. IPCA p.p.	-1,00	-12,71	-2,27	-20,72	-14,46	-15,23	-10,59
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	-0,74	-18,75	-8,66	16,40	-12,35	7,01	25,13
Var. IBOVESPA p.p.	-0,05	0,01	0,05	-0,31	0,03	-0,45	-1,30
FIA BRASIL IBX-50	-0,87	-19,55	-8,84	17,74	-12,96	3,63	19,94
Var. IBOVESPA p.p.	-0,18	-0,80	-0,13	1,04	-0,58	-3,84	-6,50
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	-0,80	-18,74	-8,63	16,20	-12,40	6,68	24,45
Var. IBOVESPA p.p.	-0,11	0,02	0,07	-0,50	-0,02	-0,79	-1,98
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-0,82	-18,46	-8,89	16,42	-11,42	11,13	26,93
Var. IBOVESPA p.p.	-0,13	0,30	-0,19	-0,29	0,95	3,66	0,49
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	-19,09	8,78	-12,69	23,96	38,65	82,52	69,21
Var. IPCA p.p.	-19,95	6,57	-14,44	21,97	34,73	75,97	57,80
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-1,77	50,05	10,87	21,16	60,56	94,90	135,92
Var. IBOVESPA p.p.	-1,08	68,81	19,57	4,46	72,93	87,43	109,48
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	-1,87	43,32	9,75	15,93	54,05	75,70	119,04
Var. IBOVESPA p.p.	-1,18	62,08	18,46	-0,77	66,43	68,23	92,61
IPAJM - CONSOLIDADO	-0,22	-0,05	-1,30	4,39	0,86	14,01	22,47
Var. IPCA + 5,5% p.p.	-1,53	-6,91	-4,42	-0,39	-8,72	-4,54	-8,24
CDI	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,79
IBOVESPA	-0,69	-18,76	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44
INPC + 6%	1,38	8,05	3,63	5,69	11,01	20,67	32,97
IPCA + 6%	1,35	7,28	3,24	5,03	10,10	19,67	32,57

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	0,16	3,29	0,43	1,38	4,06	11,49	19,36
IRF-M 1+	-0,61	4,76	-2,63	1,75	4,63	23,41	36,20
IRF-M TOTAL	-0,33	4,27	-1,63	1,64	4,44	19,78	31,08
IMA-B 5	0,20	4,72	0,50	4,81	5,71	20,28	31,47
IMA-B 5+	0,22	-4,35	-5,92	4,90	-5,85	28,98	43,02
IMA-B TOTAL	0,21	-0,51	-3,08	4,81	-1,00	25,47	38,38
IMA-C TOTAL	2,81	21,09	8,08	19,98	20,18	45,58	72,54
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,00	1,96	-1,39	2,13	2,16	17,10	27,20
IMA-GERAL TOTAL	0,09	2,49	-1,11	2,64	2,67	17,87	28,36
IDKA 2	0,04	5,45	1,09	4,85	6,73	19,60	31,26
IDKA 20	0,68	-11,22	-9,64	5,97	-13,27	34,55	50,97
CDI	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,79
Renda Variável							
IBOVESPA	-0,69	-18,76	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44
IBRX 100	-0,55	-17,87	-8,31	17,55	-11,05	11,01	29,92
IBRX 50	-0,54	-18,50	-8,37	18,20	-12,42	5,25	23,91
SMALL CAP	-2,28	-20,78	-8,74	20,16	-6,17	34,08	41,52
IFIX	-1,01	-13,47	1,23	6,27	-0,90	23,38	24,28
Índice Consumo - ICON	-2,86	-11,86	-8,08	17,23	-1,94	42,20	27,52
Índice Dividendos - IDIV	0,65	-20,56	-8,64	11,34	-10,58	24,50	30,96
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,86	2,22	1,75	1,99	3,92	6,55	11,41
INPC	0,89	2,95	2,13	2,63	4,77	7,45	11,75
IGPM	3,23	18,10	10,67	15,22	20,93	24,74	38,21
SELIC	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,80
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
843	01/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	11.801,70	1.453,81636114	8,1177377800
844	01/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.414,36	0,00	1.618,78976093	2,1092053350
845	01/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.990,44	0,00	943,69190470	2,1092053350
846	02/10/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	158.408,17	7.945,37587435	19,9371524400
847	02/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.158,02	0,00	1.497,85772793	2,1083577840
848	02/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	12.282,64	0,00	5.825,69054134	2,1083577840
849	02/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	14.542.342,79	1.791.414,33536131	8,1177997200
850	05/10/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	211.174,43	10.591,64383487	19,9378333800
851	05/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.560,04	0,00	740,31115756	2,1072760880
852	05/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	4.695,24	0,00	2.228,10861222	2,1072760880
853	05/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	9.300.000,00	0,00	1.145.621,88640990	8,1178616700
854	05/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	16.030.000,00	0,00	1.974.657,93969362	8,1178616700
855	06/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.273,12	0,00	1.553,73654904	2,1066119620
856	07/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	4.657,46	0,00	2.209,93653451	2,1075084860
857	07/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.600,40	0,00	759,38009770	2,1075084860
858	07/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	137.348,62	0,00	16.919,05135464	8,1179858800
859	08/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	8.623,92	0,00	4.091,72420880	2,1076493820
891	08/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	5.250,80	0,00	2.491,30621290	2,1076493820
860	09/10/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	126.174,54	6.327,53275004	19,9405589800
861	09/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	11.245,59	5.333,10641654	2,1086378410
862	09/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	529,12	0,00	250,92976599	2,1086378410
863	09/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	67.092,81	8.264,58479002	8,1181101900
889	09/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.756,26	0,00	832,88840115	2,1086378410
864	13/10/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	12.578,81	630,79511270	19,9411976200
865	13/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	4.521,16	0,00	2.142,05973626	2,1106600920
866	13/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	15.674,38	0,00	7.426,29287369	2,1106600920
867	13/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	709.403,54	0,00	87.384,68538753	8,1181678100
868	13/10/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	140.000,00	0,00	37.647,63587637	3,7186930000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
869	14/10/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	2.246,32	112,64346825	19,9418575700
870	14/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.003,16	0,00	948,98788793	2,1108383210
871	14/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	7.372,08	0,00	3.492,48918151	2,1108383210
872	14/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	32.040,81	3.946,77407625	8,1182275400
873	15/10/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	1.384,65	69,43205355	19,9425183200
874	15/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.987,77	0,00	1.889,51174493	2,1104764290
875	15/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.105.533,80	0,00	259.356,87841037	8,1182878700
890	15/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.189,28	0,00	563,51257169	2,1104764290
876	16/10/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	69.781,56	3.499,02428444	19,9431482400
877	16/10/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	5.745.890,55	0,00	288.113,51552186	19,9431482400
878	16/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	15.497,09	0,00	7.342,98972777	2,1104605310
879	16/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.677,24	0,00	1.268,55724648	2,1104605310
880	16/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	4.071.256,09	501.488,25787125	8,1183477900
881	16/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.668.693,06	205.545,89470230	8,1183477900
882	19/10/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	21.963,73	1.101,28044278	19,9438119000
884	19/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	13.822,92	0,00	6.550,30101790	2,1102724840
885	19/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	6.126,96	0,00	2.903,39756901	2,1102724840
886	19/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.031.415,49	250.223,38277654	8,1184079100
887	19/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.700.000,00	0,00	209.400,66314061	8,1184079100
888	19/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	189.384,58	82.652,25533768	2,2913419510
892	20/10/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	128.162,62	6.425,97094762	19,9444754800
893	20/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	26.324.292,22	0,00	3.242.519,62696628	8,1184681200
894	21/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	7.970,30	0,00	3.776,29056996	2,1106161860
895	21/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	10.269,26	0,00	4.865,52698123	2,1106161860
896	22/10/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	4.688.660,05	235.070,04266824	19,9457999700
897	22/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	79.755,96	37.789,40642257	2,1105375170
898	22/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.083,99	987,42144274	2,1105375170
899	22/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	4.273.924,30	526.436,86768950	8,1185885000
900	22/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	580.000,00	0,00	71.440,99001939	8,1185885000
901	23/10/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	713.637,68	35.777,66234053	19,9464591400

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
902	23/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	575.540,08	251.136,77172206	2,2917395810
903	23/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.544,74	1.679,52372495	2,1105626240
904	23/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	8.500,72	0,00	4.027,70327842	2,1105626240
905	23/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	129.400.000,00	0,00	15.938.612,83912170	8,1186488000
906	23/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	30.236,36	3.724,30939493	8,1186488000
907	26/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	7.278.809,11	896.547,53989051	8,1187095900
908	26/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	3.954.523,92	0,00	487.087,74173557	8,1187095900
909	27/10/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	750.519,72	37.624,22678787	19,9477779100
910	27/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.110.309,30	920.713,49367954	2,2920368980
911	27/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	76.611,09	36.296,63670006	2,1106939090
912	27/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	11.941,47	0,00	5.657,60385676	2,1106939090
913	27/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	131.952.469,49	16.252.765,35750269	8,1187703500
914	27/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	5.385.717,34	663.366,13893753	8,1187703500
915	27/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	5.775,30	0,00	2.736,20915632	2,1106939090
916	29/10/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	493.260,37	24.725,95303556	19,9490943500
917	29/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	644,88	0,00	305,51249515	2,1108138300
918	29/10/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	73.084,86	0,00	9.001,82768183	8,1188912500
919	30/10/2020	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	56.267,66	2.820,46888231	19,9497538700
920	30/10/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.597,92	0,00	757,00919753	2,1108330060

Total

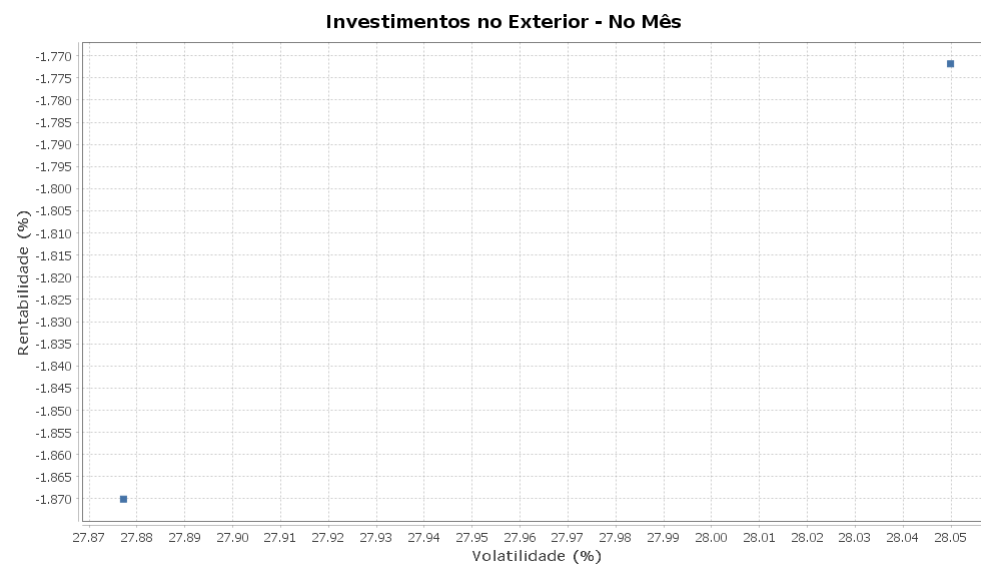
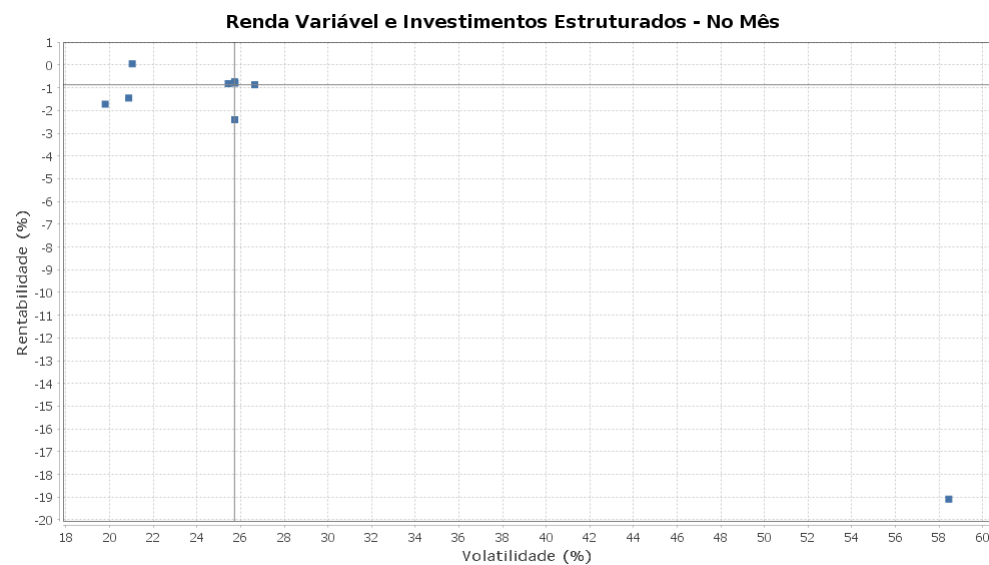
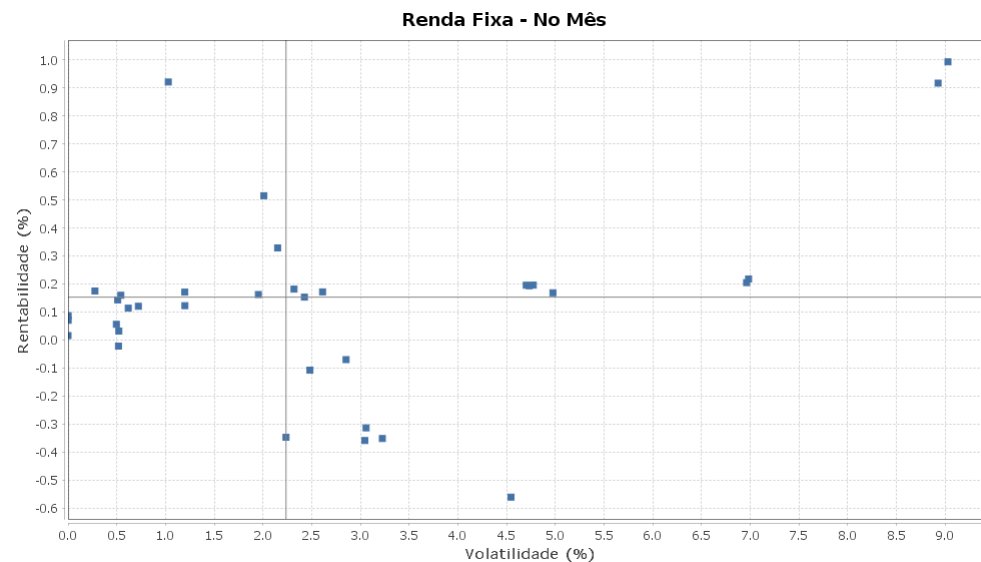
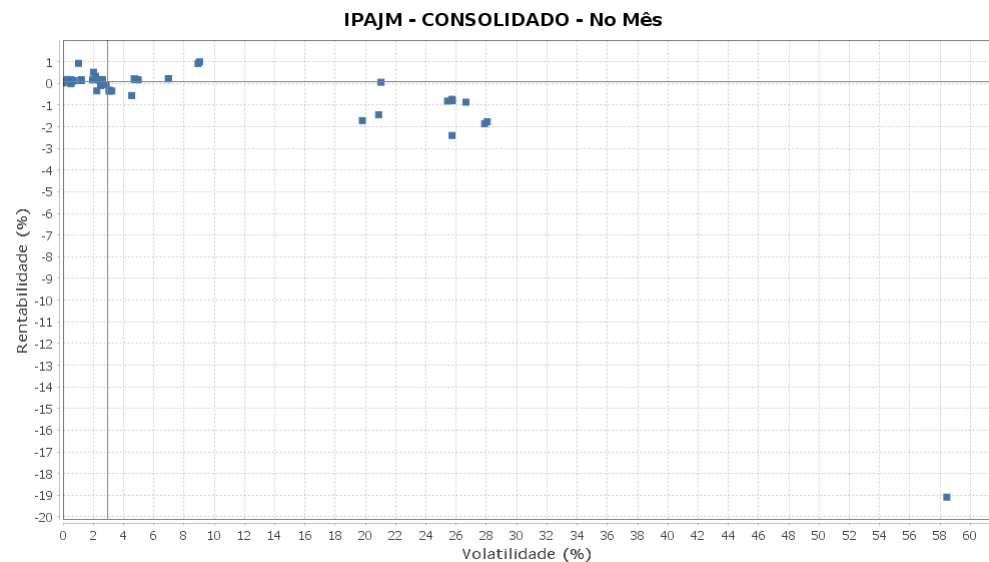
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rendimentos Realizados

Artigo	Ativo	Quantidade	Valor Aplicação	Valor Resgate	Rendimento
Artigo 7º IV, Alínea a	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	21.105.177,259354	171.332.308,28	171.345.799,34	13.491,06
Artigo 7º IV, Alínea a	BB PREV RF FLUXO FIC	82.086,094707	173.169,92	173.241,37	71,45
Artigo 7º IV, Alínea a	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.254.502,520739	2.726.629,39	2.875.233,96	148.604,57
Artigo 7º IV, Alínea a	FI BANESTES INVEST MONEY RF	372.722,052483	7.431.931,27	7.434.220,31	2.289,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 86.118.315,79

Value-At-Risk: 1,79%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	-647,52	0,02	90.407.030,76	1,87
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,01	0,00	-71,82	0,09	5,76	0,00
FI BANESTES INVEST MONEY RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,02	0,00	-76,60	0,07	37.824,25	0,00
LFT 010921	Artigo 7º I, Alínea a	0,28	0,05	0,00	0,06	0,17	247.805.429,95	5,14
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,50	0,06	0,00	-0,20	0,06	244.554,47	0,01
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,51	0,16	0,00	-0,03	0,14	40.456.582,63	0,84
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,52	0,12	-0,00	-0,35	-0,02	14.474.156,09	0,30
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,52	0,12	-0,00	-0,24	0,03	185.827.141,80	3,85
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,54	0,10	0,00	0,00	0,16	319.986.776,95	6,63
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,62	0,17	0,01	-0,07	0,11	304.289.464,86	6,31
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,72	0,13	0,00	-0,05	0,12	130.701.570,26	2,71
NTN-B 150521	Artigo 7º I, Alínea a	1,03	0,41	0,00	0,74	0,92	324.145.971,09	6,72
35-BRB MILLENIUM	Artigo 7º I, Alínea b	1,20	0,18	0,00	0,01	0,17	1.389.377,76	0,03
33-BRB TESOURO	Artigo 7º IV, Alínea a	1,20	0,18	0,00	-0,03	0,12	2.583,19	0,00
LFT 010324	Artigo 7º I, Alínea a	1,95	0,22	0,00	0,00	0,16	112.003.122,62	2,32
NTN-B 150822	Artigo 7º I, Alínea a	2,01	0,94	0,04	0,18	0,51	410.569.229,29	8,51
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,15	0,90	0,00	0,08	0,33	41.841.348,27	0,87
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	2,24	0,87	0,00	-0,23	-0,35	1.403.756,75	0,03
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,32	1,02	0,00	0,01	0,18	34.735.139,04	0,72
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,43	1,08	0,00	-0,00	0,15	33.266.967,53	0,69
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,48	1,21	0,13	-0,11	-0,11	692.872.462,38	14,37
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	2,61	1,25	0,00	0,01	0,17	7.120.494,72	0,15
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,85	1,34	0,14	-0,08	-0,07	656.797.802,03	13,62
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,04	1,36	0,01	-0,17	-0,36	36.506.531,74	0,76
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,06	1,36	0,01	-0,15	-0,31	49.563.395,77	1,03
NTN-B 150523	Artigo 7º I, Alínea a	3,22	1,42	0,01	-0,16	-0,35	76.729.645,82	1,59
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	4,54	2,04	0,01	-0,16	-0,56	20.687.846,07	0,43
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	4,70	3,15	0,00	0,01	0,20	2.028.541,83	0,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,73	3,16	0,01	0,01	0,19	13.753.472,41	0,29
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,77	3,15	0,01	0,01	0,20	25.336.046,59	0,53
NTN-B 150830	Artigo 7º I, Alínea a	4,97	2,96	0,05	0,00	0,17	113.736.373,07	2,36
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,96	4,93	0,01	0,01	0,20	7.380.141,23	0,15
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,98	4,93	0,01	0,01	0,22	10.548.800,78	0,22
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	8,93	5,38	-0,00	0,09	0,92	33.184.464,13	0,69
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	9,03	4,92	-0,00	0,09	0,99	30.903.729,98	0,64
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	19,79	10,05	0,01	-0,09	-1,72	5.213.624,70	0,11
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	20,87	9,39	0,21	-0,08	-1,45	115.676.210,61	2,40
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,03	9,83	0,05	-0,00	0,05	28.172.671,26	0,58
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	25,43	10,36	0,19	-0,04	-0,82	93.182.915,14	1,93
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	25,72	10,22	0,12	-0,03	-0,74	62.224.390,06	1,29
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	25,73	12,41	0,31	-0,10	-2,40	137.521.937,11	2,85
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	25,75	10,77	0,02	-0,04	-0,80	8.649.734,91	0,18
FIA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	26,64	10,66	0,28	-0,04	-0,87	136.750.647,57	2,84
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	27,88	12,89	0,02	-0,07	-1,87	23.578.075,38	0,49
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	28,05	13,17	0,09	-0,07	-1,77	109.794.625,31	2,28
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	Artigo 8º IV, Alínea b	58,44	22,30	0,04	-0,33	-19,09	29.800.000,00	0,62