



VITÓRIA
FEVEREIRO 2020



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 04.09.2020.

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 **91,93%**

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 150555 (4,460000%)	41,08	0,90	9,81	0,00	0,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		41,08	0,90	9,81	0,00	0,00

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	2,05	0,63	1,49	42.947.228,31	6,35	5.100.791.923,15	0,84
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	7,95	0,08	0,63	44.925.857,07	6,64	297.383.588,49	15,11
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,26	0,35	0,77	2.607.682,14	0,39	7.492.585.716,79	0,03
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,91	0,44	0,69	52.024.189,46	7,69	6.609.422.706,56	0,79
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,25	0,36	0,79	5.915.896,15	0,87	10.513.960.188,40	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,98	0,63	1,18	123.208.873,70	18,21	9.698.235.388,71	1,27
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	1,50	0,63	1,02	16.732.604,62	2,47	6.830.764.502,36	0,24
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,97	0,65	1,21	22.588.148,15	3,34	4.537.919.668,21	0,50
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS	4,11	0,70	1,51	6.725.568,00	0,99	449.351.413,77	1,50
BB	BB	BB PREV IPCA I	2,29	0,73	1,37	9.474.639,77	1,40	497.651.331,34	1,90
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1,36	0,71	1,44	11.577.725,37	1,71	202.735.948,95	5,71
BB	BB	BB PREV RF VII	1,19	0,41	0,61	2.370.979,05	0,35	676.748.275,25	0,35
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,33	0,46	0,94	80.121.013,08	11,84	10.908.803.618,87	0,73
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,24	0,52	1,05	421.220.404,87	62,25		

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 DE FI RF REFERENCIADO DI	0,37	0,25	0,59	5.414.779,80	0,80	520.194.517,94	1,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,05	0,08	0,20	1.117.595,05	0,17	571.609.197,48	0,20
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,27	0,65	8.254.567,26	1,22	5.421.482.050,58	0,15
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	4,89	0,40	0,67	76.070.292,92	11,24	1.649.350.516,71	4,61
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	7,55	0,20	0,93	40.462.851,60	5,98	329.955.502,48	12,26
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,27	0,62	75.329,18	0,01	2.774.667.818,45	0,00
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,05	0,22	0,50	749,06	0,00	1.376.949.540,95	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,10	0,29	0,69	46.043.640,78	6,80	2.995.405.175,98	1,54
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,60	0,42	1,04	23.400.408,21	3,46	238.856.359,80	9,80
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,59	0,32	0,76	200.840.213,86	29,68		
Renda Fixa			3,03	0,48	1,46	622.060.618,73	91,93		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,45%

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
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,49	-6,37	-4,94	8.720.173,75	1,29	909.648.393,83	0,96
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	17,97	-8,31	-5,23	20.629.973,11	3,05	151.383.918,69	13,63
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	18,81	-8,96	-10,27	10.854.698,20	1,60	798.991.874,74	1,36
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	17,16	-8,78	-5,89	4.815.778,06	0,71	833.715.081,43	0,58
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			16,33	-7,82	-6,64	45.020.623,12	6,65		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	7,71	-2,28	-2,02	2.620.076,41	0,39	114.225.102,88	2,29
Sub-total Artigo 8º III			7,71	-2,28	-2,02	2.620.076,41	0,39		

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
RIO BRAVO	CEF	BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTIELABOR	30,58	-0,07	-0,06	1.327.316,31	0,20	245.227.800,74	0,54
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			30,58	-0,07	-0,06	1.327.316,31	0,20		

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
BB	BB	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	24,51	-0,71	-10,65	1.456.165,05	0,22	112.715.459,16	1,29
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			24,51	-0,71	-10,65	1.456.165,05	0,22		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			13,86	-6,93	-6,23	50.424.180,89	7,45		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 0,62%

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	16,34	-5,69	0,46	4.186.110,39	0,62	866.229.995,42	0,48
Sub-total Artigo 9º A, III			16,34	-5,69	0,46	4.186.110,39	0,62		
Investimentos no Exterior			16,34	-5,69	0,46	4.186.110,39	0,62		
Total						676.670.910,01	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	0,00	0,00	0,00	1,00	6,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	421.220.404,87	62,25	53,50	58,50	63,50	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	200.840.213,86	29,68	13,00	18,00	23,00	50,00
	Total Renda Fixa	622.060.618,73	91,93				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	45.020.623,12	6,65	1,00	6,00	11,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	2.620.076,41	0,39	0,00	2,00	7,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	1.327.316,31	0,20	0,00	0,50	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.456.165,05	0,22	0,00	1,00	5,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	50.424.180,89	7,45				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	4.186.110,39	0,62	0,00	1,00	6,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	4.186.110,39	0,62				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

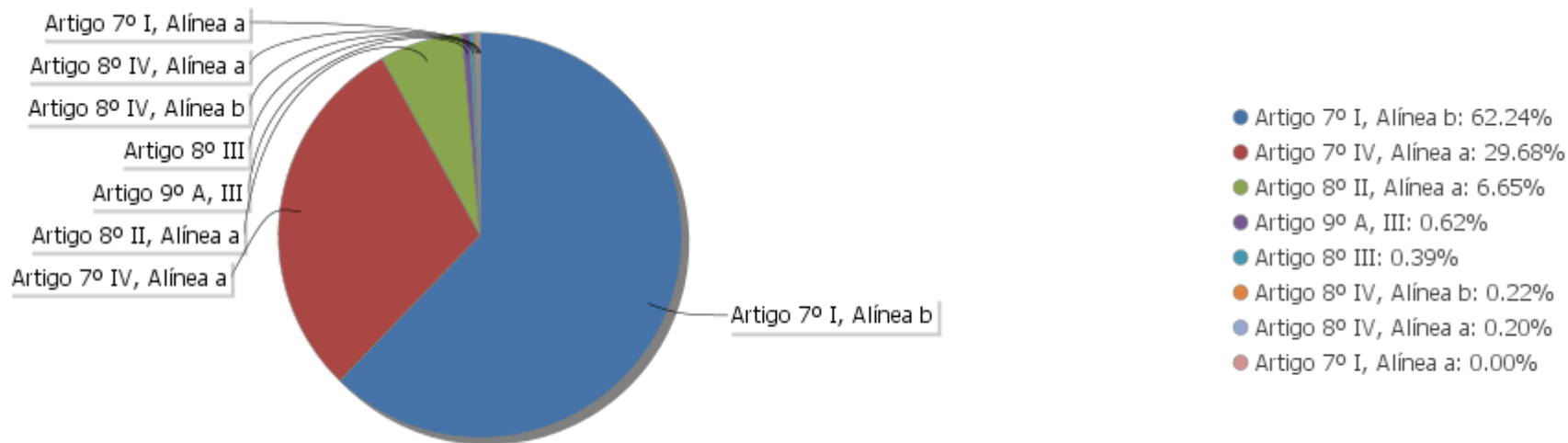
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,90 306,31	9,81 1.460,47	10,77 1.026,87	17,14 716,57	24,67 442,50	265.983,60	3.463.250,51
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,52 176,26	1,05 156,70	2,39 227,67	5,64 235,86	13,26 237,81	2.095.809,18	4.246.679,34
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,32 110,22	0,76 113,25	2,36 224,75	5,54 231,78	12,44 223,14	636.840,52	1.427.823,01
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-7,82 0,61	-6,64 3,28	1,08 4,83	6,57 3,57	20,95 11,97	-3.239.618,27	-2.780.423,94
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-2,28 6,15	-2,02 7,90				-69.909,65	-67.230,16
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,07 8,35	-0,06 9,86	-25,95 -22,20	-29,42 -32,42	-31,20 -40,19	-994,14	-757,67
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-0,71 7,72	-10,65 -0,72	-10,66 -6,91	-10,26 -13,27	-19,53 -28,51	-10.345,14	-173.485,41
Artigo 9º A, III % do CDI	-5,69 -1.935,50	0,46 68,96	-1,30 -124,40	8,85 369,86	26,84 481,52	-252.329,90	19.294,59
						-574.563,80	6.135.150,27

Análise de Liquidez

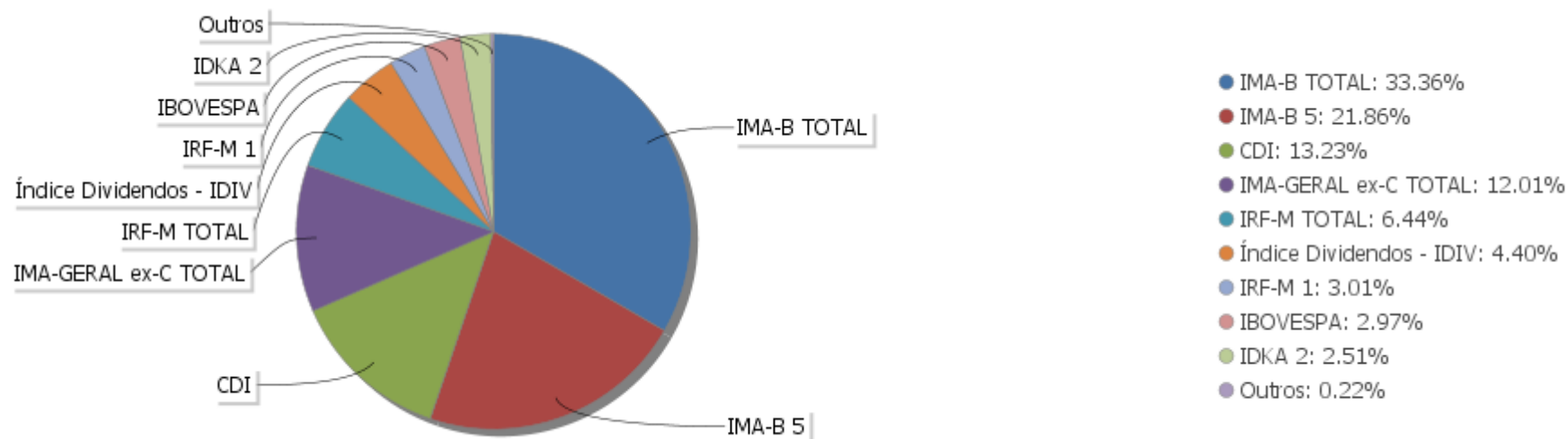
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	610.295.618,71	90,19	610.295.618,71	90,19
de 31 a 364 dias	45.020.623,12	6,65	655.316.241,83	96,84
acima de 365 dias	21.354.668,18	3,16	676.670.910,01	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

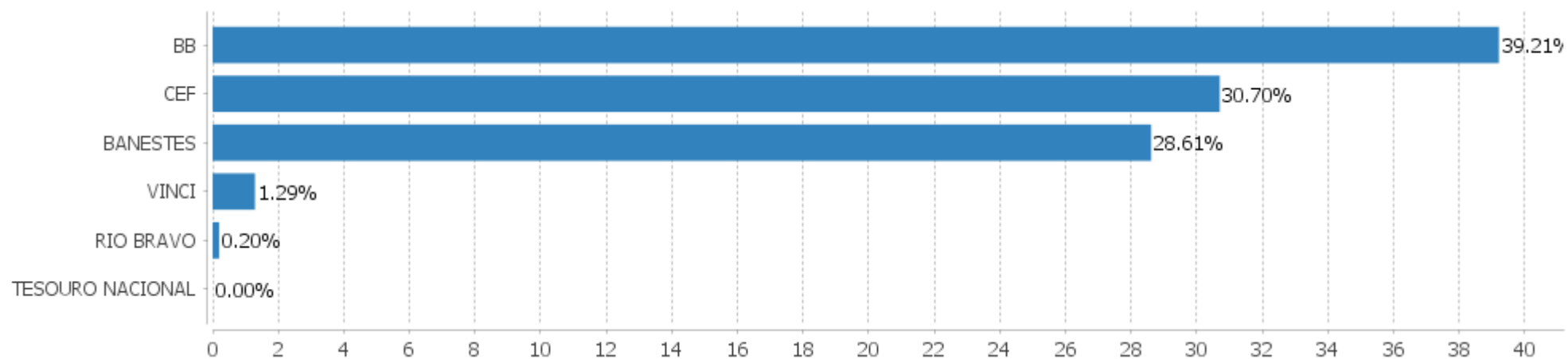


Alocação Por Estratégia



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	1,00	-0,08											0,92
INPC + 5,5%	0,66	0,55											1,22
p.p. indexador	0,34	-0,64											-0,30
2019	2,06	0,56	0,52	1,09	2,39	2,36	1,26	-0,21	2,09	2,21	-0,89	1,62	16,06
INPC + 6%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,44	0,57	1,01	1,71	10,78
p.p. indexador	1,19	-0,45	-0,70	0,00	1,73	1,91	0,62	-0,84	1,65	1,63	-1,90	-0,09	5,29

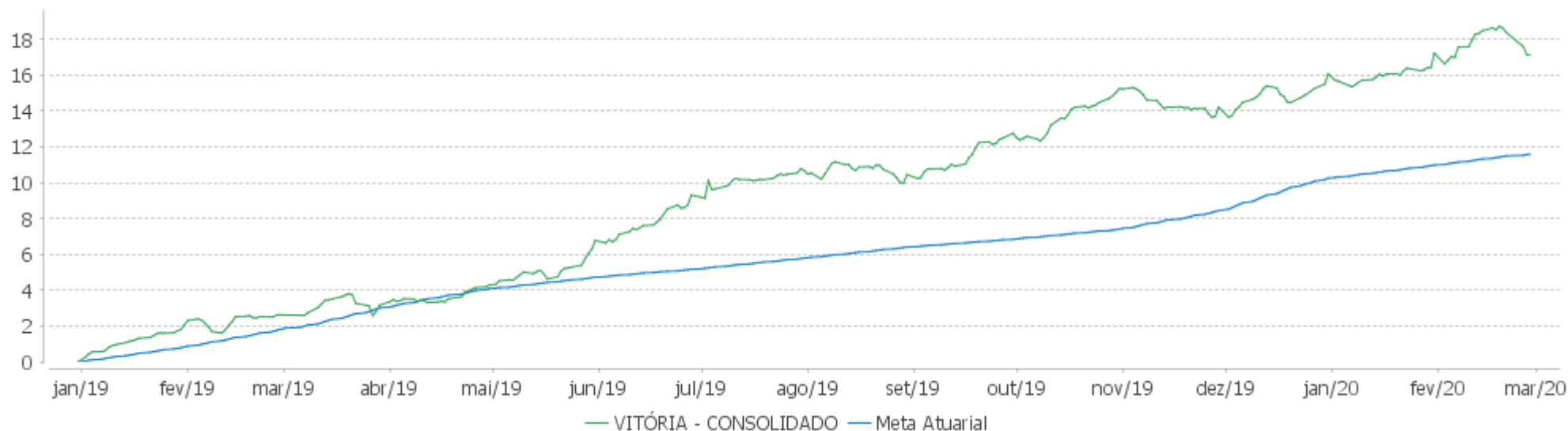
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

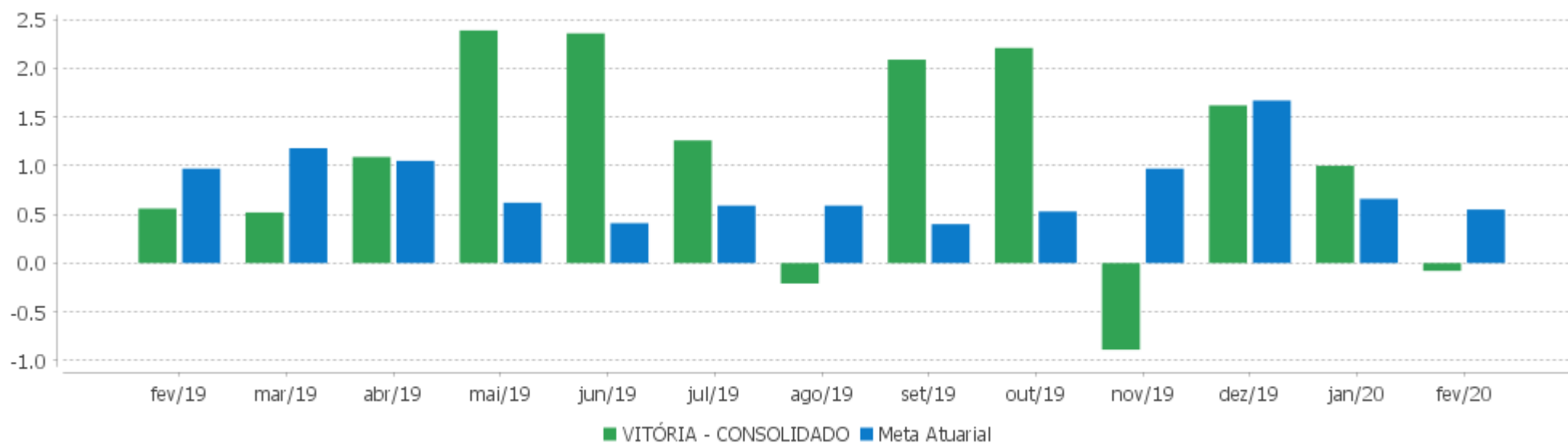
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	8	57,14	03 meses	2,55	2,95	-0,40	3,73
Meses abaixo da Meta Atuarial	6	42,86	06 meses	6,05	5,04	1,01	3,19
			12 meses	14,13	10,05	4,08	3,09
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,39	2019-05	Desde 31/12/2018	17,12	12,12	5,00	2,95
Menor rentabilidade da Carteira	-0,89	2019-11					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,44 -0,01	0,69 -0,03	2,69 -0,04	6,35 -0,19	17,63 -0,37	34,00 -0,65	48,25 -1,02
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,63 -0,01	1,18 -0,03	2,40 -0,05	5,51 -0,15	11,87 -0,29	22,95 -0,54	37,12 -0,84
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6% p.p.	0,73 0,06	1,37 -0,02	2,57 -0,49	5,75 0,56	12,96 2,74	25,03 3,65	40,63 8,40
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,35 -0,03	0,77 -0,05	1,17 -0,07	2,72 -0,15	6,24 -0,28	13,31 -0,55	24,21 -0,86
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,65 0,01	1,21 0,01	2,42 -0,03	5,56 -0,09	11,96 -0,21	23,02 -0,47	37,23 -0,73
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,08 -0,37	0,63 -0,09	3,21 0,48	8,70 2,15	23,37 5,36	41,76 7,10	56,38 7,11
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,71 0,33	1,44 0,61	1,89 0,64	3,96 1,09	10,48 3,96	19,23 5,38	31,51 6,45
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,41 -0,04	0,61 -0,10	1,53 -1,20	4,15 -2,39	9,09 -8,91	20,06 -14,60	33,19 -16,08
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,70 0,25	1,51 0,79	3,02 0,29	6,73 0,19	13,29 -4,72	22,27 -12,38	29,67 -19,60
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,63 -0,06	1,02 -0,21	2,18 -0,26	5,12 -0,25	10,31 -0,88	20,84 -1,68	34,64 -3,12
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,46 0,01	0,94 -0,00	1,91 0,05	4,31 -0,05	11,46 0,39	22,39 0,50	35,25 -0,19
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,63 -0,02	1,49 -0,04	2,11 -0,06	4,80 -0,11	11,62 -0,24	22,46 -0,52	38,10 -0,96
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,36 -0,02	0,79 -0,04	1,19 -0,05	2,77 -0,11	6,31 -0,21	13,44 -0,41	24,42 -0,64
NTN-B 150555 (4,460000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	-13,69 -14,13	-6,07 -6,78	-5,24 -7,98	0,21 -6,34	8,70 -9,30		
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,25 83,47	0,59 87,29	0,94 89,32	1,90 79,60	5,33 95,53	11,90 96,42	21,90 97,82
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,20 -0,25	0,93 0,22	3,33 0,60	7,69 1,14	22,29 4,29	37,68 3,03	51,75 2,48
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,29	0,69	1,09	2,22	5,62	12,94	23,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	100,18	102,80	104,36	92,94	100,90	104,90	106,41
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	0,42	1,04	2,19	6,79	16,16		
% do CDI	144,27	155,12	209,01	283,69	289,87		
BB PREV RF IMA-B	0,40	0,67	2,69	6,42	17,63	33,97	48,34
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,05	-0,04	-0,04	-0,13	-0,37	-0,69	-0,92
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,27	0,62	0,98	2,23	5,33	11,98	22,11
% do CDI	92,98	92,92	93,45	93,12	95,61	97,04	98,72
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,08	0,20	0,33	0,90	2,51	5,90	12,09
% do CDI	28,07	29,79	31,42	37,81	45,07	47,83	53,97
BB PREV RF FLUXO FIC	0,22	0,50	0,79	1,85	4,45	9,95	18,58
% do CDI	73,69	74,86	75,23	77,44	79,85	80,64	82,98
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,27	0,65	1,00	2,22	5,33	11,90	21,87
% do CDI	93,24	96,16	95,34	92,84	95,61	96,39	97,66
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,07	-0,06	-25,95	-29,42	-31,20	-29,76	-17,35
% do CDI	-25,48	-8,50	-2.474,91	-1.230,04	-559,79	-241,12	-77,47
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	-7,11	-5,23	1,58	5,50	24,87	47,72	86,40
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,94	2,43	0,02	-2,02	3,23	5,41	18,79
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-6,37	-4,94	3,17	8,42	19,87	41,01	75,29
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,19	2,72	1,61	0,89	-1,76	-1,30	7,68
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	-8,78	-5,89	2,87	11,04			
Var. IBOVESPA p.p.	-0,35	4,04	6,62	8,03			
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-8,96	-10,27	-2,37	3,90	13,67	34,53	
Var. IBOVESPA p.p.	-0,53	-0,35	1,38	0,90	4,69	12,49	
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	-2,28	-2,02	0,35				
% do CDI	-774,83	-300,47	33,34				
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	-0,71	-10,65	-10,66	-10,26	-19,93	-24,25	-31,84
Var. IFIX p.p.	2,98	-3,33	-13,20	-21,82	-41,67	-52,47	-77,92
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-5,69	0,46	-1,30	8,85	26,84	48,66	81,60
Var. IBOVESPA p.p.	2,74	10,38	2,45	5,84	17,86	26,61	25,33
CDI	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,34	22,39
IBOVESPA	-8,43	-9,92	-3,75	3,00	8,98	22,05	56,27
INPC + 6%	0,59	1,29	3,03	5,12	10,13	21,34	30,86
IPCA + 6%	0,67	1,39	3,06	5,19	10,22	21,38	32,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,38	0,82	1,25	2,87	6,52	13,85	25,06
IRF-M 1+	0,80	1,92	2,66	6,01	14,22	27,05	45,12
IRF-M TOTAL	0,65	1,53	2,17	4,91	11,86	22,99	39,06
IMA-B 5	0,64	1,20	2,45	5,66	12,17	23,49	37,96
IMA-B 5+	0,32	0,35	2,96	7,23	22,04	43,07	58,49
IMA-B TOTAL	0,45	0,71	2,73	6,54	18,00	34,65	49,27
IMA-C TOTAL	0,63	3,18	3,59	6,91	18,59	39,02	52,96
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,44	0,95	1,87	4,36	11,07	21,89	35,44
IMA-GERAL TOTAL	0,45	1,01	1,91	4,43	11,28	22,36	35,89
IDKA 2	0,69	1,22	2,44	5,37	11,19	22,52	37,76
IDKA 20	-0,09	-1,46	2,43	6,69	27,19	57,08	70,16
CDI	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,34	22,39
Renda Variável							
IBOVESPA	-8,43	-9,92	-3,75	3,00	8,98	22,05	56,27
IBRX 100	-8,22	-9,37	-2,78	3,55	11,15	25,47	60,69
IBRX 50	-8,66	-10,38	-4,50	2,05	6,61	18,16	52,61
SMALL CAP	-8,27	-7,86	3,80	13,95	35,70	51,63	99,83
IFIX	-3,69	-7,31	2,54	11,56	21,74	28,23	46,08
Índice Consumo - ICON	-10,00	-6,70	0,78	4,44	34,77	34,01	67,27
Índice Dividendos - IDIV	-6,18	-7,66	1,56	7,52	21,63	42,31	67,61
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,25	0,46	1,62	2,20	4,00	8,05	11,13
INPC	0,17	0,36	1,58	2,12	3,92	8,02	9,97
IGPM	-0,04	0,44	2,54	3,53	6,82	14,94	14,46
SELIC	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,34	22,41
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
35	03/02/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.416,51	0,00	386,45620389	3,6653830000
71	03/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	314.047,68	38.809,62016388	8,0920060200
75	03/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	9.836.721,29	1.215.609,73455628	8,0920060200
72	03/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	12.490,43	1.543,55174343	8,0920060200
73	03/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	31.463,42	3.888,21015731	8,0920060200
74	03/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.628.942,29	201.302,65424592	8,0920060200
86	03/02/2020	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	10.150.000,00	0,00	5.869.726,44692169	1,7292117600
43	04/02/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	1.673.665,17	0,00	1.704,07876433	982,1524714900
96	05/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	43.409,44	0,00	5.363,91536868	8,0928644500
50	05/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.003,72	371,15659339	8,0928644500
55	05/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	6.857,96	847,40823751	8,0928644500
56	05/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.686.502,37	208.393,74987925	8,0928644500
49	05/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	271.107,77	33.499,60593990	8,0928644500
54	05/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	42.763,45	5.284,09319892	8,0928644500
44	05/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	178.480,22	22.054,02315864	8,0928644500
45	05/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	45.789,45	5.658,00283483	8,0928644500
53	05/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	394.079,57	48.694,69548573	8,0928644500
47	05/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.702,70	333,96086351	8,0928644500
48	05/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	346,37	42,79943179	8,0928644500
46	05/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	7.122,14	880,05180910	8,0928644500
51	05/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	26.103,03	3.225,43768789	8,0928644500
52	05/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	415,47	51,33781772	8,0928644500
60	06/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	10.397,55	0,00	1.284,71179594	8,0932937900
137	07/02/2020	NTN-B 150555 (4,460000%)	0,00	29.829.183,60	6.000,00000000	4.971,5306000000
62	07/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	770,41	0,00	95,18701378	8,0936460700
97	10/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	36.021,37	4.450,37984314	8,0939990000
95	10/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	32.018,79	3.955,86779786	8,0939990000
36	10/02/2020	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	200.000,00	47.612,97753123	4,2005354500

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
89	10/02/2020	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	29.900.000,00	0,00	17.277.862,08103193	1,7305381800
32	10/02/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.095,27	0,00	524,65051600	2,0876182650
64	10/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	297.384,43	0,00	36.741,34750943	8,0939990000
33	13/02/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.095,27	524,45935700	2,0883791770
57	13/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	12.413,14	1.533,42184684	8,0950587900
58	14/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.009,83	248,26777139	8,0954124200
28	17/02/2020	BB PREV IPCA I	0,00	243.169,27	106.836,61112600	2,2760855800
38	17/02/2020	BB PREV RF VII	0,00	63.713,01	36.398,26523000	1,7504408410
66	17/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	330,52	0,00	40,82627781	8,0957662000
29	17/02/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	243.169,27	0,00	116.411,93727100	2,0888688540
37	18/02/2020	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	174.607,23	40.818,83293428	4,2776144600
99	19/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.670.705,04	0,00	206.349,69378456	8,0964745300
39	19/02/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	63.713,01	0,00	43.206,60068400	1,4746128830
41	19/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	161.481,66	0,00	63.611,44474256	2,5385630000
68	19/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	20.525.658,23	0,00	2.535.135,28066394	8,0964745300
31	19/02/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	243.169,27	0,00	164.903,80139900	1,4746128830
30	19/02/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	243.169,27	116.383,99628300	2,0893703410
93	20/02/2020	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	5.000.000,00	0,00	3.892.830,13718224	1,2844125800
100	20/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.655.563,89	204.470,65674258	8,0968287400
98	20/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	7.396,74	913,53543931	8,0968287400
87	20/02/2020	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	2.961.424,39	1.708.938,53533540	1,7329028100
84	20/02/2020	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	1.535.409,15	886.033,04301873	1,7329028100
85	20/02/2020	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	503.166,46	290.360,46170414	1,7329028100
61	20/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	10.402,09	1.284,71162402	8,0968287400
63	20/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	770,71	95,18664958	8,0968287400
65	20/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	297.488,40	36.741,34769954	8,0968287400
67	20/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	330,56	40,82586042	8,0968287400
69	20/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	16.671.596,84	2.059.027,96951094	8,0968287400
59	20/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	811.822,53	100.264,25852253	8,0968287400
90	21/02/2020	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	2.788.521,00	1.608.885,56950598	1,7332003300

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
88	21/02/2020	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	7.211.479,00	4.160.787,92230555	1,7332003300
42	21/02/2020	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	1.620.000,00	0,00	1.267.901,27901498	1,2777020000
83	26/02/2020	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	10.000.000,00	0,00	4.297.523,97984001	2,3269212800
101	27/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	8.978,77	0,00	1.108,77861670	8,0978924600
91	27/02/2020	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	15.000.000,00	8.652.454,45646484	1,7336121300
40	27/02/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	15.000.000,00	0,00	10.224.019,97390700	1,4671332840
70	27/02/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.762.114,75	341.090,56938501	8,0978924600
34	27/02/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	644,48	0,00	308,31813700	2,0903084270

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,01	0,08	1.117.595,05	0,17
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,22	749,06	0,00
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	0,27	8.254.567,26	1,22
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,02	0,27	75.329,18	0,01
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,02	0,25	5.414.779,80	0,80
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,02	0,29	46.043.640,78	6,80
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,14	0,03	0,36	5.915.896,15	0,87
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,14	0,03	0,35	2.607.682,14	0,39
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	0,82	0,11	0,41	2.370.979,05	0,35
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	1,12	0,16	0,71	11.577.725,37	1,71
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,41	0,18	0,63	16.732.604,62	2,47
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	1,75	0,22	0,73	9.474.639,77	1,40
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	0,22	0,65	22.588.148,15	3,34
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	0,22	0,63	123.208.873,70	18,21
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	1,94	0,24	0,63	42.947.228,31	6,35
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,27	0,26	0,46	80.121.013,08	11,84
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS	Artigo 7º I, Alínea b	2,98	0,35	0,70	6.725.568,00	0,99
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	3,54	0,39	0,42	23.400.408,21	3,46
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	5,09	0,55	0,40	76.070.292,92	11,24
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,09	0,55	0,44	52.024.189,46	7,69
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	8,41	0,88	0,20	40.462.851,60	5,98
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	9,17	0,95	0,08	44.925.857,07	6,64
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	10,03	0,91	-2,28	2.620.076,41	0,39
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	29,18	2,70	-5,69	4.186.110,39	0,62
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	31,19	2,72	-8,78	4.815.778,06	0,71
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	32,04	2,95	-6,37	8.720.173,75	1,29
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	32,35	2,94	-7,11	20.629.973,11	3,05
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	32,70	2,87	-8,96	10.854.698,20	1,60
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	59,39	6,11	-0,71	1.456.165,05	0,22
NTN-B 150555 (4,460000%)	Artigo 7º I, Alínea a	103,48	9,90	-13,69	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 15,11% do patrimônio líquido do fundo Banestes Previdenciario FI Renda Fixa IMA-B (Art. 7, Inciso I, Alínea B), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- O percentual alocado no Artigo 7, Inciso IV, Alínea A (29,68% dos recursos) está superior ao limite máximo estipulado em Política de Investimentos;