



LDB
EMPRESAS

VITÓRIA
MARÇO 2020



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 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 **93,31%**

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	5,03	-0,11	1,38	42.899.650,74	6,70	4.885.428.546,31	0,88
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	20,16	-13,12	-12,58	37.531.997,58	5,86	244.950.986,31	15,32
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,45	0,60	1,38	2.623.265,87	0,41	6.969.533.398,64	0,04
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11,16	-7,10	-6,46	48.329.362,57	7,55	5.890.819.394,91	0,82
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,44	0,59	1,38	5.950.670,16	0,93	10.517.651.272,61	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,58	-1,80	-0,64	120.994.656,38	18,90	9.363.308.744,85	1,29
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	3,77	-1,66	-0,66	16.454.400,57	2,57	6.723.745.548,10	0,24
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,56	-1,79	-0,60	22.183.541,96	3,46	4.397.326.460,64	0,50
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS	8,17	-2,69	-1,23	6.544.440,00	1,02	437.249.635,23	1,50
BB	BB	BB PREV IPCA I	4,71	-1,73	-0,38	9.310.841,50	1,45	489.047.898,60	1,90
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	3,98	1,11	2,57	11.706.805,98	1,83	145.422.021,85	8,05
BB	BB	BB PREV RF VII	2,22	-1,34	-0,74	2.339.177,52	0,37	667.671.168,60	0,35
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	5,33	-2,10	-1,18	78.437.469,91	12,25	10.536.452.770,12	0,74
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			5,39	-3,39	-2,37	405.306.280,74	63,30		

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	0,66	-1,34	-0,77	5.341.980,77	0,83	445.586.463,98	1,20
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,05	0,08	0,28	3.217.968,05	0,50	653.242.969,82	0,49
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,11	0,14	0,79	8.266.308,49	1,29	5.503.080.783,31	0,15
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	11,09	-7,12	-6,50	70.656.893,63	11,03	1.522.221.858,52	4,64
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	22,83	-14,22	-13,42	34.709.421,26	5,42	196.839.318,27	17,63
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,16	-0,03	0,59	75.304,28	0,01	2.725.355.805,79	0,00

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 RF FLUXO FIC	0,05	0,25	0,75	1.395,40	0,00	1.561.401.900,27	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,57	-1,31	-0,63	46.918.483,60	7,33	2.377.431.261,25	1,97
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,55	-1,74	-0,72	22.992.511,60	3,59	221.275.689,72	10,39
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,79	-6,21	-5,50	192.180.267,08	30,01		
Renda Fixa			5,76	-4,31	-2,91	597.486.547,82	93,31		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

5,99%

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	35,44	-27,40	-30,98	6.330.772,89	0,99	668.247.605,13	0,95
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	41,55	-31,64	-35,22	14.102.086,13	2,20	109.237.299,41	12,91
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	37,39	-27,05	-34,54	9.483.840,45	1,48	606.513.004,24	1,56
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	45,87	-31,94	-35,94	3.277.686,54	0,51	590.532.828,22	0,56
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			38,31	-29,72	-34,39	33.194.386,01	5,18		

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	18,00	-7,92	-9,77	2.412.680,76	0,38	130.488.932,32	1,85
Sub-total Artigo 8º III			18,00	-7,92	-9,77	2.412.680,76	0,38		

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 MULTIELABORAÇÃO	30,40	-0,10	-0,15	1.326.051,44	0,21	245.227.800,74	0,54
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			30,40	-0,10	-0,15	1.326.051,44	0,21		

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	24,17	-1,37	-11,87	1.436.243,51	0,22	112.715.459,16	1,27
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			24,17	-1,37	-11,87	1.436.243,51	0,22		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			33,86	-27,00	-31,55	38.369.361,72	5,99		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,69%

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	23,76	6,30	6,80	4.449.997,40	0,69	876.229.505,18	0,51
Sub-total Artigo 9º A, III			23,76	6,30	6,80	4.449.997,40	0,69		
Investimentos no Exterior			23,76	6,30	6,80	4.449.997,40	0,69		
Total						640.305.906,94	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 b	Fundos 100% Títulos Públicos	405.306.280,74	63,30	53,50	58,50	63,50	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	192.180.267,08	30,01	13,00	18,00	23,00	50,00
	Total Renda Fixa	597.486.547,82	93,31				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	33.194.386,01	5,18	1,00	6,00	11,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	2.412.680,76	0,38	0,00	2,00	7,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	1.326.051,44	0,21	0,00	0,50	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.436.243,51	0,22	0,00	1,00	5,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	38.369.361,72	5,99				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	4.449.997,40	0,69	0,00	1,00	6,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	4.449.997,40	0,69				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

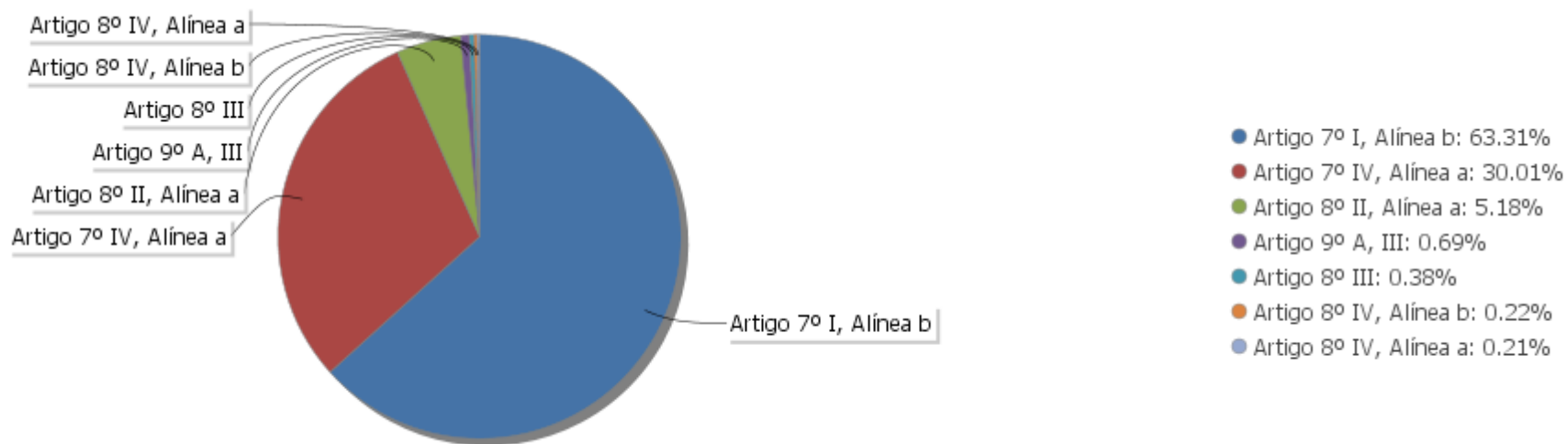
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,00 0,00	9,81 968,92	9,81 968,92	16,59 732,57	24,67 453,65	0,00	3.463.250,51
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-3,39 -1.001,62	-2,37 -234,43	-2,37 -234,43	-0,07 -3,00	8,76 161,06	-14.236.150,02	-9.989.470,68
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-6,21 -1.835,68	-5,50 -543,24	-5,50 -543,24	-3,37 -148,80	4,91 90,33	-12.258.105,92	-10.830.282,91
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-29,72 0,18	-34,39 2,47	-34,39 2,47	-26,34 3,95	-14,02 9,45	-13.426.237,11	-16.206.661,05
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-7,92 21,99	-9,77 27,09	-9,77 27,09			-207.395,65	-274.625,81
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,10 29,81	-0,15 36,71	-0,15 36,71	-29,49 0,80	-31,22 -7,74	-1.264,87	-2.022,54
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-1,37 28,54	-11,87 24,99	-11,87 24,99	-9,11 21,17	-21,37 2,10	-19.921,54	-193.406,95
Artigo 9º A, III % do CDI	6,30 1.863,01	6,80 671,49	6,80 671,49	12,71 561,33	27,06 497,76	263.887,01	283.181,60
						-39.885.188,10	-33.750.037,83

Análise de Liquidez

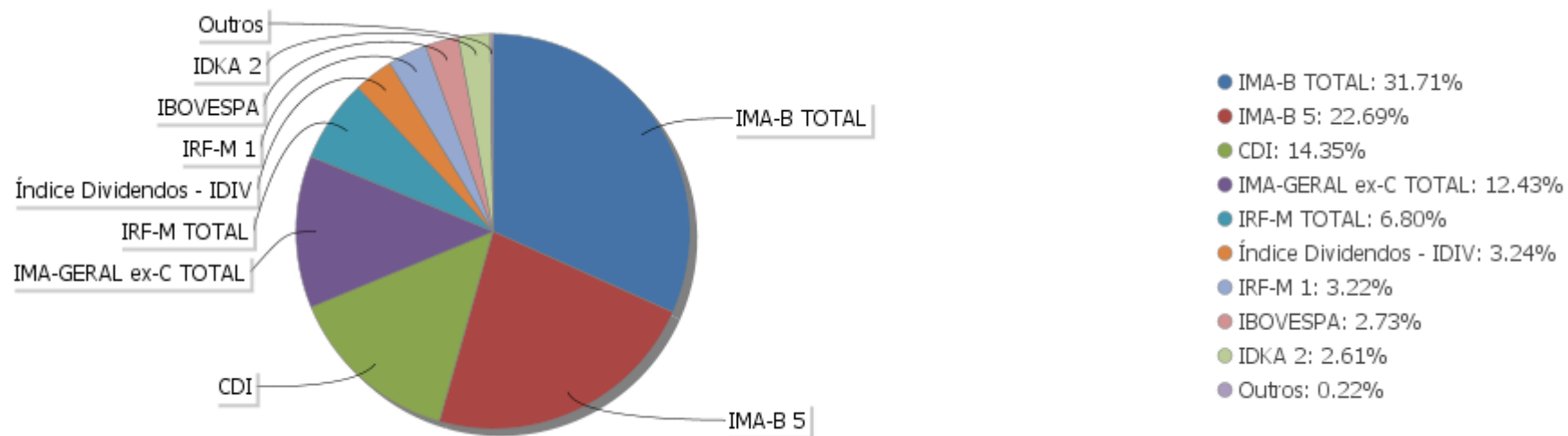
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	586.154.766,96	91,54	586.154.766,96	91,54
de 31 a 364 dias	33.194.386,01	5,18	619.349.152,97	96,73
acima de 365 dias	20.956.753,97	3,27	640.305.906,94	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

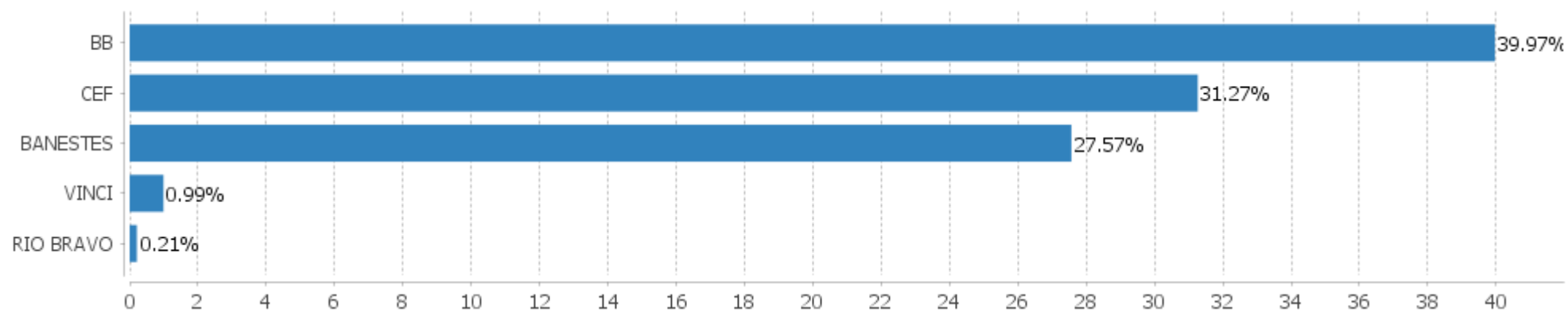


Alocação Por Estratégia



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	-5,94										-5,07
INPC + 5,5%	0,66	0,55	0,65										1,87
p.p. indexador	0,34	-0,64	-6,59										-6,95
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

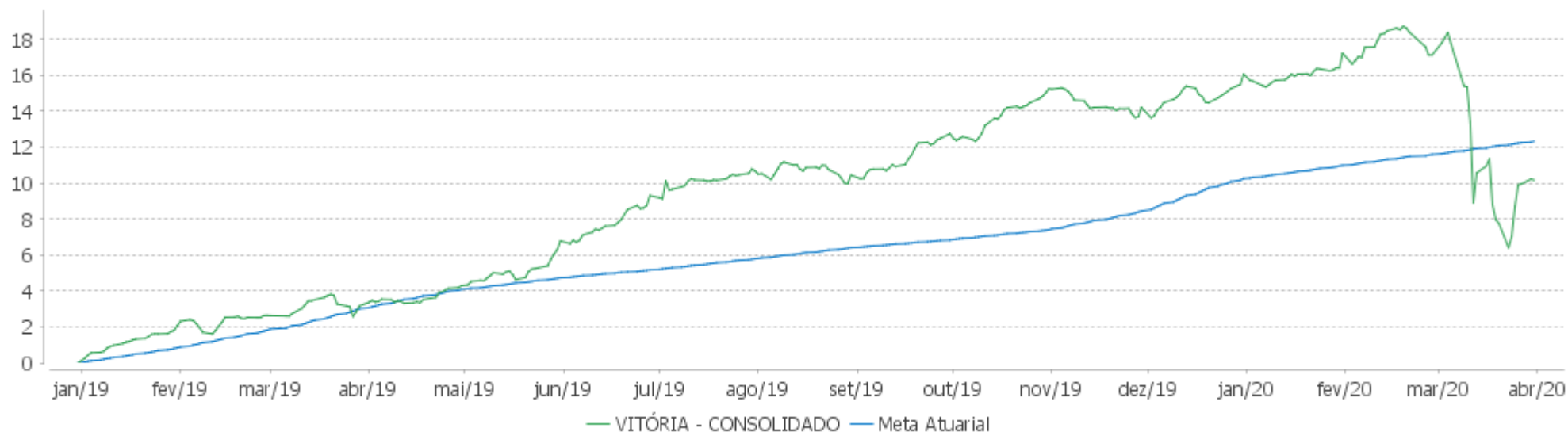
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

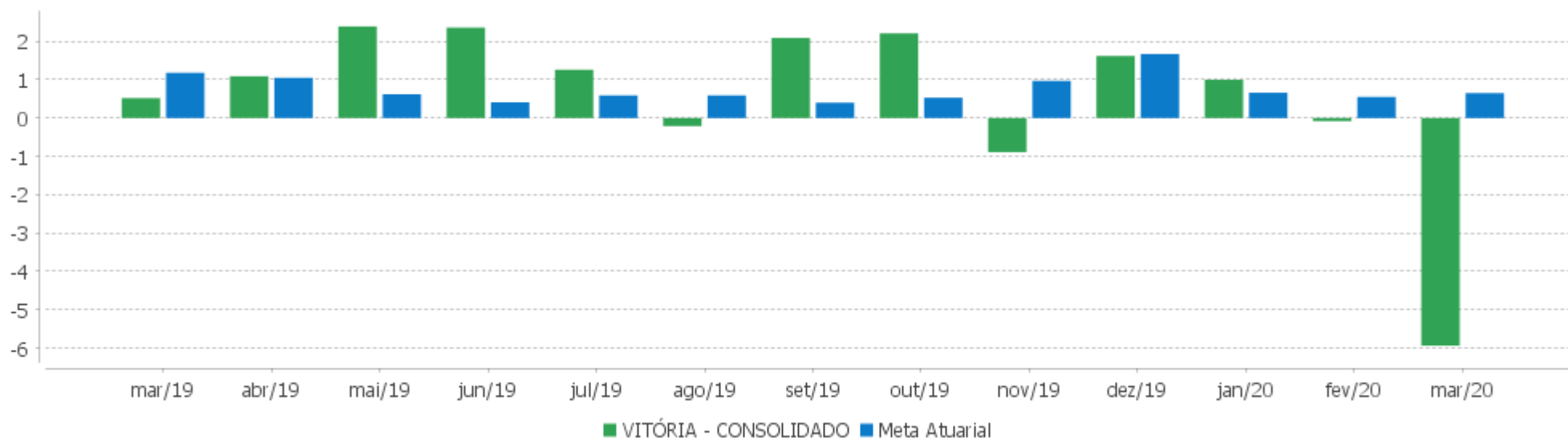
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	8	53,33	03 meses	-5,07	1,87	-6,95	12,59
Meses abaixo da Meta Atuarial	7	46,67	06 meses	-2,28	5,26	-7,55	9,11
			12 meses	6,80	9,43	-2,63	6,74
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,39	2019-05	Desde 31/12/2018	10,17	12,85	-2,68	6,15
Menor rentabilidade da Carteira	-5,94	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
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-7,10 -0,13	-6,46 -0,15	-6,46 -0,15	-3,94 -0,30	8,66 -0,48	23,36 -0,75	36,31 -1,12
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-1,80 -0,04	-0,64 -0,07	-0,64 -0,07	1,86 -0,17	9,03 -0,31	18,84 -0,55	32,82 -0,85
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6% p.p.	-1,73 -2,31	-0,38 -2,36	-0,38 -2,36	2,06 -3,27	10,13 0,58	20,34 -1,04	35,89 3,93
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,60 -0,01	1,38 -0,06	1,38 -0,06	2,70 -0,13	6,40 -0,26	13,27 -0,53	23,59 -0,83
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-1,79 -0,04	-0,60 -0,03	-0,60 -0,03	1,92 -0,11	9,12 -0,21	18,91 -0,48	32,93 -0,74
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	1,11 0,51	2,57 1,14	2,57 1,14	4,09 1,26	11,15 4,49	19,40 5,61	31,38 6,96
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-13,12 -6,15	-12,58 -6,27	-12,58 -6,27	-10,06 -6,42	6,89 -2,25	23,16 -0,94	35,15 -2,28
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,34 5,63	-0,74 5,57	-0,74 5,57	1,66 5,30	6,93 -2,21	16,97 -7,14	29,44 -7,98
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	-1,66 -0,45	-0,66 -0,66	-0,66 -0,66	1,94 -0,52	7,78 -1,34	17,10 -2,04	30,56 -3,36
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,69 4,28	-1,23 5,08	-1,23 5,08	1,63 5,27	9,24 0,09	16,43 -7,67	24,70 -12,72
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-2,10 -0,17	-1,18 -0,17	-1,18 -0,17	0,61 -0,26	8,55 0,22	18,63 0,23	30,83 -0,39
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,11 -0,00	1,38 -0,04	1,38 -0,04	3,22 -0,09	10,87 -0,23	20,76 -0,49	35,94 -0,91
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,59 -0,02	1,38 -0,05	1,38 -0,05	2,73 -0,11	6,46 -0,20	13,39 -0,41	23,77 -0,64
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	-1,34 -397,33	-0,77 -75,70	-0,77 -75,70	0,11 4,79	3,40 62,59	9,80 80,86	19,00 88,24
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-14,22 -7,25	-13,42 -7,11	-13,42 -7,11	-11,76 -8,12	4,77 -4,37	17,76 -6,34	29,41 -8,01
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	-1,31 -387,82	-0,63 -62,35	-0,63 -62,35	0,40 17,76	3,68 67,66	10,81 89,12	20,84 96,79
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	-1,74	-0,72	-0,72	2,81	12,99		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-515,15	-71,11	-71,11	123,97	238,97		
BB PREV RF IMA-B	-7,12	-6,50	-6,50	-3,88	8,66	23,30	36,36
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,14	-0,19	-0,19	-0,24	-0,48	-0,81	-1,06
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	-0,03	0,59	0,59	1,74	4,81	11,34	20,78
% do CDI	-9,77	58,36	58,36	76,63	88,50	93,51	96,50
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,08	0,28	0,28	0,77	2,35	5,69	11,31
% do CDI	23,94	27,79	27,79	33,86	43,13	46,90	52,53
BB PREV RF FLUXO FIC	0,25	0,75	0,75	1,73	4,31	9,74	17,73
% do CDI	73,55	74,38	74,38	76,27	79,23	80,32	82,36
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,14	0,79	0,79	1,91	4,99	11,48	20,75
% do CDI	42,04	77,94	77,94	84,42	91,77	94,69	96,38
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	-7,92	-9,77	-9,77				
% do CDI	-2.339,34	-965,66	-965,66				
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	-31,64	-35,22	-35,22	-28,77	-13,41	-0,89	26,00
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-6,11	-3,98	-3,98	-7,35	-5,64	-5,77	-1,17
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-27,40	-30,98	-30,98	-22,11	-12,36	1,73	28,59
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,87	0,25	0,25	-0,69	-4,59	-3,15	1,41
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	-31,94	-35,94	-35,94	-26,62			
Var. IBOVESPA p.p.	-2,03	0,91	0,91	3,67			
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-27,05	-34,54	-34,54	-25,80	-18,01	-0,68	
Var. IBOVESPA p.p.	2,86	2,32	2,32	4,49	5,46	13,78	
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	-1,37	-11,87	-11,87	-9,11	-21,37	-26,20	-33,39
Var. IFIX p.p.	14,48	10,13	10,13	-2,03	-21,82	-31,99	-56,08
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,10	-0,15	-0,15	-29,49	-31,22	-29,79	-17,43
% do CDI	-28,16	-15,05	-15,05	-1.302,44	-574,12	-245,68	-80,96
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	6,30	6,80	6,80	12,71	27,06	62,46	91,78
Var. IBOVESPA p.p.	36,21	43,65	43,65	43,00	50,53	76,92	79,42
CDI	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,12	21,53
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
INPC + 6%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65
IPCA + 6%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,60	1,43	1,43	2,83	6,66	13,79	24,42
IRF-M 1+	-0,47	1,44	1,44	3,57	12,96	24,50	42,11
IRF-M TOTAL	-0,11	1,42	1,42	3,31	11,09	21,25	36,85
IMA-B 5	-1,75	-0,57	-0,57	2,03	9,34	19,39	33,68
IMA-B 5+	-10,93	-10,62	-10,62	-7,92	8,24	26,94	39,94
IMA-B TOTAL	-6,97	-6,31	-6,31	-3,64	9,14	24,10	37,42
IMA-C TOTAL	-3,52	-0,45	-0,45	1,38	13,06	32,40	46,04
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-1,93	-1,00	-1,00	0,87	8,34	18,40	31,22
IMA-GERAL TOTAL	-1,98	-0,99	-0,99	0,89	8,47	18,79	31,60
IDKA 2	-1,21	-0,00	-0,00	2,46	9,11	19,14	33,92
IDKA 20	-16,46	-17,67	-17,67	-14,94	5,94	33,16	42,21
CDI	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,12	21,53
Renda Variável							
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
IBRX 100	-30,09	-36,64	-36,64	-29,86	-22,20	-12,35	15,05
IBRX 50	-30,37	-37,60	-37,60	-31,47	-25,64	-17,77	8,61
SMALL CAP	-35,07	-40,17	-40,17	-27,52	-11,98	-1,62	31,66
IFIX	-15,85	-22,00	-22,00	-7,08	0,45	5,79	22,69
Índice Consumo - ICON	-31,51	-36,10	-36,10	-30,32	-6,98	-7,63	14,29
Índice Dividendos - IDIV	-25,53	-31,24	-31,24	-21,42	-7,78	4,87	27,17
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,07	0,53	0,53	2,31	3,30	8,03	10,93
INPC	0,18	0,54	0,54	2,36	3,31	8,13	9,82
IGPM	1,24	1,69	1,69	4,83	6,81	15,64	15,87
SELIC	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,13	21,55
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

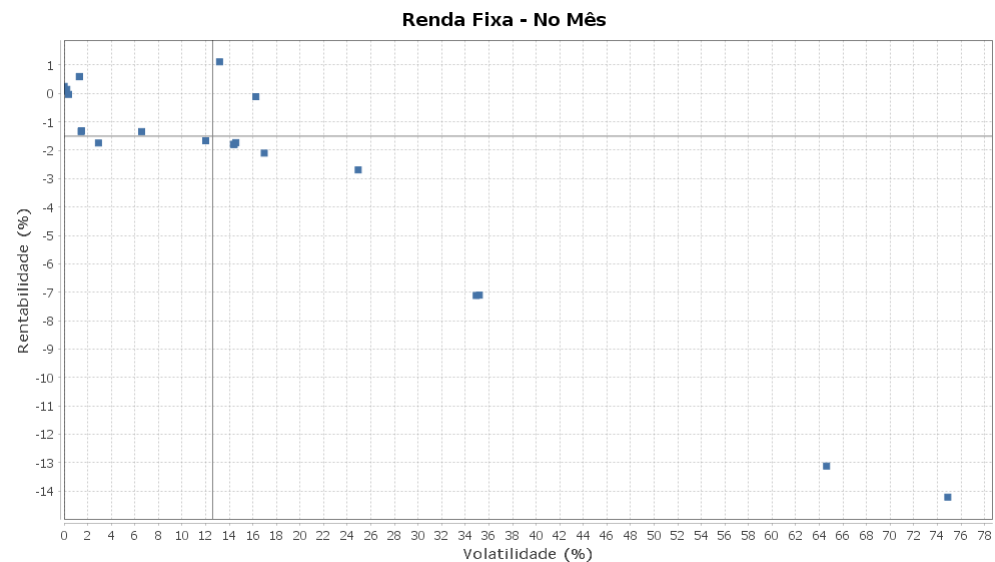
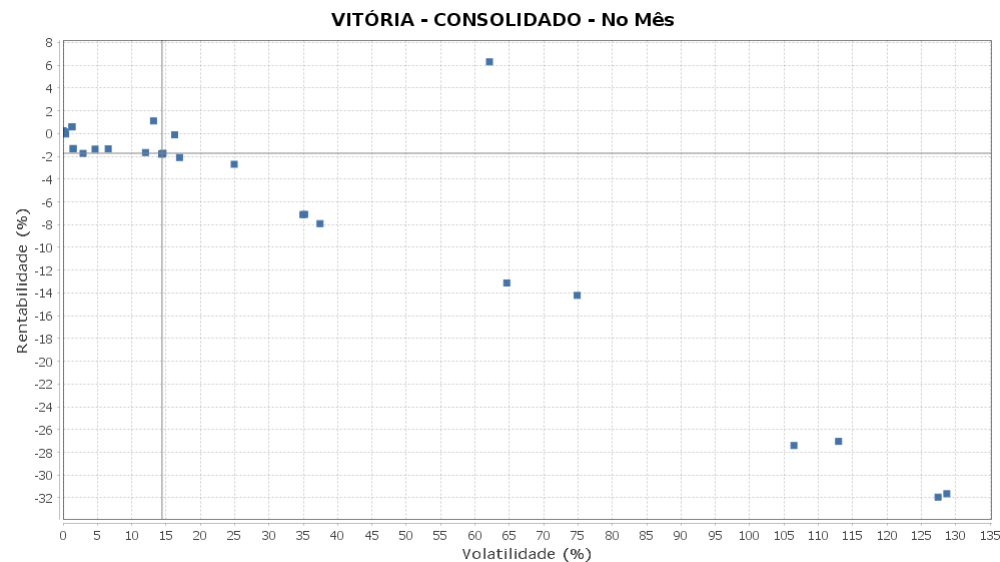
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
124	02/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	35.348,34	0,00	4.364,74695019	8,0986000800
107	02/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	54.592,17	0,00	6.740,93910808	8,0986000800
126	04/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	445,65	0,00	55,02323231	8,0993060800
109	06/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	805,03	0,00	99,38625877	8,1000131200
128	09/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.564,22	0,00	316,55603546	8,1003668000
111	09/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	3.612,43	0,00	445,95881757	8,1003668000
120	09/03/2020	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	1.500.000,00	0,00	864.316,66511483	1,7354750400
103	09/03/2020	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	1.500.000,00	359.419,74184241	4,1733934600
130	10/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.225,77	0,00	151,31616716	8,1007206500
113	10/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	319.383,82	0,00	39.426,59348462	8,1007206500
115	13/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	46.789,98	0,00	5.775,26926887	8,1017832800
102	24/03/2020	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	177.974,11	53.732,83582814	3,3122039300
132	25/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.654.574,67	0,00	204.167,56581587	8,1040035100
117	25/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	20.734.605,99	0,00	2.558.563,30323825	8,1040035100
123	27/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	8.985,99	1.108,77839775	8,1044057300
127	27/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	445,93	55,02315837	8,1044057300
131	27/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.226,33	151,31646179	8,1044057300
125	27/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	35.373,68	4.364,74692636	8,1044057300
129	27/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.565,50	316,55621467	8,1044057300
133	27/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.536.174,09	189.548,02377595	8,1044057300
122	27/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	15.228,48	1.879,03721844	8,1044057300
134	30/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	43.033,60	5.309,77002460	8,1046071300
121	30/03/2020	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	1.600.000,00	0,00	1.594.111,14142600	1,0036941330
108	30/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	54.632,66	6.740,93871840	8,1046071300
112	30/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.614,32	445,95869263	8,1046071300
116	30/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	46.806,29	5.775,26945467	8,1046071300
106	30/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.094.257,66	135.016,74324836	8,1046071300
110	30/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	805,49	99,38668057	8,1046071300

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
114	30/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	319.537,05	39.426,59340231	8,1046071300
118	30/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	16.306.563,54	2.012.011,59765532	8,1046071300
135	31/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	15.247,52	0,00	1.881,29305273	8,1048085400
119	31/03/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.302.430,32	160.698,46851681	8,1048085400
105	31/03/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	644,48	0,00	307,51978100	2,0957351030

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



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	3.217.968,05	0,50
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,25	1.395,40	0,00
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,24	0,03	0,14	8.266.308,49	1,29
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,38	0,04	-0,03	75.304,28	0,01
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,30	0,16	0,59	5.950.670,16	0,93
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,31	0,16	0,60	2.623.265,87	0,41
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	1,46	0,09	-1,34	5.341.980,77	0,83
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	1,48	0,09	-1,31	46.918.483,60	7,33
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	2,92	0,22	-1,74	22.992.511,60	3,59
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	4,66	0,42	-1,37	1.436.243,51	0,22
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	6,57	0,62	-1,34	2.339.177,52	0,37
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	12,01	1,17	-1,66	16.454.400,57	2,57
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	13,18	1,42	1,11	11.706.805,98	1,83
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	14,36	1,41	-1,79	22.183.541,96	3,46
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	14,42	1,41	-1,80	120.994.656,38	18,90
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	14,56	1,43	-1,73	9.310.841,50	1,45
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	16,25	1,68	-0,11	42.899.650,74	6,70
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	16,96	1,66	-2,10	78.437.469,91	12,25
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS	Artigo 7º I, Alínea b	24,93	2,46	-2,69	6.544.440,00	1,02
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	34,93	3,28	-7,12	70.656.893,63	11,03
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	35,19	3,31	-7,10	48.329.362,57	7,55
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	37,42	3,50	-7,92	2.412.680,76	0,38
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	62,09	6,71	6,30	4.449.997,40	0,69
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	64,61	6,05	-13,12	37.531.997,58	5,86
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	74,88	7,06	-14,22	34.709.421,26	5,42
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	106,44	9,57	-27,40	6.330.772,89	0,99
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	112,93	10,27	-27,05	9.483.840,45	1,48
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	127,42	11,45	-31,94	3.277.686,54	0,51
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	128,70	11,61	-31,64	14.102.086,13	2,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 15,32% 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 Instituto está com 17,63% 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 percentual alocado no Artigo 7, Inciso IV, Alínea A (30,01% dos recursos) está superior ao limite máximo estipulado em Política de Investimentos;