



LDB
EMPRESAS

VITÓRIA
ABRIL 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 92,37%

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	43.359.548,81	6,65	4.883.028.533,44	0,89
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	22,33	1,69	-11,10	37.844.034,10	5,80	248.411.318,97	15,23
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,53	0,41	1,79	2.634.081,83	0,40	7.168.032.689,23	0,04
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,33	1,30	-5,25	48.959.156,53	7,51	5.880.207.997,15	0,83
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,52	0,43	1,82	5.976.451,56	0,92	10.765.141.210,50	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	0,47	-0,18	121.557.597,81	18,64	9.104.032.681,09	1,34
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,07	0,32	-0,34	16.507.664,06	2,53	6.681.370.754,80	0,25
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,92	0,49	-0,12	22.291.467,85	3,42	4.608.504.106,72	0,48
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS	8,83	0,70	-0,54	6.589.988,00	1,01	440.292.930,31	1,50
BB	BB	BB PREV IPCA I	5,03	0,46	0,08	9.354.004,97	1,43	491.315.041,18	1,90
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	4,20	0,92	3,51	11.814.426,48	1,81	224.491.001,93	5,26
BB	BB	BB PREV RF VII	2,33	0,14	-0,60	2.342.524,12	0,36	668.626.387,30	0,35
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,01	0,91	-0,28	79.153.288,42	12,14	10.512.346.440,60	0,75
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,05	0,84	-1,56	408.384.234,54	62,61		

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	0,97	-1,63	-2,38	5.254.878,03	0,81	345.886.868,82	1,52
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,06	0,05	0,33	4.715.646,26	0,72	687.184.174,78	0,69
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,29	0,00	0,79	8.266.596,02	1,27	4.876.604.207,95	0,17
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	12,26	1,22	-5,36	71.519.222,65	10,97	1.433.166.438,94	4,99
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	25,49	2,06	-11,64	35.424.197,53	5,43	199.092.846,68	17,79
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,26	0,85	75.498,72	0,01	2.594.654.169,89	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	0,06	0,20	0,95	1.398,18	0,00	1.637.982.393,12	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,91	-1,61	-2,24	46.160.975,28	7,08	2.039.086.693,71	2,26
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,62	-1,55	-2,26	22.636.008,37	3,47	175.932.315,10	12,87
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			6,65	0,09	-5,42	194.054.421,04	29,75		
Renda Fixa			6,44	0,61	-2,32	602.438.655,58	92,37		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

6,84%

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	37,40	7,24	-25,99	6.789.053,53	1,04	714.263.825,61	0,95
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	43,87	20,45	-21,97	16.985.675,74	2,60	126.854.958,61	13,39
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	39,44	8,39	-29,05	11.879.492,57	1,82	659.703.695,70	1,80
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	46,12	12,64	-27,85	3.691.943,86	0,57	626.935.624,99	0,59
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			40,40	13,71	-25,39	39.346.165,70	6,03		

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	17,40	4,16	-6,02	2.513.078,77	0,39	126.765.838,67	1,98
Sub-total Artigo 8º III			17,40	4,16	-6,02	2.513.078,77	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 MULTIELABORAÇÃO	30,45	-0,16	-0,31	1.323.892,70	0,20	245.227.800,74	0,54
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			30,45	-0,16	-0,31	1.323.892,70	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	24,18	-0,15	-12,00	1.434.144,27	0,22	112.715.459,16	1,27
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			24,18	-0,15	-12,00	1.434.144,27	0,22		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			35,78	12,11	-23,25	44.617.281,44	6,84		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,79%

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	5.160.430,67	0,79	1.075.121.854,10	0,48
Sub-total Artigo 9º A, III			25,47	15,96	23,85	5.160.430,67	0,79		
Investimentos no Exterior			25,47	15,96	23,85	5.160.430,67	0,79		
Total						652.216.367,69	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	408.384.234,54	62,61	53,50	58,50	63,50	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	194.054.421,04	29,75	13,00	18,00	23,00	50,00
	Total Renda Fixa	602.438.655,58	92,37				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	39.346.165,70	6,03	1,00	6,00	11,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	2.513.078,77	0,39	0,00	2,00	7,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	1.323.892,70	0,20	0,00	0,50	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.434.144,27	0,22	0,00	1,00	5,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	44.617.281,44	6,84				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	5.160.430,67	0,79	0,00	1,00	6,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	5.160.430,67	0,79				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

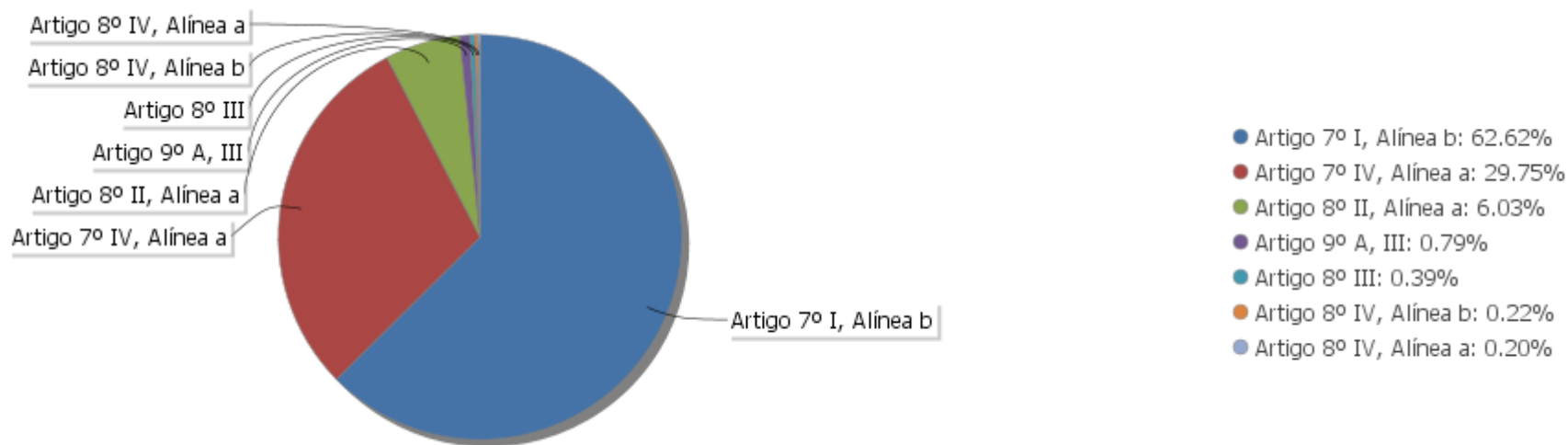
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,00 0,00	9,81 754,39	0,90 97,81	16,17 782,51	24,55 472,75	0,00	3.463.250,51
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,84 293,79	-1,56 -119,66	-2,08 -225,71	-1,42 -68,59	8,54 164,53	3.390.396,44	-6.599.074,24
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,09 30,37	-5,42 -416,67	-5,83 -633,42	-5,76 -278,65	3,95 76,16	378.187,38	-10.452.095,53
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	13,71 3,46	-25,39 5,00	-26,33 2,90	-18,14 6,78	-5,17 11,28	4.551.779,69	-11.654.881,36
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	4,16 -6,09	-6,02 24,37	-6,27 22,97			100.398,01	-174.227,80
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,16 -10,41	-0,31 30,07	-0,33 28,90	-26,22 -1,31	-31,27 -14,82	-2.158,74	-4.181,28
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-0,15 -10,40	-12,00 18,39	-2,21 27,03	-13,27 11,64	-20,30 -3,86	-2.099,24	-195.506,19
Artigo 9º A, III % do CDI	15,96 5.603,14	23,85 1.834,43	16,27 1.768,47	32,52 1.573,89	39,65 763,72	710.433,27	993.614,87
						9.126.936,81	-24.623.101,02

Análise de Liquidez

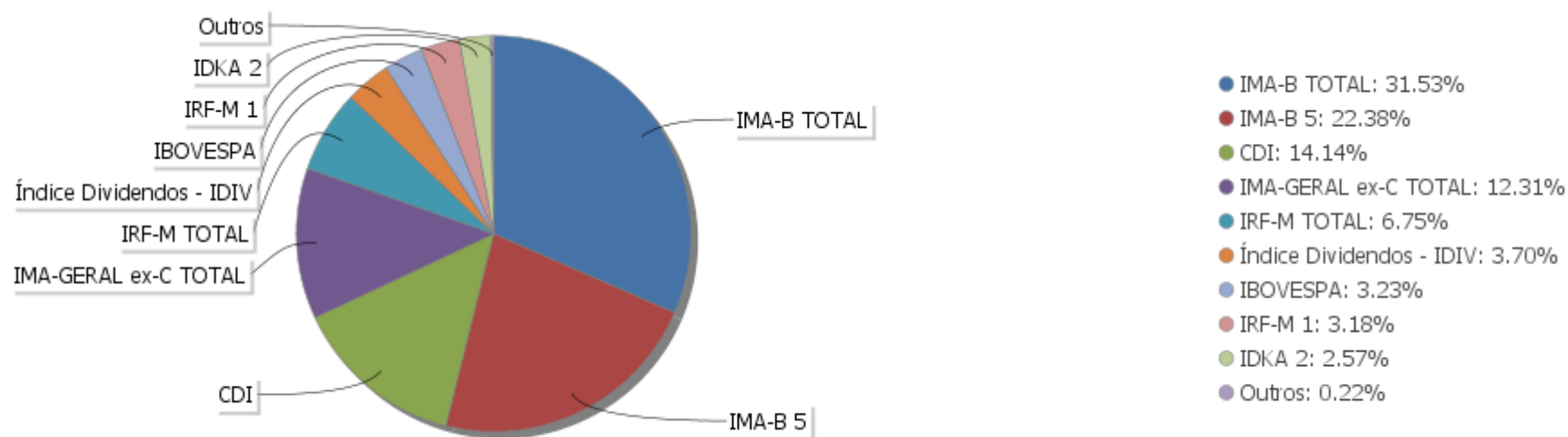
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	591.825.647,93	90,74	591.825.647,93	90,74
de 31 a 364 dias	39.346.165,70	6,03	631.171.813,63	96,77
acima de 365 dias	21.044.554,06	3,23	652.216.367,69	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

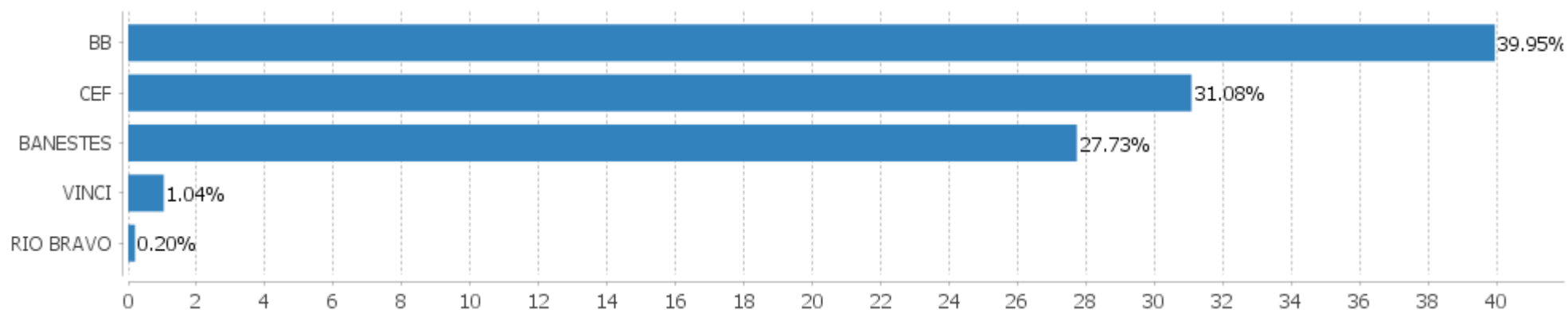


Alocação Por Estratégia



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	1,40									-3,74
INPC + 5,5%	0,66	0,55	0,65	0,19									2,07
p.p. indexador	0,34	-0,64	-6,59	1,21									-5,82
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

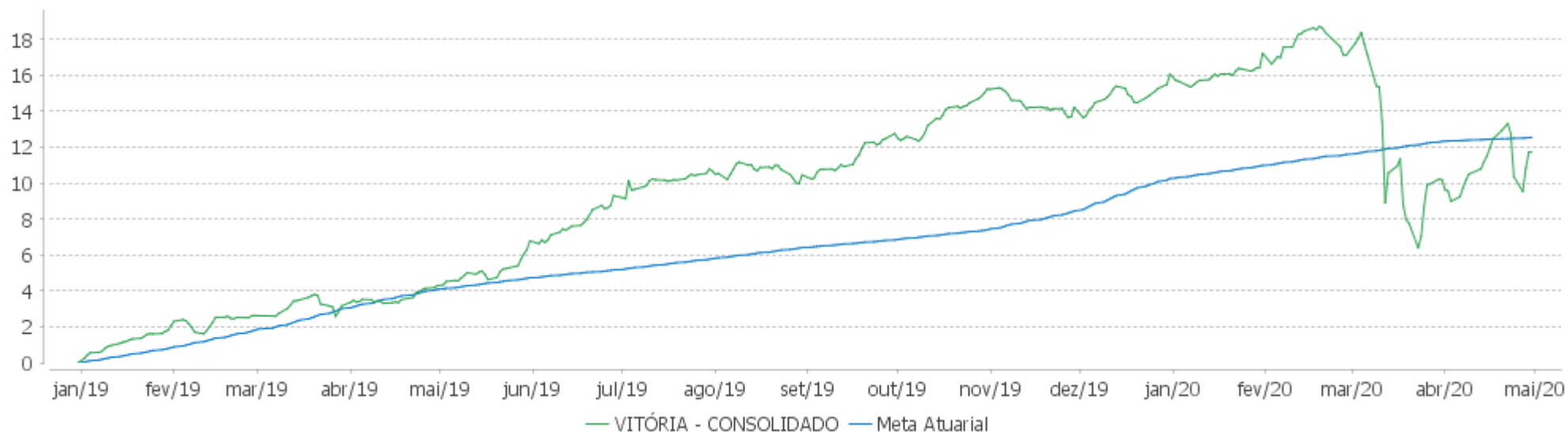
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

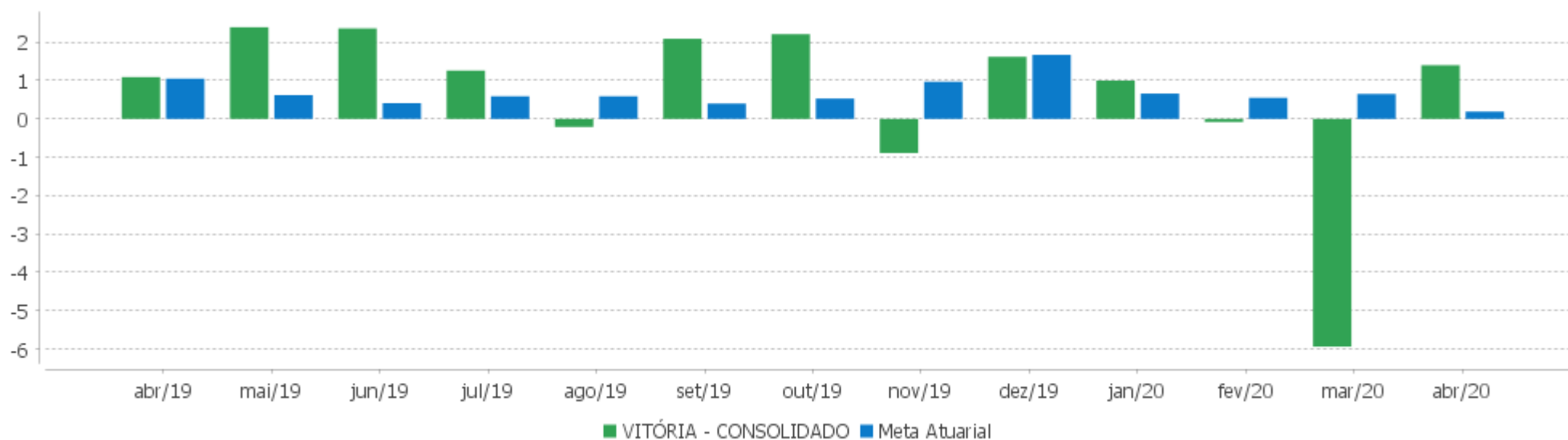
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	9	56,25	03 meses	-4,70	1,40	-6,10	14,16
Meses abaixo da Meta Atuarial	7	43,75	06 meses	-3,05	4,87	-7,92	10,13
			12 meses	7,13	8,47	-1,34	7,40
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,39	2019-05	Desde 31/12/2018	11,72	13,07	-1,35	6,53
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
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	-1,63 -572,26	-2,38 -183,42	-2,72 -295,18	-1,83 -88,63	1,21 23,36	7,44 62,73	16,15 77,16
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,06 0,75	-11,64 -6,56	-12,28 -6,96	-13,59 -8,04	5,28 -3,66	20,20 -5,71	33,24 -6,44
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	-1,61 -566,65	-2,24 -171,96	-2,62 -284,83	-1,58 -76,58	1,44 27,82	8,38 70,64	17,91 85,56
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	-1,55 -544,18	-2,26 -173,79	-2,86 -310,57	-1,15 -55,67	10,27 197,82		
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,22 -0,09	-5,36 -0,28	-5,60 -0,28	-5,85 -0,30	8,39 -0,55	25,02 -0,90	38,51 -1,17
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,26 90,62	0,85 65,42	0,50 54,23	1,55 75,16	4,55 87,67	11,05 93,13	20,15 96,28
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO % do CDI	0,05 17,30	0,33 25,44	0,21 23,15	0,61 29,28	2,12 40,82	5,45 45,97	10,72 51,25
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,20 69,79	0,95 73,32	0,67 72,37	1,54 74,49	4,07 78,35	9,49 79,98	17,11 81,78
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,00 1,22	0,79 60,96	0,42 45,66	1,46 70,60	4,46 85,97	10,92 92,02	19,81 94,64
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,30 -0,01	-5,25 -0,17	-5,48 -0,15	-5,82 -0,27	8,47 -0,47	25,17 -0,75	38,56 -1,12
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,47 -0,02	-0,18 -0,09	-0,72 -0,08	0,68 -0,18	8,37 -0,30	18,91 -0,56	32,52 -0,86
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6% p.p.	0,46 0,31	0,08 -2,05	-0,55 -1,96	0,88 -3,95	9,27 0,71	20,67 -0,04	36,11 4,68
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,41 -0,03	1,79 -0,09	1,37 -0,07	2,51 -0,14	6,31 -0,29	13,19 -0,53	23,04 -0,85
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,49 -0,00	-0,12 -0,03	-0,67 -0,03	0,76 -0,10	8,48 -0,19	19,01 -0,46	32,65 -0,73
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,92 0,47	3,51 1,63	2,77 1,34	4,10 1,45	11,55 4,94	19,86 6,14	31,52 7,63
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,69 0,38	-11,10 -6,02	-11,59 -6,26	-12,78 -7,22	7,09 -1,85	25,47 -0,45	38,78 -0,90
BB PREV RF VII	0,14	-0,60	-0,79	0,75	5,98	16,46	28,78

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.	-1,17	4,48	4,53	6,30	-2,96	-9,45	-10,90
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS	0,70	-0,54	-1,33	-0,05	8,71	17,58	25,46
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,62	4,54	4,00	5,50	-0,23	-8,33	-14,22
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 RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	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
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	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 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
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	4,16	-6,02	-6,27	-3,53			
% do CDI	1.460,47	-463,03	-681,29	-170,61			
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	-0,15	-12,00	-2,21	-13,27	-20,30	-25,97	-33,39
Var. IFIX p.p.	-4,54	6,58	13,19	-6,53	-24,10	-37,36	-61,27
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTISTRATÉGIA	-0,16	-0,31	-0,33	-26,22	-31,27	-31,81	-17,10
% do CDI	-57,14	-24,22	-36,16	-1.269,05	-602,23	-268,07	-81,69
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	20,45	-21,97	-23,52	-16,17	0,28	20,54	49,01
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	16,69	6,68	3,98	3,51	7,46	10,16	18,25
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
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	12,64	-27,85	-30,07	-19,61			
Var. IBOVESPA p.p.	2,39	2,54	-0,84	5,30			
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	8,39	-29,05	-28,01	-20,57	-13,78	5,57	
Var. IBOVESPA p.p.	-1,86	1,34	1,22	4,34	2,67	12,09	
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
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	4,96	6,68	15,90	18,09
SELIC	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,94
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
146	01/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	330,52	0,00	40,77971868	8,1050093200
140	03/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	969.645,98	119.629,56487814	8,1054042200
171	03/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.274,54	280,62018109	8,1054042200
138	06/04/2020	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	150.000,00	43.217,39229672	3,4708248700
141	06/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	433.925,03	53.533,96039752	8,1056030000
174	06/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	32.896,44	0,00	4.058,48152198	8,1056030000
148	07/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	3.877,33	0,00	478,34009580	8,1058017800
150	08/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	7.275,77	0,00	897,57825399	8,1060007500
152	09/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	6.738,32	0,00	831,25508870	8,1062000000
142	13/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	9.260,45	1.142,36291885	8,1063993300
143	14/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.183,70	269,37313895	8,1065989300
154	16/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	315.341,09	0,00	38.897,39185107	8,1069983100
144	20/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	484,15	59,71705982	8,1073984800
156	23/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	45.703,38	0,00	5.636,96489828	8,1077992900
176	23/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	33.950,16	0,00	4.187,34588582	8,1077992900
158	28/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	20.362.732,71	0,00	2.511.312,77949050	8,1084016600
178	28/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.646.071,81	0,00	203.008,17337655	8,1084016600
139	29/04/2020	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	162.442,64	44.576,28683260	3,6441492000
153	29/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	6.740,32	831,25540345	8,1086029300
155	29/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	315.403,51	38.897,39240197	8,1086029300
157	29/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	45.707,91	5.636,96488712	8,1086029300
159	29/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	15.788.042,44	1.947.073,07489282	8,1086029300
145	29/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.712.684,99	211.218,25853174	8,1086029300
147	29/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	330,67	40,78014460	8,1086029300
149	29/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.878,67	478,34010784	8,1086029300
151	29/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	7.278,11	897,57878920	8,1086029300
173	29/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	15.254,66	1.881,29325504	8,1086029300
177	29/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	33.953,53	4.187,34648781	8,1086029300

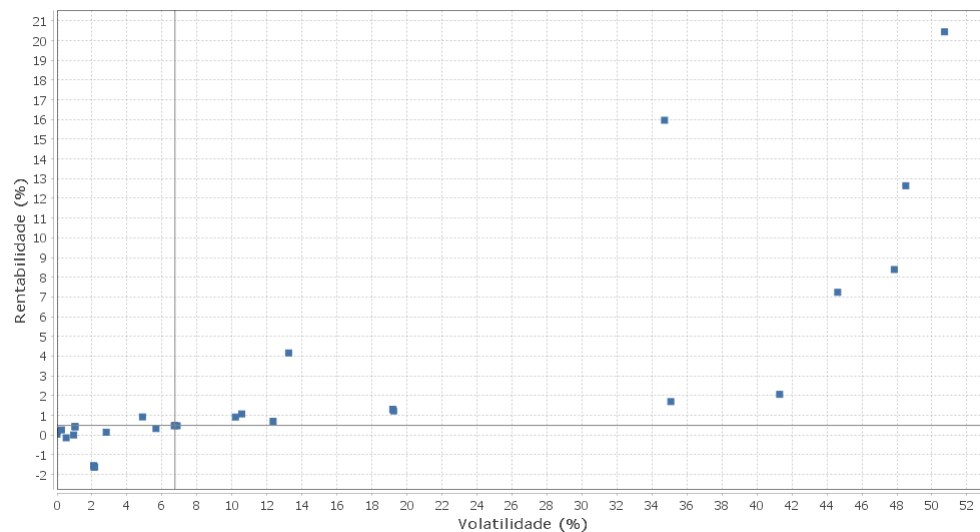
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
175	29/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	32.908,62	4.058,48211882	8,1086029300
179	29/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.480.083,43	182.532,48343485	8,1086029300
172	29/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	73.213,81	9.029,15220193	8,1086029300
181	30/04/2020	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	1.600.000,00	0,00	1.503.659,40231900	1,0640707580
160	30/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	39.598,61	4.883,40928935	8,1088042500
180	30/04/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	13.902,18	0,00	1.714,45500118	8,1088042500

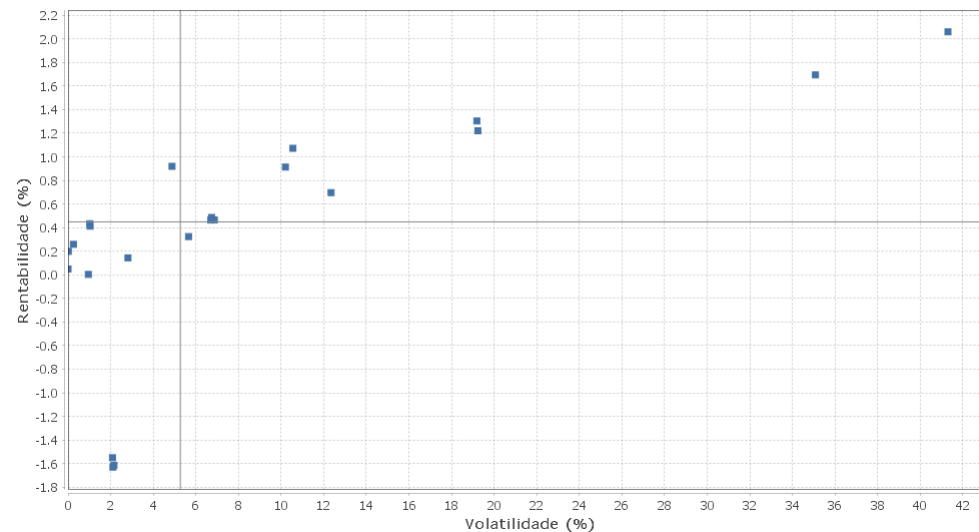
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

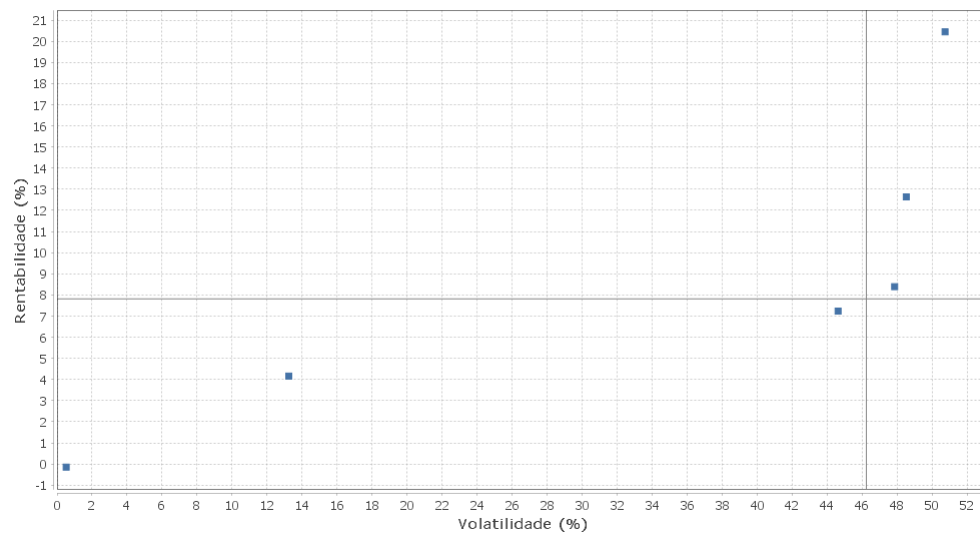
VITÓRIA - CONSOLIDADO - No Mês



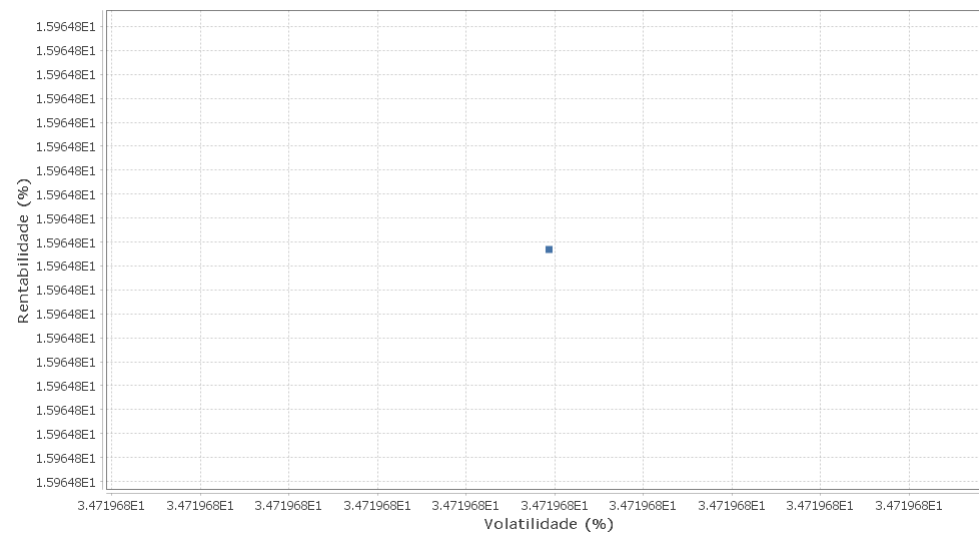
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,00	0,05	4.715.646,26	0,72
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,01	0,20	1.398,18	0,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,25	0,04	0,26	75.498,72	0,01
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	0,52	0,05	-0,15	1.434.144,27	0,22
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,95	0,10	0,00	8.266.596,02	1,27
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,02	0,13	0,43	5.976.451,56	0,92
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,03	0,13	0,41	2.634.081,83	0,40
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	2,08	0,14	-1,55	22.636.008,37	3,47
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	2,11	0,14	-1,63	5.254.878,03	0,81
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	2,15	0,14	-1,61	46.160.975,28	7,08
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	2,81	0,30	0,14	2.342.524,12	0,36
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	4,88	0,55	0,92	11.814.426,48	1,81
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	5,66	0,60	0,32	16.507.664,06	2,53
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	6,70	0,72	0,46	9.354.004,97	1,43
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,74	0,72	0,49	22.291.467,85	3,42
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,87	0,73	0,47	121.557.597,81	18,64
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	10,20	1,10	0,91	79.153.288,42	12,14
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	10,56	1,15	1,07	43.359.548,81	6,65
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS	Artigo 7º I, Alínea b	12,35	1,31	0,70	6.589.988,00	1,01
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	13,24	1,58	4,16	2.513.078,77	0,39
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	19,19	2,05	1,30	48.959.156,53	7,51
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	19,24	2,05	1,22	71.519.222,65	10,97
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	34,72	4,34	15,96	5.160.430,67	0,79
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	35,08	3,72	1,69	37.844.034,10	5,80
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	41,30	4,38	2,06	35.424.197,53	5,43
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	44,62	4,97	7,24	6.789.053,53	1,04
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	47,85	5,36	8,39	11.879.492,57	1,82
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	48,51	5,62	12,64	3.691.943,86	0,57
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	50,73	6,19	20,45	16.985.675,74	2,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 15,23% 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 17,79% 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 (29,75% dos recursos) está superior ao limite máximo estipulado em Política de Investimentos;