



LDB
EMPRESAS

VITÓRIA
MAIO 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	91,81%
------------	--------

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	5,87	1,38	3,88	43.957.011,80	6,61	4.981.094.634,77	0,88
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	22,64	0,71	-10,47	37.960.392,14	5,71	260.165.233,98	14,59
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,54	0,39	2,19	2.644.321,06	0,40	7.581.218.915,05	0,03
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,48	1,50	-3,82	49.693.849,40	7,48	5.962.762.833,75	0,83
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,54	0,39	2,22	5.999.939,96	0,90	10.824.772.393,85	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,00	2,11	1,92	124.116.699,57	18,68	8.882.233.150,63	1,40
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,12	2,00	1,65	16.837.916,72	2,53	6.335.156.883,21	0,27
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,97	2,11	1,99	22.761.353,40	3,43	4.431.593.608,10	0,51
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS	8,94	3,16	2,60	6.797.904,00	1,02	454.184.206,37	1,50
BB	BB	BB PREV IPCA I	5,05	2,10	2,18	9.550.236,51	1,44	501.622.017,02	1,90
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	4,21	0,81	4,35	11.909.738,37	1,79	208.974.590,90	5,70
BB	BB	BB PREV RF VII	2,34	1,25	0,64	2.371.759,13	0,36	676.970.933,69	0,35
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,08	1,07	0,79	80.001.925,71	12,04	10.653.642.517,78	0,75
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,11	1,56	-0,02	414.603.047,77	62,39		

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	0,99	0,37	-2,02	5.274.403,69	0,79	323.135.106,30	1,63
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,06	0,03	0,36	4.492.847,20	0,68	754.928.997,84	0,60
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,30	0,33	1,12	8.293.737,65	1,25	4.656.011.205,04	0,18
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	12,41	1,54	-3,89	72.623.062,82	10,93	1.446.799.170,09	5,02
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	25,86	1,49	-10,32	35.740.151,51	5,38	225.670.767,85	15,84
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,26	1,11	75.691,82	0,01	2.574.764.271,12	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	0,16	1,11	2.045,74	0,00	1.994.953.765,50	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,92	0,25	-1,99	46.277.313,52	6,96	1.967.279.723,17	2,35
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,56	0,37	-1,90	22.719.326,62	3,42	177.142.920,74	12,83
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			6,73	0,99	-4,48	195.498.580,57	29,42		
Renda Fixa			6,49	1,37	-0,98	610.101.628,34	91,81		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,39%

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	38,32	7,50	-20,43	7.298.519,97	1,10	768.284.939,45	0,95
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	44,74	6,55	-16,86	18.097.611,10	2,72	141.474.377,54	12,79
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	40,12	7,48	-23,74	14.368.297,47	2,16	710.762.724,82	2,02
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	45,05	7,64	-22,34	3.973.996,59	0,60	675.160.336,89	0,59
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			41,13	7,10	-20,09	43.738.425,13	6,58		

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	16,47	2,38	-3,78	2.572.894,90	0,39	130.575.333,52	1,97
Sub-total Artigo 8º III			16,47	2,38	-3,78	2.572.894,90	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	30,58	-0,00	-0,31	1.323.892,70	0,20	245.227.800,74	0,54
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			30,58	0,00	-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	24,43	3,01	-9,35	1.477.327,82	0,22	112.715.459,16	1,31
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			24,43	3,01	-9,35	1.477.327,82	0,22		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			36,51	6,49	-18,27	49.112.540,55	7,39		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 0,80%

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	25,65	2,78	27,29	5.303.971,20	0,80	1.133.955.741,98	0,47
Sub-total Artigo 9º A, III			25,65	2,78	27,29	5.303.971,20	0,80		
Investimentos no Exterior			25,65	2,78	27,29	5.303.971,20	0,80		
Total						664.518.140,09	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	414.603.047,77	62,39	53,50	58,50	63,50	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	195.498.580,57	29,42	13,00	18,00	23,00	50,00
	Total Renda Fixa	610.101.628,34	91,81				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	43.738.425,13	6,58	1,00	6,00	11,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	2.572.894,90	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	1.477.327,82	0,22	0,00	1,00	5,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	49.112.540,55	7,39				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	5.303.971,20	0,80	0,00	1,00	6,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	5.303.971,20	0,80				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

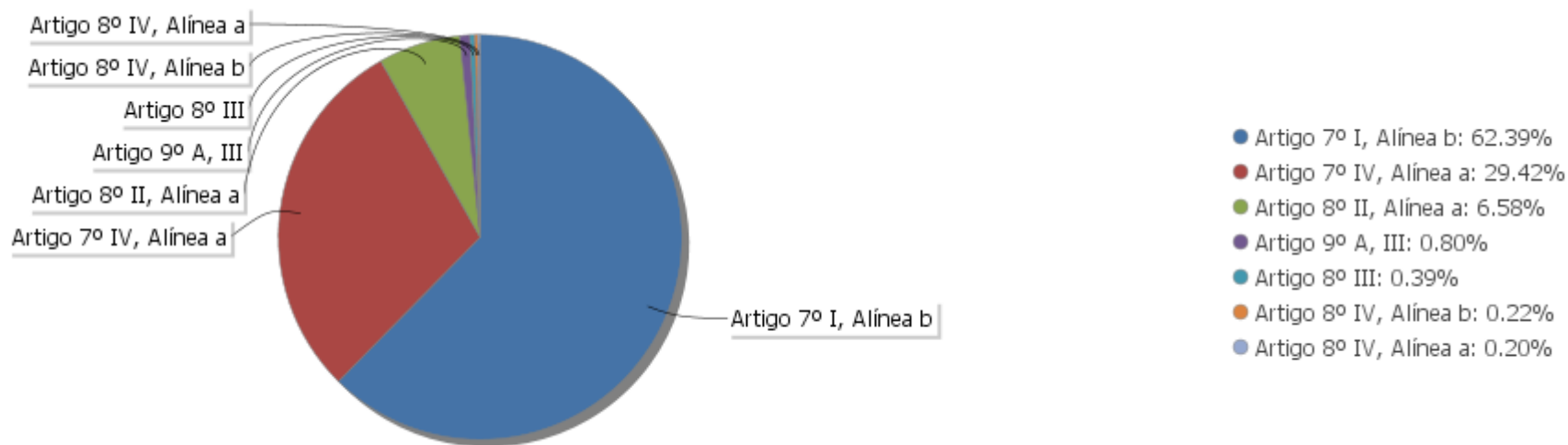
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,00 0,00	9,81 637,28	0,00 0,00	10,77 561,08	18,68 383,54	0,00	3.463.250,51
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,56 661,47	-0,02 -1,29	-1,06 -123,14	1,30 67,80	7,92 162,60	6.368.813,23	-230.261,01
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,99 417,95	-4,48 -291,41	-5,21 -604,16	-2,97 -154,79	2,86 58,82	1.879.767,75	-8.572.327,78
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	7,10 -1,47	-20,09 4,33	-14,41 1,69	-13,49 5,76	-0,12 9,80	2.792.259,43	-8.862.621,93
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,38 -6,19	-3,78 20,64	-1,80 14,30			59.816,13	-114.411,67
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,00 -8,57	-0,31 24,11	-0,26 15,84	-26,14 -6,90	-31,15 -21,23	0,00	-4.181,28
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	3,01 -5,56	-9,35 15,07	1,45 17,55	-9,36 9,89	-18,91 -8,98	43.183,55	-152.322,64
Artigo 9º A, III % do CDI	2,78 1.179,59	27,29 1.773,53	26,70 3.099,57	25,05 1.305,26	53,85 1.105,57	143.540,53	1.137.155,40
						11.287.380,62	-13.335.720,40

Análise de Liquidez

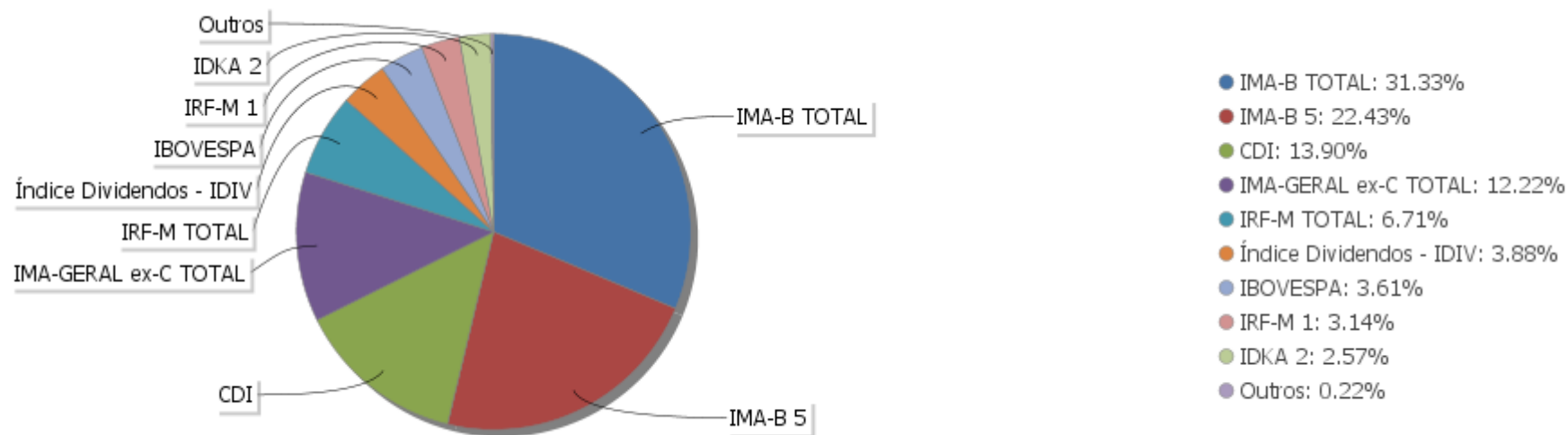
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	599.258.594,80	90,18	599.258.594,80	90,18
de 31 a 364 dias	43.738.425,13	6,58	642.997.019,93	96,76
acima de 365 dias	21.521.120,16	3,24	664.518.140,09	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

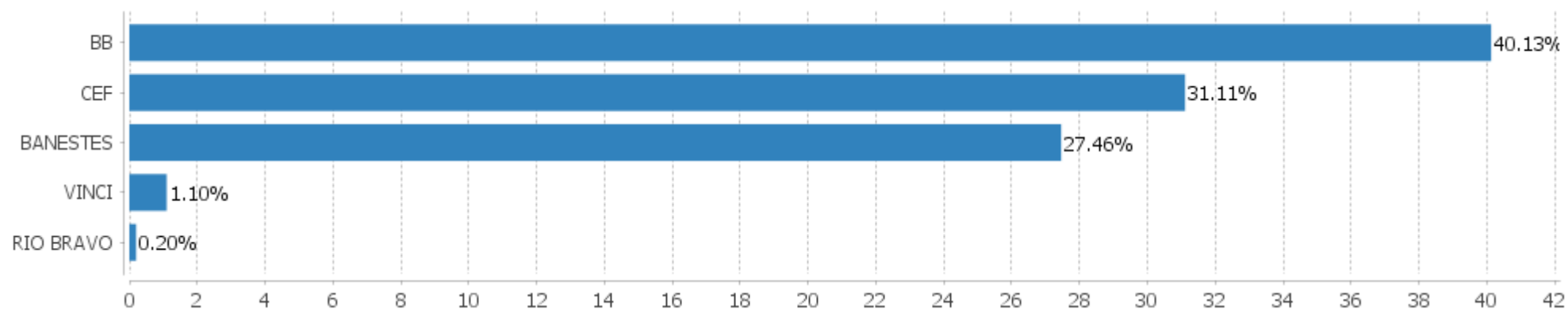


Alocação Por Estratégia



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	1,73								-2,08
INPC + 5,5%	0,66	0,55	0,65	0,19	0,17								2,25
p.p. indexador	0,34	-0,64	-6,59	1,21	1,56								-4,33
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

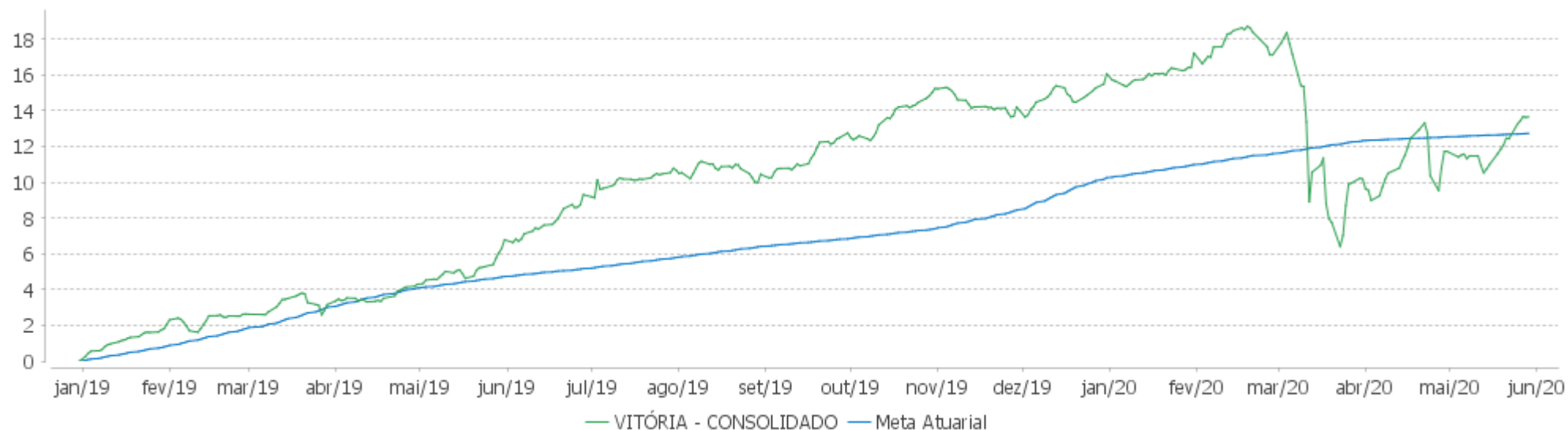
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

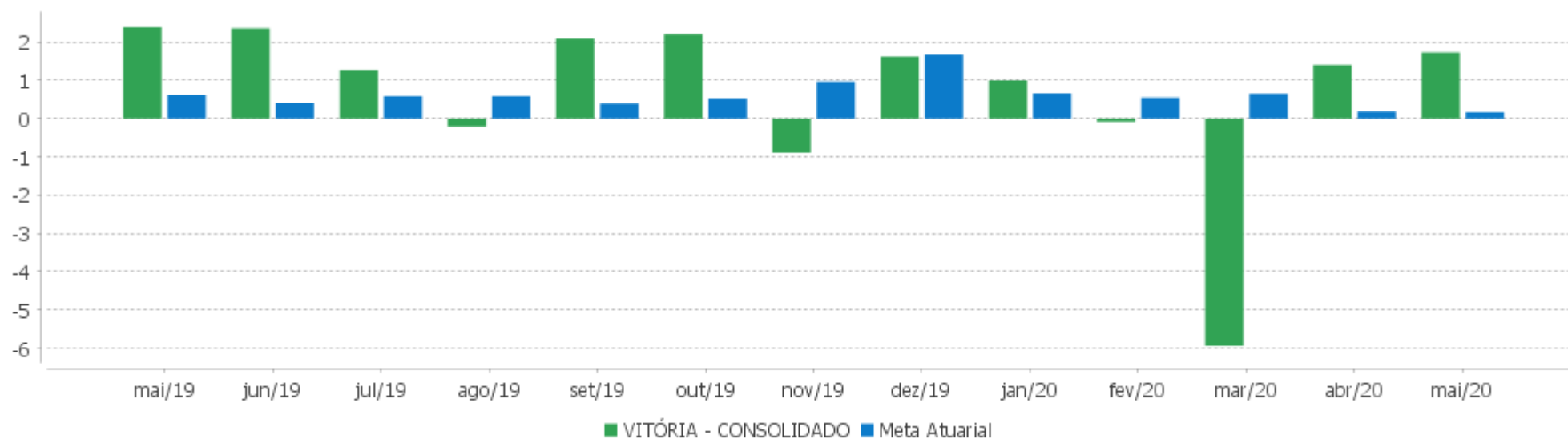
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	10	58,82	03 meses	-2,96	1,02	-3,99	14,00
Meses abaixo da Meta Atuarial	7	41,18	06 meses	-0,49	4,00	-4,49	10,27
			12 meses	6,44	7,94	-1,50	7,49
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,39	2019-05	Desde 31/12/2018	13,65	13,27	0,38	6,43
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.	1,50 -0,02	-3,82 -0,19	-4,48 -0,16	-1,91 -0,20	6,23 -0,45	31,21 -0,78	42,33 -1,17
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	2,11 -0,02	1,92 -0,11	0,74 -0,08	3,15 -0,14	9,15 -0,31	23,37 -0,56	35,19 -0,90
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6% p.p.	2,10 2,02	2,18 -0,04	0,80 -0,02	3,39 -0,51	9,69 1,73	26,84 7,09	39,47 9,01
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,39 -0,03	2,19 -0,12	1,41 -0,07	2,60 -0,14	6,04 -0,28	13,42 -0,55	22,44 -0,85
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	2,11 -0,01	1,99 -0,04	0,77 -0,05	3,20 -0,09	9,26 -0,20	23,45 -0,48	35,33 -0,77
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,71 -0,81	-10,47 -6,83	-11,02 -6,71	-8,17 -6,46	2,16 -4,52	33,67 1,67	42,63 -0,88
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,81 0,39	4,35 2,04	2,87 1,40	4,81 2,07	10,49 4,17	20,96 6,99	32,13 8,85
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,25 -0,27	0,64 4,28	0,03 4,35	1,57 3,27	6,31 -0,37	18,52 -13,48	30,05 -13,46
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,16 1,64	2,60 6,24	1,08 5,39	4,13 5,83	9,51 2,83	25,45 -6,54	29,93 -13,58
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	2,00 0,25	1,65 -0,68	0,63 -0,47	2,82 -0,74	8,06 -0,97	20,02 -2,15	32,08 -3,11
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,07 0,10	0,79 -0,00	-0,15 0,00	1,76 0,05	7,59 0,17	22,37 0,40	33,47 0,42
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,39 -0,02	2,22 -0,09	1,42 -0,05	2,63 -0,11	6,11 -0,21	13,55 -0,42	22,63 -0,66
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,38 -0,04	3,88 -0,17	2,35 -0,12	4,51 -0,19	10,99 -0,31	25,54 -0,61	38,26 -0,97
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,49 -0,03	-10,32 -6,68	-11,15 -6,83	-8,19 -6,49	1,29 -5,39	29,08 -2,91	38,10 -5,41
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,37 157,57	-2,02 -131,37	-2,59 -300,91	-1,68 -87,54	1,05 21,59	7,31 63,27	15,50 77,12
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,25 106,88	-1,99 -129,26	-2,66 -308,85	-1,60 -83,14	1,11 22,69	8,06 69,76	17,05 84,81
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	0,37	-1,90	-2,91	-0,78	8,23		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	156,09	-123,43	-337,83	-40,77	168,95		
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,54 0,03	-3,89 -0,26	-4,53 -0,21	-1,96 -0,26	6,22 -0,46	31,06 -0,93	42,41 -1,10
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,26 108,46	1,11 72,02	0,48 55,88	1,47 76,39	4,27 87,61	10,77 93,25	19,35 96,29
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,16 66,82	1,11 72,28	0,61 70,39	1,40 72,95	3,77 77,32	9,20 79,65	16,34 81,31
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO % do CDI	0,03 12,47	0,36 23,40	0,16 18,55	0,49 25,52	1,86 38,21	5,20 45,02	10,02 49,87
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,33 139,24	1,12 73,00	0,47 55,08	1,48 77,07	4,25 87,22	10,73 92,88	19,09 94,97
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTIESTRATÉGIA % do CDI	0,00 0,00	-0,31 -20,46	-0,26 -29,94	-26,14 -1.362,24	-31,15 -639,57	-31,74 -274,74	-16,98 -84,49
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p.	3,01 0,93	-9,35 7,54	1,45 11,78	-9,36 -1,31	-18,91 -23,02	-22,34 -42,37	-30,43 -59,64
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP % do CDI	2,38 1.009,38	-3,78 -245,78	-1,80 -209,02	-1,46 -75,94			
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	6,55 1,54	-16,86 8,22	-12,28 6,59	-10,89 6,71	3,44 8,94	41,18 11,64	66,84 21,26
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	7,50 2,50	-20,43 4,65	-16,30 2,56	-13,65 3,95	-1,18 4,33	31,96 2,42	50,60 5,01
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	7,64 -0,93	-22,34 2,08	-17,48 -1,38	-15,12 4,13			
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,48 -1,08	-23,74 0,68	-15,01 1,09	-17,02 2,22	-8,97 0,96	29,31 15,44	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	2,78 -5,79	27,29 51,71	26,70 42,80	25,05 44,30	53,85 63,77	66,23 52,36	116,02 76,65
CDI	0,24	1,54	0,86	1,92	4,87	11,55	20,10
IBOVESPA	8,57	-24,42	-16,10	-19,25	-9,92	13,87	39,37
INPC + 6%	0,21	2,45	1,14	4,20	8,15	20,09	29,45
IPCA + 6%	0,08	2,22	0,82	3,90	7,97	19,75	30,46

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	0,42	2,31	1,47	2,74	6,33	13,97	23,28
IRF-M 1+	1,92	4,94	2,96	5,70	13,65	31,67	46,28
IRF-M TOTAL	1,42	4,05	2,47	4,69	11,31	26,14	39,22
IMA-B 5	2,12	2,03	0,82	3,29	9,46	23,93	36,10
IMA-B 5+	1,02	-7,88	-8,21	-5,48	4,17	38,08	48,04
IMA-B TOTAL	1,52	-3,64	-4,32	-1,70	6,68	31,99	43,51
IMA-C TOTAL	2,63	3,59	0,39	4,00	13,32	37,08	56,72
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,97	0,80	-0,15	1,71	7,42	21,97	33,05
IMA-GERAL TOTAL	1,02	0,88	-0,13	1,78	7,59	22,39	33,68
IDKA 2	1,75	2,33	1,10	3,57	9,03	22,17	35,19
IDKA 20	0,44	-15,84	-14,60	-12,53	-2,27	47,87	55,09
CDI	0,24	1,54	0,86	1,92	4,87	11,55	20,10
Renda Variável							
IBOVESPA	8,57	-24,42	-16,10	-19,25	-9,92	13,87	39,37
IBRX 100	8,52	-24,19	-16,35	-18,67	-8,92	16,77	41,65
IBRX 50	9,10	-24,78	-16,07	-19,84	-11,37	10,51	35,55
SMALL CAP	5,07	-30,73	-24,82	-21,96	-1,69	25,45	48,98
IFIX	2,08	-16,88	-10,33	-8,05	4,11	20,03	29,22
Índice Consumo - ICON	7,65	-19,06	-13,24	-12,56	7,69	32,60	36,80
Índice Dividendos - IDIV	5,00	-25,08	-18,87	-17,60	-5,50	29,54	45,59
Indicadores Econômicos							
IPCA	-0,38	-0,16	-0,62	0,99	1,88	6,62	9,67
INPC	-0,25	0,06	-0,30	1,28	2,05	6,93	8,81
IGPM	0,28	2,79	2,34	4,94	6,51	14,65	19,54
SELIC	0,24	1,54	0,86	1,92	4,87	11,55	20,11
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
187	04/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.316,75	0,00	285,70092984	8,1090040600
206	04/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.639,50	0,00	202,18265867	8,1090040600
185	05/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.755.210,42	339.763,35768941	8,1092041200
184	05/05/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	644,48	0,00	306,84332600	2,1003552750
203	05/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	5.118,07	631,14331866	8,1092041200
189	06/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	459,03	0,00	56,60466068	8,1094029100
191	07/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	424,41	0,00	52,33425901	8,1096017800
193	08/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	2.566,82	0,00	316,50774283	8,1098174000
195	11/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	315.341,09	0,00	38.883,43266226	8,1099087300
183	21/05/2020	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	150.000,00	41.125,99317320	3,6473283300
197	22/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	34.709,74	0,00	4.279,48514609	8,1107280000
208	22/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	33.877,50	0,00	4.176,87536803	8,1107280000
199	26/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	20.034.269,64	0,00	2.470.039,29936953	8,1109112900
210	26/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.631.903,76	0,00	201.198,57086983	8,1109112900
182	27/05/2020	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	0,00	212.170,62	26.205,07217606	8,0965478200
201	27/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	6.392,32	0,00	788,10471217	8,1110034000
188	28/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.317,35	285,70122530	8,1110957700
192	28/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	424,49	52,33448255	8,1110957700
196	28/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	315.387,25	38.883,43313199	8,1110957700
200	28/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	15.788.693,95	1.946.554,99055956	8,1110957700
186	28/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.781.139,36	219.592,93916708	8,1110957700
190	28/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	459,13	56,60517555	8,1110957700
194	28/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.567,22	316,50717397	8,1110957700
198	28/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	34.711,31	4.279,48466943	8,1110957700
207	28/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.639,92	202,18230021	8,1110957700
211	28/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.433.526,12	176.736,43126026	8,1110957700
204	28/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	160.961,02	19.844,54684845	8,1110957700
205	28/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	13.906,11	1.714,45516048	8,1110957700

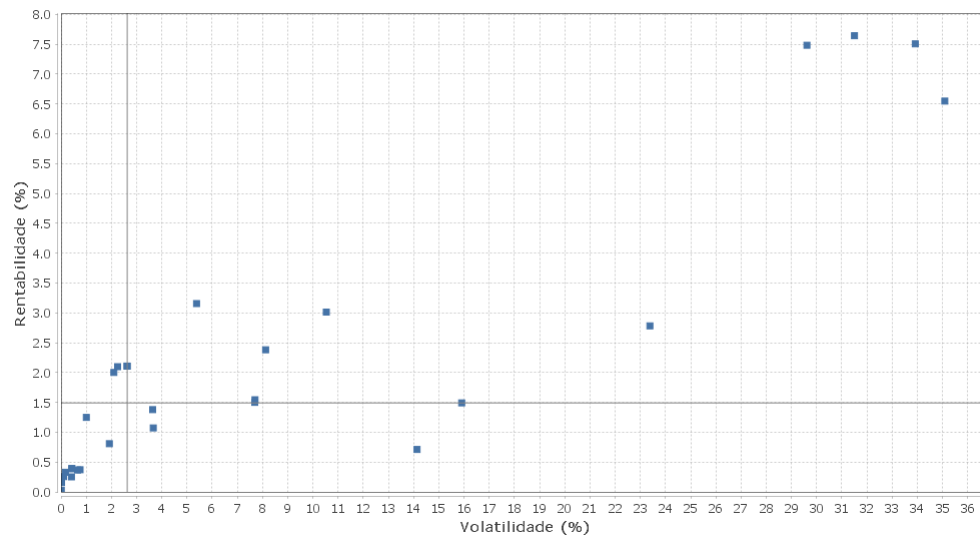
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
209	28/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	33.879,04	4.176,87584522	8,1110957700
202	29/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	27.740,10	0,00	3.419,97994296	8,1111879200
212	29/05/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	14.218,02	0,00	1.752,88997619	8,1111879200
213	29/05/2020	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	1.600.000,00	0,00	1.398.989,23412500	1,1436828540

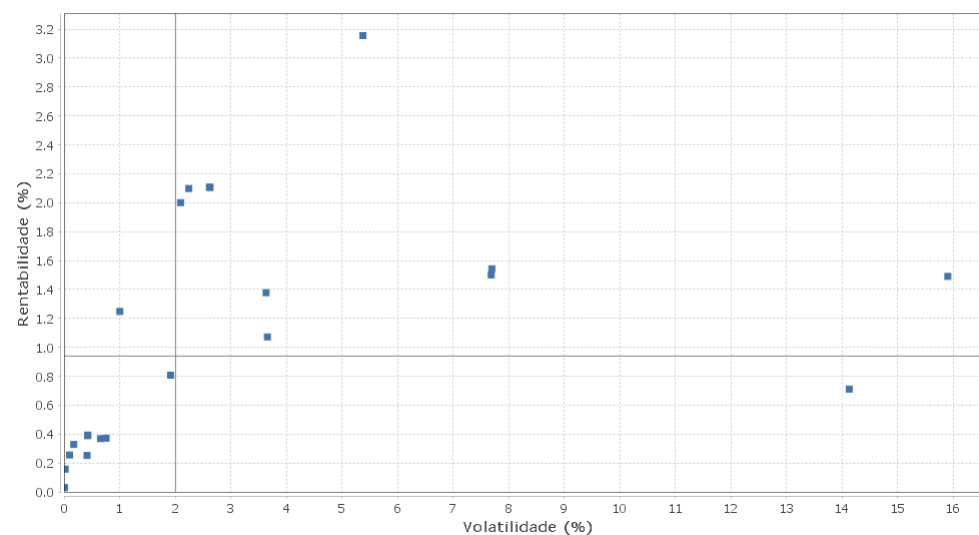
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

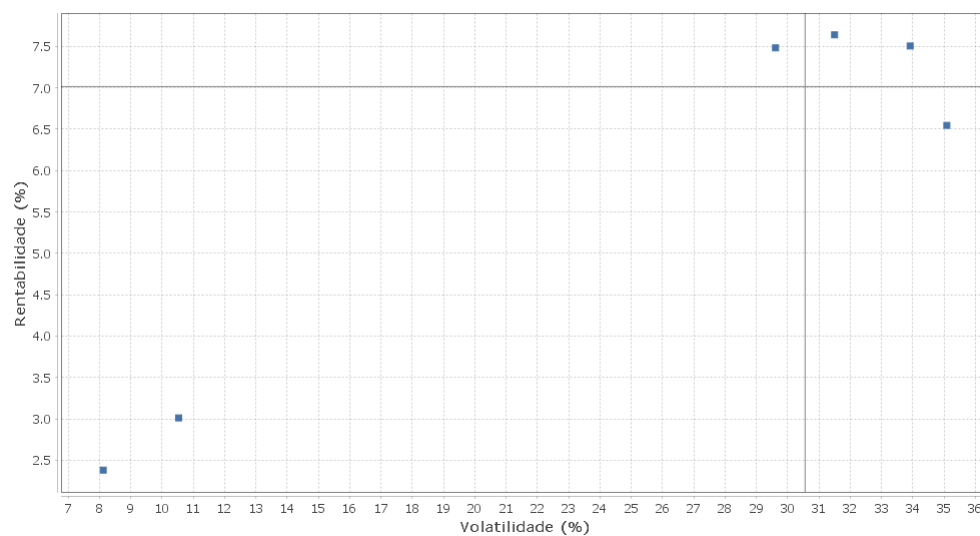
VITÓRIA - CONSOLIDADO - No Mês



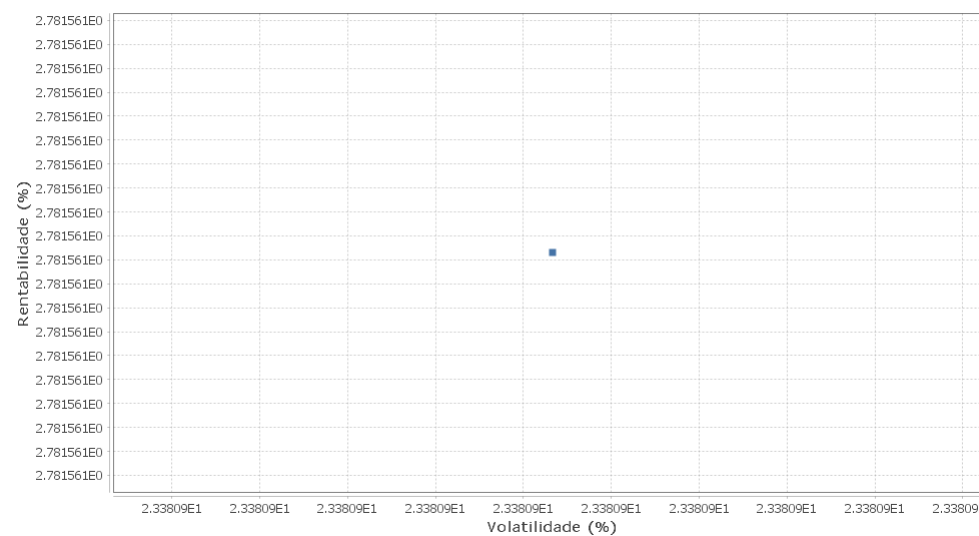
Renda Fixa - No Mês



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	0,01	0,00	0,03	4.492.847,20	0,68
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,16	2.045,74	0,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,10	0,02	0,26	75.691,82	0,01
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,18	0,03	0,33	8.293.737,65	1,25
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,41	0,06	0,25	46.277.313,52	6,96
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,43	0,06	0,39	2.644.321,06	0,40
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,43	0,06	0,39	5.999.939,96	0,90
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,66	0,09	0,37	22.719.326,62	3,42
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,76	0,10	0,37	5.274.403,69	0,79
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,00	0,17	1,25	2.371.759,13	0,36
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	1,92	0,24	0,81	11.909.738,37	1,79
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,10	0,32	2,00	16.837.916,72	2,53
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	2,24	0,34	2,10	9.550.236,51	1,44
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,62	0,38	2,11	22.761.353,40	3,43
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,63	0,38	2,11	124.116.699,57	18,68
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,64	0,45	1,38	43.957.011,80	6,61
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,66	0,43	1,07	80.001.925,71	12,04
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS	Artigo 7º I, Alínea b	5,38	0,71	3,16	6.797.904,00	1,02
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,69	0,87	1,50	49.693.849,40	7,48
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	7,70	0,87	1,54	72.623.062,82	10,93
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	8,12	0,96	2,38	2.572.894,90	0,39
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	10,53	1,24	3,01	1.477.327,82	0,22
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	14,13	1,50	0,71	37.960.392,14	5,71
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	15,91	1,72	1,49	35.740.151,51	5,38
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	23,38	2,56	2,78	5.303.971,20	0,80
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	29,61	3,43	7,48	14.368.297,47	2,16
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	31,50	3,63	7,64	3.973.996,59	0,60
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	33,92	3,88	7,50	7.298.519,97	1,10
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	35,09	3,95	6,55	18.097.611,10	2,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 15,84% 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 (29,42 % dos recursos) está superior ao limite máximo estipulado em Política de Investimentos;