



LDB
EMPRESAS

VITÓRIA
JUNHO 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

REND A FIXA 91,40%

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	5,84	0,77	4,68	44.296.348,92	6,54	5.220.862.294,67	0,85
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	22,66	2,29	-8,42	38.649.975,73	5,71	273.434.802,05	14,13
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,53	0,26	2,45	2.651.109,23	0,39	7.792.694.548,07	0,03
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,47	2,03	-1,88	50.700.246,91	7,49	5.979.262.081,07	0,85
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,26	2,48	6.015.492,59	0,89	11.257.382.974,77	0,05
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	1,10	3,04	125.480.267,01	18,53	8.746.335.681,60	1,43
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,10	1,21	2,88	17.042.162,78	2,52	6.212.458.601,64	0,27
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,92	1,08	3,08	23.006.213,88	3,40	4.025.627.854,04	0,57
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS	8,87	1,24	3,87	6.881.984,00	1,02	459.801.943,88	1,50
BB	BB	BB PREV IPCA I	4,98	1,19	3,40	9.663.627,49	1,43	507.577.829,32	1,90
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	4,16	0,48	4,85	11.966.735,48	1,77	215.246.883,23	5,56
BB	BB	BB PREV RF VII	2,30	0,99	1,64	2.395.294,14	0,35	683.688.528,70	0,35
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,05	0,95	1,75	80.760.897,45	11,93	10.783.491.196,95	0,75
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,06	1,23	1,21	419.510.355,61	61,95		

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	0,40	-1,63	5.295.471,70	0,78	329.826.181,39	1,61
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,06	0,02	0,38	5.748.107,30	0,85	800.768.664,32	0,72
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,30	0,24	1,37	8.313.870,90	1,23	5.172.945.706,81	0,16
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	12,40	2,03	-1,94	74.098.298,14	10,94	1.463.118.783,06	5,06
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	25,86	2,19	-8,35	36.524.330,09	5,39	257.794.723,23	14,17
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,26	1,37	75.888,63	0,01	2.439.958.346,20	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	0,07	0,13	1,24	2.693,46	0,00	1.768.065.678,44	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,92	0,46	-1,54	46.488.070,66	6,87	1.967.233.455,21	2,36
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,52	0,60	-1,31	22.856.295,47	3,38	164.480.013,81	13,90
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			6,71	1,33	-3,22	199.403.026,35	29,45		
Renda Fixa			6,44	1,26	0,27	618.913.381,96	91,40		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,78%

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	38,70	4,58	-16,79	7.633.007,46	1,13	799.344.501,83	0,95
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	44,83	10,23	-8,36	19.948.478,29	2,95	158.247.917,35	12,61
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	40,57	7,44	-18,07	15.437.053,66	2,28	852.822.941,33	1,81
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	44,07	9,88	-14,67	4.366.515,18	0,64	767.311.524,38	0,57
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			41,38	8,34	-13,43	47.385.054,59	7,00		

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	15,55	2,24	-1,62	2.630.584,51	0,39	120.700.505,91	2,18
Sub-total Artigo 8º III			15,55	2,24	-1,62	2.630.584,51	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	31,52	-8,17	-8,46	1.215.725,73	0,18	166.493.639,28	0,73
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			31,52	-8,17	-8,46	1.215.725,73	0,18		

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	24,29	-1,02	-10,27	1.462.221,67	0,22	112.715.459,16	1,30
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			24,29	-1,02	-10,27	1.462.221,67	0,22		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			36,79	7,29	-12,32	52.693.586,50	7,78		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 0,82%

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	26,27	4,37	32,85	5.535.725,11	0,82	1.181.944.568,52	0,47
Sub-total Artigo 9º A, III			26,27	4,37	32,85	5.535.725,11	0,82		
Investimentos no Exterior			26,27	4,37	32,85	5.535.725,11	0,82		
Total						677.142.693,57	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	419.510.355,61	61,95	53,50	58,50	63,50	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	199.403.026,35	29,45	13,00	18,00	23,00	50,00
	Total Renda Fixa	618.913.381,96	91,40				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	47.385.054,59	7,00	1,00	6,00	11,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	2.630.584,51	0,39	0,00	2,00	7,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	1.215.725,73	0,18	0,00	0,50	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.462.221,67	0,22	0,00	1,00	5,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	52.693.586,50	7,78				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	5.535.725,11	0,82	0,00	1,00	6,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	5.535.725,11	0,82				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

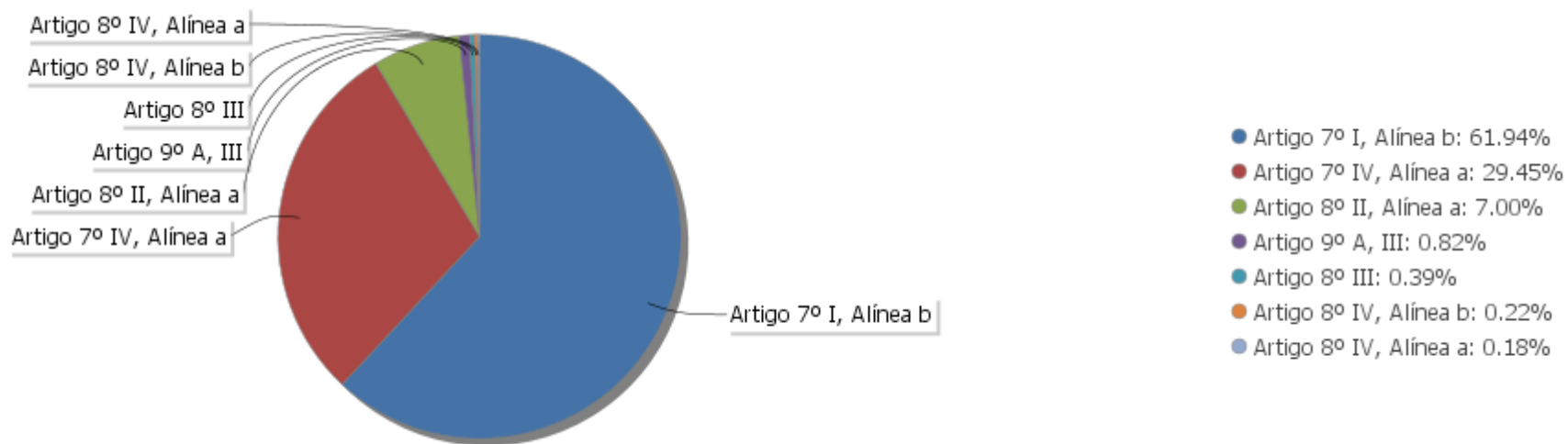
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,00 0,00	9,81 558,97	0,00 0,00	9,81 558,97	18,29 397,38	0,00	3.463.250,51
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,23 577,87	1,21 68,79	3,67 498,95	1,21 68,79	6,74 146,38	5.086.550,02	4.856.289,01
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,33 625,28	-3,22 -183,32	2,41 328,62	-3,22 -183,32	2,11 45,77	2.649.506,42	-5.922.821,36
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,34 -0,42	-13,43 4,37	31,94 1,76	-13,43 4,37	2,74 8,59	3.646.629,46	-5.215.992,47
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,24 -6,51	-1,62 16,18	9,03 -21,15	-1,62 16,18		57.689,61	-56.722,06
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-8,17 -16,93	-8,46 9,34	-8,32 -38,50	-8,46 9,34	-35,35 -29,50	-108.166,97	-112.348,25
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-1,02 -9,78	-10,27 7,53	1,81 -28,37	-10,27 7,53	-21,08 -15,22	-15.106,15	-167.428,79
Artigo 9º A, III % do CDI	4,37 2.057,88	32,85 1.872,61	24,40 3.320,23	32,85 1.872,61	54,59 1.185,93	231.753,91	1.368.909,31
						11.548.856,30	-1.786.864,10

Análise de Liquidez

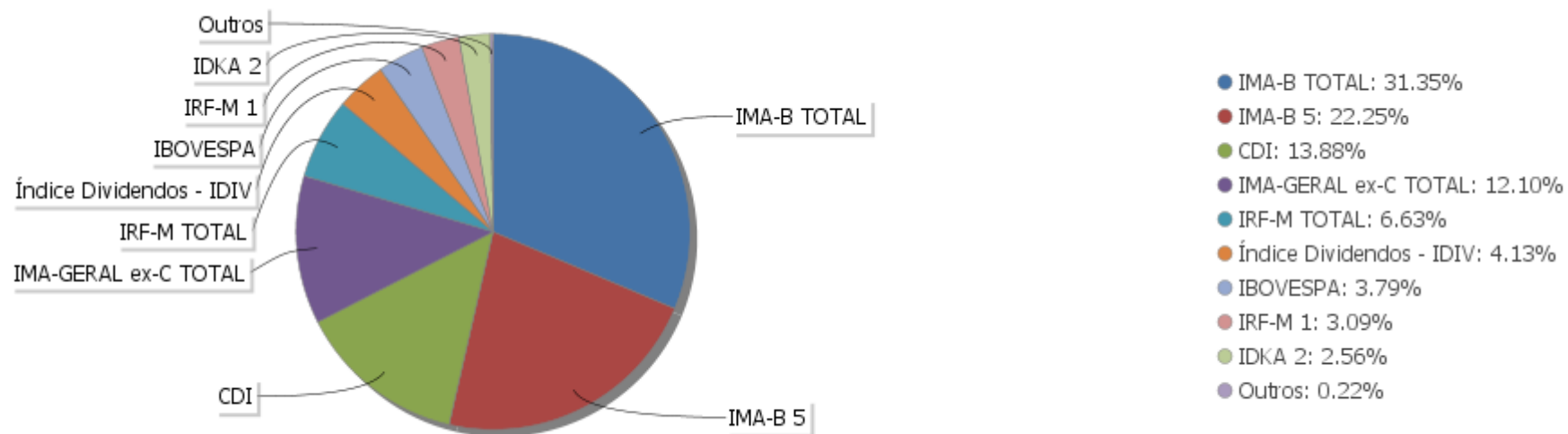
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	608.138.785,95	89,81	608.138.785,95	89,81
de 31 a 364 dias	47.385.054,59	7,00	655.523.840,54	96,81
acima de 365 dias	21.618.853,03	3,19	677.142.693,57	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

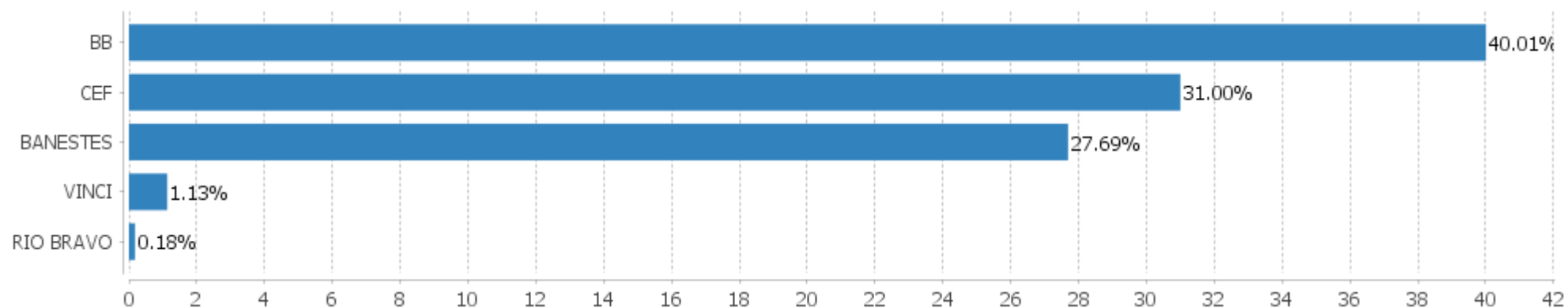


Alocação Por Estratégia



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	1,73							-0,38
INPC + 5,5%	0,66	0,55	0,65	0,19	0,17	0,75							3,02
p.p. indexador	0,34	-0,64	-6,59	1,21	1,56	0,98							-3,39
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

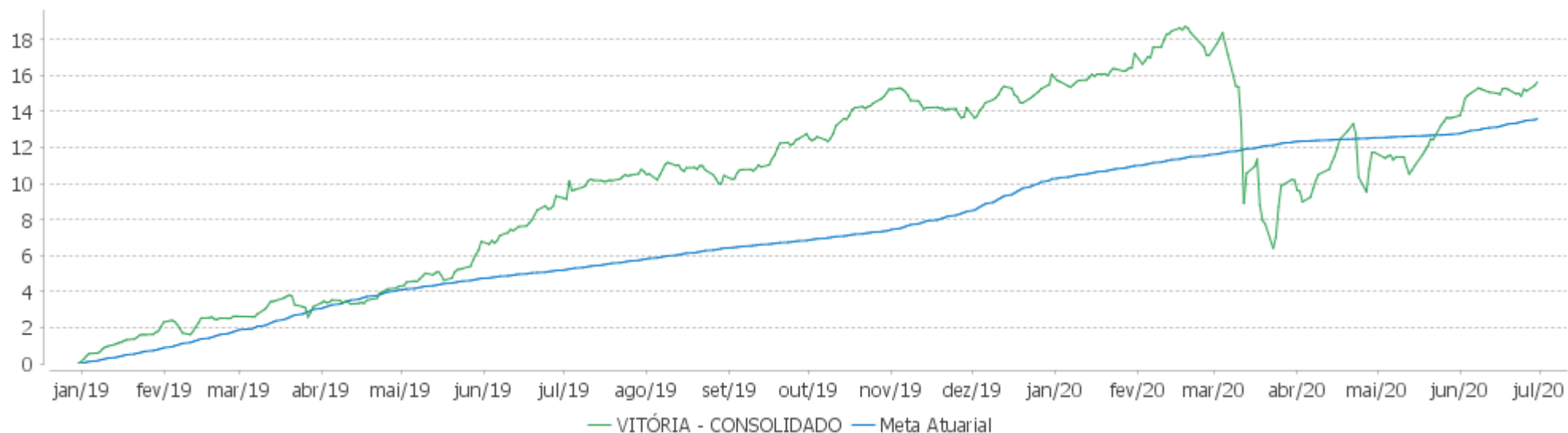
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

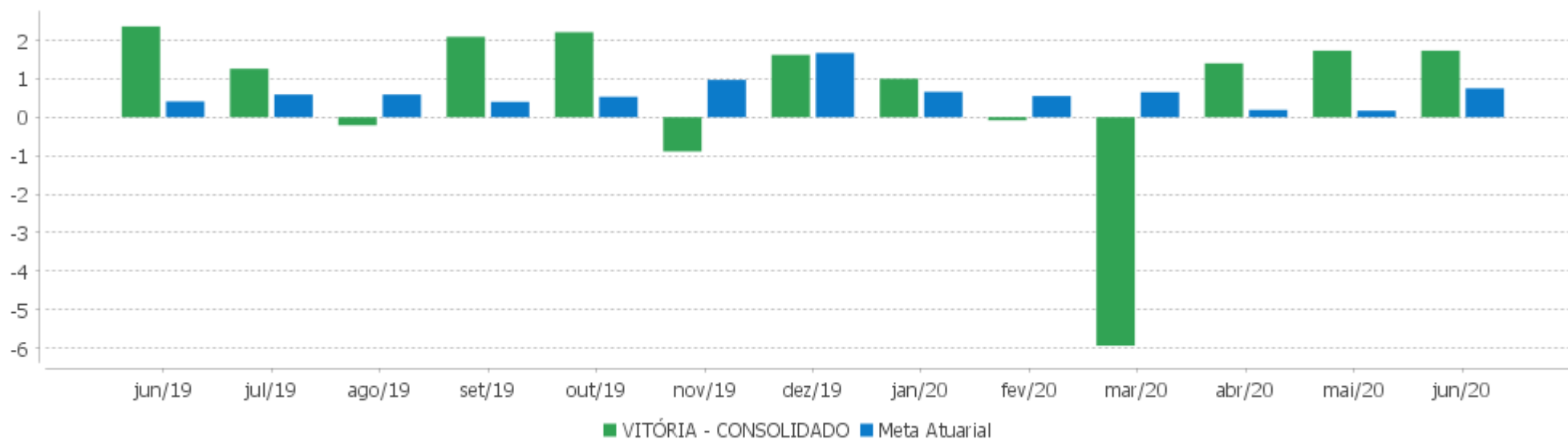
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	11	61,11	03 meses	4,95	1,12	3,83	6,96
Meses abaixo da Meta Atuarial	7	38,89	06 meses	-0,38	3,02	-3,39	10,23
			12 meses	5,79	8,26	-2,48	7,46
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,39	2019-05	Desde 31/12/2018	15,62	14,12	1,51	6,29
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.	2,03 -0,02	-1,88 -0,21	4,91 -0,05	-1,88 -0,21	4,52 -0,42	34,35 -0,78	45,00 -1,21
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,10 -0,02	3,04 -0,13	3,71 -0,06	3,04 -0,13	8,51 -0,30	24,21 -0,55	35,98 -0,92
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6% p.p.	1,19 0,44	3,40 0,41	3,79 2,81	3,40 0,41	9,01 0,73	27,95 9,39	40,65 9,55
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,26 -0,03	2,45 -0,14	1,06 -0,09	2,45 -0,14	5,71 -0,30	13,15 -0,52	21,70 -0,85
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,08 -0,04	3,08 -0,09	3,71 -0,06	3,08 -0,09	8,59 -0,22	24,25 -0,51	36,09 -0,81
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,48 0,20	4,85 2,25	2,22 1,07	4,85 2,25	9,17 3,16	21,18 7,51	31,47 8,92
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,29 0,24	-8,42 -6,75	4,76 -0,20	-8,42 -6,75	-0,74 -5,69	38,52 3,39	45,40 -0,80
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,99 -1,06	1,64 3,31	2,40 -2,56	1,64 3,31	6,28 1,33	19,00 -16,13	30,65 -15,55
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,21 0,22	2,88 -0,46	3,57 0,22	2,88 -0,46	8,18 -0,59	21,13 -2,04	32,87 -2,59
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,24 -0,81	3,87 5,53	5,16 0,20	3,87 5,53	7,66 2,71	27,01 -8,12	31,33 -14,88
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,95 0,05	1,75 0,04	2,96 0,22	1,75 0,04	6,31 -0,01	23,29 0,35	33,67 0,56
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,26 -0,02	2,48 -0,11	1,09 -0,06	2,48 -0,11	5,78 -0,23	13,28 -0,39	21,89 -0,66
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,77 -0,01	4,68 -0,18	3,26 -0,13	4,68 -0,18	9,51 -0,30	26,49 -0,59	37,50 -0,94
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,19 0,15	-8,35 -6,69	5,85 0,89	-8,35 -6,69	-1,68 -6,62	33,55 -1,58	40,67 -5,54
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,40 188,12	-1,63 -92,92	-0,87 -118,48	-1,63 -92,92	1,01 21,96	7,20 64,18	14,95 77,09
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,46 214,49	-1,54 -87,93	-0,92 -124,84	-1,54 -87,93	1,07 23,33	7,95 70,89	16,49 85,04
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	0,60	-1,31	-0,59	-1,31	6,44		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	283,94	-74,55	-80,62	-74,55	139,98		
BB PREV RF IMA-B	2,03	-1,94	4,87	-1,94	4,50	34,26	45,03
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,28	-0,09	-0,28	-0,44	-0,87	-1,18
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,26	1,37	0,78	1,37	4,06	10,51	18,70
% do CDI	122,46	78,16	105,60	78,16	88,25	93,70	96,43
BB PREV RF FLUXO FIC	0,13	1,24	0,49	1,24	3,50	8,88	15,65
% do CDI	60,81	70,84	66,18	70,84	76,04	79,16	80,73
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,02	0,38	0,10	0,38	1,64	4,94	9,43
% do CDI	10,88	21,85	13,86	21,85	35,54	44,07	48,64
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,24	1,37	0,58	1,37	4,03	10,44	18,40
% do CDI	114,33	78,02	78,30	78,02	87,52	93,15	94,90
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTIESTRATÉGIA	-8,17	-8,46	-8,32	-8,46	-35,35	-37,26	-23,63
% do CDI	-3.848,00	-482,19	-1.132,20	-482,19	-768,06	-332,30	-121,85
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	10,23	-8,36	41,46	-8,36	8,76	58,50	80,20
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,28	10,02	22,76	10,02	8,91	10,98	19,63
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	4,58	-16,79	20,57	-16,79	-2,34	45,78	57,70
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-4,37	1,59	1,87	1,59	-2,18	-1,73	-2,87
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	9,88	-14,67	33,22	-14,67	5,17		
Var. IBOVESPA p.p.	1,12	3,14	3,04	3,14	11,02		
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	7,44	-18,07	25,16	-18,07	-4,94	52,01	
Var. IBOVESPA p.p.	-1,32	-0,26	-5,01	-0,26	0,92	21,37	
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	-1,02	-10,27	1,81	-10,27	-21,08	-22,44	-30,64
Var. IFIX p.p.	-6,61	1,96	-10,71	1,96	-27,94	-54,49	-65,93
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	2,24	-1,62	9,03	-1,62			
% do CDI	1.056,01	-92,60	1.229,06	-92,60			
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4,37	32,85	24,40	32,85	54,59	66,72	118,22
Var. IBOVESPA p.p.	-4,39	50,66	-5,78	50,66	60,44	36,08	67,09
CDI	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,39
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
INPC + 6%	0,79	3,25	1,24	3,25	8,51	18,75	30,23
IPCA + 6%	0,75	2,99	0,98	2,99	8,29	18,56	31,11

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	0,28	2,60	1,15	2,60	6,01	13,67	22,54
IRF-M 1+	1,04	6,03	4,53	6,03	11,80	33,23	45,60
IRF-M TOTAL	0,79	4,86	3,39	4,86	9,81	27,08	38,44
IMA-B 5	1,12	3,17	3,77	3,17	8,81	24,75	36,90
IMA-B 5+	2,84	-5,26	5,99	-5,26	1,97	43,55	52,33
IMA-B TOTAL	2,05	-1,66	4,96	-1,66	4,95	35,13	46,21
IMA-C TOTAL	3,74	7,46	7,95	7,46	13,21	41,24	63,14
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,90	1,71	2,74	1,71	6,32	22,95	33,11
IMA-GERAL TOTAL	0,99	1,87	2,89	1,87	6,52	23,45	33,90
IDKA 2	0,99	3,35	3,35	3,35	8,77	23,17	35,46
IDKA 20	4,18	-12,33	6,49	-12,33	-4,69	58,14	62,45
CDI	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,39
Renda Variável							
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
IBRX 100	8,97	-17,39	30,39	-17,39	-4,66	34,21	53,90
IBRX 50	9,33	-17,76	31,79	-17,76	-6,93	27,59	47,47
SMALL CAP	14,43	-20,73	32,49	-20,73	5,15	49,01	69,83
IFIX	5,59	-12,24	12,52	-12,24	6,86	32,05	35,30
Índice Consumo - ICON	10,08	-10,90	39,45	-10,90	13,99	52,93	55,22
Índice Dividendos - IDIV	8,95	-18,38	18,70	-18,38	-0,15	47,52	60,57
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,26	0,10	-0,43	0,10	2,13	5,57	10,21
INPC	0,30	0,36	-0,18	0,36	2,35	5,74	9,47
IGPM	1,56	4,39	2,66	4,39	7,31	14,30	22,21
SELIC	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,40
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

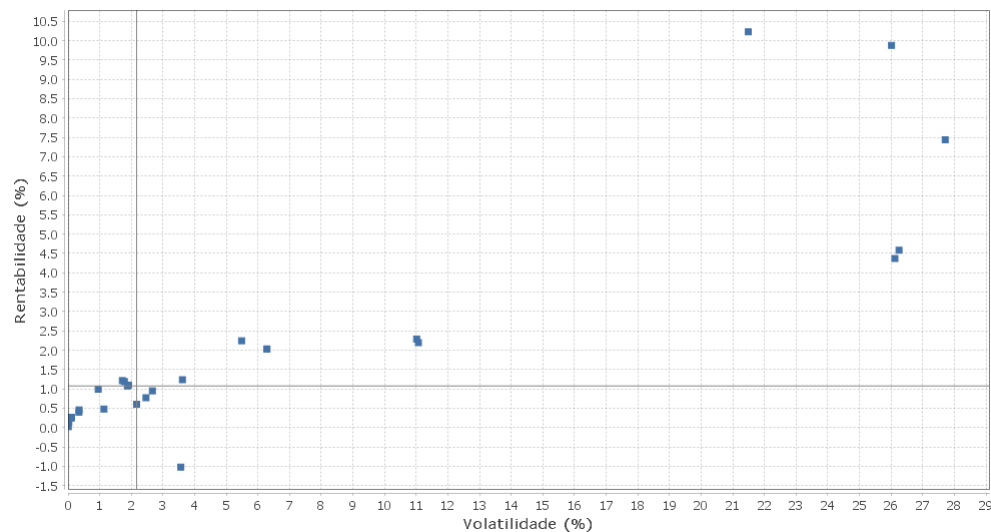
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
225	04/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	16.856,72	0,00	2.078,11211628	8,1115546500
238	04/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.669,50	0,00	205,81751243	8,1115546500
221	05/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.767.893,84	341.224,70928182	8,1116453900
215	05/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	644,48	0,00	306,31456000	2,1039809520
236	05/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	5.118,07	630,95337061	8,1116453900
227	08/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	318.475,32	0,00	39.261,05743039	8,1117356700
229	22/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.418,84	0,00	174,89127276	8,1126975500
231	23/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	53.064,79	0,00	6.540,90642365	8,1127578600
239	23/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	33.563,79	0,00	4.137,16156444	8,1127578600
233	25/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	19.955.908,30	0,00	2.459.781,30311320	8,1128790900
240	25/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.631.807,40	0,00	201.137,89222021	8,1128790900
235	26/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	58.511,06	0,00	7.212,06608493	8,1129400800
214	26/06/2020	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	179.242,18	47.323,37479359	3,7876035000
222	29/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.478.672,35	182.259,59844392	8,1130012500
226	29/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	16.859,73	2.078,11258503	8,1130012500
230	29/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.418,89	174,89088887	8,1130012500
234	29/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	16.097.374,17	1.984.145,40734848	8,1130012500
223	29/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	6.393,89	788,10415566	8,1130012500
224	29/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	27.746,30	3.419,97975164	8,1130012500
228	29/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	318.525,01	39.261,05767579	8,1130012500
232	29/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	53.066,38	6.540,90617822	8,1130012500
237	29/06/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	43.912,21	5.412,57281330	8,1130012500

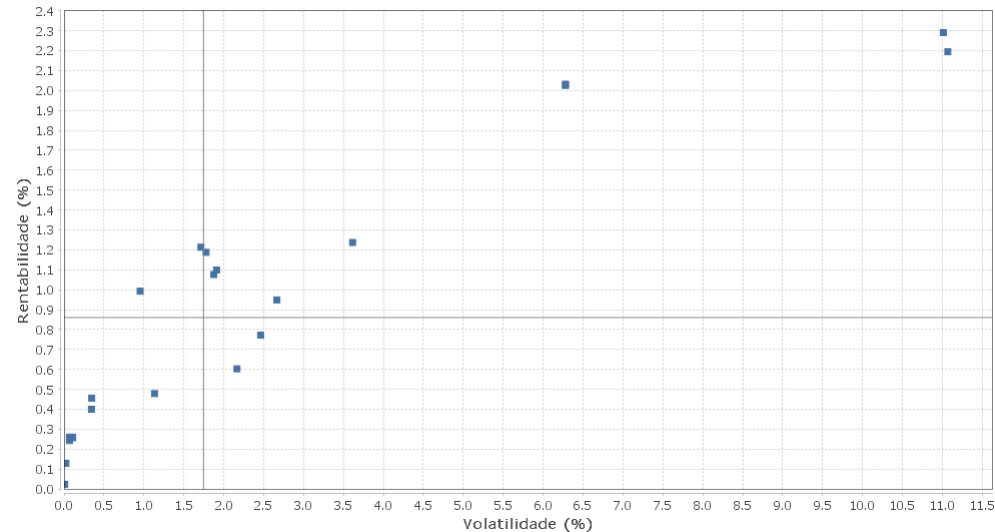
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

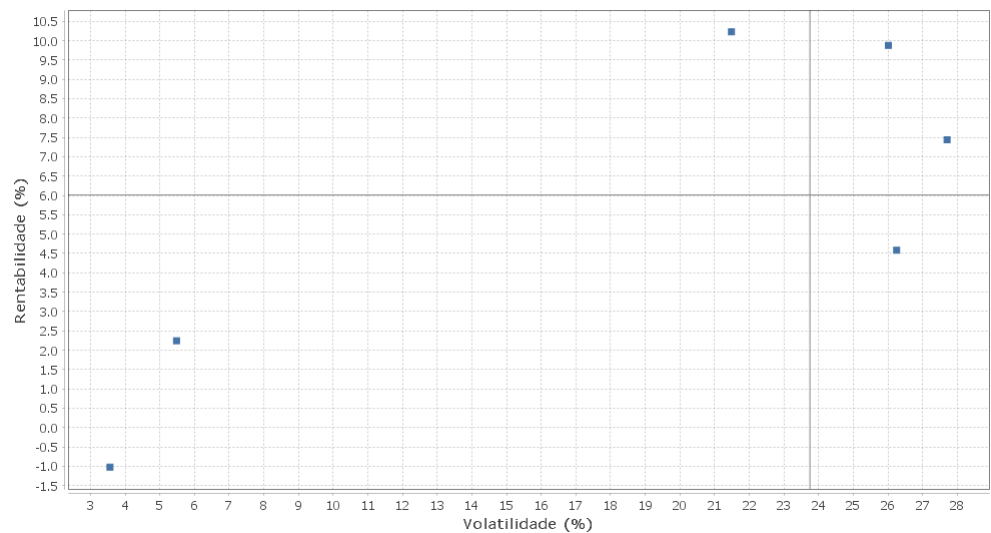
VITÓRIA - CONSOLIDADO - No Mês



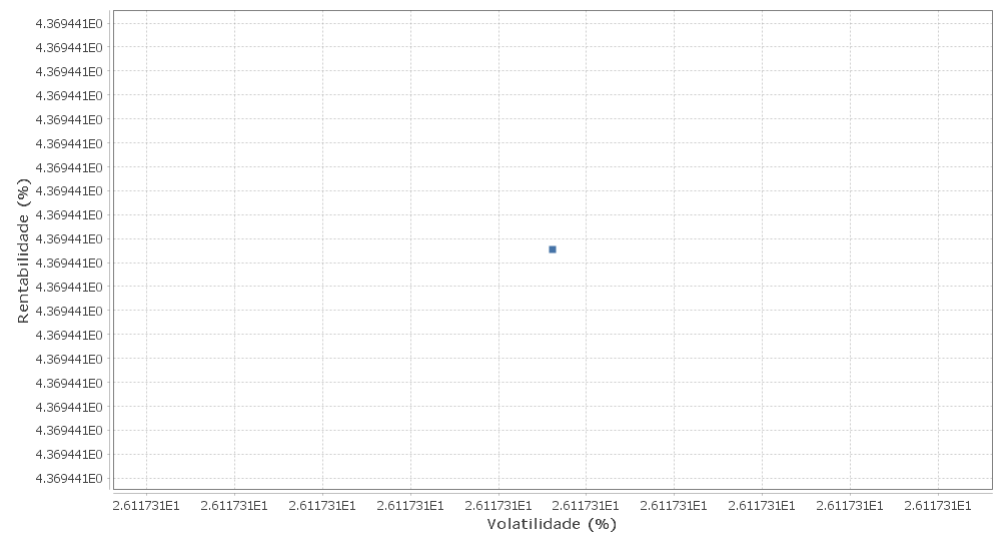
Renda Fixa - No Mês



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	0,02	5.748.107,30	0,85
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,13	2.693,46	0,00
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,02	0,24	8.313.870,90	1,23
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,02	0,26	75.888,63	0,01
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,11	0,02	0,26	6.015.492,59	0,89
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,11	0,02	0,26	2.651.109,23	0,39
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,34	0,05	0,40	5.295.471,70	0,78
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,35	0,06	0,46	46.488.070,66	6,87
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	0,95	0,15	0,99	2.395.294,14	0,35
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	1,13	0,14	0,48	11.966.735,48	1,77
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,71	0,24	1,21	17.042.162,78	2,52
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	1,78	0,24	1,19	9.663.627,49	1,43
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,88	0,25	1,08	23.006.213,88	3,40
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,91	0,25	1,10	125.480.267,01	18,53
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	2,17	0,25	0,60	22.856.295,47	3,38
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,46	0,29	0,77	44.296.348,92	6,54
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,67	0,32	0,95	80.760.897,45	11,93
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	3,56	0,32	-1,02	1.462.221,67	0,22
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS	Artigo 7º I, Alínea b	3,61	0,43	1,24	6.881.984,00	1,02
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	5,48	0,67	2,24	2.630.584,51	0,39
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,28	0,75	2,03	50.700.246,91	7,49
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	6,28	0,75	2,03	74.098.298,14	10,94
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	11,01	1,25	2,29	38.649.975,73	5,71
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	11,07	1,25	2,19	36.524.330,09	5,39
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	21,49	2,69	10,23	19.948.478,29	2,95
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	26,01	3,14	9,88	4.366.515,18	0,64
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	26,12	2,91	4,37	5.535.725,11	0,82
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	26,25	2,93	4,58	7.633.007,46	1,13
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	27,71	3,21	7,44	15.437.053,66	2,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O percentual alocado no Artigo 7, Inciso IV, Alínea A (29,45 % dos recursos) está superior ao limite máximo estipulado em Política de Investimentos;