



LDB
EMPRESAS

VITÓRIA
JULHO 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

RENDA FIXA **86,92%**

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	1,13	5,86	44.795.214,11	6,42	5.350.645.859,80	0,84
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	22,79	7,49	-1,55	39.649.062,51	5,68	336.367.162,90	11,79
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,54	0,23	2,69	2.657.284,21	0,38	7.835.713.656,67	0,03
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,54	4,38	2,42	52.918.389,20	7,59	6.313.416.954,01	0,84
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,24	2,73	6.029.993,02	0,86	10.907.406.871,77	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	0,97	4,05	106.584.949,83	15,28	12.027.903.790,65	0,89
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,11	0,81	3,71	17.179.633,19	2,46	6.099.396.938,17	0,28
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,92	0,97	4,08	19.198.768,46	2,75	4.153.926.563,49	0,46
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS	8,90	1,77	5,70	7.003.620,00	1,00	467.928.646,41	1,50
BB	BB	BB PREV IPCA I	4,97	0,79	4,21	9.739.741,25	1,40	511.575.671,32	1,90
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	4,17	0,67	5,55	12.047.343,59	1,73	179.782.214,33	6,70
BB	BB	BB PREV RF VII	2,29	0,32	1,97	2.402.961,24	0,34	685.876.947,75	0,35
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,08	1,77	3,55	82.188.563,45	11,78	10.799.663.748,52	0,76
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,08	2,16	3,40	402.395.524,06	57,69		

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	0,55	-1,09	5.324.540,20	0,76	316.989.364,17	1,68
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,06	0,02	0,40	3.603.688,17	0,52	824.188.882,05	0,44
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,29	0,25	1,62	8.334.527,53	1,19	4.665.137.027,34	0,18
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	12,48	4,39	2,36	77.348.138,22	11,09	1.510.787.186,06	5,12
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	25,96	6,59	-2,31	37.370.743,24	5,36	311.642.335,02	11,99
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,24	1,61	76.067,77	0,01	2.412.408.451,26	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	0,10	1,35	141,07	0,00	1.725.378.039,09	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,92	0,61	-0,94	48.572.504,62	6,96	1.958.639.802,94	2,48
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,54	1,86	0,53	23.282.443,09	3,34	182.307.109,20	12,77
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			6,77	3,22	-0,10	203.912.793,91	29,23		
Renda Fixa			6,39	2,51	2,78	606.308.317,97	86,92		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

11,61%

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	39,01	8,32	-9,87	8.267.775,30	1,19	862.156.434,48	0,96
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	45,00	8,36	-0,70	21.616.264,80	3,10	154.315.606,33	14,01
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	40,86	6,38	-12,84	20.542.607,47	2,95	921.115.521,73	2,23
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	41,22	1,33	1,33	16.213.231,68	2,32	230.915.401,73	7,02
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	44,29	9,22	-6,80	8.921.016,89	1,28	872.742.979,00	1,02
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			41,60	7,33	-7,08	75.560.896,14	10,83		

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	14,72	2,52	0,86	2.696.904,97	0,39	139.704.818,64	1,93
Sub-total Artigo 8º III			14,72	2,52	0,86	2.696.904,97	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 MULTIESTRATÉGIA	31,51	-0,10	-8,55	1.214.503,03	0,17	166.326.190,81	0,73
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			31,51	-0,10	-8,55	1.214.503,03	0,17		

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	24,30	1,07	-9,32	1.477.810,76	0,21	112.715.459,16	1,31
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			24,30	1,07	-9,32	1.477.810,76	0,21		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			37,04	6,80	-6,35	80.950.114,90	11,61		
--	--	--	--------------	-------------	--------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,47%

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	26,66	1,88	35,34	10.280.720,48	1,47	1.279.266.331,34	0,80
Sub-total Artigo 9º A, III			26,66	1,88	35,34	10.280.720,48	1,47		
Investimentos no Exterior			26,66	1,88	35,34	10.280.720,48	1,47		
Total						697.539.153,35	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	402.395.524,06	57,69	53,50	58,50	63,50	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	203.912.793,91	29,23	13,00	18,00	23,00	50,00
	Total Renda Fixa	606.308.317,97	86,92				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	75.560.896,14	10,83	1,00	6,00	11,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	2.696.904,97	0,39	0,00	2,00	7,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	1.214.503,03	0,17	0,00	0,50	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.477.810,76	0,21	0,00	1,00	5,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	80.950.114,90	11,61				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	10.280.720,48	1,47	0,00	1,00	6,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	10.280.720,48	1,47				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

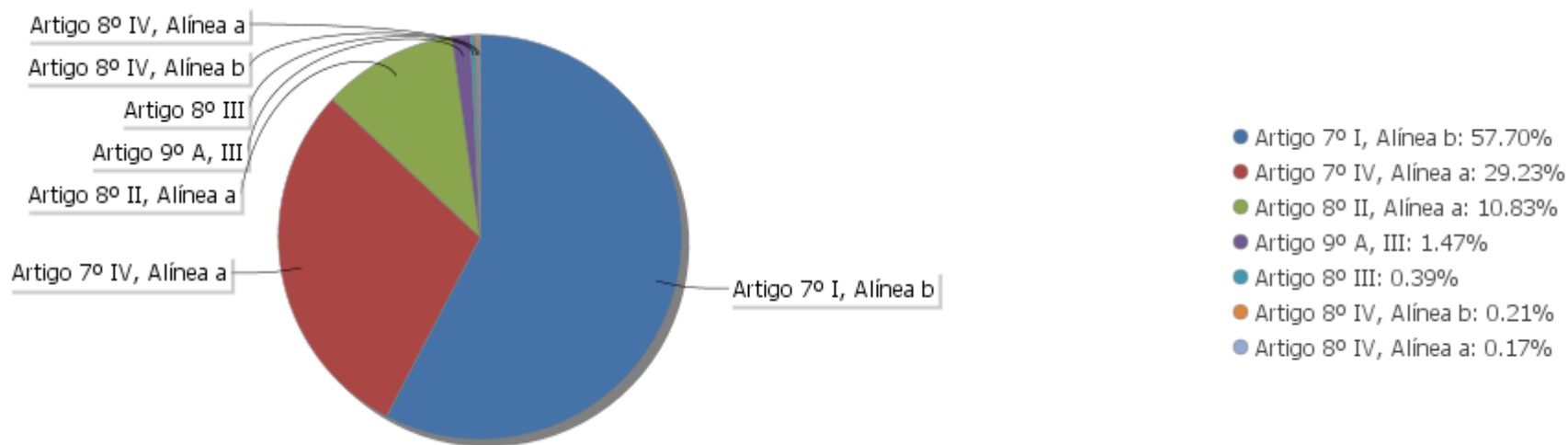
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,00 0,00	9,81 502,34	0,00 0,00	0,90 57,32	17,81 422,57	0,00	3.463.250,51
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	2,16 1.113,50	3,40 174,01	5,03 781,34	2,85 181,58	7,80 185,11	8.704.997,94	13.561.286,95
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	3,22 1.654,81	-0,10 -5,31	5,62 872,42	-0,54 -34,18	4,29 101,83	6.357.462,73	434.641,37
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	7,33 -0,93	-7,08 3,93	24,53 -3,30	-8,25 1,28	7,22 6,14	4.175.841,55	-1.040.150,92
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,52 -5,74	0,86 11,87	7,31 -20,52	0,59 10,13		66.320,46	9.598,40
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,10 -8,37	-8,55 2,46	-8,26 -36,09	-8,57 0,97	-35,18 -36,26	-1.222,70	-113.570,95
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	1,07 -7,20	-9,32 1,69	3,04 -24,79	0,77 10,31	-20,72 -21,80	15.589,09	-151.839,70
Artigo 9º A, III % do CDI	1,88 964,81	35,34 1.810,52	9,28 1.441,94	27,06 1.724,07	55,47 1.316,13	144.995,37	1.513.904,68
						19.463.984,44	17.677.120,34

Análise de Liquidez

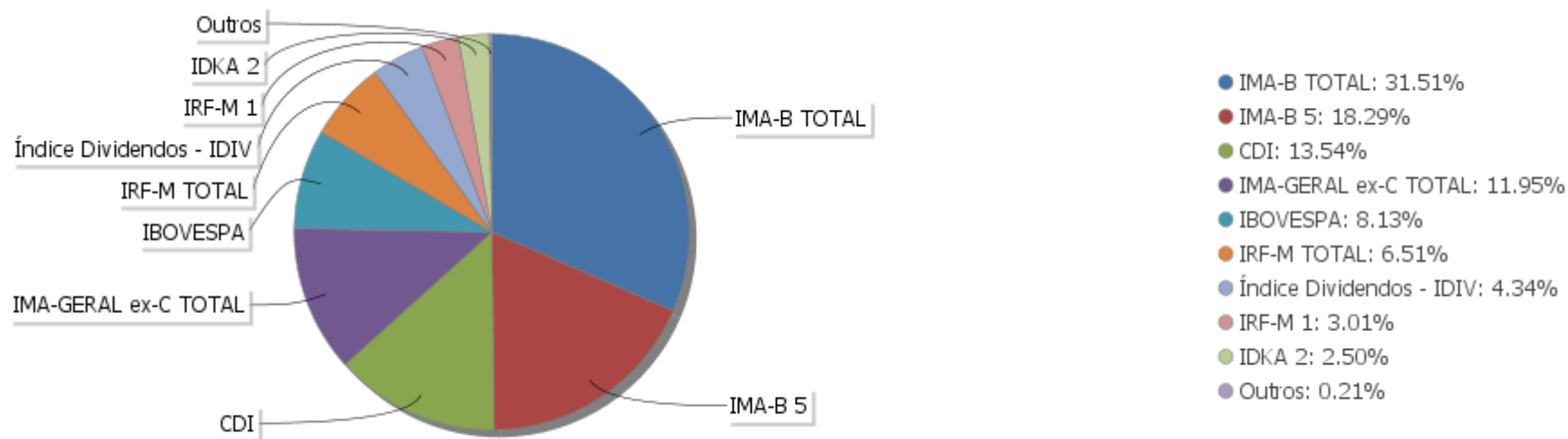
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	616.352.852,61	88,36	616.352.852,61	88,36
de 31 a 364 dias	60.562.167,49	8,68	676.915.020,10	97,04
acima de 365 dias	20.624.133,25	2,96	697.539.153,35	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

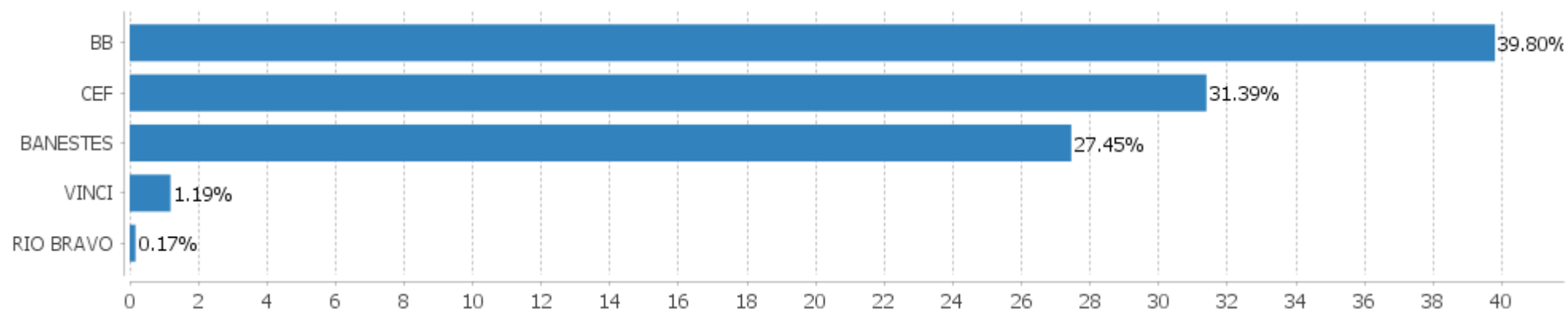


Alocação Por Estratégia



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	2,87						2,48
INPC + 5,5%	0,66	0,55	0,65	0,19	0,17	0,75	0,93						3,98
p.p. indexador	0,34	-0,64	-6,59	1,21	1,56	0,98	1,94						-1,49
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

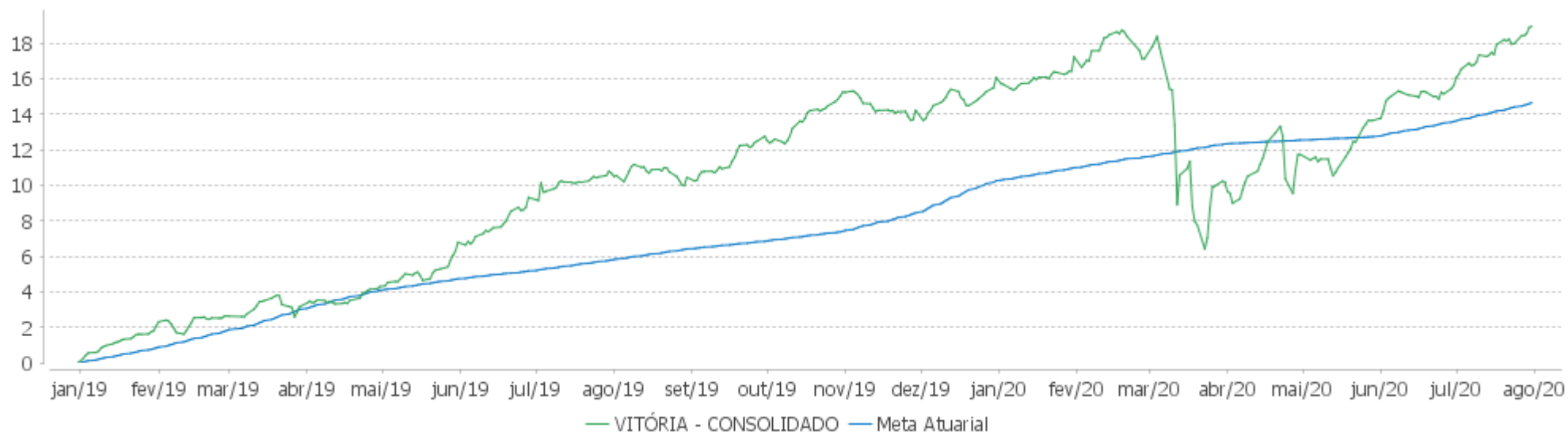
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

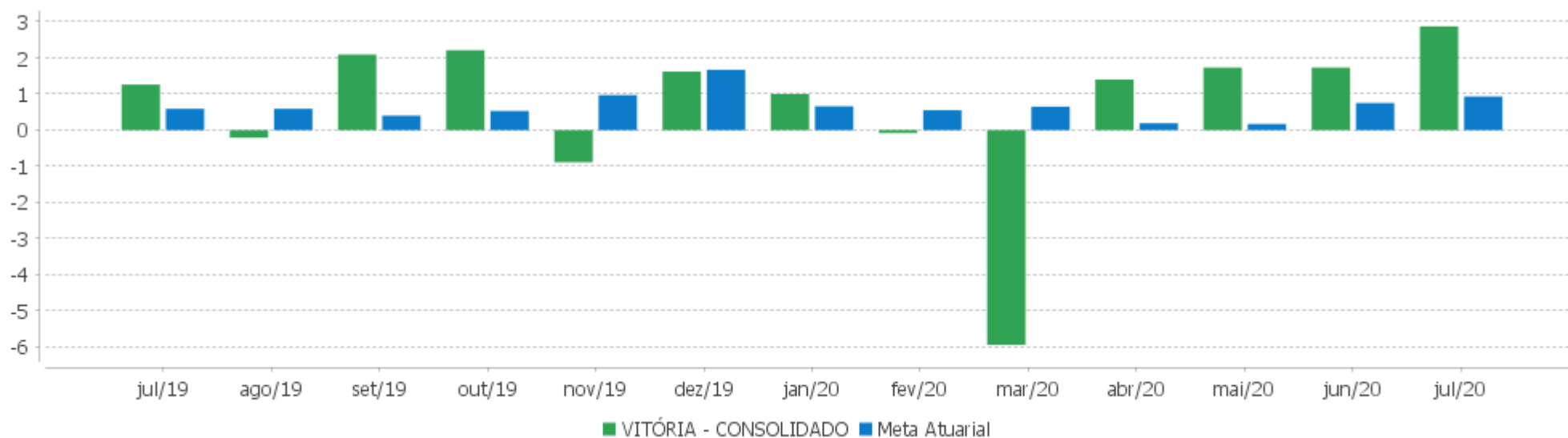
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	12	63,16	03 meses	6,47	1,87	4,60	3,49
Meses abaixo da Meta Atuarial	7	36,84	06 meses	1,47	3,30	-1,83	10,22
			12 meses	7,47	8,58	-1,11	7,45
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,87	2020-07	Desde 31/12/2018	18,94	15,18	3,76	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
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,55 282,46	-1,09 -55,85	1,33 205,90	-1,43 -90,82	1,02 24,21	7,23 66,79	14,67 78,56
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	6,59 2,20	-2,31 -4,96	10,55 2,41	-3,03 -5,41	2,22 -5,94	38,94 1,08	44,06 -2,69
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,61 314,02	-0,94 -48,24	1,32 205,51	-1,33 -84,82	1,09 25,76	7,99 73,79	16,22 86,85
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	1,86 959,39	0,53 27,26	2,86 443,55	-0,08 -5,26	6,90 163,77	26,22 242,12	
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,39 -0,00	2,36 -0,29	8,15 0,01	2,09 -0,29	7,74 -0,41	36,90 -0,96	45,55 -1,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,24 121,46	1,61 82,50	0,75 117,07	1,26 80,04	3,74 88,70	10,19 94,14	18,03 96,53
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO % do CDI	0,02 8,80	0,40 20,52	0,07 10,81	0,28 18,01	1,35 32,10	4,66 43,07	8,85 47,38
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,10 52,46	1,35 68,95	0,39 60,44	1,06 67,36	3,12 74,14	8,50 78,50	14,95 80,06
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,25 127,85	1,62 83,02	0,82 127,63	1,25 79,33	3,72 88,18	10,14 93,65	17,77 95,15
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,38 -0,01	2,42 -0,23	8,09 -0,05	2,17 -0,22	7,72 -0,43	37,07 -0,79	45,56 -1,19
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,97 -0,02	4,05 -0,15	4,23 -0,05	3,48 -0,13	8,54 -0,29	23,61 -0,55	33,54 -0,89
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6% p.p.	0,79 -0,11	4,21 0,30	4,12 2,39	3,55 0,38	8,77 0,30	26,46 7,83	36,61 5,29
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,23 -0,01	2,69 -0,15	0,88 -0,06	2,26 -0,13	5,22 -0,29	12,65 -0,54	20,70 -0,86
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,97 -0,02	4,08 -0,11	4,20 -0,08	3,51 -0,11	8,59 -0,24	23,64 -0,51	33,60 -0,83
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	7,49 3,11	-1,55 -4,20	10,74 2,60	-2,09 -4,47	4,08 -4,07	44,21 6,35	49,90 3,15
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,67 0,44	5,55 2,71	1,97 1,03	4,80 2,41	8,68 3,18	21,03 7,83	30,55 8,99
BB PREV RF VII	0,32	1,97	2,58	1,77	5,74	18,19	27,84

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.	-4,07	-0,68	-5,56	-0,61	-2,41	-19,68	-18,91
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS	1,77	5,70	6,28	4,86	8,52	26,45	28,73
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,62	3,05	-1,86	2,48	0,37	-11,41	-18,02
BB PREV RF IDKA2	0,81	3,71	4,07	3,32	7,99	20,62	30,76
Var. IDKA 2 p.p.	-0,13	-0,60	0,35	-0,44	-0,69	-1,75	-2,60
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	1,77	3,55	3,83	3,05	7,10	23,78	32,81
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,11	0,15	0,26	0,17	0,02	0,51	0,56
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,24	2,73	0,90	2,30	5,30	12,79	20,92
Var. IRF-M 1 p.p.	0,00	-0,11	-0,04	-0,09	-0,21	-0,41	-0,64
BB PREV RF IRF-M	1,13	5,86	3,31	4,96	9,57	26,04	35,92
Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,04	-0,14	-0,01	-0,12	-0,24	-0,55	-0,87
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	8,36	-0,70	27,26	-2,67	12,67	62,04	86,72
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,83	12,35	5,40	8,98	9,17	15,55	23,54
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	6,18	-8,45	26,47	-9,58	6,75		
Var. IBOVESPA p.p.	-2,08	2,56	-1,36	-0,04	5,67		
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	8,32	-9,87	21,78	-11,23	4,70	50,50	62,91
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,79	3,18	-0,08	0,43	1,20	4,00	-0,28
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	9,22	-6,80	29,18	-9,66	9,15		
Var. IBOVESPA p.p.	0,96	4,21	1,34	-0,13	8,07		
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	6,38	-12,84	22,84	-11,57	0,02	50,60	
Var. IBOVESPA p.p.	-1,89	-1,83	-4,99	-2,03	-1,06	20,69	
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	2,52	0,86	7,31	0,59			
% do CDI	1.297,28	43,83	1.136,11	37,57			
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,10	-8,55	-8,26	-8,57	-35,18	-37,22	-23,81
% do CDI	-51,75	-438,06	-1.283,34	-545,86	-834,70	-343,77	-127,51
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	1,07	-9,32	3,04	0,77	-20,72	-24,14	-31,48
Var. IFIX p.p.	3,67	5,21	-1,93	11,95	-23,48	-51,00	-63,75
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1,88	35,34	9,28	27,06	55,47	69,34	132,22
Var. IBOVESPA p.p.	-6,39	46,35	-18,55	36,60	54,39	39,44	76,11
CDI	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,68
IBOVESPA	8,27	-11,01	27,83	-9,54	1,08	29,91	56,12
INPC + 6%	0,98	4,26	1,99	3,54	8,88	19,01	30,64
IPCA + 6%	0,90	3,91	1,73	3,16	8,47	18,63	31,32

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	0,24	2,84	0,94	2,39	5,51	13,20	21,56
IRF-M 1+	1,47	7,59	4,50	6,40	12,02	32,81	43,78
IRF-M TOTAL	1,08	6,00	3,32	5,08	9,81	26,59	36,79
IMA-B 5	0,99	4,19	4,28	3,61	8,83	24,16	34,43
IMA-B 5+	7,32	1,68	11,51	1,64	7,81	49,37	56,19
IMA-B TOTAL	4,39	2,65	8,14	2,38	8,16	37,86	46,75
IMA-C TOTAL	4,26	12,04	11,01	9,27	15,97	43,97	64,91
IMA-GERAL ex-C TOTAL	1,66	3,39	3,57	2,88	7,07	23,27	32,25
IMA-GERAL TOTAL	1,74	3,64	3,79	3,07	7,33	23,84	33,11
IDKA 2	0,94	4,31	3,72	3,76	8,68	22,37	33,35
IDKA 20	12,08	-1,74	17,28	-0,38	4,95	69,37	71,28
CDI	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,68
Renda Variável							
IBOVESPA	8,27	-11,01	27,83	-9,54	1,08	29,91	56,12
IBRX 100	8,41	-10,43	28,20	-9,30	2,17	33,69	59,04
IBRX 50	8,15	-11,06	29,00	-9,35	0,23	26,69	52,24
SMALL CAP	9,50	-13,20	31,66	-13,59	7,86	55,28	71,97
IFIX	-2,61	-14,53	4,97	-11,18	2,77	26,86	32,28
Índice Consumo - ICON	7,62	-4,11	27,54	-7,49	12,15	54,44	58,02
Índice Dividendos - IDIV	6,53	-13,05	21,87	-11,65	3,50	46,49	63,19
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,36	0,46	0,24	0,25	2,31	5,60	10,34
INPC	0,44	0,80	0,49	0,61	2,69	5,94	9,76
IGPM	2,23	6,71	4,11	6,21	9,27	16,26	25,84
SELIC	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,69
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
255	01/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.669,82	205,81711656	8,1131250300
256	01/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	33.565,31	4.137,16168257	8,1131250300
253	01/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	149.432,51	18.418,61298174	8,1131250300
257	01/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.399.471,44	172.494,74583778	8,1131250300
254	01/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	14.221,42	1.752,89052583	8,1131250300
274	01/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	3.014,70	0,00	371,58308159	8,1131250300
270	02/07/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1.600.000,00	0,00	355.755,96474903	4,4974650000
260	03/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	13.902,18	0,00	1.713,51534914	8,1132509300
276	03/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	17.848,32	0,00	2.199,89744604	8,1132509300
241	06/07/2020	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	0,00	1.500.000,00	177.103,87167577	8,4696059200
242	06/07/2020	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	1.500.000,00	384.746,71247977	3,8986687900
246	06/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	644,48	0,00	305,97494100	2,1063162800
258	06/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	5.118,07	630,82360984	8,1133139600
268	06/07/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	4.000.000,00	1.289.523,90777325	3,1019200000
271	06/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.766.925,67	341.035,20258693	8,1133139600
278	07/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	459,03	0,00	56,57693433	8,1133770400
252	07/07/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	16.000.000,00	5.162.544,32124965	3,0992470000
269	08/07/2020	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	4.000.000,00	0,00	3.604.808,45399679	1,1096290000
280	08/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	315.546,11	0,00	38.891,80023954	8,1134354300
245	08/07/2020	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	4.000.000,00	202.139,68018000	19,7882968670
251	08/07/2020	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	16.000.000,00	0,00	15.187.441,50461983	1,0535020000
248	09/07/2020	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	4.000.000,00	0,00	3.152.857,00401600	1,2686905860
250	09/07/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	3.000.000,00	0,00	655.325,17235052	4,5778800000
243	13/07/2020	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	150.000,00	37.858,68835697	3,9621024000
282	17/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.709,15	0,00	210,64596148	8,1138512600
262	22/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	33.563,79	0,00	4.136,51292884	8,1140300000
284	22/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	46.104,42	0,00	5.682,06181145	8,1140300000
264	28/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.631.097,21	0,00	201.015,90613081	8,1142693700

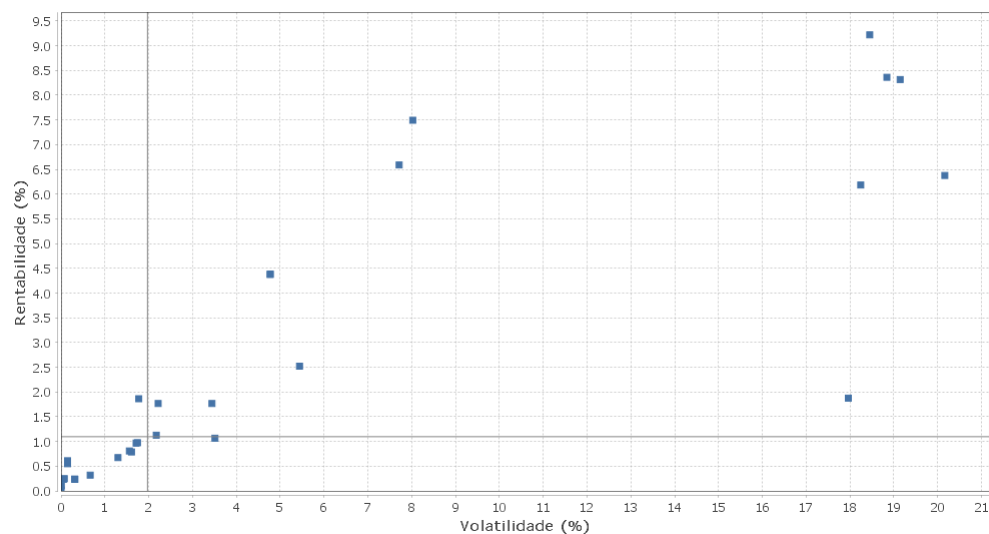
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
286	28/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	20.109.713,26	0,00	2.478.314,72471809	8,1142693700
244	29/07/2020	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	169.829,49	42.177,64330485	4,0265286700
259	30/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	227.302,92	28.012,32295675	8,1143902400
263	30/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	33.565,28	4.136,51291191	8,1143902400
261	30/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	13.904,13	1.713,51507492	8,1143902400
265	30/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.569.068,88	193.368,67387339	8,1143902400
267	30/07/2020	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	1.800.000,00	0,00	1.055.593,74784959	1,7052014600
273	30/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	58.521,52	7.212,06625133	8,1143902400
277	30/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	17.850,83	2.199,89789399	8,1143902400
281	30/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	315.583,24	38.891,79971211	8,1143902400
285	30/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	46.106,47	5.682,06219276	8,1143902400
275	30/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.015,17	371,58306549	8,1143902400
279	30/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	459,09	56,57726415	8,1143902400
283	30/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.709,26	210,64552597	8,1143902400
287	30/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	16.521.293,56	2.036.048,68281514	8,1143902400
272	30/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.092.202,54	134.600,69181982	8,1143902400
247	30/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.200,00	1.518,04852900	2,1079695010
266	31/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	13.902,18	0,00	1.713,26209158	8,1144502457
288	31/07/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	61.012,87	7.519,03926361	8,1144502457

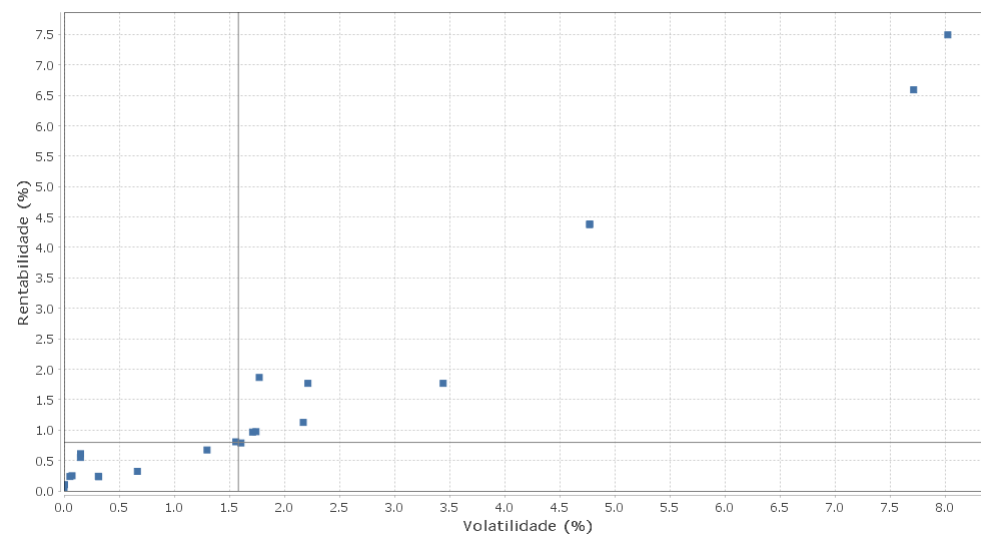
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

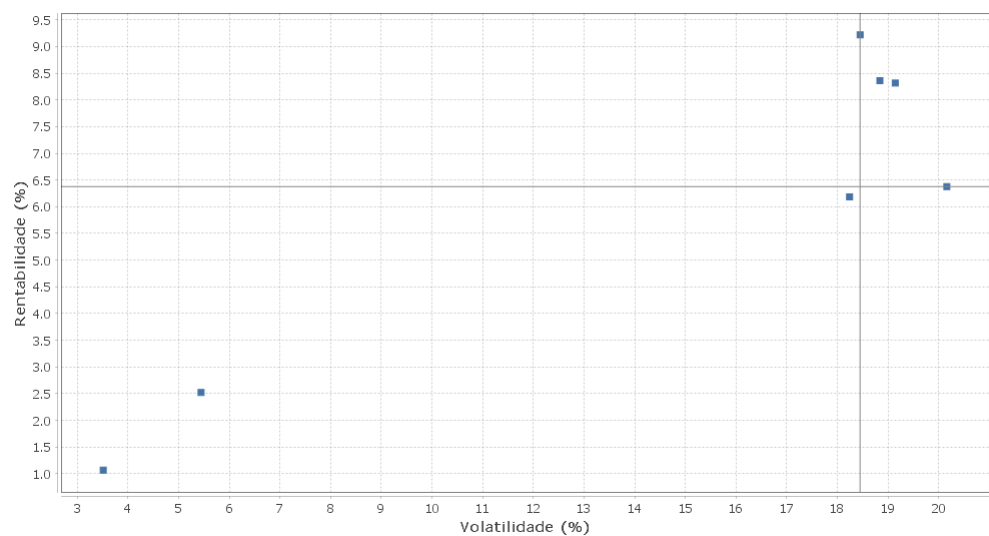
VITÓRIA - CONSOLIDADO - No Mês



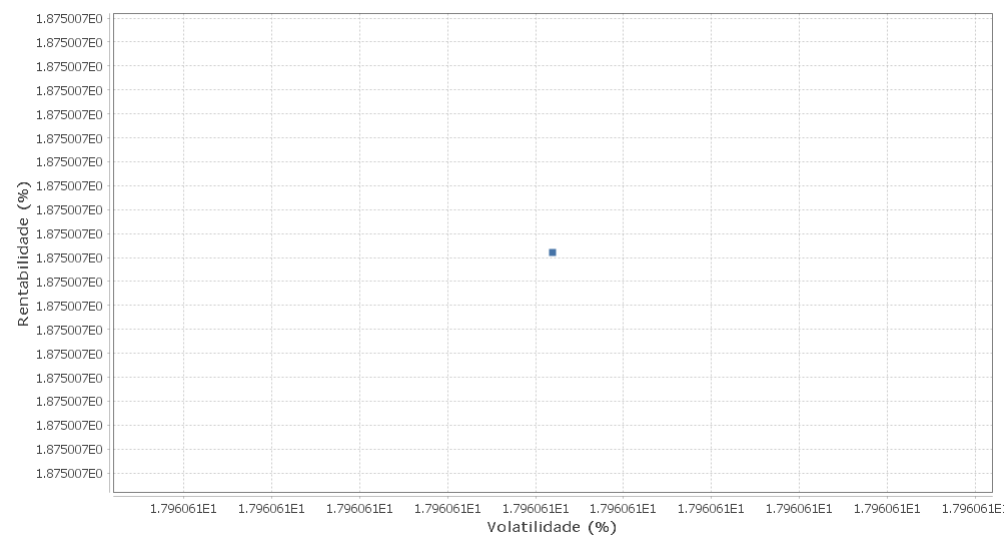
Renda Fixa - No Mês



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	0,02	3.603.688,17	0,52
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,00	0,10	141,07	0,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,02	0,24	76.067,77	0,01
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,02	0,25	8.334.527,53	1,19
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,15	0,04	0,55	5.324.540,20	0,76
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,15	0,04	0,61	48.572.504,62	6,96
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,31	0,04	0,24	6.029.993,02	0,86
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,31	0,04	0,23	2.657.284,21	0,38
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	0,67	0,08	0,32	2.402.961,24	0,34
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	1,30	0,16	0,67	12.047.343,59	1,73
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,56	0,20	0,81	17.179.633,19	2,46
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	1,61	0,20	0,79	9.739.741,25	1,40
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,71	0,22	0,97	19.198.768,46	2,75
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,74	0,22	0,97	106.584.949,83	15,28
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	1,77	0,26	1,86	23.282.443,09	3,34
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,17	0,27	1,13	44.795.214,11	6,42
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,21	0,31	1,77	82.188.563,45	11,78
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS	Artigo 7º I, Alínea b	3,44	0,43	1,77	7.003.620,00	1,00
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	3,51	0,41	1,07	1.477.810,76	0,21
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,77	0,68	4,38	52.918.389,20	7,59
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	4,77	0,68	4,39	77.348.138,22	11,09
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	5,44	0,67	2,52	2.696.904,97	0,39
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	7,71	1,08	6,59	37.370.743,24	5,36
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	8,02	1,15	7,49	39.649.062,51	5,68
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	17,96	1,94	1,88	10.280.720,48	1,47
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	Artigo 8º II, Alínea a	18,24	2,15	6,18	16.213.231,68	2,32
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	18,45	2,30	9,22	8.921.016,89	1,28
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	18,84	2,30	8,36	21.616.264,80	3,10
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	19,14	2,33	8,32	8.267.775,30	1,19
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,16	2,36	6,38	20.542.607,47	2,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O percentual alocado no Artigo 7, Inciso IV, Alínea A (29,23 % dos recursos) está superior ao limite máximo estipulado em Política de Investimentos;