



VITÓRIA - CONSOLIDADO
AGOSTO 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 31.08.2020.

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 **86,45%**

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	5,92	-0,80	5,01	44.435.477,74	6,42	5.055.871.049,38	0,88
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	22,96	-3,55	-5,04	37.917.537,30	5,48	288.523.008,49	13,14
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,54	0,09	2,78	2.659.629,91	0,38	7.749.783.927,00	0,03
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,61	-1,83	0,54	51.949.776,67	7,50	6.019.680.821,86	0,86
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,10	2,83	6.035.810,41	0,87	10.245.504.415,29	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	0,39	4,45	107.002.550,38	15,46	12.740.710.327,20	0,84
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,12	0,69	4,43	17.297.506,84	2,50	6.452.433.505,43	0,27
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,92	0,37	4,46	19.269.176,93	2,78	4.251.005.212,54	0,45
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,63	-0,24	5,45	6.829.560,00	0,99	456.299.202,88	1,50
BB	BB	BB PREV IPCA I	4,95	0,83	5,08	9.576.336,76	1,38	502.994.488,31	1,90
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	4,20	-0,18	5,36	12.025.212,80	1,74	194.803.588,72	6,17
BB	BB	BB PREV RF VII	2,28	0,47	2,45	835.507,65	0,12	238.494.074,76	0,35
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,12	-0,89	2,63	81.458.112,43	11,77	10.897.747.304,90	0,75
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,10	-0,69	2,68	397.292.195,82	57,38		

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	0,92	0,34	-0,75	5.342.817,72	0,77	328.244.713,37	1,63
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,05	0,02	0,42	6.862.433,78	0,99	890.783.861,56	0,77
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,29	0,14	1,77	8.504.253,43	1,23	4.687.255.346,64	0,18
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	12,54	-1,79	0,52	75.960.894,86	10,97	1.456.021.562,44	5,22
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	26,14	-3,63	-5,86	36.014.470,96	5,20	275.989.890,48	13,05
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,18	1,79	76.205,61	0,01	2.572.617.697,19	0,00
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,07	0,08	1,42	218,63	0,00	1.775.186.405,18	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,92	0,40	-0,55	45.363.494,63	6,55	2.028.417.251,32	2,24
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,58	-0,64	-0,11	23.133.043,53	3,34	184.359.376,17	12,55
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			6,79	-1,31	-1,42	201.257.833,15	29,07		
Renda Fixa			6,39	-0,90	1,85	598.550.028,97	86,45		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

11,84%

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
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	44,71	-0,53	-0,53	1.591.445,95	0,23	807.714.010,65	0,20
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	38,93	-3,82	-13,31	7.951.783,29	1,15	819.770.596,51	0,97
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	44,95	-0,43	-1,13	21.523.088,44	3,11	157.969.354,10	13,62
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	40,72	-3,55	-15,94	21.604.092,50	3,12	901.803.096,40	2,40
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	41,24	-4,09	-2,82	15.549.358,24	2,25	232.751.394,64	6,68
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	44,28	-3,45	-10,02	8.613.024,10	1,24	869.679.380,09	0,99
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			41,57	-2,81	-9,69	76.832.792,52	11,10		

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	14,07	-0,23	0,62	2.690.692,52	0,39	139.569.862,75	1,93
Sub-total Artigo 8º III			14,07	-0,23	0,62	2.690.692,52	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 MULTISTRATÉGIA	31,57	-0,09	-8,64	1.213.384,86	0,18	166.173.057,17	0,73
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			31,57	-0,09	-8,64	1.213.384,86	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	27,83	-17,59	-25,27	1.217.880,15	0,18	112.715.459,16	1,08
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			27,83	-17,59	-25,27	1.217.880,15	0,18		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			37,10	-2,94	-9,10	81.954.750,05	11,84		
--	--	--	--------------	--------------	--------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,71%

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	27,07	15,16	55,87	11.839.562,96	1,71	1.583.297.843,04	0,75
Sub-total Artigo 9º A, III			27,07	15,16	55,87	11.839.562,96	1,71		
Investimentos no Exterior			27,07	15,16	55,87	11.839.562,96	1,71		
Total			7,49	-0,91	1,55	692.344.341,98	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	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	397.292.195,82	57,38	45,00	55,00	60,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	201.257.833,15	29,07	13,00	15,00	20,00	0,00	50,00
	Total Renda Fixa	598.550.028,97	86,45					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	76.832.792,52	11,10	3,00	13,00	18,00	0,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	2.690.692,52	0,39	0,50	1,00	6,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	1.213.384,86	0,18	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.217.880,15	0,18	0,00	1,50	5,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	81.954.750,05	11,84					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	11.839.562,96	1,71	0,00	1,00	6,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	11.839.562,96	1,71					10,00

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	9,81 461,49	0,00 0,00	0,00 0,00	17,14 442,18	0,00	3.463.250,51
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,69 -431,92	2,68 126,05	2,70 472,24	1,61 111,54	7,34 189,41	-2.800.395,98	10.760.890,97
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-1,31 -817,04	-1,42 -66,66	3,21 561,95	-2,16 -149,74	3,26 84,19	-2.670.348,37	-2.235.707,00
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,81 0,63	-9,69 4,38	13,02 -0,68	-3,27 1,34	3,08 4,83	-2.148.735,36	-3.188.886,28
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,23 3,21	0,62 14,70	4,58 -9,11	2,70 7,31		-6.212,45	3.385,95
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,09 3,35	-8,64 5,44	-8,35 -22,04	-8,58 -3,97	-35,48 -33,73	-1.118,17	-114.689,12
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-17,59 -14,15	-25,27 -11,19	-17,56 -31,25	-16,36 -11,75	-24,95 -23,20	-259.930,61	-411.770,31
Artigo 9º A, III % do CDI	15,16 9.425,68	55,87 2.629,01	22,45 3.927,84	55,15 3.822,11	68,87 1.776,86	1.558.842,48	3.072.747,16
VITÓRIA - CONSOLIDADO (Total)						-6.327.898,46	11.349.221,88

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	39.649.062,51	0,00	-325.434,63	0,00	37.917.537,30	-1.406.090,58	-2.241.131,99
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	12.047.343,59	0,00	0,00	0,00	12.025.212,80	-22.130,79	611.497,86
BB PREV IPCA I	9.739.741,25	0,00	-243.847,20	0,00	9.576.336,76	80.442,71	476.717,72
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	82.188.563,45	0,00	0,00	0,00	81.458.112,43	-730.451,02	1.946.286,60
BB PREV RF IDKA2	17.179.633,19	0,00	0,00	0,00	17.297.506,84	117.873,65	733.125,96
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	19.198.768,46	0,00	0,00	0,00	19.269.176,93	70.408,47	951.102,58
BB PREV RF IRF-M	44.795.214,11	0,00	0,00	0,00	44.435.477,74	-359.736,37	2.119.797,35
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.657.284,21	0,00	0,00	0,00	2.659.629,91	2.345,70	71.970,20
BB PREV RF VII	2.402.961,24	0,00	-1.576.097,90	0,00	835.507,65	8.644,31	55.327,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.003.620,00	0,00	0,00	157.552,53	6.829.560,00	-16.507,47	363.714,19
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	106.584.949,83	0,00	0,00	0,00	107.002.550,38	417.600,55	5.227.058,10
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	52.918.389,20	0,00	0,00	0,00	51.949.776,67	-968.612,53	280.383,16
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.029.993,02	0,00	0,00	0,00	6.035.810,41	5.817,39	165.041,88
					397.292.195,82	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	23.282.443,09	0,00	0,00	0,00	23.133.043,53	-149.399,56	-123.905,59
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	37.370.743,24	0,00	0,00	0,00	36.014.470,96	-1.356.272,28	-2.361.087,85
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	3.603.688,17	24.079.583,75	-20.821.706,51	0,00	6.862.433,78	868,37	13.141,08
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	48.572.504,62	0,00	-3.400.000,00	0,00	45.363.494,63	190.990,01	-264.829,89
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	5.324.540,20	0,00	0,00	0,00	5.342.817,72	18.277,52	-40.408,82
BB PREV RF FLUXO FIC	141,07	3.943.383,25	-3.943.425,41	0,00	218,63	119,72	289,79
BB PREV RF IMA-B	77.348.138,22	0,00	0,00	0,00	75.960.894,86	-1.387.243,36	394.664,72
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	76.067,77	0,00	0,00	0,00	76.205,61	137,84	1.343,49
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.334.527,53	157.552,53	0,00	0,00	8.504.253,43	12.173,37	145.086,07
					201.257.833,15	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST ACOES FIC FIA	0,00	1.600.000,00	0,00	0,00	1.591.445,95	-8.554,05	-8.554,05
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	21.616.264,80	0,00	0,00	0,00	21.523.088,44	-93.176,36	164.411,79
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	20.542.607,47	1.820.631,74	0,00	0,00	21.604.092,50	-759.146,71	-1.115.774,45
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	8.267.775,30	0,00	0,00	0,00	7.951.783,29	-315.992,01	-1.221.206,91
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	16.213.231,68	0,00	0,00	0,00	15.549.358,24	-663.873,44	-450.641,76
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	8.921.016,89	0,00	0,00	0,00	8.613.024,10	-307.992,79	-557.120,90
					76.832.792,52	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	2.696.904,97	0,00	0,00	0,00	2.690.692,52	-6.212,45	3.385,95
					2.690.692,52	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTIESTRATÉGIA	1.214.503,03	0,00	0,00	0,00	1.213.384,86	-1.118,17	-114.689,12
					1.213.384,86	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	1.477.810,76	0,00	0,00	0,00	0,00	1.217.880,15	-259.930,61	-411.770,31
						1.217.880,15	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	10.280.720,48	0,00	0,00	0,00	11.839.562,96	1.558.842,48	3.072.747,16
					11.839.562,96	0,00	0,00

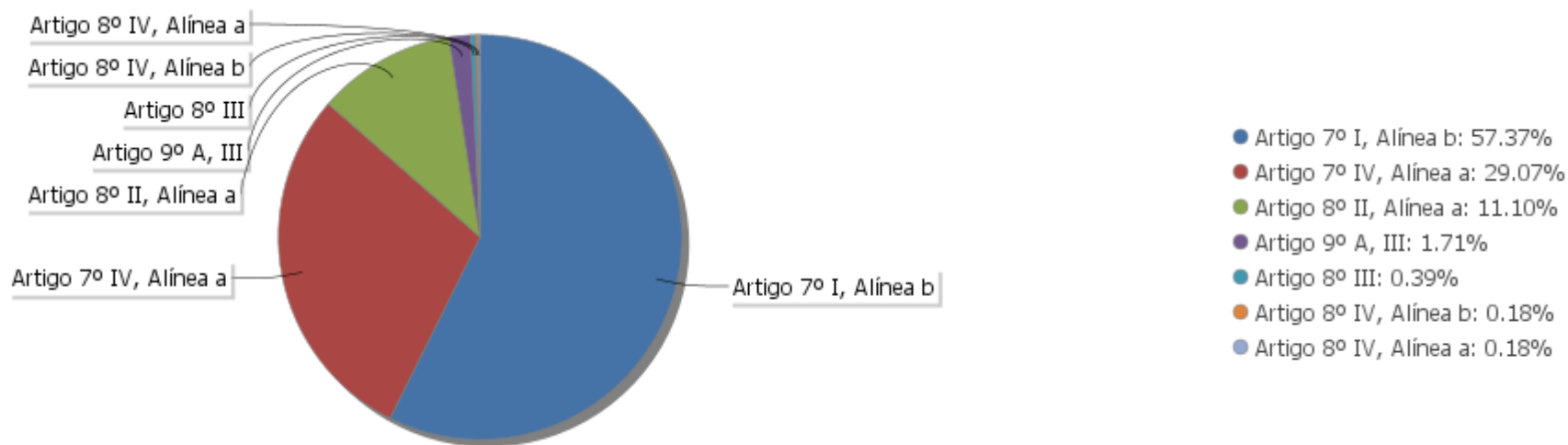
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

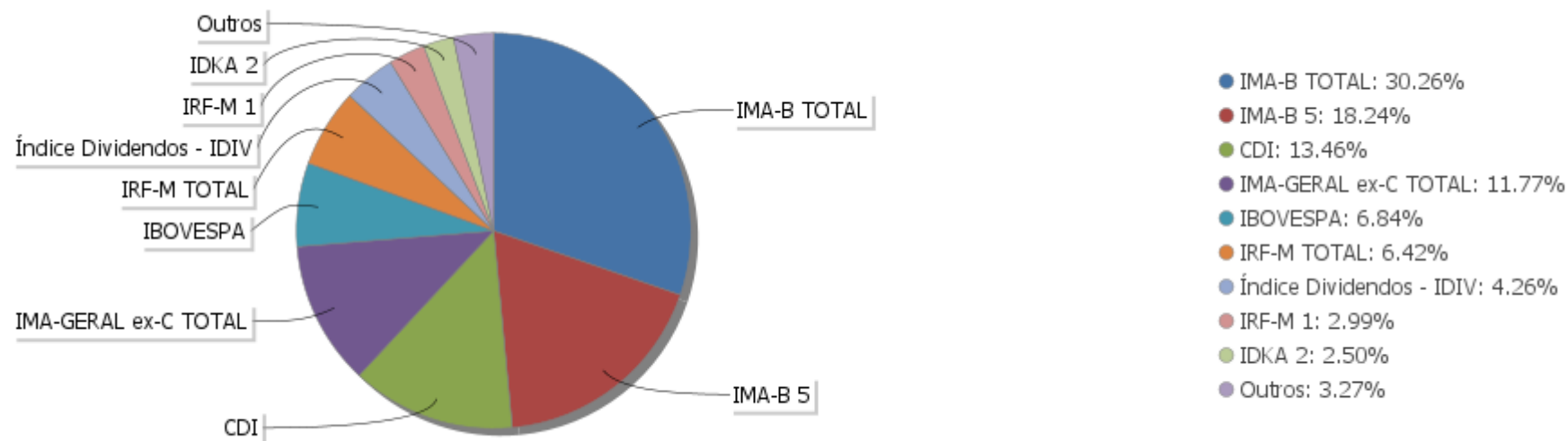
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	614.193.069,09	88,71	614.193.069,09	88,71
de 31 a 365 dias	59.691.988,33	8,62	673.885.057,42	97,33
acima de 365 dias	18.459.284,56	2,67	692.344.341,98	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

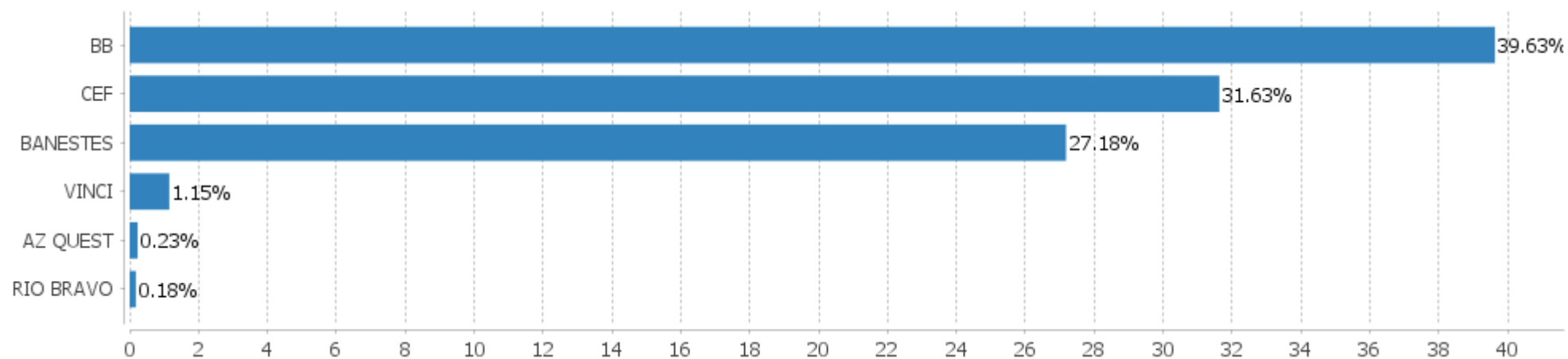


Alocação Por Estratégia



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	-0,91					1,55
INPC + 5,50%	0,66	0,55	0,65	0,19	0,17	0,75	0,93	0,81					4,82
p.p. indexador	0,34	-0,64	-6,59	1,21	1,56	0,98	1,94	-1,72					-3,27
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 + 6,00%	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

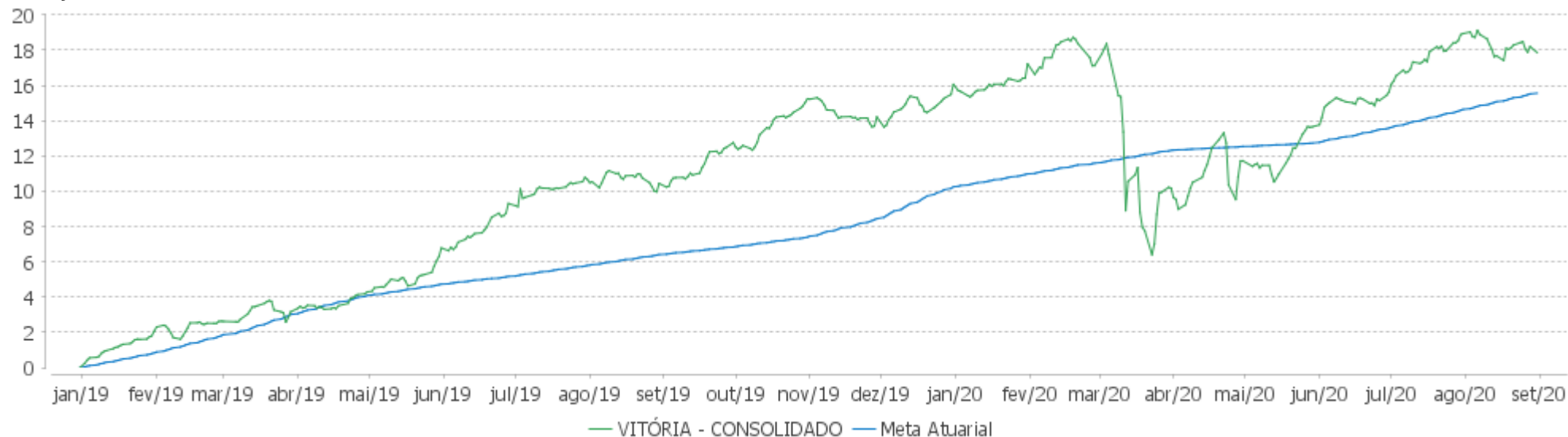
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

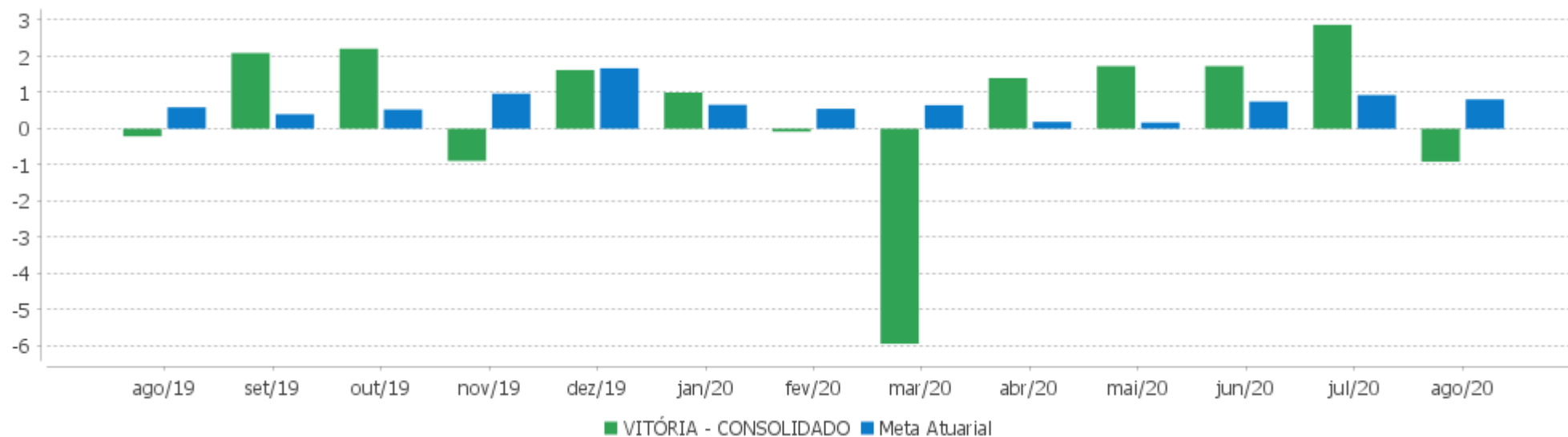
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	12	60,00	03 meses	3,70	2,51	1,19	3,43
Meses abaixo - Meta Atuarial	8	40,00	06 meses	0,63	3,56	-2,93	10,08
			12 meses	6,72	8,78	-2,06	7,49
			24 meses				
			Desde 31/12/2018	17,86	16,11	1,75	6,06
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	2,87	2020-07					
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	0,34 213,39	-0,75 -35,33	1,30 226,96	-1,33 -92,11	0,55 14,18	7,00 67,36	14,16 78,90
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-3,63 -1,83	-5,86 -6,66	4,97 0,37	-6,73 -6,82	0,44 -6,20	34,98 -1,02	37,17 -5,04
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,40 246,56	-0,55 -25,83	1,47 257,09	-1,23 -85,29	0,96 24,89	7,75 74,57	15,70 87,44
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	-0,64 -398,89	-0,11 -5,31	1,82 318,62	-1,14 -79,19	5,57 143,58	24,91 239,53	
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,79 0,00	0,52 -0,28	4,60 -0,01	-0,14 -0,24	6,26 -0,38	35,06 -0,94	41,07 -1,14
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,18 112,65	1,79 84,45	0,68 118,77	1,16 80,64	3,42 88,15	9,79 94,10	17,31 96,43
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,08 46,74	1,42 66,93	0,31 53,64	0,91 63,41	2,78 71,83	8,08 77,67	14,23 79,28
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO % do CDI	0,02 15,05	0,42 19,99	0,06 11,28	0,22 15,55	1,13 29,17	4,38 42,12	8,30 46,23
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,14 90,12	1,77 83,20	0,64 111,54	1,12 77,28	3,36 86,69	9,69 93,19	17,02 94,78
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,83 -0,03	0,54 -0,26	4,54 -0,07	-0,14 -0,23	6,20 -0,44	35,19 -0,80	41,02 -1,18
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,39 -0,03	4,45 -0,18	2,48 -0,07	3,24 -0,15	8,93 -0,32	24,43 -0,58	32,42 -0,91
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,83 0,10	5,08 0,41	2,83 0,44	3,65 0,43	9,61 1,03	28,36 9,40	35,58 4,25
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,09 -0,03	2,78 -0,18	0,58 -0,06	1,99 -0,13	4,77 -0,29	12,31 -0,53	19,76 -0,86
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,37 -0,06	4,46 -0,17	2,43 -0,13	3,21 -0,18	8,95 -0,29	24,42 -0,59	32,44 -0,89
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	-0,18 -0,30	5,36 2,39	0,97 0,33	3,87 1,74	7,98 2,92	20,55 7,71	29,10 8,49
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-3,55 -1,75	-5,04 -5,85	6,06 1,45	-5,64 -5,73	2,57 -4,07	40,28 4,29	42,92 0,72
BB PREV RF VII	0,47	2,45	1,79	1,82	6,06	18,80	27,18

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.	2,27	1,64	-2,82	1,73	-0,59	-17,19	-15,03
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	-0,24	5,45	2,78	3,88	10,88	30,51	29,60
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,56	4,65	-1,83	3,79	4,23	-5,48	-12,61
BB PREV RF IDKA2	0,69	4,43	2,73	3,38	8,67	21,54	30,37
Var. IDKA 2 p.p.	-0,35	-0,96	-0,26	-0,74	-1,03	-1,98	-3,07
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	-0,89	2,63	1,82	1,67	6,05	23,16	30,22
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,21	-0,06	-0,06	-0,06	-0,11	0,44	0,25
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,10	2,83	0,60	2,03	4,85	12,44	19,97
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,13	-0,04	-0,10	-0,21	-0,40	-0,65
BB PREV RF IRF-M	-0,80	5,01	1,09	3,47	8,43	26,24	33,44
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,05	-0,20	-0,03	-0,15	-0,28	-0,58	-0,90
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,09	-8,64	-8,35	-8,58	-35,48	-37,21	-23,89
% do CDI	-57,23	-406,40	-1.460,52	-594,91	-915,33	-357,85	-133,09
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	-0,43	-1,13	18,93	4,33	10,07	69,06	75,12
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	4,40	16,12	8,47	14,71	13,71	24,28	29,92
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	-4,09	-12,20	10,57	-7,19	3,06		
Var. IBOVESPA p.p.	-0,65	1,87	-3,12	-2,58	4,81		
AZ QUEST ACOES FIC FIA	-1,98	-12,25	17,24	-7,84	-2,23	32,56	52,94
Var. IBOVESPA p.p.	1,46	1,82	3,55	-3,23	-0,48	2,97	12,65
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-3,82	-13,31	8,95	-8,81	-1,14	48,70	47,11
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,01	3,94	-1,51	1,57	2,51	3,92	1,91
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	-3,45	-10,02	15,87	-4,39	6,16		
Var. IBOVESPA p.p.	-0,01	4,06	2,17	0,22	7,91		
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-3,55	-15,94	10,23	-6,32	-2,66	48,05	
Var. IBOVESPA p.p.	-0,11	-1,87	-3,46	-1,71	-0,92	18,46	
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	-0,23	0,62	4,58	2,70			
% do CDI	-143,20	29,33	801,09	186,80			
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	-17,59	-25,27	-17,56	-16,36	-24,95	-36,55	-43,56
Var. IFIX p.p.	-19,38	-12,27	-22,24	-10,23	-29,67	-66,59	-77,06
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	15,16	55,87	22,45	55,15	68,87	72,76	164,16
Var. Global BDRX p.p.	0,54	1,38	0,56	1,27	0,91	-0,19	-5,87
VITÓRIA - CONSOLIDADO	-0,91	1,55	3,70	0,63	6,72		
Var. INPC + 5,50% p.p.	-1,72	-3,27	1,19	-2,93	-1,89		
CDI	0,16	2,12	0,57	1,44	3,88	10,40	17,95
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59	40,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
INPC + 6,00%	0,85	5,15	2,64	3,80	9,12	19,38	31,09
IPCA + 6,00%	0,73	4,66	2,39	3,22	8,58	18,96	31,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,12	2,96	0,64	2,12	5,06	12,83	20,62	36,48	56,78
IRF-M 1+	-1,13	6,37	1,36	4,37	10,64	33,26	40,58	68,60	104,98
IRF-M TOTAL	-0,75	5,20	1,11	3,62	8,70	26,82	34,34	58,52	88,20
IMA-B 5	0,43	4,63	2,55	3,39	9,24	25,01	33,33	51,87	79,36
IMA-B 5+	-3,62	-2,01	6,38	-2,35	4,71	44,71	48,51	72,94	125,39
IMA-B TOTAL	-1,80	0,80	4,61	0,09	6,64	36,00	42,20	64,23	106,12
IMA-GERAL TOTAL	-0,60	3,02	2,13	1,99	6,51	23,37	30,91	50,59	80,38
IDKA 2	1,03	5,39	2,99	4,11	9,71	23,52	33,44	52,56	79,57
IDKA 20	-6,22	-7,86	9,49	-6,50	-0,24	59,80	58,73	87,62	175,39
CDI	0,16	2,12	0,57	1,44	3,88	10,40	17,95	32,19	50,87

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59	40,28	71,62	113,12
IBRX 100	-3,38	-13,46	14,15	-4,51	-1,12	33,35	43,15	75,30	115,86
IBRX 50	-3,42	-14,10	14,20	-4,15	-2,18	26,25	37,06	67,20	102,75
SMALL CAP	-1,23	-14,27	23,76	-6,96	6,02	60,17	56,43	113,65	174,90
IFIX	1,79	-12,99	4,68	-6,13	4,72	30,04	33,50	57,44	90,80
Índice Consumo - ICON	-1,48	-5,53	16,72	1,26	5,75	60,13	42,78	63,55	87,75
Índice Dividendos - IDIV	-4,83	-17,25	10,46	-10,38	-3,64	44,78	45,20	93,78	148,77

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,24	0,70	0,86	0,24	2,44	5,95	10,39	13,10	23,25
INPC	0,36	1,16	1,10	0,80	2,94	6,32	10,19	12,10	22,89
IGPM	2,74	9,64	6,67	9,17	13,02	18,62	29,16	26,95	41,54
SELIC	0,16	2,12	0,57	1,44	3,88	10,40	17,97	32,22	50,93

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	12,52	47,07	15,93	44,10	58,13	59,61	146,21	172,25	166,29
MSCI ACWI	11,43	40,45	15,75	38,72	51,35	47,99	112,54	137,04	121,18
MSCI World	12,02	41,33	15,27	39,48	51,80	49,34	117,83	141,12	123,90

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	3,35	1,89	2,24	6,54	14,54	24,08	32,19	49,82
IPCA + 5,00%	0,65	4,01	2,14	2,73	7,56	16,74	27,67	37,32	57,13
IPCA + 5,50%	0,69	4,34	2,27	2,98	8,07	17,85	29,49	39,94	60,88
IPCA + 5,89%	0,72	4,59	2,36	3,17	8,47	18,72	30,92	42,01	63,87
IPCA + 6,00%	0,73	4,66	2,39	3,22	8,58	18,96	31,33	42,59	64,71
INPC + 4,00%	0,69	3,83	2,13	2,81	7,06	14,94	23,86	31,02	49,37
INPC + 6,00%	0,85	5,15	2,64	3,80	9,12	19,38	31,09	41,33	64,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
301	04/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.545,77	436,92983020	8,1151932300
302	05/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.962.488,50	241.827,16583265	8,1152524500
295	05/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	644,48	0,00	305,67904900	2,1083551580
323	05/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.995,44	492,33711762	8,1152524500
303	06/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	800.261,89	98.611,35015340	8,1153121700
324	06/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.192,92	146,99619374	8,1153121700
305	07/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	671,74	0,00	82,77297291	8,1154509300
307	10/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	324.524,56	0,00	39.988,18302460	8,1155115200
327	10/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.639,50	0,00	202,02053758	8,1155115200
309	12/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.709,15	0,00	210,59976962	8,1156309100
292	17/08/2020	BB PREV IPCA I	0,00	243.847,20	103.323,14218300	2,3600443700
316	17/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	243.847,20	0,00	115.625,19664700	2,1089451700
333	17/08/2020	BB PREV RF VII	0,00	64.015,33	35.942,14642200	1,7810658620
334	17/08/2020	BB PREV RF VII	0,00	1.512.082,57	848.976,22387900	1,7810658620
317	18/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	243.847,20	115.621,03807400	2,1090210230
318	18/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	243.847,20	0,00	115.621,03807400	2,1090210230
319	19/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	244.533,84	115.943,83049800	2,1090716240
338	19/08/2020	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	1.576.097,90	0,00	1.230.966,59782600	1,2803742220
340	19/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	157.552,53	0,00	42.425,41002942	3,7136360000
300	20/08/2020	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	244.533,84	0,00	190.142,90196900	1,2860529500
311	25/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	47.868,99	0,00	5.897,97600393	8,1161723900
289	25/08/2020	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	150.000,00	37.841,20105470	3,9639333800
329	25/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	33.925,44	0,00	4.179,98021355	8,1161723900
312	26/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	20.198.652,05	0,00	2.488.673,36560556	8,1162326600
330	26/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	3.440.312,91	0,00	423.880,51872333	8,1162326600
332	26/08/2020	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	3.400.000,00	1.986.182,23533957	1,7118268100
308	27/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	324.555,83	39.988,18312814	8,1162934800
313	27/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	5.325.823,61	656.189,13647267	8,1162934800

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
310	27/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.709,29	210,59982666	8,1162934800
304	27/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	761.889,10	93.871,55625624	8,1162934800
322	27/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	47.869,70	5.897,97548819	8,1162934800
306	27/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	671,81	82,77300490	8,1162934800
290	27/08/2020	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	127.454,28	32.590,59996331	3,9107681400
291	27/08/2020	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	47.980,35	12.268,77899235	3,9107681400
320	27/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.445.479,29	0,00	1.633.303,02327200	2,1095162630
339	27/08/2020	AZ QUEST ACOES FIC FIA	1.600.000,00	0,00	123.894,13258760	12,9142516000
325	27/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	21.047,26	2.593,21081130	8,1162934800
335	27/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	9.565,08	0,00	4.534,25278900	2,1095162630
314	28/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	11.543.861,44	1.422.296,34854973	8,1163545500
321	28/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.445.479,29	1.633.253,49027700	2,1095802400
326	28/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	22.793,95	2.808,39752127	8,1163545500
337	28/08/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.565,08	4.534,11528000	2,1095802400
315	31/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	16.377,23	0,00	2.017,79107373	8,1164151300
331	31/08/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	13.902,18	0,00	1.712,84733190	8,1164151300
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 16.205.147,45

Value-At-Risk: 2,34%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,02	0,00	-9,59	0,08	218,63	0,00
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,01	0,00	-5,14	0,02	6.862.433,78	0,99
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,07	0,00	0,35	0,18	76.205,61	0,01
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,09	0,00	-0,24	0,14	8.504.253,43	1,23
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,23	0,31	-0,00	0,79	0,34	5.342.817,72	0,77
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,24	0,31	-0,00	1,00	0,40	45.363.494,63	6,55
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTISTRATÉGIA	Artigo 8º IV, Alínea a	0,32	0,41	-0,00	-0,79	-0,09	1.213.384,86	0,18
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,22	0,00	-0,20	0,10	6.035.810,41	0,87
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,22	0,00	-0,22	0,09	2.659.629,91	0,38
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,00	0,52	0,00	0,31	0,47	835.507,65	0,12
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	1,63	1,09	0,01	0,41	0,83	9.576.336,76	1,38
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,72	0,88	0,02	0,31	0,69	17.297.506,84	2,50
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	1,90	0,99	0,01	-0,18	-0,18	12.025.212,80	1,74
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,06	0,13	0,11	0,39	107.002.550,38	15,46
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,09	1,10	0,02	0,10	0,37	19.269.176,93	2,78
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	2,32	0,99	0,00	-0,35	-0,64	23.133.043,53	3,34
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,17	1,37	0,14	-0,33	-0,89	81.458.112,43	11,77
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,24	1,44	0,08	-0,30	-0,80	44.435.477,74	6,42
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,88	2,04	0,02	-0,10	-0,24	6.829.560,00	0,99
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	5,29	2,94	0,01	-0,07	-0,23	2.690.692,52	0,39
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	6,18	3,10	0,30	-0,32	-1,79	75.960.894,86	10,97
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,19	3,13	0,21	-0,32	-1,83	51.949.776,67	7,50
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	10,95	5,49	0,09	-0,34	-3,55	37.917.537,30	5,48
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	11,36	6,14	0,10	-0,33	-3,63	36.014.470,96	5,20
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,20	13,11	0,33	-0,18	-3,55	21.604.092,50	3,12
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	20,73	12,64	0,31	-0,03	-0,43	21.523.088,44	3,11
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	20,78	13,75	0,15	-0,17	-3,45	8.613.024,10	1,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,10	13,21	0,13	-0,19	-3,82	7.951.783,29	1,15
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,64	14,75	0,03	-0,09	-1,98	1.591.445,95	0,23
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	Artigo 8º II, Alínea a	24,04	15,15	0,29	-0,18	-4,09	15.549.358,24	2,25
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	24,11	13,62	-0,05	0,62	15,16	11.839.562,96	1,71
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	67,01	0,76	0,00	-0,26	-17,59	1.217.880,15	0,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O percentual alocado no Artigo 7, Inciso IV, Alínea A (29,07 % dos recursos) está superior ao limite máximo estipulado em Política de Investimentos;
- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso II, Alínea A (11,10 % dos recursos) está superior ao limite máximo estipulado em Política de Investimentos;