



VITÓRIA - CONSOLIDADO
SETEMBRO 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 30.09.2020.

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 86,75%

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	6,00	-0,66	4,32	44.143.355,48	6,46	4.983.832.924,90	0,89
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	23,29	-5,05	-9,84	35.820.475,80	5,24	288.574.129,48	12,41
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,54	0,04	2,83	2.660.766,95	0,39	7.413.658.574,68	0,04
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,79	-1,53	-1,00	51.153.221,46	7,49	5.834.527.804,73	0,88
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,13	2,97	6.043.857,93	0,88	10.130.144.603,43	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,01	-0,16	4,29	106.832.105,36	15,64	17.747.142.317,32	0,60
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,16	0,11	4,55	17.317.245,13	2,53	7.070.754.781,93	0,24
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,98	-0,15	4,30	19.239.571,06	2,82	4.406.252.863,92	0,44
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,72	-0,77	4,64	6.776.964,00	0,99	452.785.187,83	1,50
BB	BB	BB PREV IPCA I	4,95	0,20	5,28	9.595.134,83	1,40	503.981.851,79	1,90
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	4,24	-0,23	5,12	15.503.768,52	2,27	194.056.442,06	7,99
BB	BB	BB PREV RF VII	2,35	0,19	2,64	837.103,09	0,12	238.949.489,36	0,35
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,22	-0,75	1,86	80.845.099,75	11,83	10.452.752.168,75	0,77
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,18	-0,96	1,69	396.768.669,36	58,08		

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	0,10	-0,65	5.348.146,15	0,78	335.581.050,20	1,59
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,05	0,02	0,44	4.743.799,31	0,69	899.876.672,43	0,53
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,30	-0,00	1,77	8.504.029,14	1,24	4.760.770.417,77	0,18
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	12,73	-1,57	-1,05	74.770.717,95	10,95	1.338.179.967,69	5,59
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	26,43	-4,96	-10,53	34.226.921,94	5,01	291.923.457,14	11,72
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,02	1,82	76.223,92	0,01	2.533.726.732,47	0,00
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,08	0,00	1,42	863,02	0,00	1.878.414.583,86	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	0,15	-0,40	45.427.809,65	6,65	2.000.048.767,88	2,27
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,82	-1,52	-1,63	22.781.520,49	3,33	183.820.888,05	12,39
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			6,86	-1,62	-3,02	195.880.031,57	28,67		
Renda Fixa			6,46	-1,18	0,65	592.648.700,93	86,75		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

11,55%

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	45,10	-6,19	-6,69	1.492.913,46	0,22	736.706.513,52	0,20
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,13	-4,93	-17,58	7.560.008,02	1,11	783.577.685,83	0,96
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	45,33	-2,96	-4,05	20.886.731,95	3,06	157.034.448,33	13,30
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	41,05	-4,77	-19,95	20.573.482,82	3,01	862.681.891,51	2,38
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	41,62	-2,47	-5,22	15.165.070,40	2,22	229.362.963,61	6,61
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	44,55	-5,38	-14,85	8.149.842,10	1,19	829.854.206,90	0,98
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			41,93	-3,91	-13,23	73.828.048,75	10,81		

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	13,53	-1,61	-1,00	2.647.296,90	0,39	142.193.242,12	1,86
Sub-total Artigo 8º III			13,53	-1,61	-1,00	2.647.296,90	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 MULTIESTRATÉGIA	31,57	-0,10	-8,73	1.212.172,80	0,18	166.007.064,69	0,73
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			31,57	-0,10	-8,73	1.212.172,80	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	27,64	-0,76	-25,84	1.208.587,42	0,18	112.715.459,16	1,07
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			27,64	-0,76	-25,84	1.208.587,42	0,18		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			37,47	-3,73	-12,49	78.896.105,87	11,55		
--	--	--	--------------	--------------	---------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,70%

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	28,45	-1,99	52,76	11.603.448,35	1,70	1.671.279.124,17	0,69
Sub-total Artigo 9º A, III			28,45	-1,99	52,76	11.603.448,35	1,70		
Investimentos no Exterior			28,45	-1,99	52,76	11.603.448,35	1,70		
Total			7,61	-1,50	0,03	683.148.255,15	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	396.768.669,36	58,08	45,00	55,00	60,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	195.880.031,57	28,67	13,00	15,00	20,00	0,00	50,00
	Total Renda Fixa	592.648.700,93	86,75					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	73.828.048,75	10,81	3,00	13,00	18,00	0,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	2.647.296,90	0,39	0,50	1,00	6,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	1.212.172,80	0,18	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.208.587,42	0,18	0,00	1,50	5,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	78.896.105,87	11,55					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	11.603.448,35	1,70	0,00	1,00	6,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	11.603.448,35	1,70					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	9,81 429,11	0,00 0,00	0,00 0,00	16,59 466,29	0,00	3.463.250,51
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,96 -611,17	1,69 74,10	0,48 93,71	4,16 331,20	4,09 115,11	-3.854.126,12	6.906.764,85
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-1,62 -1.033,68	-3,02 -131,98	0,21 40,26	2,63 208,86	-0,83 -23,36	-3.254.308,40	-5.490.015,40
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,91 0,89	-13,23 4,97	0,24 0,71	32,25 2,69	-2,58 7,10	-3.004.743,77	-6.193.630,05
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-1,61 3,18	-1,00 17,20	0,64 1,11	9,72 -19,83		-43.395,62	-40.009,67
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,10 4,70	-8,73 9,47	-0,29 0,18	-8,59 -38,15	-35,54 -25,86	-1.212,06	-115.901,18
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-0,76 4,03	-25,84 -7,64	-17,35 -16,87	-15,85 -45,41	-23,52 -13,84	-9.292,73	-421.063,04
Artigo 9º A, III % do CDI	-1,99 -1.270,48	52,76 2.308,57	14,98 2.920,27	43,04 3.422,32	61,21 1.721,00	-236.114,61	2.836.632,55
VITÓRIA - CONSOLIDADO (Total)						-10.403.193,31	946.028,57

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	37.917.537,30	0,00	-187.400,34	0,00	35.820.475,80	-1.909.661,16	-4.150.793,15
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	12.025.212,80	3.518.000,00	0,00	0,00	15.503.768,52	-39.444,28	572.053,58
BB PREV IPCA I	9.576.336,76	0,00	0,00	0,00	9.595.134,83	18.798,07	495.515,79
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	81.458.112,43	0,00	0,00	0,00	80.845.099,75	-613.012,68	1.333.273,92
BB PREV RF IDKA2	17.297.506,84	0,00	0,00	0,00	17.317.245,13	19.738,29	752.864,25
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	19.269.176,93	0,00	0,00	0,00	19.239.571,06	-29.605,87	921.496,71
BB PREV RF IRF-M	44.435.477,74	0,00	0,00	0,00	44.143.355,48	-292.122,26	1.827.675,09
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.659.629,91	0,00	0,00	0,00	2.660.766,95	1.137,04	73.107,24
BB PREV RF VII	835.507,65	0,00	0,00	0,00	837.103,09	1.595,44	56.922,80

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	6.829.560,00	0,00	0,00	0,00	6.776.964,00	-52.596,00	311.118,19
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	107.002.550,38	0,00	0,00	0,00	106.832.105,36	-170.445,02	5.056.613,08
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	51.949.776,67	0,00	0,00	0,00	51.153.221,46	-796.555,21	-516.172,05
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.035.810,41	0,00	0,00	0,00	6.043.857,93	8.047,52	173.089,40
					396.768.669,36	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	23.133.043,53	0,00	0,00	0,00	22.781.520,49	-351.523,04	-475.428,63
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	36.014.470,96	0,00	0,00	0,00	34.226.921,94	-1.787.549,02	-4.148.636,87
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	6.862.433,78	22.294.556,61	-24.413.694,27	0,00	4.743.799,31	503,19	13.644,27
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	45.363.494,63	0,00	-5.000,00	0,00	45.427.809,65	69.315,02	-195.514,87
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	5.342.817,72	0,00	0,00	0,00	5.348.146,15	5.328,43	-35.080,39
BB PREV RF FLUXO FIC	218,63	644,48	0,00	0,00	863,02	-0,09	289,70
BB PREV RF IMA-B	75.960.894,86	0,00	0,00	0,00	74.770.717,95	-1.190.176,91	-795.512,19
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	76.205,61	0,00	0,00	0,00	76.223,92	18,31	1.361,80
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.504.253,43	0,00	0,00	0,00	8.504.029,14	-224,29	144.861,78
					195.880.031,57	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	1.591.445,95	0,00	0,00	0,00	1.492.913,46	-98.532,49	-107.086,54
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	21.523.088,44	0,00	0,00	0,00	20.886.731,95	-636.356,49	-471.944,70
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	21.604.092,50	0,00	0,00	0,00	20.573.482,82	-1.030.609,68	-2.146.384,13
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	7.951.783,29	0,00	0,00	0,00	7.560.008,02	-391.775,27	-1.612.982,18
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	15.549.358,24	0,00	0,00	0,00	15.165.070,40	-384.287,84	-834.929,60
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	8.613.024,10	0,00	0,00	0,00	8.149.842,10	-463.182,00	-1.020.302,90
					73.828.048,75	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	2.690.692,52	0,00	0,00	0,00	2.647.296,90	-43.395,62	-40.009,67
					2.647.296,90	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	1.213.384,86	0,00	0,00	0,00	1.212.172,80	-1.212,06	-115.901,18
					1.212.172,80	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	1.217.880,15	0,00	0,00	0,00	0,00	1.208.587,42	-9.292,73	-421.063,04
						1.208.587,42	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	11.839.562,96	0,00	0,00	0,00	11.603.448,35	-236.114,61	2.836.632,55
					11.603.448,35	0,00	0,00

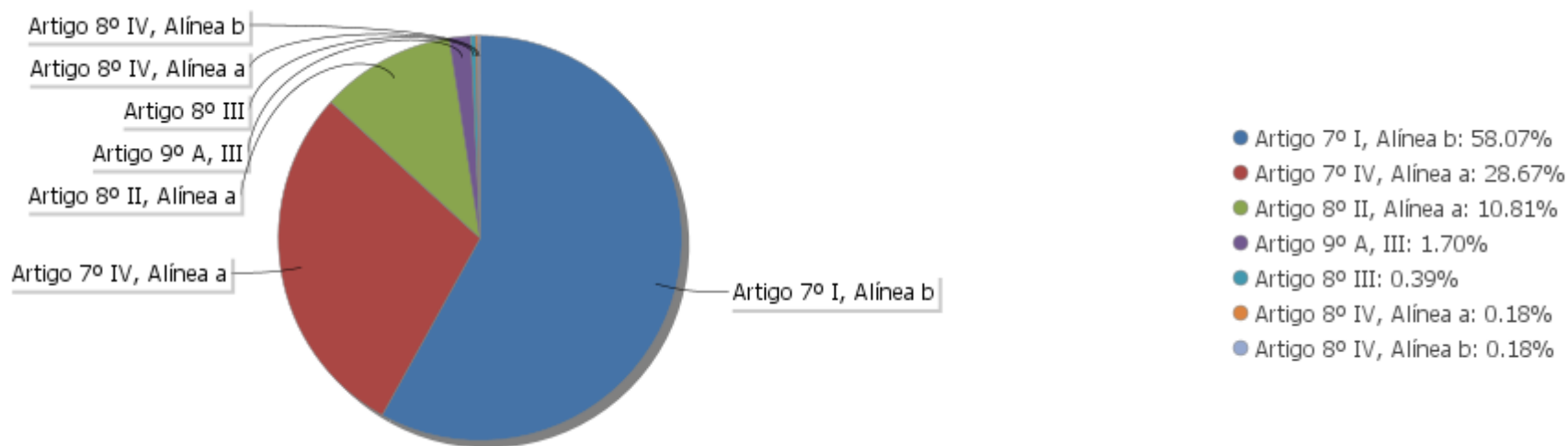
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

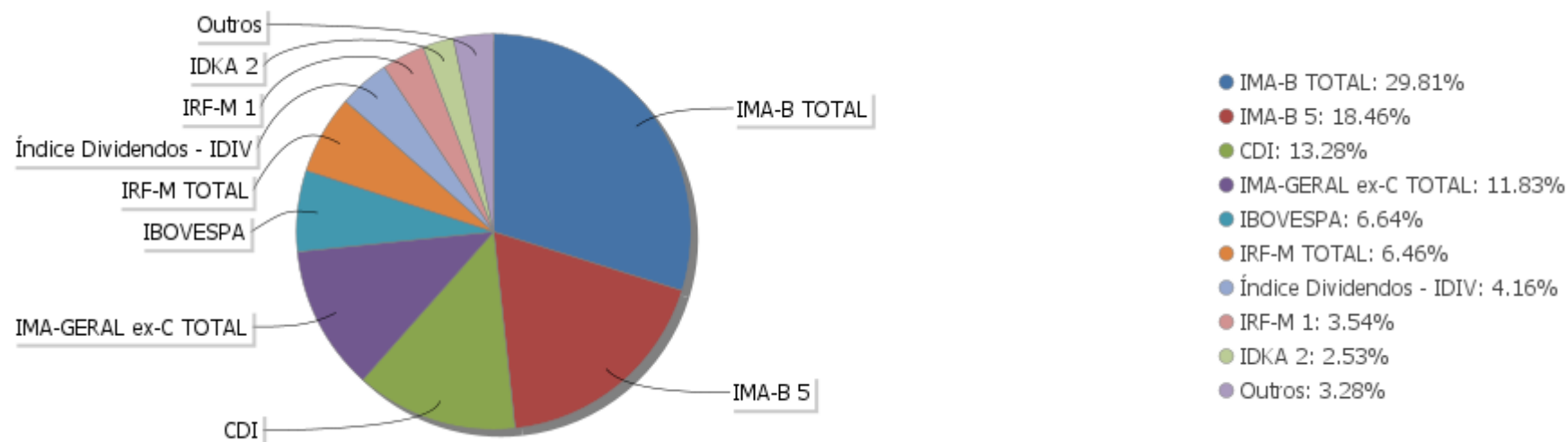
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	607.560.400,92	88,94	607.560.400,92	88,94
de 31 a 365 dias	57.170.064,89	8,37	664.730.465,81	97,30
acima de 365 dias	18.417.789,34	2,70	683.148.255,15	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

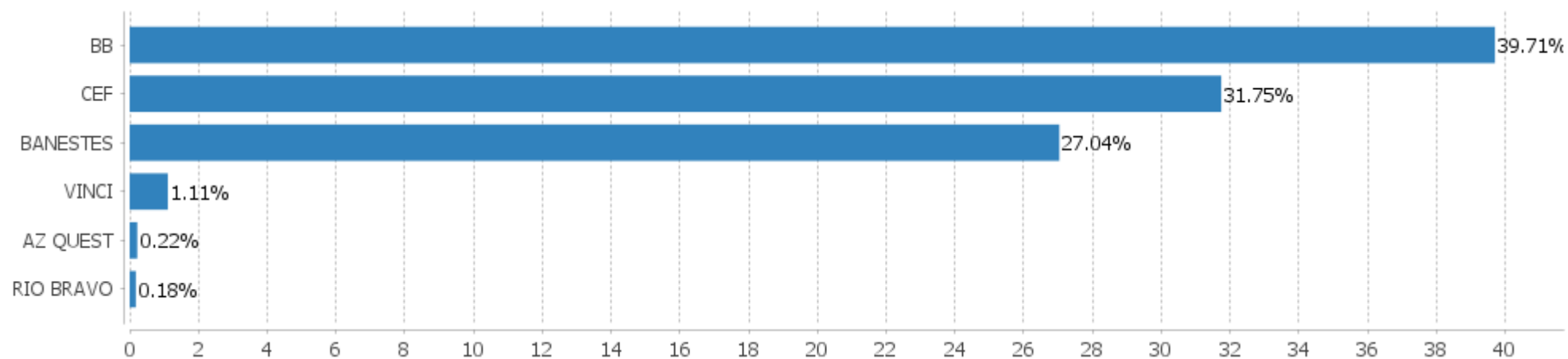


Alocação Por Estratégia



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	-1,50				0,03
INPC + 5,50%	0,66	0,55	0,65	0,19	0,17	0,75	0,93	0,81	1,32				6,20
p.p. indexador	0,34	-0,64	-6,59	1,21	1,56	0,98	1,94	-1,72	-2,82				-6,18
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

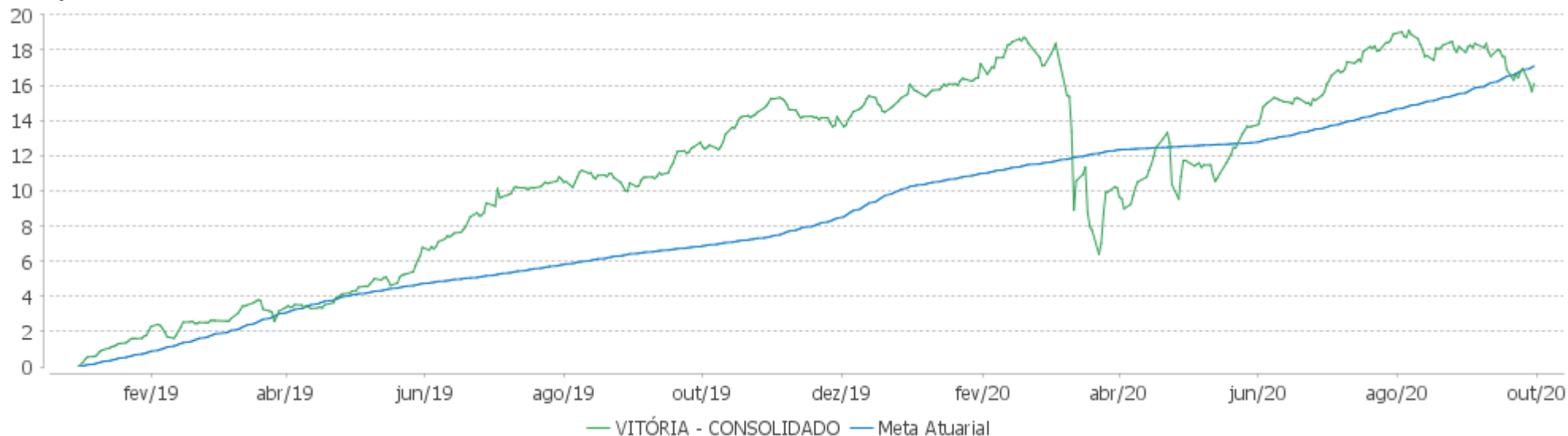
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

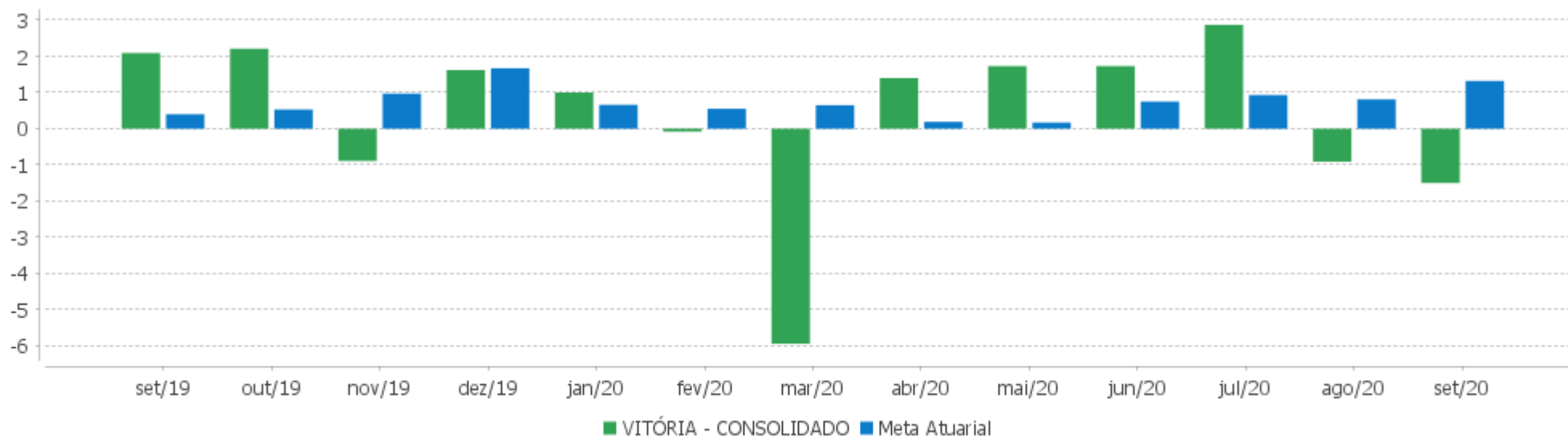
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	12	57,14	03 meses	0,41	3,09	-2,69	4,30
Meses abaixo - Meta Atuarial	9	42,86	06 meses	5,37	4,25	1,13	5,75
			12 meses	2,97	9,73	-6,77	7,61
			24 meses				
Desde 31/12/2018				16,09	17,65	-1,55	6,03
	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
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,53 -0,02	-1,00 -0,28	0,89 -0,07	5,84 -0,12	1,68 -0,43	33,36 -0,78	36,41 -1,16
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,16 -0,04	4,29 -0,22	1,21 -0,09	4,96 -0,15	6,91 -0,33	23,18 -0,58	30,91 -0,93
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,20 -0,93	5,28 -0,56	1,82 -0,95	5,68 1,89	7,86 -1,46	27,55 8,34	34,17 2,18
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,04 -0,11	2,83 -0,29	0,36 -0,14	1,43 -0,23	4,17 -0,37	11,70 -0,63	18,97 -0,94
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-0,15 -0,03	4,30 -0,20	1,18 -0,11	4,93 -0,17	6,95 -0,29	23,16 -0,59	30,94 -0,89
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-5,05 -3,54	-9,84 -9,12	-1,55 -2,51	3,14 -2,83	-7,24 -9,35	33,89 -0,25	32,47 -5,09
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	-0,23 -0,38	5,12 2,00	0,26 -0,25	2,49 0,83	6,68 2,14	19,42 7,10	27,61 7,70
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,19 1,70	2,64 3,36	0,98 0,02	3,41 -2,56	5,12 3,01	17,74 -16,40	26,32 -11,25
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,11 0,10	4,55 -0,86	1,61 -0,38	5,24 -0,17	7,28 -0,72	20,27 -1,61	29,41 -2,85
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,77 0,74	4,64 5,36	0,74 -0,22	5,94 -0,03	7,66 5,55	29,86 -4,28	26,75 -10,81
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,75 -0,04	1,86 -0,10	0,10 -0,15	3,07 0,08	3,70 -0,19	21,50 0,39	27,56 0,18
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,13 -0,02	2,97 -0,15	0,47 -0,04	1,57 -0,10	4,34 -0,21	11,93 -0,39	19,28 -0,63
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,66 -0,10	4,32 -0,30	-0,35 -0,11	2,90 -0,25	6,21 -0,35	23,82 -0,67	30,66 -0,98
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,10 63,53	-0,65 -28,52	0,99 193,88	0,12 9,18	0,22 6,30	6,64 66,01	13,56 78,01
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-4,96 -3,45	-10,53 -9,81	-2,38 -3,34	3,34 -2,63	-8,82 -10,92	28,45 -5,69	27,13 -10,43
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,15 97,35	-0,40 -17,37	1,16 226,81	0,24 18,74	0,64 17,95	7,39 73,50	15,09 86,81
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	-1,52	-1,63	-0,33	-0,92	1,86	22,52	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-968,06	-71,36	-63,77	-72,97	52,38	223,91	
BB PREV RF IMA-B	-1,57	-1,05	0,91	5,82	1,71	33,16	36,34
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,06	-0,33	-0,05	-0,14	-0,40	-0,98	-1,22
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,02	1,82	0,44	1,22	2,98	9,27	16,58
% do CDI	15,30	79,60	86,11	97,11	83,71	92,22	95,38
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,02	0,44	0,06	0,16	0,93	4,14	7,88
% do CDI	9,90	19,27	11,08	12,63	26,05	41,18	45,32
BB PREV RF FLUXO FIC	-0,00	1,42	0,18	0,66	2,40	7,66	13,60
% do CDI	-0,19	62,22	34,48	52,81	67,54	76,15	78,24
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	-0,00	1,77	0,39	0,97	2,90	9,20	16,28
% do CDI	-1,68	77,25	76,24	77,04	81,49	91,50	93,61
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	-2,96	-4,05	4,70	48,11	5,50	60,57	61,54
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,67	17,03	8,01	33,33	15,30	22,72	31,05
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	-2,47	-14,37	-0,68	29,13	0,95		
Var. IBOVESPA p.p.	2,32	3,82	-0,20	-0,43	10,63		
AZ QUEST ACOES FIC FIA	-6,19	-17,68	0,10	33,91	-10,03	20,62	34,83
Var. IBOVESPA p.p.	-1,40	0,51	0,57	4,35	-0,35	1,39	7,49
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-4,93	-17,58	-0,96	19,42	-6,98	43,54	33,91
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,30	3,49	2,35	4,64	2,83	5,70	3,42
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	-5,38	-14,85	-0,22	32,92	-2,46		
Var. IBOVESPA p.p.	-0,58	3,34	0,25	3,37	7,23		
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-4,77	-19,95	-2,30	22,29	-9,26	41,30	
Var. IBOVESPA p.p.	0,03	-1,76	-1,82	-7,27	0,42	22,06	
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	-0,76	-25,84	-17,35	-15,85	-23,52	-28,33	-37,58
Var. IFIX p.p.	-1,22	-13,24	-16,94	-27,91	-27,64	-59,25	-63,42
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,10	-8,73	-0,29	-8,59	-35,54	-37,22	-23,97
% do CDI	-63,64	-381,88	-56,96	-682,92	-999,28	-370,16	-137,87
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	-1,61	-1,00	0,64	9,72			
% do CDI	-1.027,45	-43,74	123,83	773,29			
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-1,99	52,76	14,98	43,04	61,21	70,33	154,87
Var. Global BDRX p.p.	-0,02	1,32	0,64	0,02	0,92	0,05	-5,51
VITÓRIA - CONSOLIDADO	-1,50	0,03	0,41	5,37	2,97		
Var. INPC + 5,50% p.p.	-2,82	-6,18	-2,69	1,13	-6,63		
CDI	0,16	2,29	0,51	1,26	3,56	10,06	17,39
IBOVESPA	-4,80	-18,20	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34

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%	1,36	6,58	3,22	4,50	10,12	20,11	32,29
IPCA + 6,00%	1,13	5,85	2,78	3,79	9,32	19,21	31,99

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	0,15	3,12	0,51	1,66	4,54	12,32	19,91	35,08	55,52
IRF-M 1+	-0,91	5,40	-0,59	3,90	7,61	30,00	36,94	63,26	107,88
IRF-M TOTAL	-0,56	4,62	-0,24	3,15	6,56	24,50	31,64	54,61	88,92
IMA-B 5	-0,12	4,51	1,30	5,11	7,24	23,75	31,84	49,57	77,74
IMA-B 5+	-2,60	-4,56	0,75	6,78	-1,67	42,42	41,26	65,69	123,18
IMA-B TOTAL	-1,51	-0,72	0,96	5,97	2,11	34,14	37,56	59,25	104,41
IMA-GERAL TOTAL	-0,60	2,41	0,53	3,43	4,35	21,85	28,42	47,44	79,98
IDKA 2	0,02	5,41	1,99	5,41	8,00	21,88	32,26	50,33	78,04
IDKA 20	-4,30	-11,82	0,58	7,11	-8,89	56,79	46,43	76,85	176,44
CDI	0,16	2,29	0,51	1,26	3,56	10,06	17,39	30,94	49,45

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-4,80	-18,20	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34	62,08	109,95
IBRX 100	-4,58	-17,42	-0,04	30,33	-8,59	23,26	30,47	66,26	112,57
IBRX 50	-4,62	-18,06	-0,37	31,30	-10,02	16,09	24,57	58,13	99,89
SMALL CAP	-5,44	-18,93	2,27	35,50	-1,78	54,49	42,68	101,86	167,19
IFIX	0,46	-12,59	-0,41	12,06	4,12	30,92	25,84	53,90	99,57
Índice Consumo - ICON	-3,96	-9,26	1,83	42,00	-1,04	53,03	27,90	53,75	79,98
Índice Dividendos - IDIV	-4,63	-21,08	-3,31	14,78	-9,81	37,85	30,49	85,32	152,90

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	0,64	1,34	1,24	0,81	3,14	6,12	10,92	13,74	23,38
INPC	0,87	2,04	1,68	1,49	3,89	6,93	11,17	12,99	23,33
IGPM	4,34	14,40	9,59	12,51	17,94	21,91	34,14	32,20	46,30
SELIC	0,16	2,29	0,51	1,26	3,56	10,06	17,40	30,98	49,51

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	-0,95	45,67	11,74	41,18	53,03	62,59	137,68	169,51	148,68
MSCI ACWI	-0,38	39,92	10,90	38,62	47,03	51,87	106,68	134,69	110,24
MSCI World	-0,61	40,47	10,75	38,64	47,08	52,70	110,69	138,37	112,47

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,97	4,35	2,27	2,81	7,26	14,76	24,69	32,93	49,97
IPCA + 5,00%	1,05	5,10	2,53	3,30	8,29	16,97	28,31	38,09	57,28
IPCA + 5,50%	1,09	5,47	2,65	3,54	8,81	18,09	30,14	40,72	61,04
IPCA + 5,89%	1,12	5,76	2,75	3,74	9,21	18,96	31,58	42,80	64,03
IPCA + 6,00%	1,13	5,85	2,78	3,79	9,32	19,21	31,99	43,39	64,88
INPC + 4,00%	1,20	5,07	2,71	3,50	8,04	15,63	24,98	32,05	49,91
INPC + 6,00%	1,36	6,58	3,22	4,50	10,12	20,11	32,29	42,44	64,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
367	02/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	3.014,70	0,00	371,42690112	8,1165365000
384	02/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.639,50	0,00	201,99502583	8,1165365000
359	03/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	90,71	11,17586556	8,1165972800
381	03/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	33.927,22	4.179,98070246	8,1165972800
378	03/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	13.037,61	1.606,29011767	8,1165972800
383	03/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	13.902,49	1.712,84708609	8,1165972800
380	03/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.639,72	202,02061818	8,1165972800
385	03/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	1.119,63	137,94327369	8,1165972800
382	03/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.440.467,47	423.880,51930057	8,1165972800
379	03/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	13.905,86	1.713,26228471	8,1165972800
398	03/09/2020	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	3.518.000,00	0,00	1.898.932,25112260	1,8526200700
360	04/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	2.296.557,50	282.943,77240900	8,1166568200
399	04/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	644,48	0,00	305,44787300	2,1099508500
387	04/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.004,56	0,00	123,76524255	8,1166568200
397	04/09/2020	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,00	5.000,00	2.917,92535997	1,7135462300
400	08/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	883,44	0,00	108,84204531	8,1167162700
371	09/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	316.636,43	0,00	39.010,12779090	8,1167750000
390	09/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	217,86	0,00	26,84070952	8,1167750000
361	15/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	56.872,51	7.006,58020913	8,1170140500
362	16/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	404,94	49,88743419	8,1170741000
363	17/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	478.638,98	58.966,50098721	8,1171338300
386	17/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	519,92	64,05216557	8,1171338300
388	17/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	673,00	82,91103906	8,1171338300
364	21/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	482,51	59,44251796	8,1172537200
373	25/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	48.326,34	0,00	5.953,35678423	8,1174943400
392	25/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	36.132,18	0,00	4.451,14939249	8,1174943400
375	28/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	20.220.791,35	0,00	2.490.995,34265420	8,1175548600
357	28/09/2020	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	62.351,93	16.284,46457150	3,8289211000

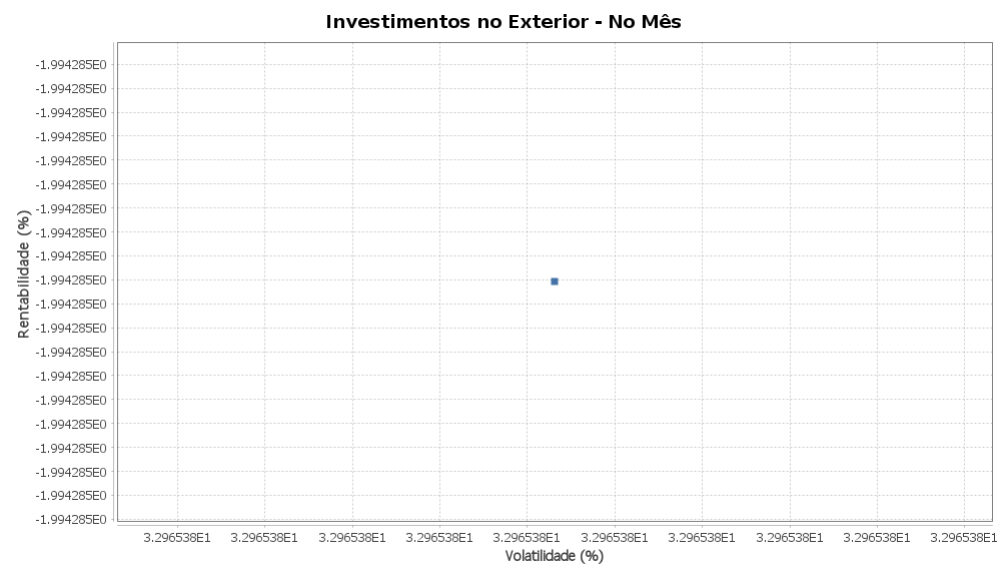
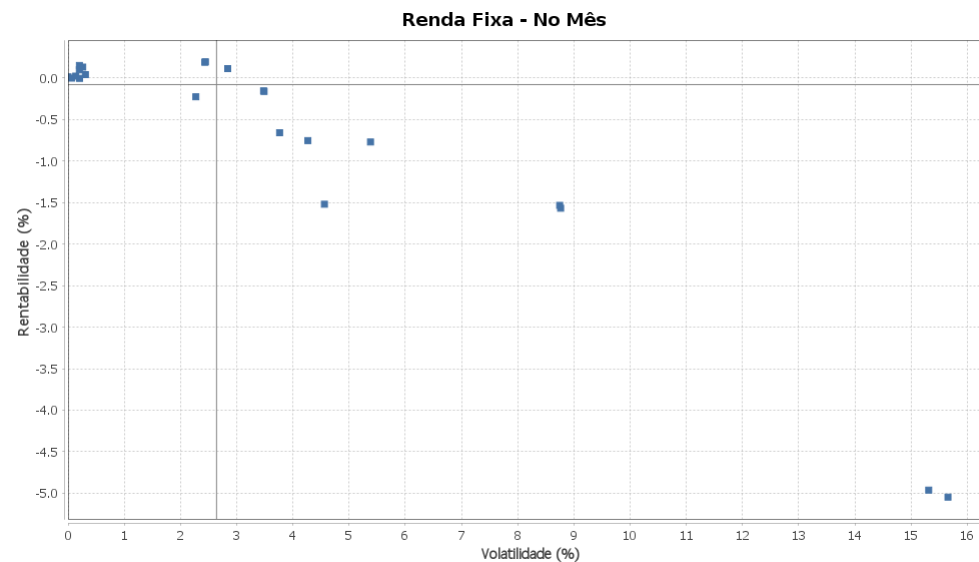
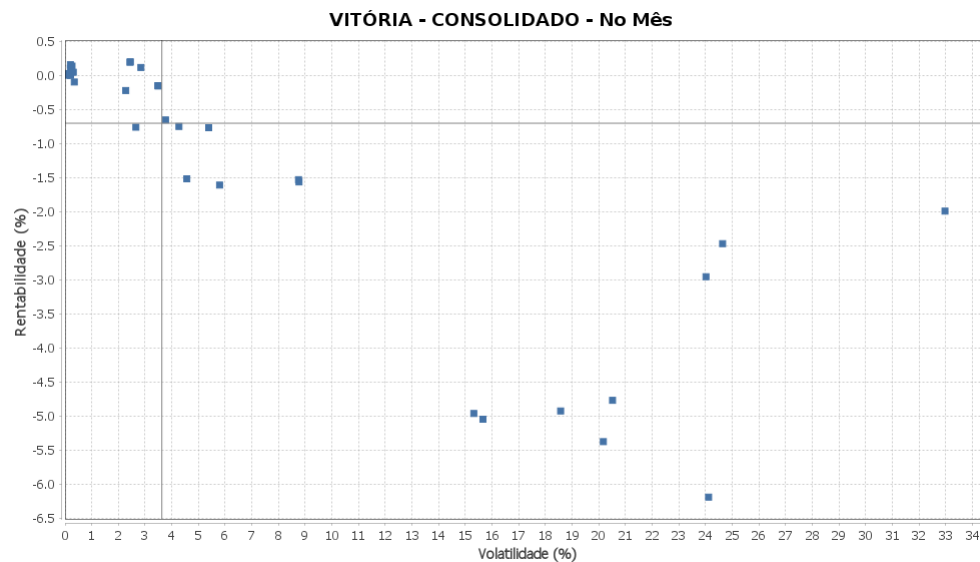
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
358	28/09/2020	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	125.048,41	32.658,91532735	3,8289211000
394	28/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	1.637.441,10	0,00	201.716,04975146	8,1175548600
376	29/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	17.135.928,55	2.110.955,90064649	8,1176156000
370	29/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	883,54	108,84230586	8,1176156000
366	29/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	16.379,65	2.017,79079068	8,1176156000
372	29/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	316.669,22	39.010,12755519	8,1176156000
368	29/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	3.015,10	371,42680173	8,1176156000
365	29/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	496.396,42	61.150,52060361	8,1176156000
374	29/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	48.327,06	5.953,35654967	8,1176156000
391	29/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	217,88	26,84039387	8,1176156000
393	29/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	36.132,72	4.451,14942373	8,1176156000
389	29/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	331,64	40,85436122	8,1176156000
395	29/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	0,00	7.172,42	883,56240963	8,1176156000
377	30/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	12.927,47	0,00	1.592,50872892	8,1176760700
396	30/09/2020	BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	15.541,68	0,00	1.914,54794032	8,1176760700

Total

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 14.426.645,91

Value-At-Risk: 2,11%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	-1.392,80	0,02	4.743.799,31	0,69
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,04	0,00	-2,43	-0,00	863,02	0,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,14	0,06	0,00	-0,97	0,02	76.223,92	0,01
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,20	0,13	0,00	-0,28	0,10	5.348.146,15	0,78
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,20	0,13	0,00	-0,02	0,15	45.427.809,65	6,65
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,21	0,08	0,00	-0,78	-0,00	8.504.029,14	1,24
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,26	0,14	0,00	-0,09	0,13	6.043.857,93	0,88
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,31	0,14	0,00	-0,37	0,04	2.660.766,95	0,39
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTIESTRATÉGIA	Artigo 8º IV, Alínea a	0,35	0,40	-0,00	-0,74	-0,10	1.212.172,80	0,18
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	2,27	0,83	0,01	-0,17	-0,23	15.503.768,52	2,27
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	2,43	0,55	0,00	0,01	0,19	837.103,09	0,12
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	2,44	0,98	0,01	0,02	0,20	9.595.134,83	1,40
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	2,65	0,78	0,00	-0,35	-0,76	1.208.587,42	0,18
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,84	0,94	0,02	-0,02	0,11	17.317.245,13	2,53
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,48	1,03	0,02	-0,09	-0,15	19.239.571,06	2,82
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,49	1,02	0,12	-0,09	-0,16	106.832.105,36	15,64
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,76	1,34	0,07	-0,22	-0,66	44.143.355,48	6,46
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,27	1,43	0,14	-0,21	-0,75	80.845.099,75	11,83
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	4,56	1,15	0,01	-0,37	-1,52	22.781.520,49	3,33
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,38	1,83	0,01	-0,17	-0,77	6.776.964,00	0,99
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	5,79	2,46	0,01	-0,31	-1,61	2.647.296,90	0,39
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	8,75	3,24	0,21	-0,19	-1,53	51.153.221,46	7,49
BB PREV RF IMA-B	Artigo 7º IV, Alínea a	8,76	3,25	0,30	-0,20	-1,57	74.770.717,95	10,95
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	15,31	5,43	0,05	-0,33	-4,96	34.226.921,94	5,01
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	15,66	5,47	0,06	-0,33	-5,05	35.820.475,80	5,24
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	18,57	10,57	0,10	-0,27	-4,93	7.560.008,02	1,11
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	20,17	11,08	0,11	-0,27	-5,38	8.149.842,10	1,19
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,51	10,43	0,26	-0,24	-4,77	20.573.482,82	3,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	24,01	11,94	0,30	-0,13	-2,96	20.886.731,95	3,06
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,11	12,30	0,02	-0,26	-6,19	1.492.913,46	0,22
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	Artigo 8º II, Alínea a	24,63	13,71	0,26	-0,11	-2,47	15.165.070,40	2,22
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	32,97	12,73	0,00	-0,07	-1,99	11.603.448,35	1,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O percentual alocado no Artigo 7, Inciso IV, Alínea A (28,67 % dos recursos) está superior ao limite máximo estipulado em Política de Investimentos;
- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso III, (0,39 % dos recursos) está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos;