



LDB
EMPRESAS

LINHARES
ABRIL 2021



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 30.04.2021.

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 87,14%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (3,200000%)	1,85	0,75	3,97	1.016.061,66	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,410000%)	25,21	0,85	4,36	1.001.000,43	0,32
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		13,49	0,80	4,16	2.017.062,09	0,65

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
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	10,69	0,75	-5,63	33.110.370,72	10,62	285.663.066,18	11,59
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,36	0,24	0,30	14.491.368,83	4,65	7.571.217.894,67	0,19
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	6,04	0,65	-2,22	17.426.912,04	5,59	7.329.081.978,43	0,24
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,04	0,63	-2,25	17.721.604,28	5,68	5.864.609.190,92	0,30
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,33	0,28	0,34	27.096.158,01	8,69	9.264.610.224,23	0,29
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,50	0,86	0,63	9.876.318,16	3,17	13.787.568.837,50	0,07
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,25	0,84	0,84	6.517.177,05	2,09	9.007.156.922,35	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	4,72	1,11	-3,74	2.209.171,04	0,71	1.932.581.186,97	0,11
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,36	1,02	0,99	9.675.978,48	3,10	11.053.033.773,31	0,09
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	4,50	1,07	-1,47	46.288,51	0,01	1.289.613.390,80	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,50	0,87	0,67	6.657.182,66	2,14	5.500.987.662,99	0,12
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1,58	0,38	-0,57	16.451.652,78	5,28	176.530.333,36	9,32
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,63	0,90	0,55	3.049.142,97	0,98	427.590.215,26	0,71
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	3,06	0,62	-1,27	12.761.358,84	4,09	9.467.835.833,78	0,13
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,49	0,66	0,48	2.607.547,41	0,84	15.772.466.647,51	0,02
BANCO DO NORDESTE	SANTANDER	BNB IMA-B FI RF	5,24	0,64	-1,99	1.032.523,81	0,33	283.341.660,34	0,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,15	0,61	-1,49	180.730.755,59	57,97		
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	0,44	0,21	1,15	19.122.431,66	6,13	290.783.908,05	6,58
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,47	0,12	0,56	1.148.021,67	0,37	4.405.422.500,84	0,03
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,26	0,26	0,60	10.322.120,88	3,31	5.677.715.007,21	0,18
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	11,25	1,32	-6,00	15.290.321,30	4,90	243.241.918,68	6,29
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	0,20	0,70	24.809.169,87	7,96	3.508.946.195,72	0,71
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,96	0,59	-1,57	11.580.349,14	3,71	142.814.603,91	8,11
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	3,43	0,71	-1,03	6.138.810,78	1,97	3.647.675.472,88	0,17
BANCO DO NORDESTE	SANTANDER	BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,37	0,08	0,42	503.785,62	0,16	975.510.259,30	0,05
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,41	0,48	-0,85	88.915.010,92	28,52		
Renda Fixa			2,79	0,57	-1,24	271.662.828,60	87,14		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

12,15%

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
CEF	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	23,02	1,54	-3,90	1.754.778,98	0,56	285.669.468,94	0,61
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	21,65	2,52	-0,29	17.742.593,74	5,69	1.009.047.125,12	1,76
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	22,55	0,99	-0,48	8.533.321,34	2,74	238.974.809,93	3,57
BANESTES	BANESTES	BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	20,45	0,07	0,03	1.033.986,29	0,33	20.093.273,85	5,15
BB	BB	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	22,66	2,53	0,81	3.905.907,86	1,25	870.509.998,61	0,45
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			20,82	1,99	-0,45	32.970.588,21	10,58		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	6,46	0,13	-0,02	2.919.185,34	0,94	1.980.759.325,88	0,15
CEF	CEF	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO	3,16	0,56	-0,80	1.995.877,43	0,64	111.174.505,44	1,80
Sub-total Artigo 8º III			5,45	0,31	-0,34	4.915.062,77	1,58		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			18,78	1,77	-0,42	37.885.650,98	12,15		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,71%

Artigo 9º A, II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRPP	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	35,62	0,77	-4,42	1.242.561,54	0,40	404.128.425,92	0,31
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	27,43	2,55	2,14	972.271,21	0,31	1.746.414.996,99	0,06
Sub-total Artigo 9º A, II			37,07	1,54	-5,43	2.214.832,75	0,71		
Investimentos no Exterior			37,07	1,54	-5,43	2.214.832,75	0,71		
Total			3,53	0,72	-1,14	311.763.312,33	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	2.017.062,09	0,65	0,00	3,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	180.730.755,59	57,97	0,00	55,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	88.915.010,92	28,52	0,00	19,00	45,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	271.662.828,60	87,14					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	32.970.588,21	10,58	0,00	13,00	25,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	4.915.062,77	1,58	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	37.885.650,98	12,15					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	2.214.832,75	0,71	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	2.214.832,75	0,71					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	0,80 384,19	4,16 599,28	2,97 546,06	6,88 680,07	5,88 274,19	15.975,38	80.616,52
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,61 292,91	-1,49 -214,14	-0,78 -142,81	2,75 272,13	5,69 265,53	1.092.949,88	-2.727.243,54
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,48 233,12	-0,85 -122,03	-0,28 -52,34	1,75 172,86	3,13 146,05	427.942,30	-756.106,23
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	1,99 0,05	-0,45 -0,35	2,87 -0,45	21,78 -4,77	38,54 -9,15	643.648,19	-82.050,29
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,31 -1,63	-0,34 -0,24	0,22 -3,11	4,68 -21,87	9,58 -38,10	15.048,80	-16.674,78
Artigo 9º A, II % do CDI	1,54 742,00	-5,43 -933,65	-2,63 -483,77			33.630,44	-37.078,00
LINHARES (Total)						2.229.194,99	-3.538.536,32

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (3,200000%)	1.008.477,18	0,00	0,00	0,00	1.016.061,66	7.584,48	38.795,75
NTN-B 150535 (4,410000%)	992.609,53	0,00	0,00	0,00	1.001.000,43	8.390,90	41.820,77
					2.017.062,09	0,00	0,00

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	32.862.731,23	0,00	0,00	0,00	33.110.370,72	247.639,49	-1.976.215,07
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	16.388.561,07	0,00	0,00	0,00	16.451.652,78	63.091,71	-94.236,79
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	12.682.541,51	0,00	0,00	0,00	12.761.358,84	78.817,33	-163.686,79
BB PREV RF IDKA2	6.462.896,44	0,00	0,00	0,00	6.517.177,05	54.280,61	54.049,83
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	6.599.927,86	0,00	0,00	0,00	6.657.182,66	57.254,80	44.109,81
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	17.314.594,51	0,00	0,00	0,00	17.426.912,04	112.317,53	-395.768,78

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	14.456.271,87	0,00	0,00	0,00	14.491.368,83	35.096,96	42.675,66
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	3.021.845,45	0,00	0,00	0,00	3.049.142,97	27.297,52	16.970,68
BNB IMA-B FI RF	1.026.005,21	0,00	0,00	0,00	1.032.523,81	6.518,60	-20.911,00
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.578.406,72	0,00	0,00	0,00	9.675.978,48	97.571,76	95.189,72
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.791.945,97	0,00	0,00	0,00	9.876.318,16	84.372,19	62.073,96
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	17.610.614,30	0,00	0,00	0,00	17.721.604,28	110.989,98	-408.058,60
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.019.843,96	0,00	0,00	0,00	27.096.158,01	76.314,05	90.483,40
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	2.185.025,16	0,00	0,00	0,00	2.209.171,04	24.145,88	-85.734,64
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2.521.062,75	69.731,49	0,00	0,00	2.607.547,41	16.753,17	12.505,55
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	45.800,21	0,00	0,00	0,00	46.288,51	488,30	-690,48
					180.730.755,59	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	11.512.328,80	0,00	0,00	0,00	11.580.349,14	68.020,34	-184.891,05
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	15.091.772,82	0,00	0,00	0,00	15.290.321,30	198.548,48	-975.444,47
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	19.081.644,38	0,00	0,00	0,00	19.122.431,66	40.787,28	218.172,30
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	5.989.318,75	107.305,56	0,00	0,00	6.138.810,78	42.186,47	-57.262,39
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	24.759.784,36	0,00	0,00	0,00	24.809.169,87	49.385,51	172.955,80
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	503.358,11	0,00	0,00	0,00	503.785,62	427,51	2.090,44
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.294.962,80	0,00	0,00	0,00	10.322.120,88	27.158,08	61.919,26
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.146.593,04	0,00	0,00	0,00	1.148.021,67	1.428,63	6.353,88
					88.915.010,92	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	1.033.297,36	0,00	0,00	0,00	1.033.986,29	688,93	322,42
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	8.449.769,32	0,00	0,00	0,00	8.533.321,34	83.552,02	-29.880,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	3.809.363,64	0,00	0,00	0,00	3.905.907,86	96.544,22	70.092,60
FIA CAIXA DIVIDENDOS	1.728.192,43	0,00	0,00	0,00	1.754.778,98	26.586,55	-71.293,31
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	17.306.317,27	0,00	0,00	0,00	17.742.593,74	436.276,47	-51.291,81
					32.970.588,21	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	2.915.289,80	0,00	0,00	0,00	2.919.185,34	3.895,54	-583,78
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO	1.984.724,17	0,00	0,00	0,00	1.995.877,43	11.153,26	-16.091,00
					4.915.062,77	0,00	0,00

Artigo 9º A, II

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.233.090,11	0,00	0,00	0,00	1.242.561,54	9.471,43	-57.438,46
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	948.112,20	0,00	0,00	0,00	972.271,21	24.159,01	20.360,46
					2.214.832,75	0,00	0,00

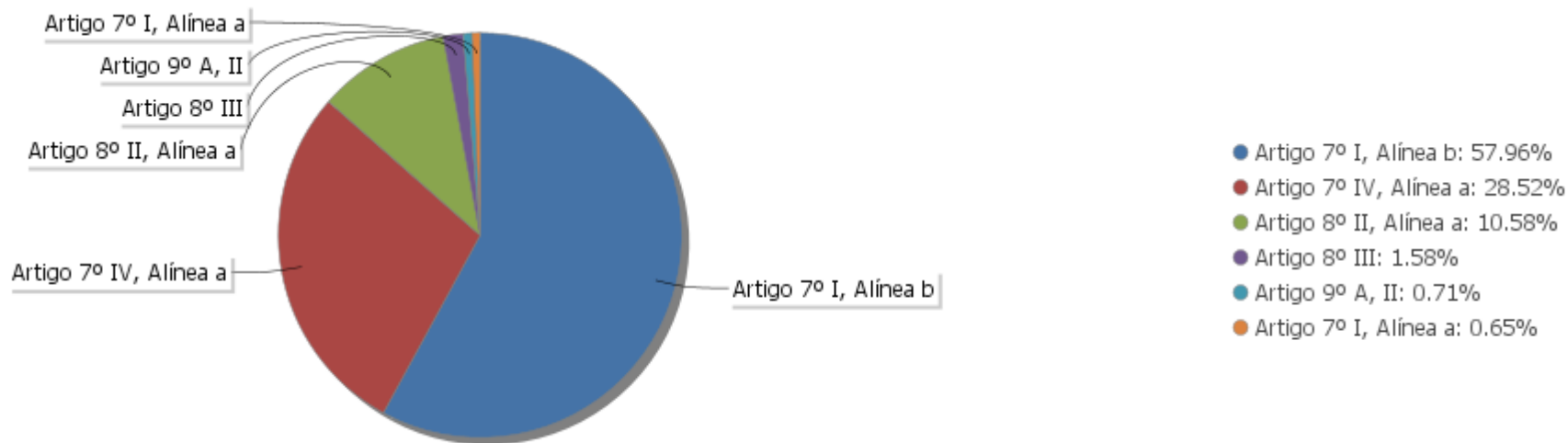
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

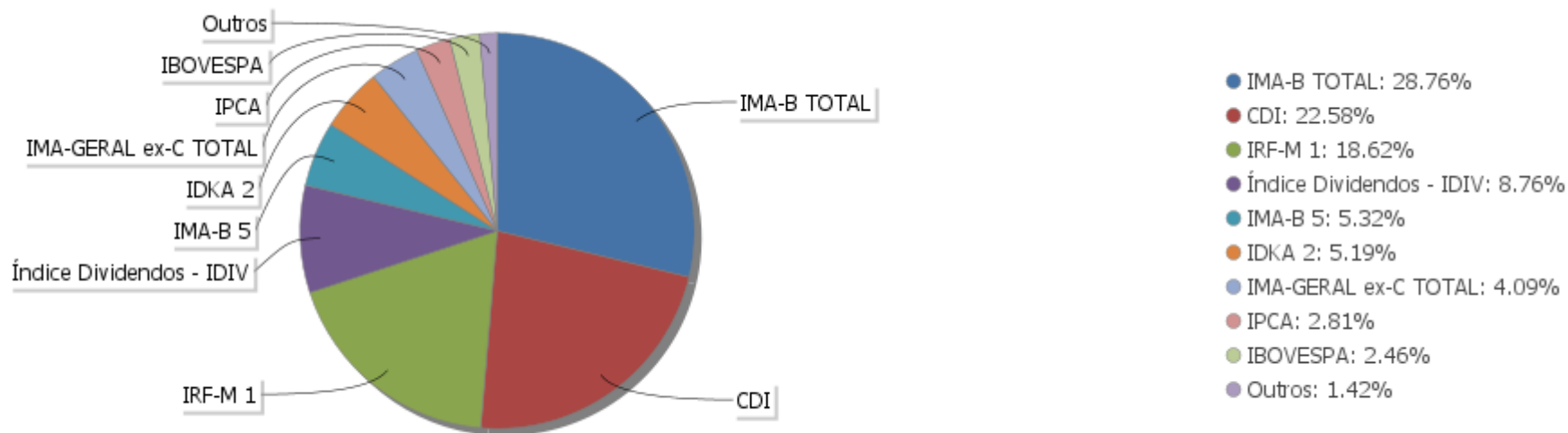
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	278.425.314,76	89,31	278.425.314,76	89,31
de 31 a 365 dias	26.275.915,08	8,43	304.701.229,84	97,73
acima de 365 dias	7.062.082,49	2,27	311.763.312,33	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

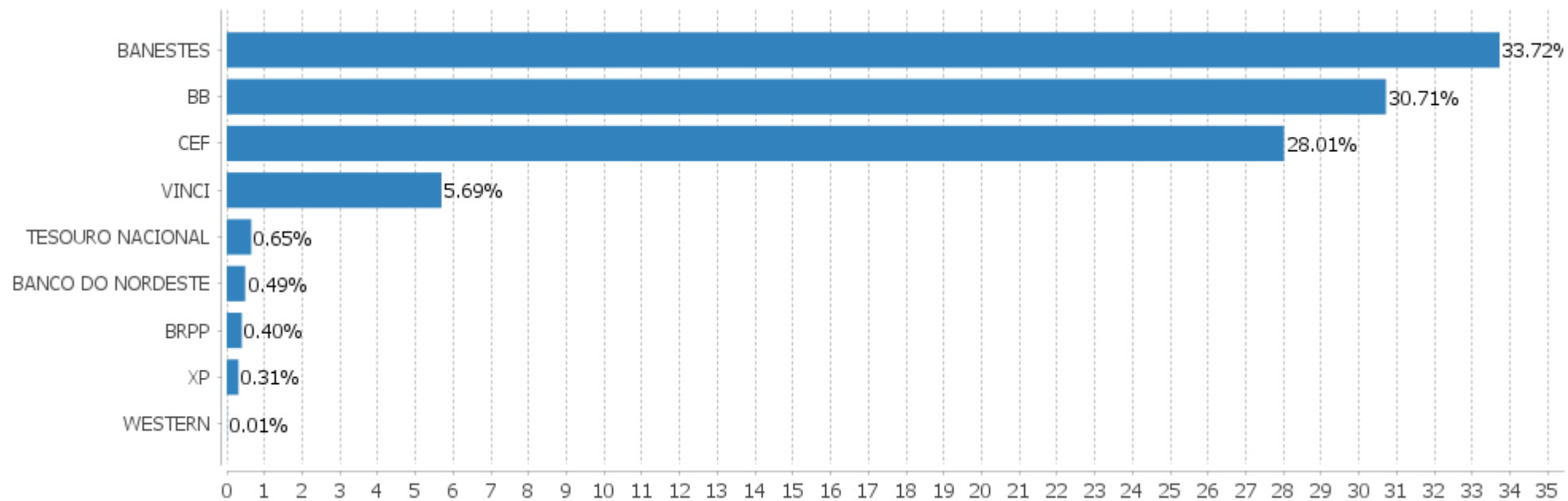


Alocação Por Estratégia



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
2021	-0,93	-1,16	0,23	0,72									-1,14
INPC + 5,45%	0,69	1,20	1,35	0,80									4,11
p.p. indexador	-1,63	-2,36	-1,12	-0,08									-5,25
2020	0,49	-0,30	-6,00	1,19	1,40	1,41	2,77	-1,09	-1,53	0,16	1,96	3,27	3,46
INPC + 6,00%	0,70	0,59	0,69	0,23	0,21	0,79	0,98	0,85	1,36	1,38	1,42	1,98	11,75
p.p. indexador	-0,21	-0,89	-6,69	0,96	1,19	0,63	1,79	-1,94	-2,89	-1,22	0,55	1,29	-8,29
2019	2,03	0,57	0,45	0,98	2,17	2,28	1,23	-0,12	1,94	2,06	-1,14	1,47	14,79
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	1,15	-0,43	-0,77	-0,11	1,51	1,83	0,60	-0,75	1,50	1,49	-2,14	-0,25	4,02
2018	3,06	0,59	0,52	0,09	-2,34	-0,08	1,29	0,01	0,40	3,08	0,67	1,06	8,56
INPC + 6,00%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	0,74	0,91	0,21	0,60	9,59
p.p. indexador	2,32	-0,01	-0,04	-0,60	-3,25	-2,00	0,53	-0,53	-0,34	2,17	0,46	0,46	-1,03

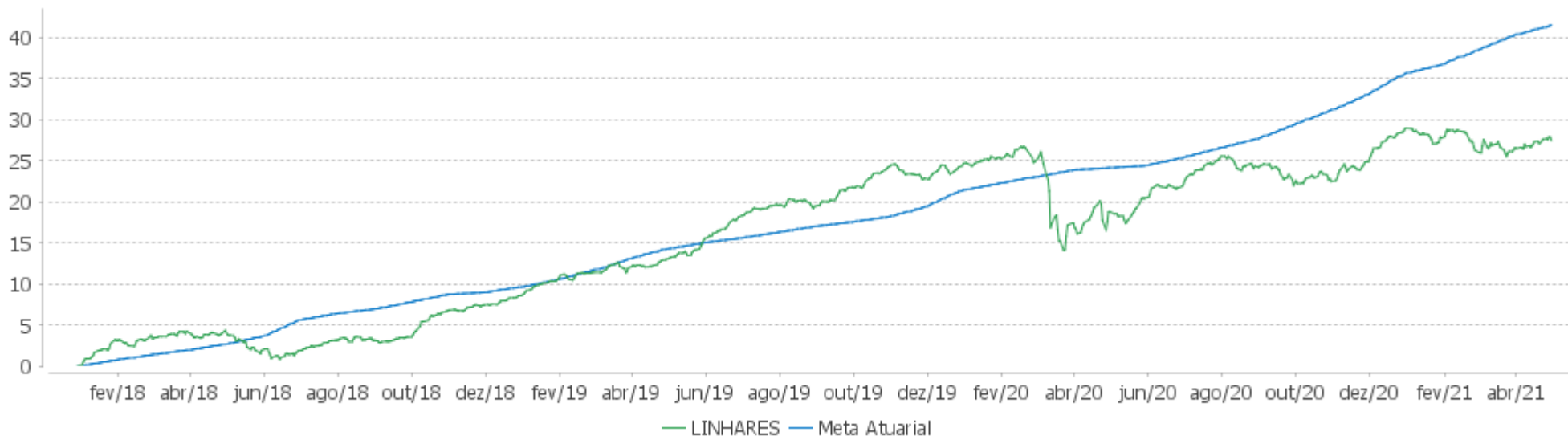
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

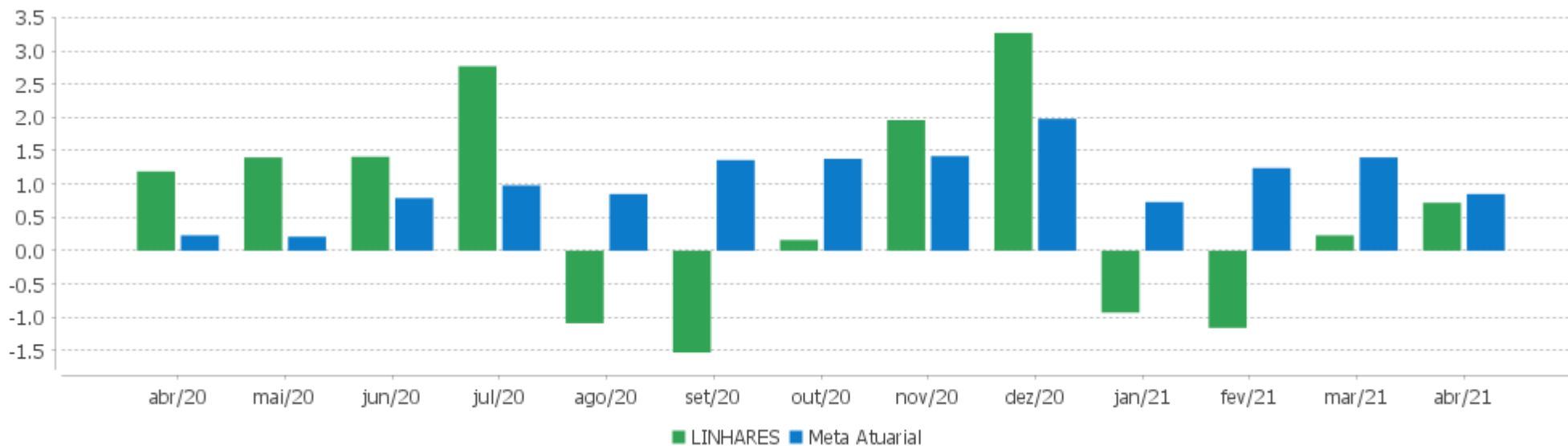
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	17	42,50	03 meses	-0,21	3,39	-3,61	4,17
Meses abaixo - Meta Atuarial	23	57,50	06 meses	4,09	7,67	-3,58	3,69
			12 meses	7,32	13,80	-6,48	3,53
			24 meses	12,80	23,63	-10,83	5,07
Maior rentabilidade da Carteira	3,27	2020-12	36 meses	22,20	37,63	-15,44	4,36
Menor rentabilidade da Carteira	-6,00	2020-03	Desde 29/12/2017	27,45	41,24	-13,78	4,22

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
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	1,07 0,19	-1,47 -2,19	-0,81 -1,43	3,20 -0,72	8,09 -0,82	20,45 2,09	33,78 3,66
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,63 -0,02	-2,25 -0,08	-1,39 -0,06	4,52 -0,11	9,41 -0,25	18,68 -0,78	36,95 -1,13
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,86 -0,01	0,63 -0,09	0,55 -0,07	3,78 -0,14	8,62 -0,29	17,71 -0,65	29,17 -0,95
BNB IMA-B FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,64 -0,02	-1,99 0,19	-1,21 0,12	3,93 -0,70	8,45 -1,22	17,40 -2,06	33,24 -4,84
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,24 -0,03	0,30 -0,11	0,26 -0,09	0,81 -0,13	1,94 -0,39	8,38 -0,71	15,39 -0,98
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,87 -0,01	0,67 -0,06	0,57 -0,05	3,83 -0,09	8,63 -0,29	17,84 -0,52	29,28 -0,84
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,90 0,25	0,55 2,72	0,47 1,80	3,76 -0,86	8,50 -1,16	17,95 -1,51	29,80 -8,29
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	1,11 -0,02	-3,74 -0,03	-2,38 -0,03	-0,38 -0,07	1,27 -0,17	15,09 -0,46	26,90 -0,71
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,75 0,10	-5,63 -3,46	-3,23 -1,90	3,68 -0,95	6,11 -3,55	13,63 -5,83	33,14 -4,94
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,38 0,11	-0,57 -0,97	-0,14 -0,50	0,86 -0,08	2,08 -0,26	13,86 4,77	22,35 5,98
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,84 -0,51	0,84 -0,47	0,66 -0,50	3,75 -0,60	9,19 -0,22	16,78 -2,06	27,40 -2,63
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,62 0,13	-1,27 -0,11	-0,72 0,00	1,94 0,29	4,05 0,23	12,99 0,52	24,29 0,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,66 0,35	0,48 -1,89	0,46 -1,66	2,64 -2,03	4,63 -2,13	18,72 9,40	30,38 15,66
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,02 -0,33	0,99 -0,31	0,86 -0,30	3,91 -0,44	9,09 -0,32	17,10 -1,74	27,65 -2,37
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,28 0,01	0,34 -0,07	0,31 -0,05	0,84 -0,10	2,12 -0,21	8,64 -0,44	15,73 -0,65
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,65 -0,00	-2,22 -0,05	-1,37 -0,04	4,55 -0,08	9,38 -0,28	18,91 -0,55	37,07 -1,01
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,21	1,15	1,00	1,62	3,40	4,65	11,09

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	102,87	165,68	183,06	159,98	158,52	62,47	77,78
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,32 0,66	-6,00 -3,82	-3,20 -1,86	3,27 -1,36	5,60 -4,06	11,17 -8,29	26,93 -11,15
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	0,59 284,34	-1,57 -226,22	-0,75 -138,50	1,59 157,01	2,42 112,69	12,94 173,69	
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,20 95,99	0,70 101,06	0,54 98,46	1,11 110,26	2,25 104,89	6,90 92,69	13,55 94,98
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,71 0,40	-1,03 -3,40	-0,57 -2,68	2,66 -2,02	4,74 -2,02		
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,12 59,96	0,56 80,11	0,35 65,19	0,91 89,67	1,65 77,10	6,99 93,87	13,54 94,90
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,26 126,95	0,60 86,87	0,44 81,03	1,12 111,24	2,22 103,72	6,79 91,13	13,38 93,84
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO % do CDI	0,08 40,87	0,42 59,98	0,24 43,49	0,90 89,30	1,73 80,53	6,51 87,48	12,88 90,28
NTN-B 150535 (4,410000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,85 0,19	4,36 6,53	3,12 4,45	7,18 2,56	1,99 -7,67	19,27 -0,20	
NTN-B 150535 (3,200000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,75 0,10	3,97 6,14	2,83 4,16	6,57 1,95	10,04 0,38	11,54 -7,92	
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,99 -1,04	-0,48 0,77	0,13 -3,90	13,72 -9,35	37,44 0,42	37,82 10,64	65,67 14,42
FIA CAIXA DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	1,54 -0,40	-3,90 -3,80	2,44 -0,88	20,20 -6,35	19,76 -27,92	16,82 -6,57	37,38 -0,68
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	2,53 0,60	0,81 0,91	6,08 2,75	30,04 3,49	58,89 11,21	43,43 20,03	
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	2,52 0,49	-0,29 0,96	3,61 -0,42	24,61 1,54	38,83 1,81	27,74 0,56	52,38 1,13
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,07 -1,96	0,03 1,28	3,73 -0,30	19,68 -3,39			
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	0,56 -1,38	-0,80 -0,70	-0,28 -3,60	2,00 -24,55			
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO % do CDI	0,13 64,31	-0,02 -3,01	0,56 103,16	6,66 658,50	11,23 523,92	12,01 161,26	20,33 142,54
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	0,77 1,90	4,93 -7,99	-1,59 -9,31	24,68 5,43			
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2,55	9,29	4,78	13,42	56,51		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,77	4,99	1,22	5,73	43,39		
LINHARES	0,72	-1,14	-0,21	4,09	7,32	12,80	22,20
Var. INPC + 6,00% p.p.	-0,12	-5,43	-3,74	-3,76	-6,67	-11,04	-15,67
CDI	0,21	0,69	0,54	1,01	2,14	7,45	14,26
IBOVESPA	1,94	-0,10	3,33	26,55	47,68	23,39	38,06
INPC + 6,00%	0,85	4,28	3,52	7,85	13,99	23,83	37,86
IPCA + 6,00%	0,77	4,30	3,56	7,69	13,11	22,80	36,54

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	0,27	0,40	0,36	0,94	2,33	9,09	16,37	26,78	44,35
IRF-M 1+	1,12	-3,70	-2,35	-0,31	1,43	15,56	27,60	45,71	73,67
IRF-M TOTAL	0,84	-1,98	-1,19	0,30	1,94	13,86	24,44	40,36	65,09
IMA-B 5	0,87	0,72	0,62	3,92	8,92	18,36	30,12	45,28	64,42
IMA-B 5+	0,45	-4,67	-3,03	5,14	10,30	19,64	43,74	58,75	88,40
IMA-B TOTAL	0,65	-2,17	-1,33	4,63	9,66	19,46	38,08	53,18	78,59
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,49	-1,16	-0,72	1,64	3,81	12,47	23,58	36,90	58,87
IMA-GERAL TOTAL	0,51	-0,82	-0,58	1,93	4,62	13,48	24,94	38,46	60,37
IDKA 2	1,35	1,30	1,16	4,35	9,41	18,84	30,03	46,02	65,35
IDKA 20	0,37	-6,86	-4,17	7,21	13,61	19,99	56,00	68,62	112,68
CDI	0,21	0,69	0,54	1,01	2,14	7,45	14,26	23,52	40,13

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	1,94	-0,10	3,33	26,55	47,68	23,39	38,06	81,79	120,54
IBRX 100	2,84	2,09	5,28	28,66	51,24	28,38	44,99	90,20	132,38
IBRX 50	2,90	2,08	5,01	29,80	53,43	25,21	38,51	83,01	120,07
SMALL CAP	4,38	3,46	7,14	29,74	55,90	48,74	65,09	118,72	207,37
IFIX	0,51	-0,31	-0,64	3,41	9,89	14,06	22,42	40,54	84,10
Índice Consumo - ICON	0,76	-3,61	-2,36	10,24	29,24	30,56	42,01	63,09	90,95
Índice Dividendos - IDIV	2,03	-1,25	4,03	23,07	37,02	27,18	51,25	79,16	149,56

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	0,31	2,37	2,11	4,67	6,76	9,32	14,72	17,89	22,70
INPC	0,38	2,35	2,07	4,83	7,59	10,24	15,83	17,79	22,49
IGPM	1,51	9,89	7,13	14,58	32,02	40,84	53,01	55,90	61,15
SELIC	0,21	0,69	0,54	1,01	2,14	7,45	14,27	23,54	40,18

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	-0,18	15,75	11,09	19,71	42,94	94,40	145,10	196,28	217,01
MSCI ACWI	-1,13	12,92	7,72	19,25	42,86	83,15	113,74	160,50	172,47
MSCI World	-0,87	13,60	8,95	19,99	42,54	84,75	118,63	164,34	175,43

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,62	3,67	3,09	6,70	11,00	18,22	28,99	37,81	49,15
IPCA + 5,00%	0,70	3,99	3,33	7,20	12,05	20,50	32,73	43,16	56,42
IPCA + 5,50%	0,74	4,15	3,45	7,45	12,58	21,65	34,63	45,89	60,16
IPCA + 5,89%	0,77	4,27	3,54	7,64	13,00	22,55	36,12	48,05	63,13
IPCA + 6,00%	0,77	4,30	3,56	7,69	13,11	22,80	36,54	48,66	63,98
INPC + 4,00%	0,69	3,65	3,05	6,86	11,86	19,21	30,23	37,69	48,89
INPC + 6,00%	0,85	4,28	3,52	7,85	13,99	23,83	37,86	48,54	63,69

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

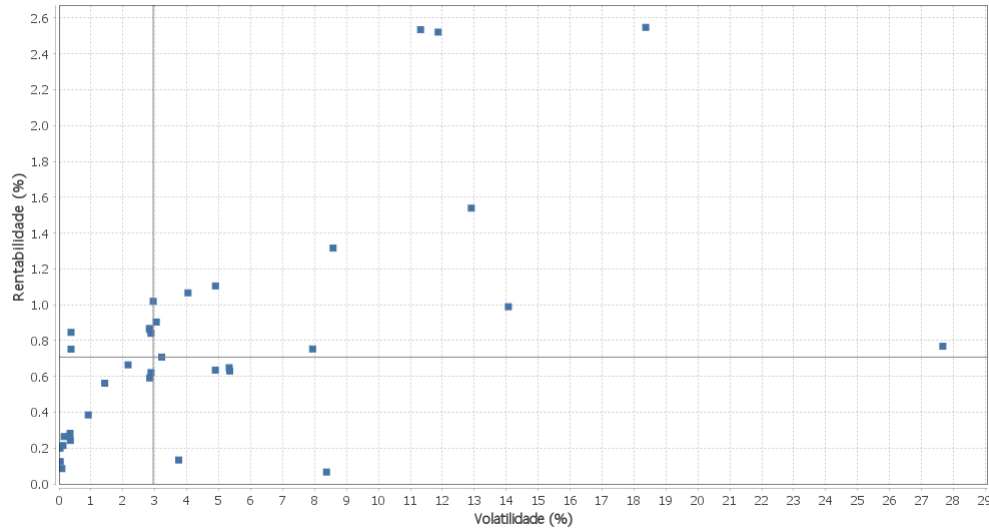
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
18	29/04/2021	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	107.305,56	0,00	101.484,45470700	1,0573595760
19	30/04/2021	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	69.731,49	0,00	45.826,41537705	1,5216440000

Total

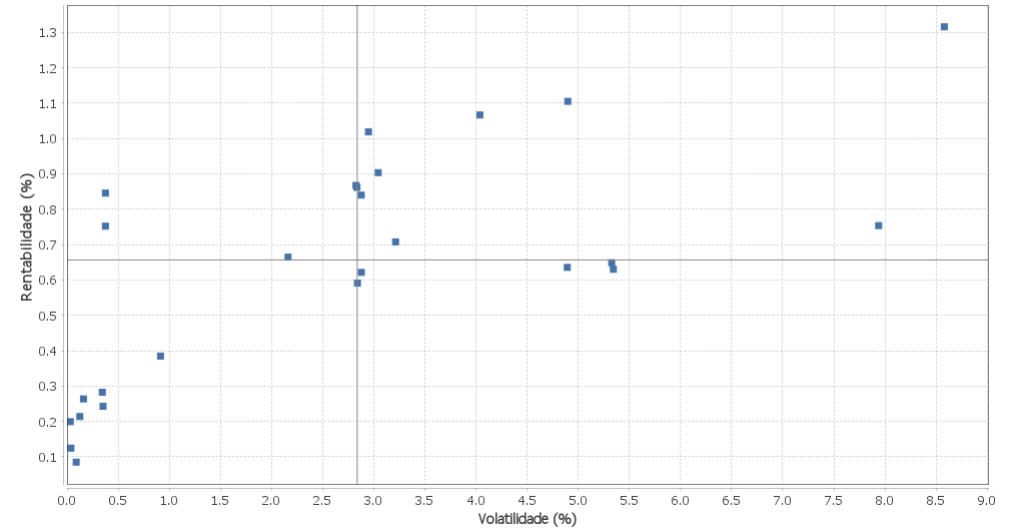
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

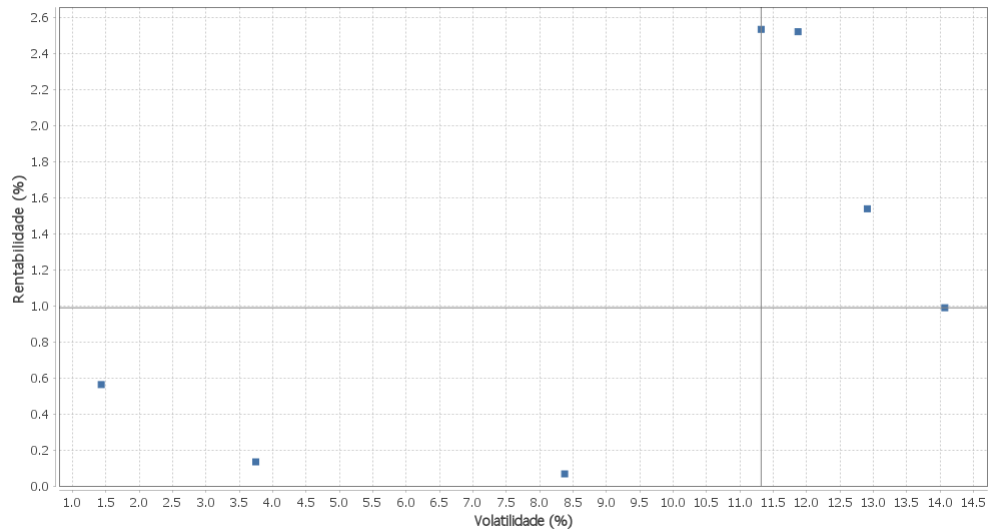
LINHARES - No Mês



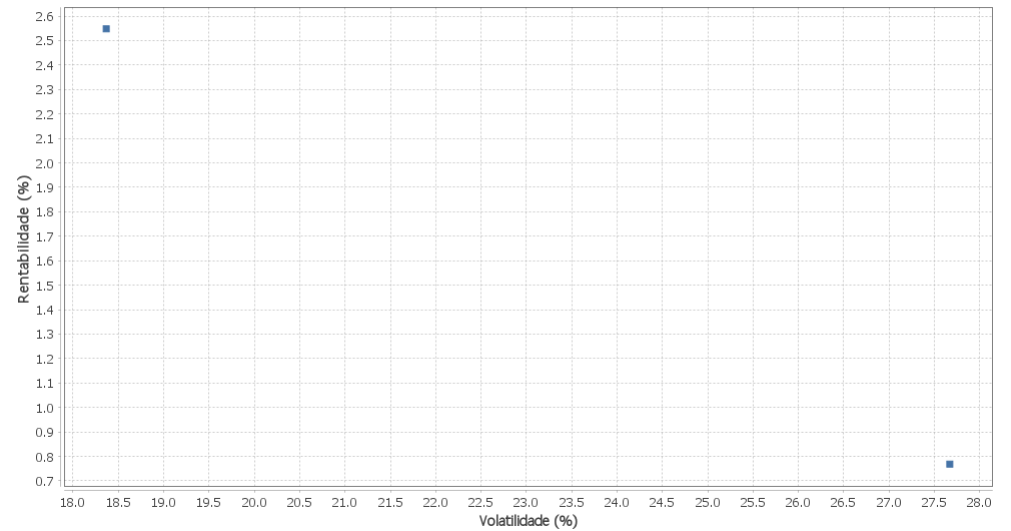
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 5.839.062,69

Value-At-Risk: 1,87%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,03	0,00	-0,26	0,20	24.809.169,87	7,96
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,04	0,00	-2,20	0,12	1.148.021,67	0,37
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	Artigo 7º IV, Alínea a	0,09	0,08	0,00	-1,38	0,08	503.785,62	0,16
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,13	0,13	-0,00	0,05	0,21	19.122.431,66	6,13
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,16	0,04	0,00	0,35	0,26	10.322.120,88	3,31
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,34	0,14	0,01	0,22	0,28	27.096.158,01	8,69
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,35	0,15	0,00	0,10	0,24	14.491.368,83	4,65
NTN-B 150535 (4,410000%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,38	0,13	0,00	1,70	0,85	1.001.000,43	0,32
NTN-B 150535 (3,200000%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,38	0,13	0,00	1,45	0,75	1.016.061,66	0,33
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	0,91	0,68	0,02	0,19	0,38	16.451.652,78	5,28
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO	Artigo 8º III	1,43	1,25	0,00	0,25	0,56	1.995.877,43	0,64
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,16	1,14	0,01	0,21	0,66	2.607.547,41	0,84
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,83	1,43	0,02	0,23	0,87	6.657.182,66	2,14
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,84	1,41	0,04	0,23	0,86	9.876.318,16	3,17
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	2,84	1,68	0,05	0,13	0,59	11.580.349,14	3,71
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,88	1,39	0,02	0,22	0,84	6.517.177,05	2,09
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,88	1,39	0,05	0,14	0,62	12.761.358,84	4,09
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,95	1,44	0,03	0,28	1,02	9.675.978,48	3,10
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,04	1,45	0,01	0,23	0,90	3.049.142,97	0,98
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	3,21	1,60	0,03	0,16	0,71	6.138.810,78	1,97
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	Artigo 8º III	3,75	2,61	0,02	-0,02	0,13	2.919.185,34	0,94
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,04	2,11	0,00	0,21	1,07	46.288,51	0,01
BNB IMA-B FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,89	2,64	0,01	0,09	0,64	1.032.523,81	0,33
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,90	2,35	0,01	0,18	1,11	2.209.171,04	0,71
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,33	2,90	0,13	0,08	0,65	17.426.912,04	5,59
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,34	2,89	0,14	0,08	0,63	17.721.604,28	5,68
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	7,94	5,05	0,40	0,07	0,75	33.110.370,72	10,62
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	8,37	10,85	0,03	-0,02	0,07	1.033.986,29	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	8,58	5,08	0,19	0,13	1,32	15.290.321,30	4,90
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	11,32	10,54	0,09	0,21	2,53	3.905.907,86	1,25
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	11,87	9,16	0,37	0,19	2,52	17.742.593,74	5,69
FIA CAIXA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	12,91	9,77	0,04	0,10	1,54	1.754.778,98	0,56
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	14,07	10,06	0,16	0,06	0,99	8.533.321,34	2,74
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	18,37	12,81	-0,01	0,13	2,55	972.271,21	0,31
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	27,67	14,55	-0,01	0,02	0,77	1.242.561,54	0,40