



LDB
EMPRESAS

LINHARES
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

RENDA FIXA 89,81%

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%)	2,96	0,21	3,71	958.138,26	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,410000%)	38,63	-8,29	-4,24	939.409,62	0,32
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		20,75	-4,19	-0,39	1.897.547,88	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	22,96	-3,55	-5,04	33.328.341,04	11,33	288.523.008,49	11,55
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,54	0,09	2,78	14.123.611,58	4,80	7.749.783.927,00	0,18
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,54	-1,85	0,64	16.898.613,04	5,75	5.638.549.883,16	0,30
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,61	-1,83	0,54	17.186.201,15	5,84	6.019.680.821,86	0,29
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,10	2,83	26.796.989,19	9,11	10.245.504.415,29	0,26
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	0,39	4,45	9.514.221,10	3,23	12.740.710.327,20	0,07
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,12	0,69	4,43	6.254.116,01	2,13	6.452.433.505,43	0,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	8,77	-1,18	6,20	2.252.168,65	0,77	3.267.192.376,45	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,03	0,79	4,80	9.294.000,61	3,16	8.901.363.723,20	0,10
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,92	0,37	4,46	6.409.450,79	2,18	4.251.005.212,54	0,15
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	4,20	-0,18	5,36	15.438.700,02	5,25	194.803.588,72	7,93
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	5,12	0,33	4,23	3.017.467,21	1,03	423.148.231,52	0,71
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,12	-0,89	2,63	12.622.337,23	4,29	10.897.747.304,90	0,12
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,93	-0,56	5,06	2.296.626,95	0,78	13.462.808.031,45	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,18	0,11	0,92	0,00	0,00	1.001.818.388,63	0,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,24	-1,02	1,37	175.432.844,57	59,65		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	19.154.786,46	6,51	328.244.713,37	5,84
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,19	0,15	2,17	1.138.456,18	0,39	5.871.239.975,92	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,29	0,14	1,77	10.195.330,02	3,47	4.687.255.346,64	0,22
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	26,14	-3,63	-5,86	15.426.452,87	5,24	275.989.890,48	5,59
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,18	1,79	24.490.715,79	8,33	2.572.617.697,19	0,95
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,58	-0,64	-0,11	11.054.627,13	3,76	184.359.376,17	6,00
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	7,14	-1,05	1,45	5.367.685,57	1,82	1.933.744.680,16	0,28
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			4,60	-0,65	-0,41	86.828.054,02	29,52		
Renda Fixa			5,35	-0,92	0,76	264.158.446,47	89,81		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

10,19%

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	38,54	-6,01	-22,50	1.520.773,10	0,52	270.846.204,75	0,56
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	38,93	-3,82	-13,31	14.968.666,49	5,09	819.770.596,51	1,83
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	44,95	-0,43	-1,13	6.377.405,83	2,17	157.969.354,10	4,04
BANESTES	BANESTES	BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	21,72	-2,52	-2,52	929.677,27	0,32	13.058.729,43	7,12
BB	BB	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	44,96	-0,34	-0,34	1.468.336,98	0,50	275.223.653,02	0,53
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			39,76	-3,10	-10,95	25.264.859,67	8,59		

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	12,77	-0,78	-1,51	2.700.547,49	0,92	2.397.521.159,05	0,11
CEF	CEF	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO	0,02	0,02	0,02	2.000.329,76	0,68	111.422.509,24	1,80
Sub-total Artigo 8º III			12,75	-0,51	-1,24	4.700.877,25	1,60		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			36,65	-2,74	-10,01	29.965.736,92	10,19		
Total			6,38	-1,09	-0,39	294.124.183,39	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	1.897.547,88	0,65	0,00	3,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	175.432.844,57	59,65	0,00	53,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	86.828.054,02	29,52	0,00	20,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	264.158.446,47	89,81					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	25.264.859,67	8,59	0,00	14,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	4.700.877,25	1,60	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	29.965.736,92	10,19					30,00

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	-4,19 -2.619,41	-0,39 -18,41	-3,56 -626,90	-2,11 -146,90	2,04 52,78	-82.948,19	-8.245,09
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-1,02 -635,50	1,37 64,59	2,88 508,12	0,50 34,89	6,00 155,45	-1.816.148,23	2.369.125,33
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,65 -406,56	-0,41 -19,16	1,72 302,64	-1,11 -77,50	1,62 41,97	-580.570,59	-292.986,87
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,10 0,34	-10,95 3,13	10,88 -2,82	-6,15 -1,54	1,13 2,88	-748.766,63	-2.998.387,63
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,51 2,94	-1,24 12,83	4,57 -9,12	1,45 6,06	4,64 6,39	-20.771,70	-41.124,17
LINHARES (Total)						-3.249.205,34	-971.618,43

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%)	956.129,41	0,00	0,00	0,00	958.138,26	2.008,85	34.800,83
NTN-B 150535 (4,410000%)	1.024.366,66	0,00	0,00	0,00	939.409,62	-84.957,04	-43.045,92
					1.897.547,88	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	34.553.543,62	0,00	0,00	0,00	33.328.341,04	-1.225.202,58	-1.747.121,05
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	15.467.112,86	0,00	0,00	0,00	15.438.700,02	-28.412,84	785.078,18
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	12.735.524,22	0,00	0,00	0,00	12.622.337,23	-113.186,99	318.532,30
BB PREV RF IDKA2	6.211.497,42	0,00	0,00	0,00	6.254.116,01	42.618,59	265.070,27
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	6.386.031,02	0,00	0,00	0,00	6.409.450,79	23.419,77	273.778,26
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	17.217.771,13	0,00	0,00	0,00	16.898.613,04	-319.158,09	106.998,53
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	14.111.155,10	0,00	0,00	0,00	14.123.611,58	12.456,48	382.188,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	4.032.305,74	0,00	-1.025.968,75	0,00	3.017.467,21	11.130,22	163.098,77
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	823.033,23	0,00	-823.941,50	0,00	0,00	908,27	7.555,18
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.221.012,64	0,00	0,00	0,00	9.294.000,61	72.987,97	425.506,06
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.477.089,80	0,00	0,00	0,00	9.514.221,10	37.131,30	405.620,56
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	17.506.640,83	0,00	0,00	0,00	17.186.201,15	-320.439,68	49.926,68
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.771.161,87	0,00	0,00	0,00	26.796.989,19	25.827,32	736.084,93
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	2.279.048,92	0,00	0,00	0,00	2.252.168,65	-26.880,27	131.487,02
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1.441.015,32	864.959,33	0,00	0,00	2.296.626,95	-9.347,70	65.321,49
					175.432.844,57	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	11.126.020,96	0,00	0,00	0,00	11.054.627,13	-71.393,83	19.293,93
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	16.007.399,11	0,00	0,00	0,00	15.426.452,87	-580.946,24	-959.776,11
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	19.183.187,39	0,00	-94.060,27	0,00	19.154.786,46	65.659,34	-141.150,78
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	5.424.541,66	0,00	0,00	0,00	5.367.685,57	-56.856,09	59.846,73
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	24.446.416,65	0,00	0,00	0,00	24.490.715,79	44.299,14	494.979,73
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	12.178.328,64	0,00	-2.000.000,00	0,00	10.195.330,02	17.001,38	209.659,11
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.136.790,47	0,00	0,00	0,00	1.138.456,18	1.665,71	24.160,52
					86.828.054,02	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	0,00	953.718,92	0,00	0,00	929.677,27	-24.041,65	-24.041,65
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	6.405.014,48	0,00	0,00	0,00	6.377.405,83	-27.608,65	-72.648,44
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	0,00	1.473.349,13	0,00	0,00	1.468.336,98	-5.012,15	-5.012,15
FIA CAIXA DIVIDENDOS	1.618.044,80	0,00	0,00	0,00	1.520.773,10	-97.271,70	-441.422,96
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	15.563.498,97	0,00	0,00	0,00	14.968.666,49	-594.832,48	-2.455.262,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					25.264.859,67	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	2.721.648,95	0,00	0,00	0,00	2.700.547,49	-21.101,46	-41.453,93
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO	0,00	2.000.000,00	0,00	0,00	2.000.329,76	329,76	329,76
					4.700.877,25	0,00	0,00

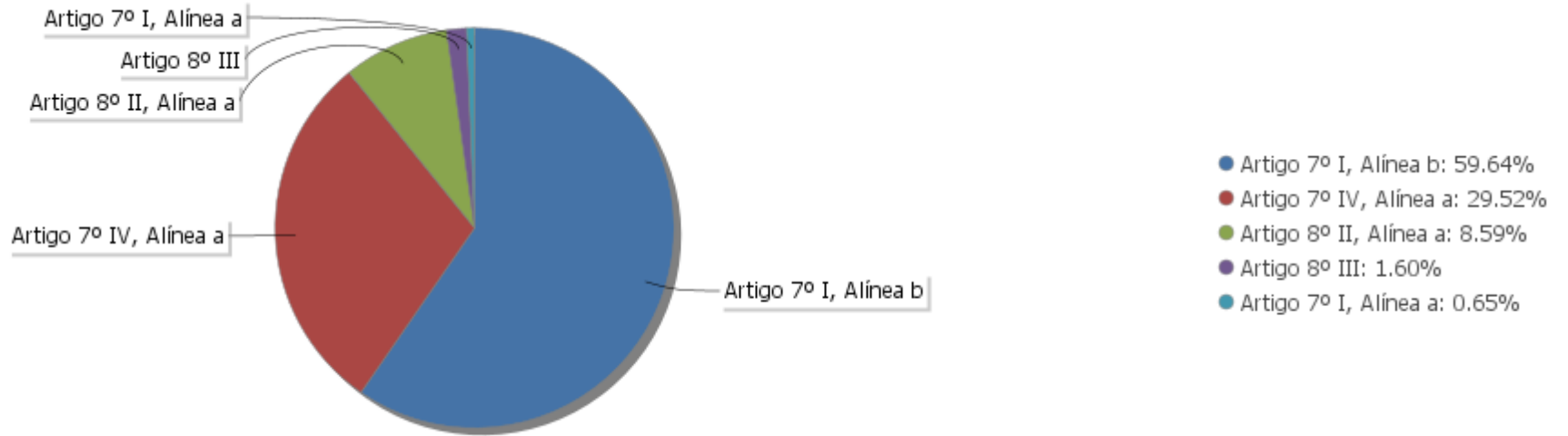
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

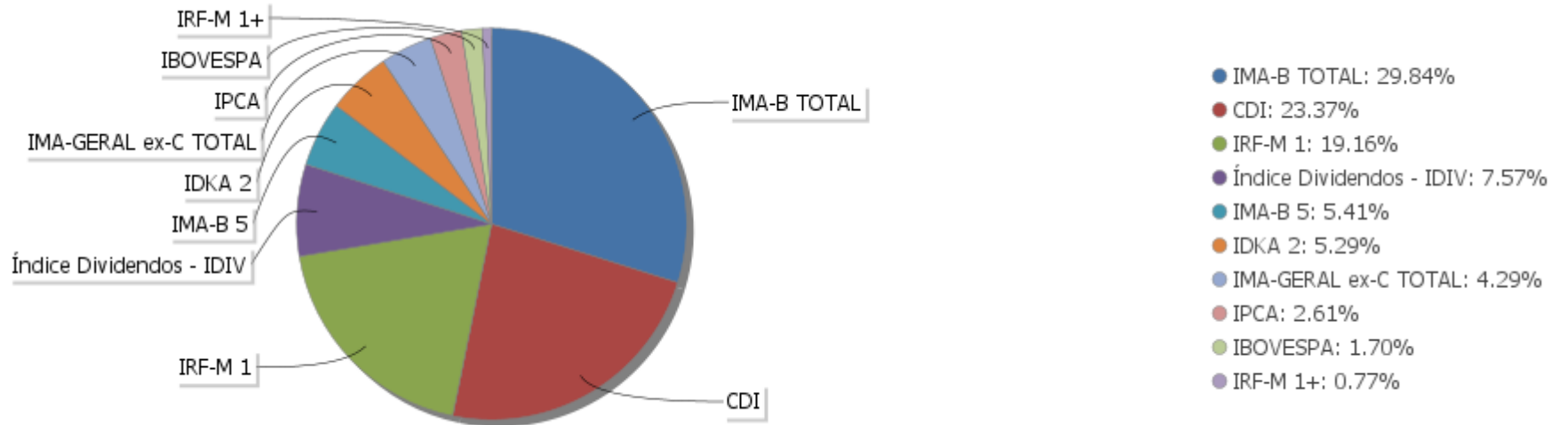
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	265.862.766,22	90,39	265.862.766,22	90,39
de 31 a 365 dias	21.346.072,32	7,26	287.208.838,54	97,65
acima de 365 dias	6.915.344,85	2,35	294.124.183,39	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

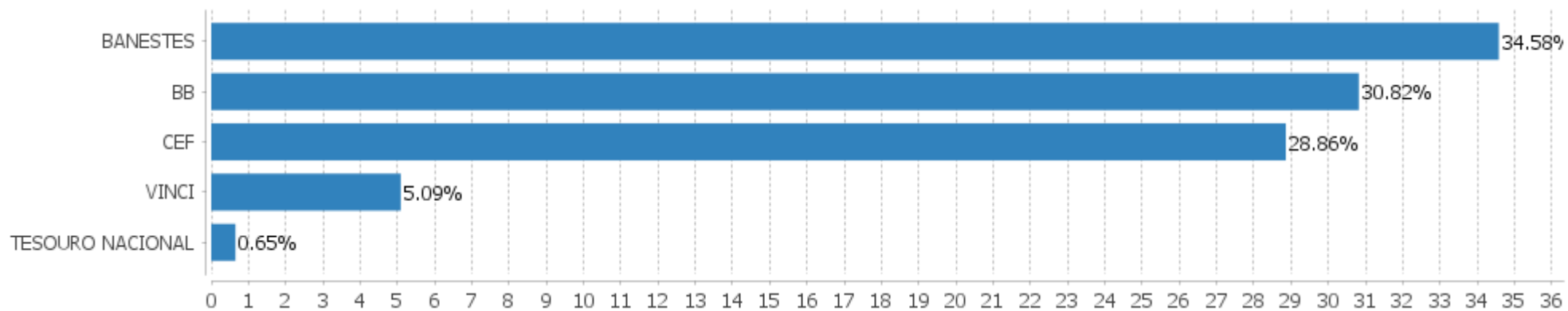


Alocação Por Estratégia



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	0,49	-0,30	-6,00	1,19	1,40	1,41	2,77	-1,09					-0,39
INPC + 6,00%	0,70	0,59	0,69	0,23	0,21	0,79	0,98	0,85					5,15
p.p. indexador	-0,21	-0,89	-6,69	0,96	1,19	0,63	1,79	-1,94					-5,54
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

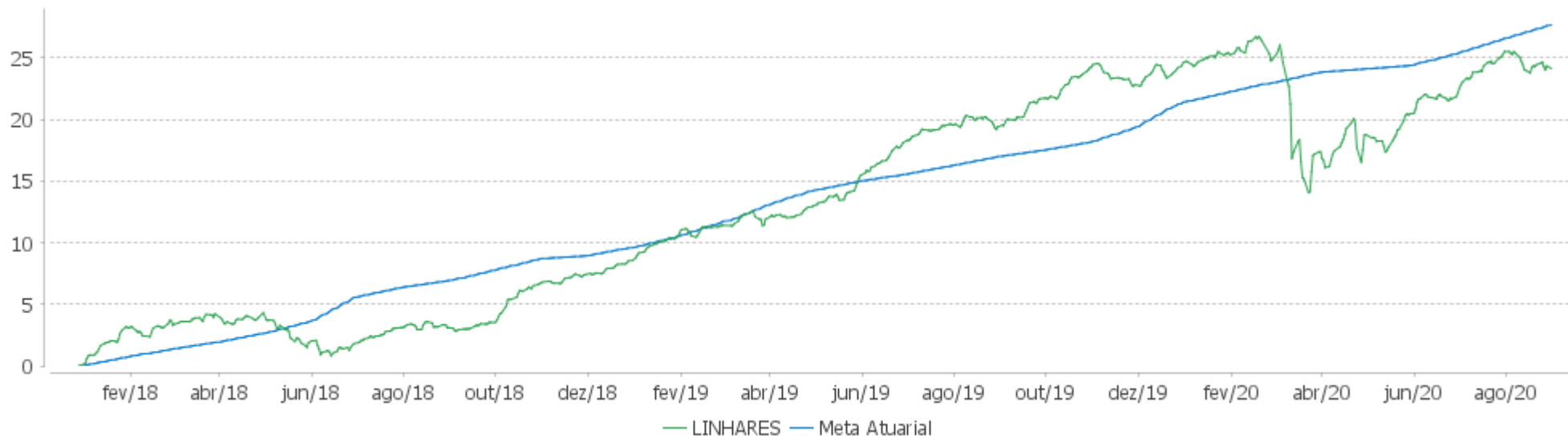
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

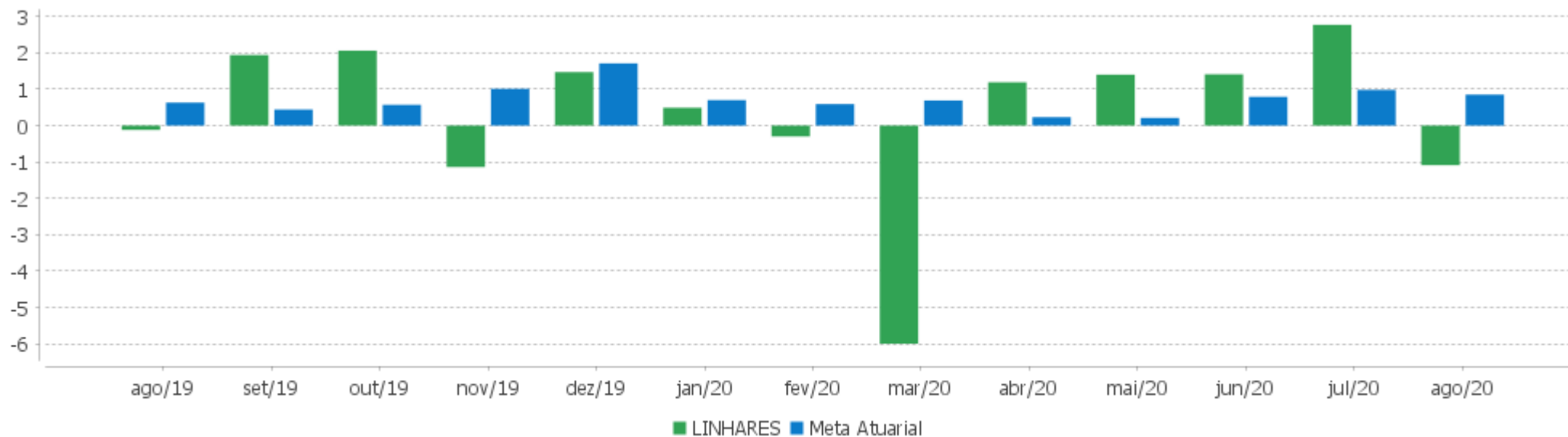
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	15	46,88	03 meses	3,08	2,64	0,45	2,84
Meses abaixo - Meta Atuarial	17	53,13	06 meses	-0,57	3,80	-4,38	8,61
			12 meses	3,96	9,12	-5,15	6,38
			24 meses	20,40	19,38	1,02	4,74
Maior rentabilidade da Carteira	3,08	2018-10	Desde 29/12/2017	24,14	27,65	-3,51	4,34
Menor rentabilidade da Carteira	-6,00	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.	-1,83 -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 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
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,33 2,13	4,23 3,43	2,44 -2,17	3,06 2,97	8,71 2,07	26,40 -9,60	33,84 -8,36
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,11 1,91	0,92 0,12	1,07 -3,54	0,71 0,61	4,07 -2,57	14,07 -21,92	22,92 -19,29
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	-1,18 -0,05	6,20 -0,17	1,32 -0,04	4,26 -0,11	10,40 -0,23	32,83 -0,43	39,62 -0,96
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
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
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,69 -0,35	4,43 -0,96	2,73 -0,26	3,38 -0,74	8,67 -1,03	21,54 -1,98	30,37 -3,07
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,89 -0,21	2,63 -0,06	1,82 -0,06	1,67 -0,06	6,05 -0,11	23,16 0,44	30,22 0,25
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,56 -0,80	5,06 4,36	1,17 0,30	3,57 3,33	9,21 6,77	27,35 21,40	34,93 24,54
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,79 -0,24	4,80 -0,59	2,82 -0,16	3,70 -0,42	8,84 -0,87	21,88 -1,64	30,88 -2,56
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,85 -0,06	0,64 -0,17	4,50 -0,11	-0,06 -0,15	6,38 -0,26	35,28 -0,71	41,12 -1,08
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,10 -0,02	2,83 -0,13	0,60 -0,04	2,03 -0,10	4,85 -0,21	12,44 -0,40	19,97 -0,65
NTN-B 150535 (4,410000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	-8,29 -6,50	-4,24 -5,05	-7,60 -12,21	-5,98 -6,07	2,49 -4,15	12,38 -23,62	
NTN-B 150535 (3,200000%)	0,21	3,71	0,76	2,02	3,33	5,43	

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.	2,01	2,91	-3,85	1,93	-3,31	-30,57	
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,34 214,69	-0,75 -35,49	1,30 228,51	-1,33 -92,67	0,55 14,24	7,00 67,48	14,16 79,04
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 ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	-0,64 -401,32	-0,11 -5,34	1,82 320,81	-1,14 -79,67	5,57 144,17	24,91 239,97	
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,18 113,33	1,79 84,85	0,68 119,59	1,16 81,13	3,42 88,51	9,79 94,28	17,31 96,60
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	-1,05 -1,29	3,80 3,60	1,81 0,95				
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,15 91,64	2,17 102,51	0,55 96,87	1,48 103,10	3,90 101,07	10,35 99,69	17,67 98,59
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,14 90,67	1,77 83,59	0,64 112,31	1,12 77,76	3,36 87,05	9,69 93,36	17,02 94,95
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	0,04 0,27	0,04 0,27					
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO % do CDI	-0,78 -484,90	-1,51 -71,48	4,29 754,92	1,17 81,82	4,36 112,88	18,02 173,61	26,04 145,31
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,43 4,40	-1,13 16,12	18,93 8,47	4,33 14,71	10,07 13,71	69,06 24,28	75,12 29,92
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-1,31 2,13	-6,39 7,69	18,38 4,69	-0,20 4,41	8,03 9,78		
FIA CAIXA DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	-6,01 -2,57	-22,50 -8,42	0,60 -13,09	-16,67 -12,06	-7,25 -5,50	31,54 1,94	25,77 -14,51
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-3,82 1,01	-13,31 3,94	8,95 -1,51	-8,81 1,57	-1,14 2,51	48,70 3,92	47,11 1,91
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-2,32 2,50	-2,32 2,50					
LINHARES Var. INPC + 6,00% p.p.	-1,09 -1,94	-0,39 -5,54	3,08 0,45	-0,57 -4,38	3,96 -5,15	20,40 1,02	
CDI	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,92
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59	40,28
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 ex-C TOTAL	-0,68	2,69	1,88	1,72	6,16	22,72	29,97	49,99	79,04
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	1,43	3,86	10,38	17,92	32,13	50,80

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	1,43	3,86	10,38	17,93	32,16	50,86

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

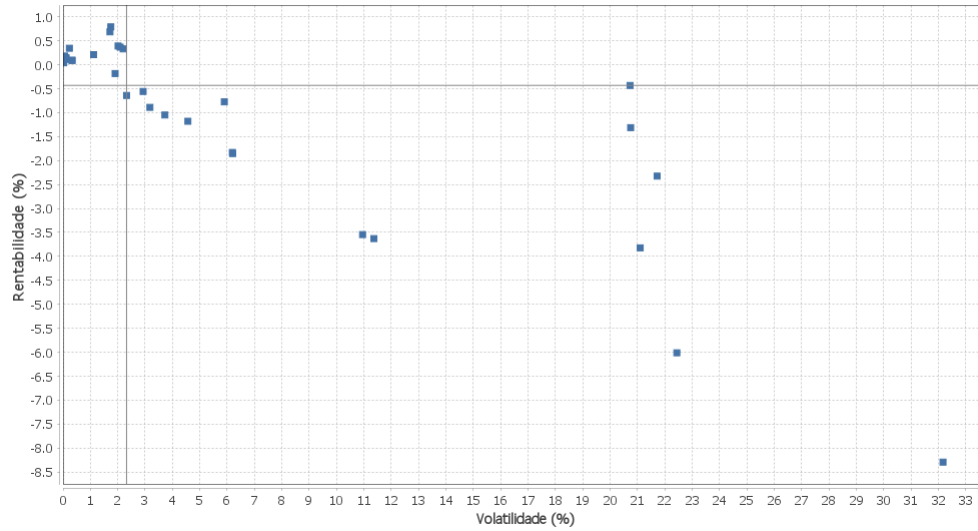
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
36	10/08/2020	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	94.060,27	4.741,40919986	19,8380409800
37	17/08/2020	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	0,00	100.548,91	52.920,71302400	1,8999915960
38	17/08/2020	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	0,00	925.419,84	487.065,22805100	1,8999915960
39	17/08/2020	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	823.941,50	648.301,66737088	1,2709230000
41	18/08/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	864.959,33	0,00	579.011,57073400	1,4938550000
42	19/08/2020	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	1.473.349,13	0,00	668.964,12030000	2,2024337110
45	21/08/2020	BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	953.718,92	0,00	951.805,73336759	1,0020100600
44	24/08/2020	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO	2.000.000,00	0,00	1.999,50050600	1.000,2498087700
40	24/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	2.000.000,00	538.421,77792300	3,7145600000
Total						

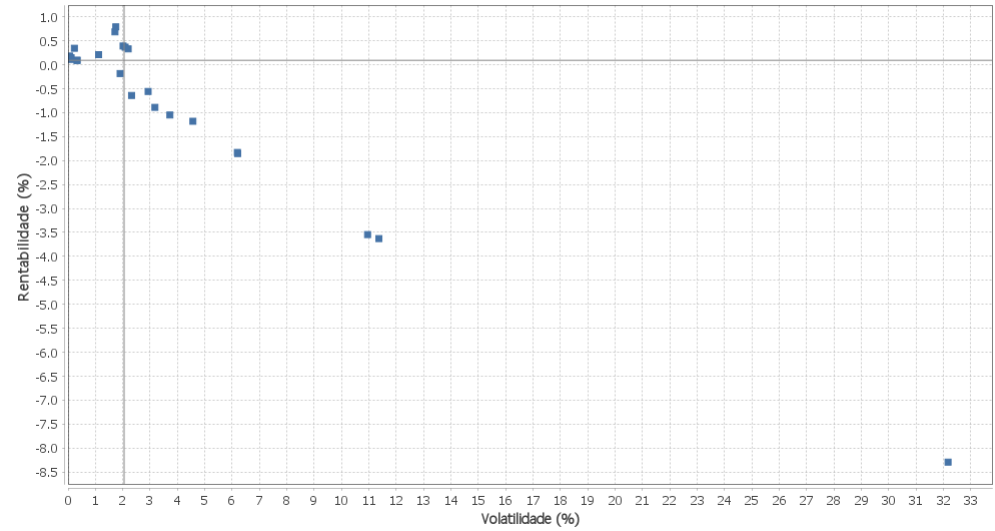
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

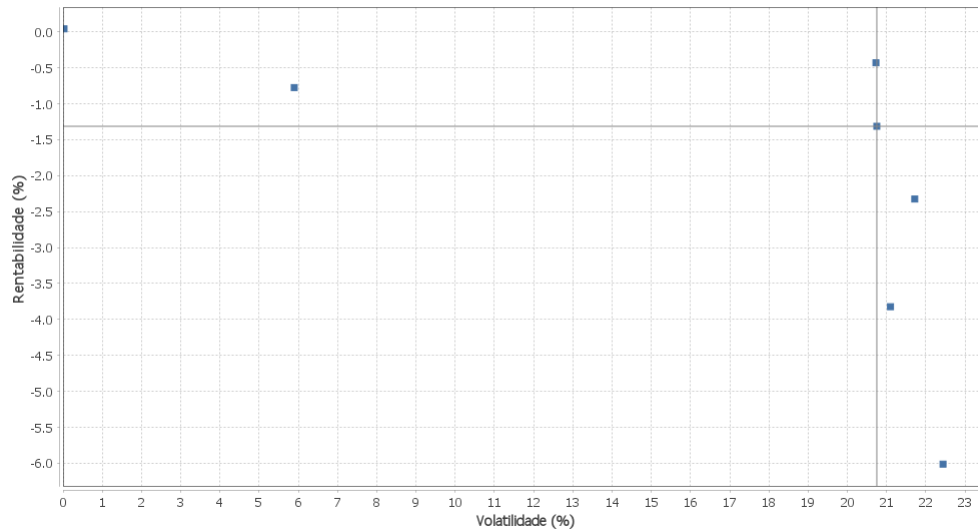
LINHARES - No Mês



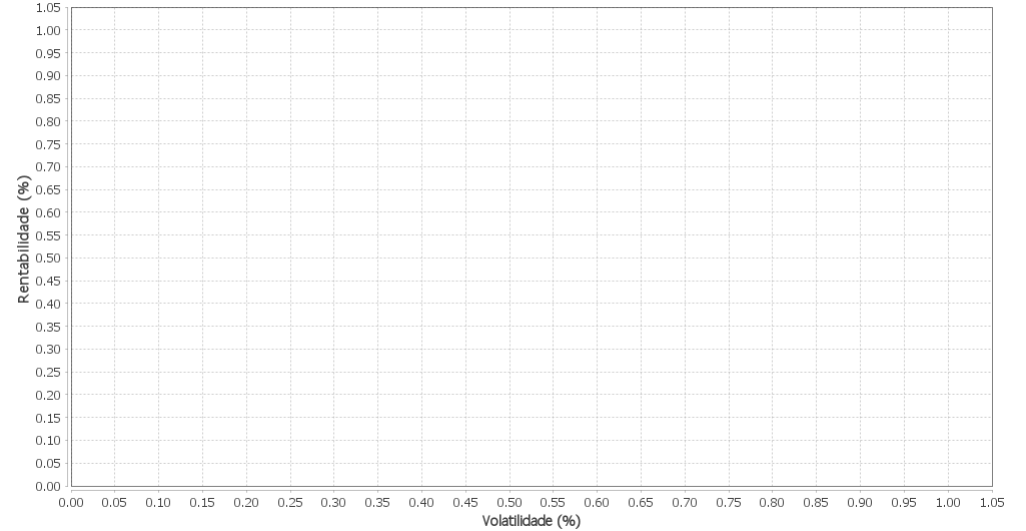
Renda Fixa - No Mês



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\$): 5.557.890,02

Value-At-Risk: 1,89%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III MULTIMERCADO	Artigo 8º III	0,02	0,01	0,00	-4,76	0,04	2.000.329,76	0,68
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,07	0,00	0,37	0,18	24.490.715,79	8,33
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,09	0,00	-0,23	0,14	10.195.330,02	3,47
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,09	NaN	0,00	-0,56	0,11	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,11	0,07	0,00	-0,12	0,15	1.138.456,18	0,39
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,23	0,31	-0,00	0,79	0,34	19.154.786,46	6,51
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,22	0,01	-0,19	0,10	26.796.989,19	9,11
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,22	0,01	-0,22	0,09	14.123.611,58	4,80
NTN-B 150535 (3,200000%)	Artigo 7º I, Alínea a	1,12	0,36	-0,00	0,04	0,21	958.138,26	0,33
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,72	0,88	0,01	0,31	0,69	6.254.116,01	2,13
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,75	0,92	0,02	0,36	0,79	9.294.000,61	3,16
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	1,90	0,99	0,04	-0,18	-0,18	15.438.700,02	5,25
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,06	0,03	0,12	0,39	9.514.221,10	3,23
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,09	1,10	0,02	0,10	0,37	6.409.450,79	2,18
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,20	1,17	0,01	0,08	0,33	3.017.467,21	1,03
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	2,32	0,99	0,01	-0,35	-0,64	11.054.627,13	3,76
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,93	1,39	0,01	-0,24	-0,56	2.296.626,95	0,78
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,17	1,37	0,05	-0,33	-0,89	12.622.337,23	4,29
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	3,72	1,52	0,02	-0,32	-1,05	5.367.685,57	1,82
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,56	2,09	0,01	-0,29	-1,18	2.252.168,65	0,77
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	Artigo 8º III	5,89	3,44	0,02	-0,16	-0,78	2.700.547,49	0,92
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,19	3,13	0,15	-0,32	-1,83	17.186.201,15	5,84
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,20	3,11	0,15	-0,32	-1,85	16.898.613,04	5,75
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	10,95	5,49	0,33	-0,34	-3,55	33.328.341,04	11,33
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	11,36	6,14	0,17	-0,33	-3,63	15.426.452,87	5,24
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	20,73	12,64	0,19	-0,03	-0,43	6.377.405,83	2,17
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	20,75	12,95	0,05	-0,07	-1,31	1.468.336,98	0,50

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	0,51	-0,19	-3,82	14.968.666,49	5,09
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,72	9,11	0,02	-0,11	-2,32	929.677,27	0,32
FIA CAIXA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	22,44	13,76	0,05	-0,28	-6,01	1.520.773,10	0,52
NTN-B 150535 (4,410000%)	Artigo 7º I, Alínea a	32,17	0,36	-0,00	-0,26	-8,29	939.409,62	0,32