



LDB
EMPRESAS

LINHARES
DEZEMBRO 2019



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 09.03.2020.

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 94,92%

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%)	3,11	0,77	0,80	944.424,43	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,410000%)	17,10	0,87	14,39	1.005.787,92	0,35
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		13,34	0,82	9,47	1.950.212,35	0,68

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 PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B	7,87	2,57	31,04	35.073.705,84	12,20	305.335.012,16	11,49
BB	BB	BB PREVID RF IRF-M1	0,26	0,40	6,49	13.741.423,43	4,78	7.033.827.032,81	0,20
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	4,94	1,97	22,64	16.791.614,51	5,84	6.490.168.573,84	0,26
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	4,95	1,99	22,59	31.080.838,32	10,81	6.698.026.543,95	0,46
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,25	0,40	6,55	25.991.883,10	9,04	10.910.469.036,62	0,24
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	1,98	1,21	12,85	9.108.600,54	3,17	9.819.854.122,58	0,09
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	1,50	1,15	11,20	5.989.045,74	2,08	7.688.780.054,14	0,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	2,99	0,70	13,89	2.120.681,63	0,74	2.077.044.204,00	0,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	1,50	1,10	11,19	8.868.494,55	3,08	8.750.821.084,96	0,10
BB	BB	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,98	1,19	12,89	6.135.672,53	2,13	4.389.106.279,05	0,14
BANESTES	BANESTES	Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1	1,36	0,44	10,23	14.653.621,84	5,10	189.924.840,20	7,72
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,25	1,19	13,85	3.980.462,16	1,38	558.191.822,15	0,71
BB	BB	BB PREV ALOC FIC	2,37	0,96	13,07	11.642.566,56	4,05	9.800.245.404,11	0,12
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	3,76	0,59	16,43	1.304.378,32	0,45	9.818.666.120,10	0,01
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,84	0,78	8,66	838.904,95	0,29	1.020.069.053,27	0,08
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,40	1,39	15,97	187.321.894,02	65,15		

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	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,36	0,35	5,78	18.726.507,76	6,51	512.966.780,08	3,65
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	0,08	0,38	5,91	1.114.295,66	0,39	3.186.970.307,05	0,03
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,35	5,72	11.812.754,60	4,11	4.527.790.510,67	0,26
BANESTES	BANESTES	Banestes Institucional FI Renda Fixa	7,50	2,37	28,73	16.386.228,98	5,70	345.776.782,11	4,74
BB	BB	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,05	0,35	5,74	28.764.818,65	10,00	2.851.366.973,39	1,01
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF	2,52	1,14	18,05	6.830.208,78	2,38	189.882.954,64	3,60
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,89	0,81	6,64	83.634.814,43	29,09		
Renda Fixa			1,97	1,21	13,93	272.906.920,80	94,92		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

5,08%

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	FI ACOES CAIXA DIVIDENDOS	14,34	12,21	30,81	1.962.196,06	0,68	263.014.736,57	0,75
VINCI	CEF	FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	15,43	8,52	42,07	3.450.361,52	1,20	842.981.450,04	0,41
BANESTES	BANESTES	Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	16,59	7,18	39,15	6.450.054,27	2,24	116.066.094,09	5,56
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			15,12	8,47	41,15	11.862.611,85	4,13		

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	5,29	2,22	13,70	2.742.001,42	0,95	2.504.561.373,12	0,11
Sub-total Artigo 8º III			5,29	2,22	13,70	2.742.001,42	0,95		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			13,75	7,87	34,34	14.604.613,27	5,08		
Total						287.511.534,07	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	1.950.212,35	0,68	0,50	10,00	75,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	187.321.894,02	65,15	40,00	56,00	75,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	83.634.814,43	29,09	10,00	20,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	272.906.920,80	94,92				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	11.862.611,85	4,13	0,00	2,00	5,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	2.742.001,42	0,95	0,00	2,00	5,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	14.604.613,27	5,08				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

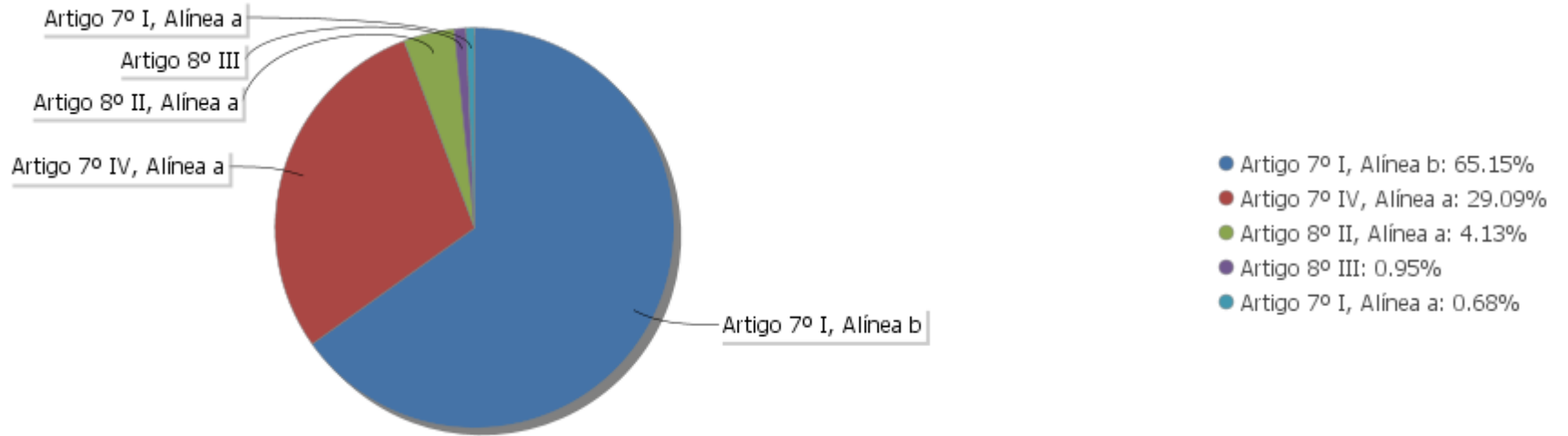
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,82 220,09	9,47 235,57	6,36 512,80	7,93 283,16		15.951,58	134.941,81
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,39 370,68	15,97 268,00	2,25 181,23	5,55 198,18	15,97 268,00	2.565.178,27	25.313.285,17
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,00 0,00	26,31 441,41	0,00 0,00	5,27 188,14	26,31 441,41	0,00	3.348.842,17
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,81 215,16	6,64 111,34	1,43 114,98	3,26 116,37	6,64 111,34	668.856,32	4.503.292,12
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,47 1,62	41,15 9,57	12,21 1,80	18,87 4,34	41,15 9,57	860.571,35	2.638.440,58
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,22 -4,63	13,70 -17,88	4,58 -5,83	6,93 -7,60	13,70 -17,88	22.891,70	121.821,56
						4.133.449,22	36.060.623,41

Análise de Liquidez

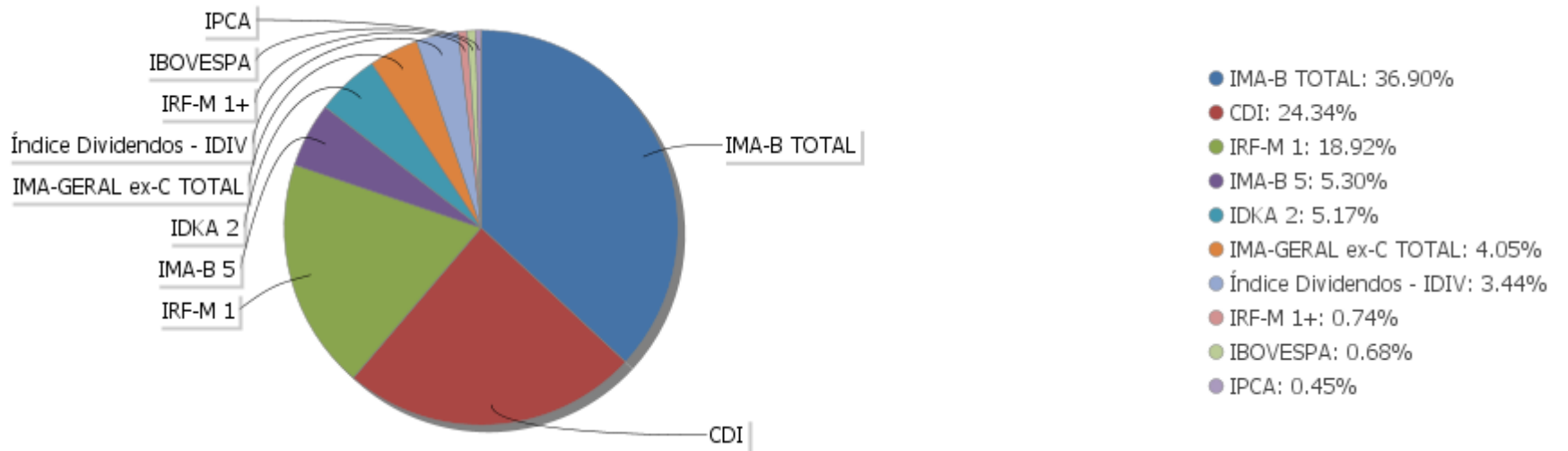
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	270.841.538,82	94,20	270.841.538,82	94,20
de 31 a 364 dias	10.739.320,74	3,74	281.580.859,56	97,94
acima de 365 dias	5.930.674,51	2,06	287.511.534,07	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

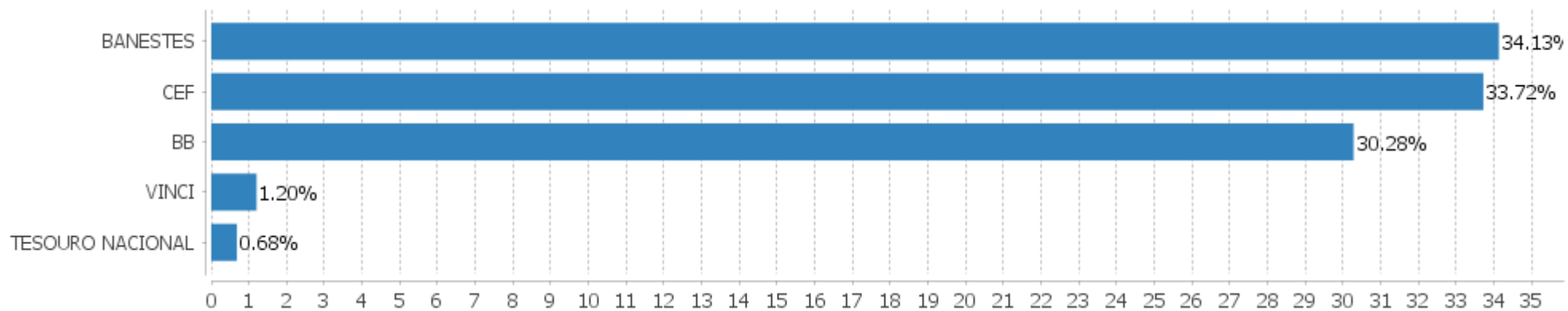


Alocação Por Estratégia



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
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%	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%	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

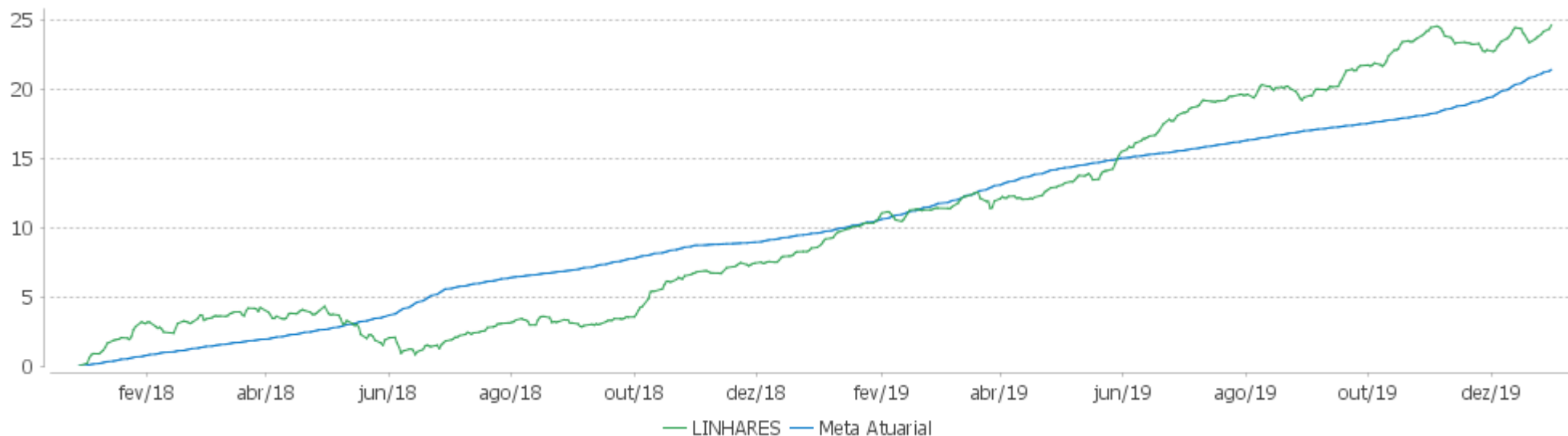
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

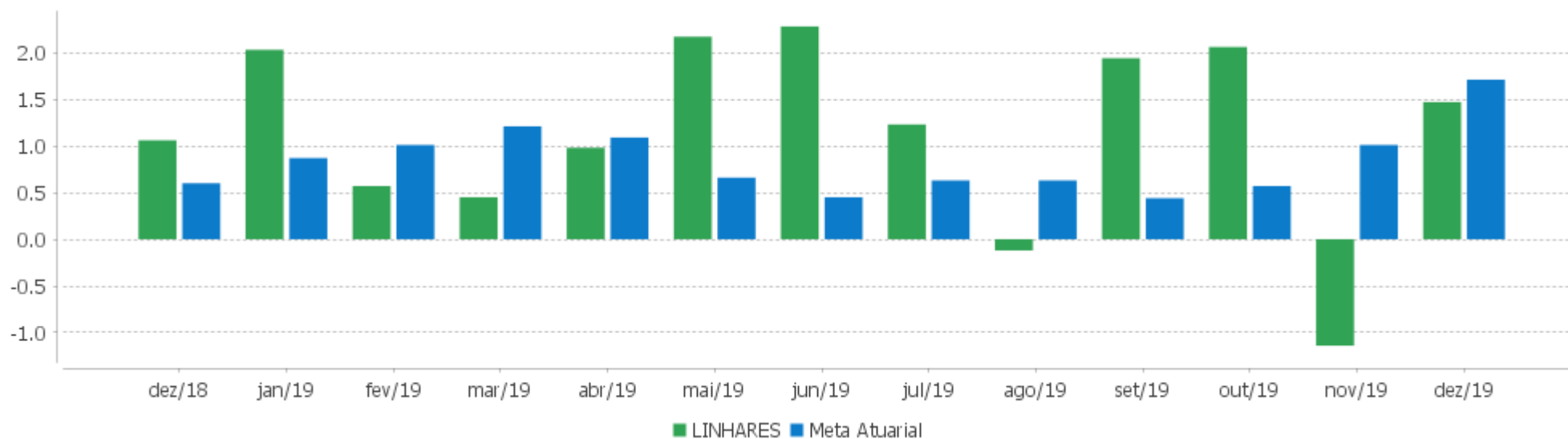
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	11	45,83	03 meses	2,38	3,33	-0,94	2,31
Meses abaixo da Meta Atuarial	13	54,17	06 meses	5,53	5,09	0,44	2,10
			12 meses	14,79	10,78	4,02	2,08
			24 meses	24,62	21,40	3,22	2,34
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,08	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-2,34	2018-05	Desde 29/12/2017	24,62	21,40	3,22	2,34

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 Institucional FI Renda Fixa Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,37 0,37	28,73 5,78	1,91 -0,93	7,28 0,56	28,73 5,78	43,37 4,36	61,02 4,23
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP % do CDI	0,35 93,00	5,78 96,94	0,88 71,12	2,68 95,90	5,78 96,94	12,41 97,26	23,58 98,44
BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF % do CDI	1,14 303,81	18,05 302,88	3,55 286,58	7,85 280,54	18,05 302,88		
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,35 94,44	5,74 96,34	1,14 91,79	2,65 94,83	5,74 96,34	12,44 97,46	23,77 99,24
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,35 93,90	5,72 95,89	1,11 89,85	2,62 93,73	5,72 95,89	12,30 96,38	23,46 97,95
FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP % do CDI	0,38 100,28	5,91 99,22	1,20 97,14	2,76 98,76	5,91 99,22	12,45 97,58	23,60 98,52
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,99 -0,02	22,59 -0,36	2,70 -0,15	6,52 -0,20	22,59 -0,36	38,33 -0,68	55,69 -1,10
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	1,21 -0,03	12,85 -0,30	2,52 -0,10	5,31 -0,17	12,85 -0,30	23,77 -0,55	39,09 -0,86
BB PREVID RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,40 -0,02	6,49 -0,27	1,31 -0,07	3,18 -0,15	6,49 -0,27	13,69 -0,52	26,04 -0,87
BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,19 -0,04	12,89 -0,27	2,54 -0,08	5,34 -0,13	12,89 -0,27	23,78 -0,53	39,16 -0,80
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,78 -1,22	8,66 -14,29	2,41 -0,44	4,13 -2,59	8,66 -14,29	18,53 -20,47	27,32 -29,48
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,19 -0,82	13,85 -9,10	2,59 -0,26	5,36 -1,36	13,85 -9,10	25,93 -13,08	43,05 -13,74
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	0,70 -0,02	13,89 -0,35	2,07 -0,03	5,34 -0,10	13,89 -0,35	27,90 -0,35	48,55 -1,08
BANESTES PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,57 0,56	31,04 8,09	2,88 0,03	8,38 1,66	31,04 8,09	48,64 9,64	66,33 9,54
Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,44 0,03	10,23 3,47	1,48 0,10	4,13 0,80	10,23 3,47	19,30 5,10	33,06 6,16
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,15 -0,05	11,20 -0,62	2,62 0,16	5,15 -0,10	11,20 -0,62	21,46 -1,27	36,52 -2,92
BB PREV ALOC FIC	0,96	13,07	1,81	4,48	13,07	24,27	39,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,05	0,44	-0,09	-0,06	0,44	0,61	-0,09
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF Var. IPCA p.p.	0,59 -0,56	16,43 12,13	1,80 0,03	4,97 2,94	16,43 12,13	25,53 17,32	39,61 28,21
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,10 -0,10	11,19 -0,63	2,40 -0,06	4,92 -0,33	11,19 -0,63	21,53 -1,20	36,53 -2,90
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,40 -0,02	6,55 -0,21	1,33 -0,05	3,22 -0,11	6,55 -0,21	13,80 -0,40	26,25 -0,66
BB PREV IMAB TPB Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,97 -0,03	22,64 -0,31	2,78 -0,07	6,61 -0,11	22,64 -0,31	38,29 -0,71	55,61 -1,18
NTN-B 150535 (4,410000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,87 -1,13	17,83 -5,12	11,13 8,28	12,77 6,05	17,83 -5,12		
NTN-B 150535 (3,200000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,77 -1,23	2,14 -20,81	-0,69 -3,53	0,47 -6,25	2,14 -20,81		
Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	7,18 -2,81	39,15 -6,01	9,95 -4,33	18,68 -3,65	39,15 -6,01	68,25 -0,07	107,80 -3,10
FI ACOES CAIXA DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	12,21 5,36	41,75 10,17	18,02 7,61	24,77 10,23	41,75 10,17	54,70 3,33	91,40 -0,61
FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	8,52 -1,46	42,07 -3,09	12,87 -1,42	17,37 -4,96	42,07 -3,09	60,48 -7,84	101,07 -9,82
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO % do CDI	2,22 592,74	13,70 229,93	4,58 369,27	6,93 247,63	13,70 229,93	22,92 179,55	39,83 166,26
CDI	0,37	5,96	1,24	2,80	5,96	12,76	23,96
IBOVESPA	6,85	31,58	10,41	14,54	31,58	51,36	92,02
INPC + 6%	1,71	10,78	3,33	5,09	10,78	21,40	31,25
IPCA + 6%	1,64	10,59	3,28	5,15	10,59	21,56	32,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,42	6,76	1,38	3,33	6,76	14,21	26,90
IRF-M 1+	0,72	14,24	2,10	5,44	14,24	28,25	49,63
IRF-M TOTAL	0,62	12,03	1,86	4,72	12,03	24,05	42,91
IMA-B 5	1,24	13,15	2,62	5,47	13,15	24,32	39,95
IMA-B 5+	2,60	30,37	3,02	7,64	30,37	50,45	69,64
IMA-B TOTAL	2,01	22,95	2,85	6,72	22,95	39,01	56,79
IMA-C TOTAL	0,40	19,41	1,84	5,35	19,41	41,36	56,88
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,91	12,63	1,90	4,54	12,63	23,66	39,60
IMA-GERAL TOTAL	0,90	12,82	1,90	4,56	12,82	24,14	40,06
IDKA 2	1,20	11,82	2,46	5,25	11,82	22,73	39,44
IDKA 20	3,94	44,26	3,32	8,71	44,26	73,70	94,85
CDI	0,37	5,96	1,24	2,80	5,96	12,76	23,96
Renda Variável							
IBOVESPA	6,85	31,58	10,41	14,54	31,58	51,36	92,02
IBRX 100	7,27	33,39	10,70	15,40	33,39	53,96	96,37
IBRX 50	6,56	29,15	9,81	13,17	29,15	47,91	87,58
SMALL CAP	12,65	58,20	21,15	32,65	58,20	71,06	155,48
IFIX	10,63	35,98	19,12	21,76	35,98	43,62	71,49
Índice Consumo - ICON							
Índice Dividendos - IDIV	9,99	45,16	14,28	22,33	45,16	68,32	110,90
Indicadores Econômicos							
IPCA	1,15	4,31	1,77	2,03	4,31	8,21	11,40
INPC	1,22	4,48	1,81	1,98	4,48	8,07	10,30
IGPM	2,09	7,32	3,09	2,80	7,32	15,42	14,81
SELIC	0,37	5,96	1,24	2,80	5,96	12,77	23,98
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	1,48	8,50	2,79	4,12	8,50	17,02	25,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	1,56	9,54	3,04	4,63	9,54	19,28	28,86
IPCA + 5,5%	1,60	10,07	3,16	4,89	10,07	20,42	30,70
IPCA + 5,89%	1,63	10,47	3,26	5,09	10,47	21,31	32,15
IPCA + 6%	1,64	10,59	3,28	5,15	10,59	21,56	32,56
INPC + 4%	1,55	8,68	2,83	4,06	8,68	16,87	24,00
INPC + 6%	1,71	10,78	3,33	5,09	10,78	21,40	31,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

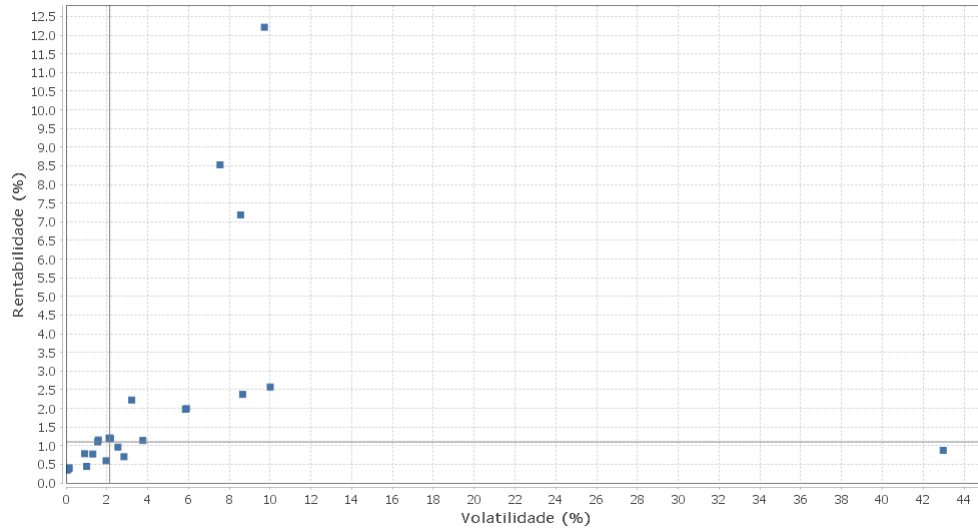
Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
19/12/2019	FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	142.135,79	0,00	18.375,99939100	7,7348604000
23/12/2019	FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	1.507.535,69	0,00	194.504,90776800	7,7506306000
23/12/2019	BB PREV ALOC FIC	184.336,68	0,00	127.486,74122400	1,4459282450
27/12/2019	FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	89.807,11	0,00	11.563,37540000	7,7665134000
27/12/2019	BB PREV ALOC FIC	8.174,68	0,00	5.637,55824700	1,4500391200
30/12/2019	Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	836.435,34	0,00	345.279,30040711	2,4224890951

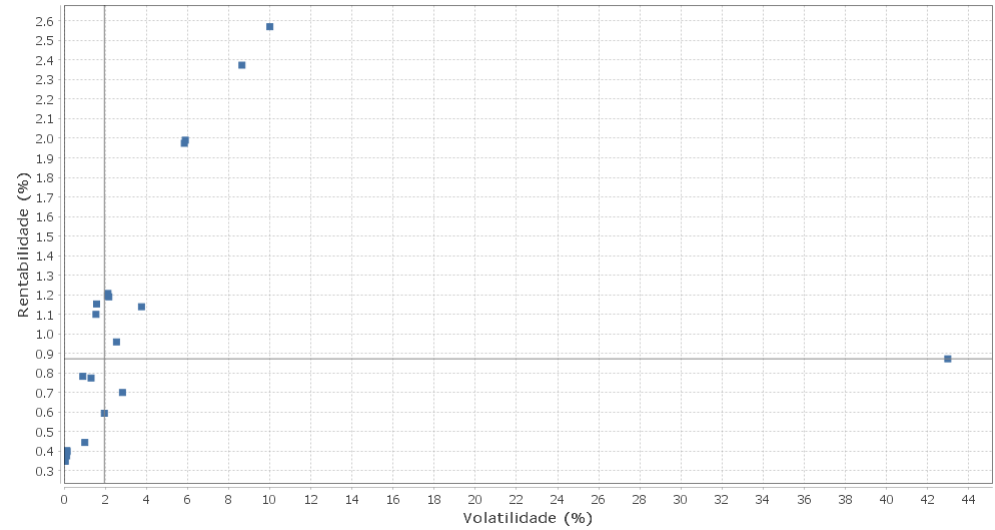
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

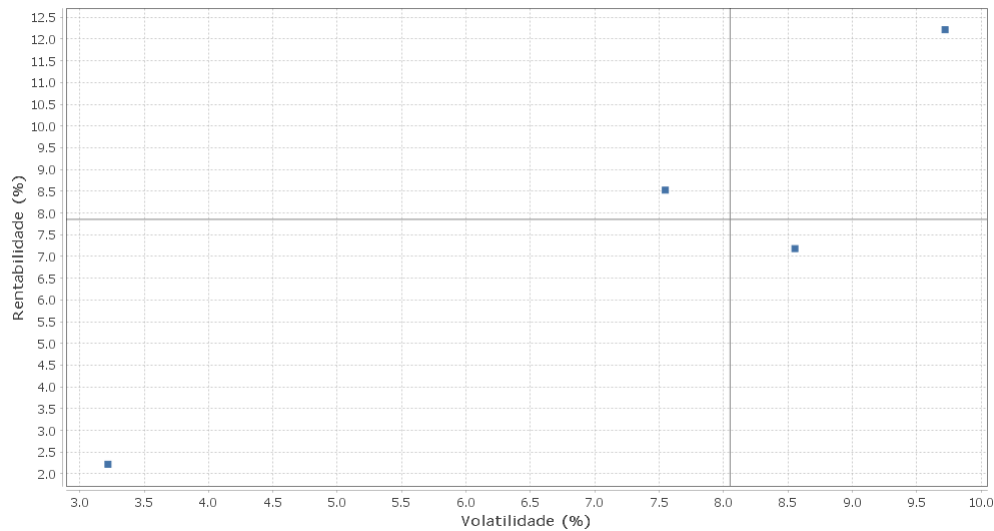
LINHARES - No Mês



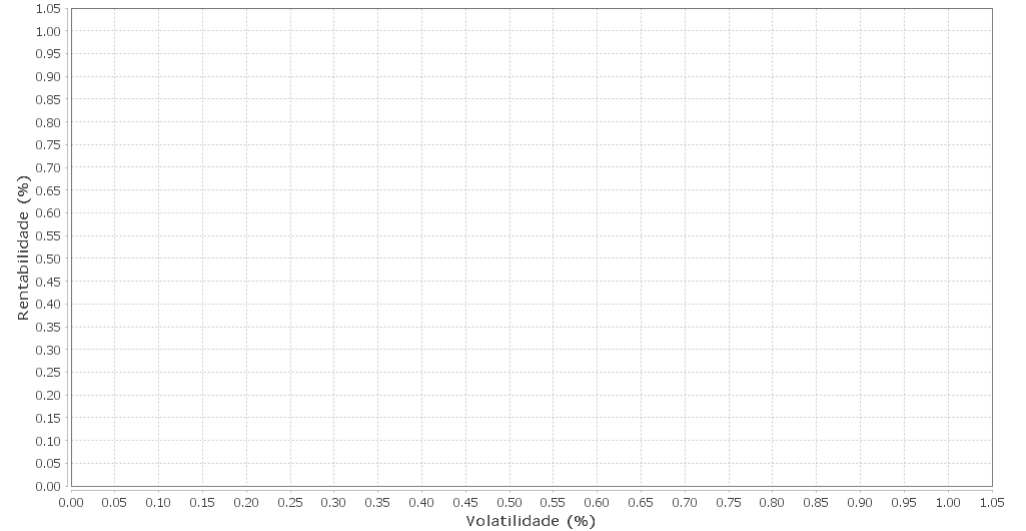
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	0,35	11.812.754,60	4,11
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	0,35	28.764.818,65	10,00
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,02	0,35	18.726.507,76	6,51
FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,13	0,03	0,38	1.114.295,66	0,39
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,14	0,03	0,40	25.991.883,10	9,04
BB PREVID RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	0,14	0,03	0,40	13.741.423,43	4,78
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	0,91	0,13	0,78	838.904,95	0,29
Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1	Artigo 7º I, Alínea b	1,01	0,13	0,44	14.653.621,84	5,10
NTN-B 150535 (3,200000%)	Artigo 7º I, Alínea a	1,31	0,17	0,77	944.424,43	0,33
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,55	0,21	1,10	8.868.494,55	3,08
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,58	0,22	1,15	5.989.045,74	2,08
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,96	0,23	0,59	1.304.378,32	0,45
BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,11	0,28	1,19	6.135.672,53	2,13
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	2,14	0,28	1,21	9.108.600,54	3,17
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,18	0,28	1,19	3.980.462,16	1,38
BB PREV ALOC FIC	Artigo 7º I, Alínea b	2,55	0,31	0,96	11.642.566,56	4,05
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,84	0,33	0,70	2.120.681,63	0,74
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	Artigo 8º III	3,22	0,44	2,22	2.742.001,42	0,95
BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	3,76	0,44	1,14	6.830.208,78	2,38
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	5,85	0,70	1,97	16.791.614,51	5,84
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	5,90	0,70	1,99	31.080.838,32	10,81
FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	7,55	1,17	8,52	3.450.361,52	1,20
Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst	Artigo 8º II, Alínea a	8,55	1,22	7,18	6.450.054,27	2,24
Banestes Institucional FI Renda Fixa	Artigo 7º IV, Alínea a	8,65	1,01	2,37	16.386.228,98	5,70
FI ACOES CAIXA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	9,72	1,56	12,21	1.962.196,06	0,68
BANESTES PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	10,01	1,16	2,57	35.073.705,84	12,20
NTN-B 150535 (4,410000%)	Artigo 7º I, Alínea a	42,98	4,49	0,87	1.005.787,92	0,35