



LDB
EMPRESAS

LINHARES
JANEIRO 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 31.01.2019.

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

97,77%

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	7,77	5,36	5,36	15.230.740,89	6,23	225.992.034,94	6,74
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,55	0,58	0,58	10.911.366,82	4,46	11.421.020.245,51	0,10
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,45	4,36	4,36	13.300.692,90	5,44	4.159.431.811,56	0,32
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,48	4,39	4,39	23.716.808,74	9,70	8.160.723.544,72	0,29
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,55	0,57	0,57	24.347.733,50	9,96	17.170.876.640,61	0,14
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,06	1,53	1,53	8.194.801,54	3,35	8.675.733.038,54	0,09
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,36	1,22	1,22	5.451.154,05	2,23	6.832.498.254,71	0,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	4,72	1,66	1,66	1.892.986,01	0,77	1.748.081.168,96	0,11
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,37	1,27	1,27	8.077.089,41	3,30	7.762.559.317,98	0,10
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	3,05	1,52	1,52	5.517.766,79	2,26	3.212.136.258,09	0,17
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1,11	0,86	0,86	18.115.458,24	7,41	192.307.871,15	9,42
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	4,20	1,87	1,87	3.748.952,53	1,53	525.726.552,20	0,71
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,76	2,01	2,01	10.245.106,68	4,19	4.940.753.535,49	0,21
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,03	2,88	2,88	1.077.612,06	0,44	3.607.219.056,01	0,03
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,52	1,05	1,05	823.435,17	0,34	1.001.258.486,54	0,08
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,36	2,30	2,30	150.651.705,33	61,62		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	6,66	4,78	4,78	13.337.572,62	5,46	210.950.606,87	6,32
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			6,66	4,78	4,78	13.337.572,62	5,46		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,04	0,53	0,53	29.013.239,45	11,87	481.061.113,79	6,03
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,07	0,53	0,53	1.057.633,11	0,43	2.597.718.578,43	0,04
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02	0,53	0,53	15.056.968,47	6,16	6.807.583.623,84	0,22
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8,61	0,53	0,53	27.347.166,73	11,18	4.246.690.677,69	0,64
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,30	1,82	1,82	2.571.648,54	1,05	41.413.498,70	6,21
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,05	0,57	0,57	75.046.656,30	30,69		
Renda Fixa			0,95	1,73	1,73	239.035.934,25	97,77		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,23%

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
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,58	12,23	12,23	2.725.709,28	1,11	506.731.472,62	0,54
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	19,48	7,61	7,61	1.827.620,32	0,75	27.842.798,15	6,56
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			12,75	10,33	10,33	4.553.329,60	1,86		

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	6,30	3,38	3,38	910.440,39	0,37	659.371.495,24	0,14
Sub-total Artigo 8º III			6,30	3,38	3,38	910.440,39	0,37		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			9,20	6,60	6,60	5.463.769,99	2,23		
Total			2,45	2,03	2,03	244.499.704,24	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 b	Fundos 100% Títulos Públicos	150.651.705,33	61,62	40,00	56,00	75,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	13.337.572,62	5,46	5,00	10,00	25,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	75.046.656,30	30,69	10,00	20,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	239.035.934,25	97,77					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	4.553.329,60	1,86	0,00	2,00	5,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	910.440,39	0,37	0,00	2,00	5,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	5.463.769,99	2,23					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 b % do CDI	2,30 423,19	2,30 423,19				3.377.598,56	3.377.598,56
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	4,78 879,65	4,78 879,65				608.078,02	608.078,02
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,57 105,74	0,57 105,74				436.377,76	436.377,76
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	10,33 -0,49	10,33 -0,49				426.304,61	426.304,61
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	3,38 -7,44	3,38 -7,44				29.739,12	29.739,12
LINHARES (Total)						4.878.098,07	4.878.098,07

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	14.153.962,80	314.996,06	0,00	0,00	15.230.740,89	761.782,03	761.782,03
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	17.961.343,83	0,00	0,00	0,00	18.115.458,24	154.114,41	154.114,41
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	10.043.419,53	0,00	0,00	0,00	10.245.106,68	201.687,15	201.687,15
BB PREV RF IDKA2	5.385.700,32	0,00	0,00	0,00	5.451.154,05	65.453,73	65.453,73
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	5.435.157,71	0,00	0,00	0,00	5.517.766,79	82.609,08	82.609,08
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12.745.494,08	0,00	0,00	0,00	13.300.692,90	555.198,82	555.198,82
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	10.848.949,82	0,00	0,00	0,00	10.911.366,82	62.417,00	62.417,00
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	3.680.102,24	0,00	0,00	0,00	3.748.952,53	68.850,29	68.850,29
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	814.882,13	0,00	0,00	0,00	823.435,17	8.553,04	8.553,04
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7.976.112,45	0,00	0,00	0,00	8.077.089,41	100.976,96	100.976,96
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8.071.079,17	0,00	0,00	0,00	8.194.801,54	123.722,37	123.722,37
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	22.535.705,14	187.455,43	0,00	0,00	23.716.808,74	993.648,17	993.648,17
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.210.242,15	0,00	0,00	0,00	24.347.733,50	137.491,35	137.491,35
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	1.862.067,54	0,00	0,00	0,00	1.892.986,01	30.918,47	30.918,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1.047.436,37	0,00	0,00	0,00	1.077.612,06	30.175,69	30.175,69
					150.651.705,33	0,00	0,00

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	0,00	0,00	0,00	0,00	13.337.572,62	608.078,02	608.078,02
					13.337.572,62	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	2.525.557,88	0,00	0,00	0,00	2.571.648,54	46.090,66	46.090,66
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	12.729.494,60	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	28.960.907,71	0,00	-102.050,88	0,00	29.013.239,45	154.382,62	154.382,62
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	27.240.569,03	0,00	-37.791,64	0,00	27.347.166,73	144.389,34	144.389,34
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	16.628.415,66	0,00	-1.657.411,57	0,00	15.056.968,47	85.964,38	85.964,38
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.052.082,35	0,00	0,00	0,00	1.057.633,11	5.550,76	5.550,76
					75.046.656,30	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 FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	1.698.383,83	0,00	0,00	0,00	1.827.620,32	129.236,49	129.236,49
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	2.428.641,16	0,00	0,00	0,00	2.725.709,28	297.068,12	297.068,12
					4.553.329,60	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	880.701,27	0,00	0,00	0,00	910.440,39	29.739,12	29.739,12
					910.440,39	0,00	0,00

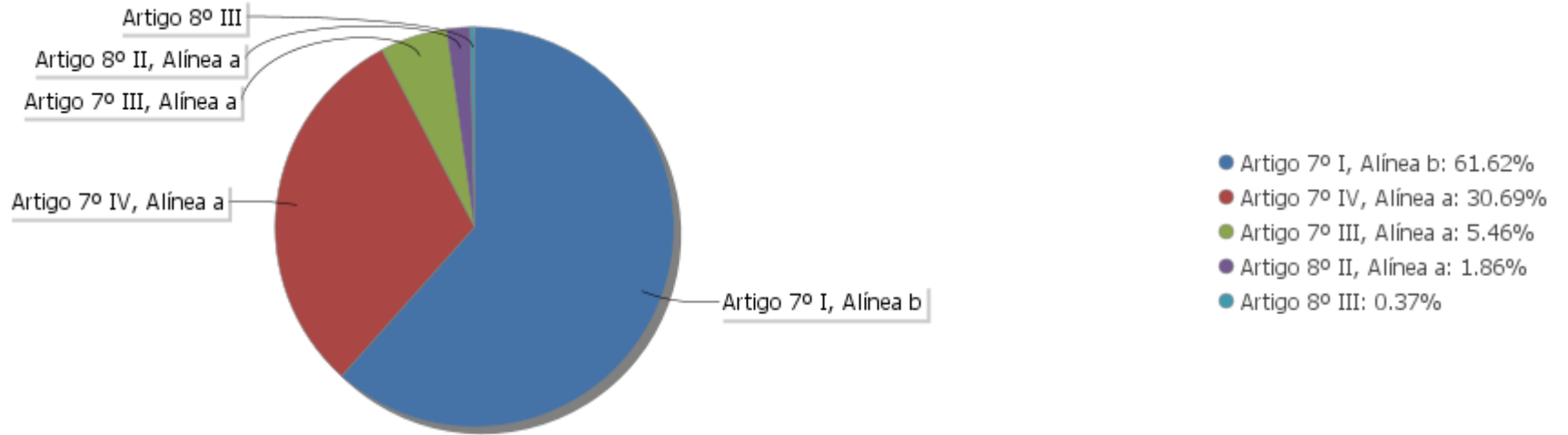
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

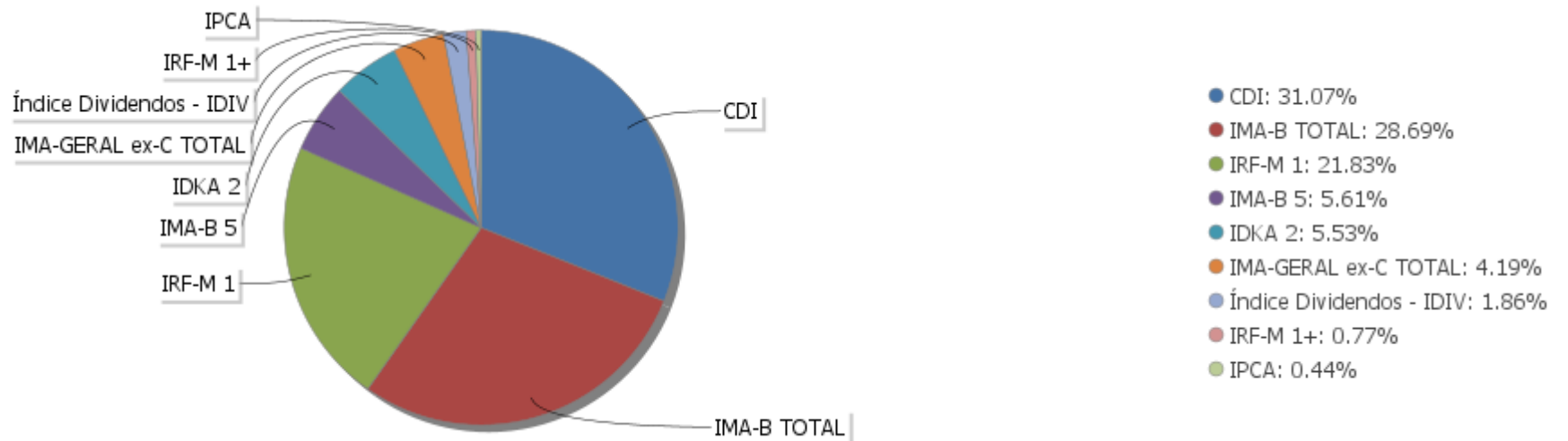
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	236.197.422,11	96,60	236.197.422,11	96,60
de 31 a 365 dias	4.553.329,60	1,86	240.750.751,71	98,47
acima de 365 dias	3.748.952,53	1,53	244.499.704,24	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

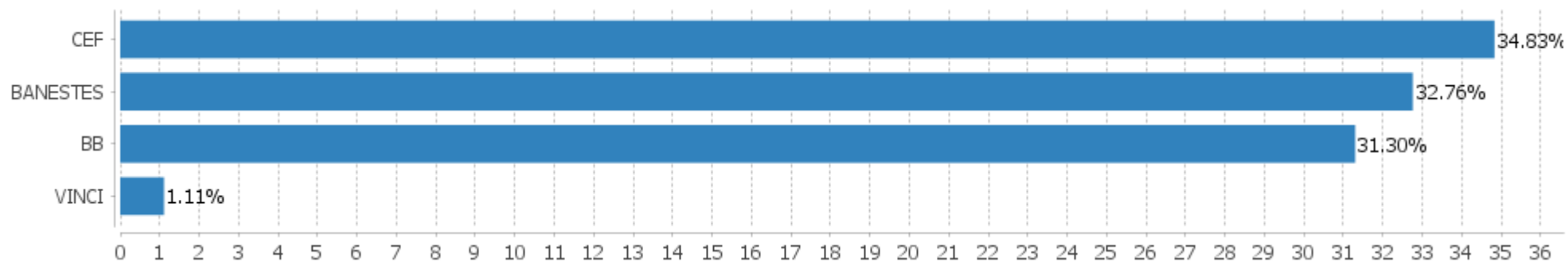


Alocação Por Estratégia



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												2,03
INPC + 6,00%	0,87												0,87
p.p. indexador	1,15												1,15
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

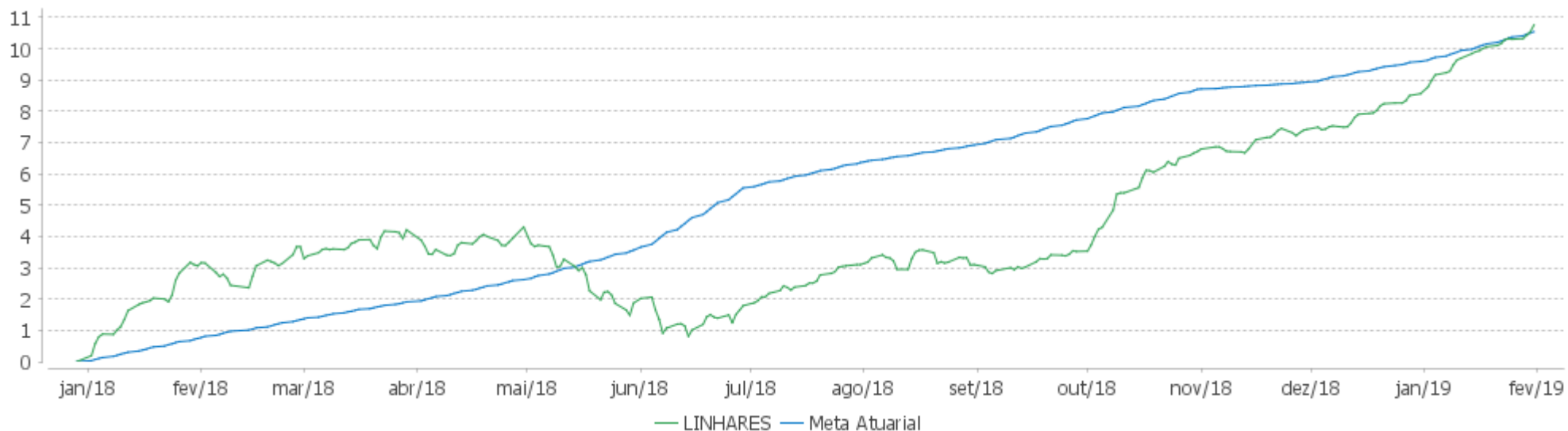
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

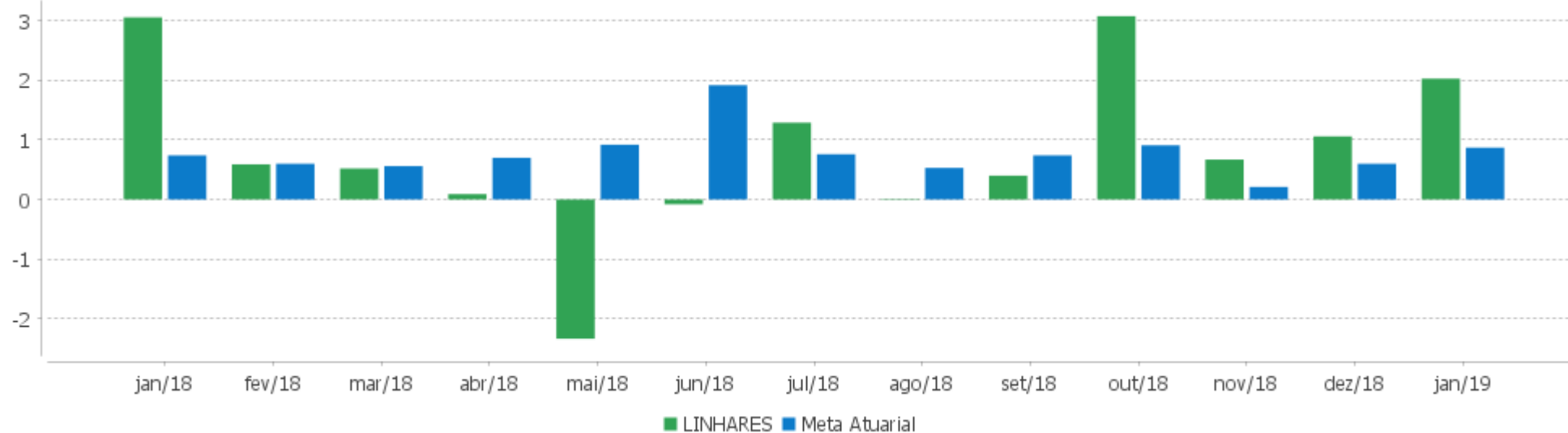
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	6	46,15	03 meses	3,80	1,70	2,10	1,20
Meses abaixo - Meta Atuarial	7	53,85	06 meses	7,44	3,94	3,50	1,85
			12 meses	7,47	9,73	-2,26	2,45
			24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,08	2018-10	Desde 29/12/2017	10,76	10,54	0,22	2,49
Menor rentabilidade da Carteira	-2,34	2018-05					

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 RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,78 0,41	4,78 0,41	8,20 1,16	15,77 1,76	11,87 -2,24	28,45 -2,20	63,26 0,26
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,39 0,03	4,39 0,03	7,05 0,00	13,97 -0,03	13,95 -0,16	30,18 -0,47	62,25 -0,75
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,53 -0,01	1,53 -0,01	3,07 0,00	6,88 -0,05	9,91 -0,18	23,73 -0,42	40,07 -0,78
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,58 -0,00	0,58 -0,00	1,64 -0,05	3,60 -0,09	6,75 -0,22	17,55 -0,48	34,09 -0,84
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,52 -0,02	1,52 -0,02	3,02 -0,05	6,83 -0,10	9,88 -0,21	23,73 -0,42	40,13 -0,71
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,87 -2,50	1,87 -2,50	3,60 -3,45	8,03 -5,98	10,47 -3,64	26,23 -4,42	51,13 -11,87
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,05 -3,32	1,05 -3,32	2,10 -4,95	5,28 -8,73	9,12 -4,99	16,96 -13,69	27,34 -35,65
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	1,66 -0,05	1,66 -0,05	4,77 -0,11	9,80 -0,11	12,31 -0,14	29,12 -0,64	65,99 -0,40
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	5,36 0,99	5,36 0,99	8,86 1,82	17,78 3,78	14,18 0,07	31,24 0,59	66,76 3,76
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,86 0,28	0,86 0,28	2,39 0,70	4,91 1,22	8,38 1,42	20,00 1,96	38,37 3,43
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,22 -0,05	1,22 -0,05	2,56 -0,15	5,85 -0,38	9,50 -0,80	22,93 -1,98	38,58 -1,63
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	2,01 0,10	2,01 0,10	3,98 0,06	7,84 -0,04	10,21 0,17	23,62 -0,50	
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	2,88 2,56	2,88 2,56	4,64 4,38	7,26 6,15	9,82 6,04	21,96 15,22	
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,27 0,00	1,27 0,00	2,57 -0,14	5,93 -0,31	9,64 -0,65	23,04 -1,87	38,94 -1,27
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,57 -0,01	0,57 -0,01	1,65 -0,04	3,62 -0,08	6,80 -0,16	17,67 -0,36	34,35 -0,59
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,36 -0,01	4,36 -0,01	7,01 -0,04	13,86 -0,15	13,82 -0,29	30,01 -0,64	61,91 -1,09
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,53	0,53	1,49	3,04	6,23	16,20	32,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	98,33	98,33	96,99	96,52	97,60	99,02	99,92
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	1,82	1,82	3,45	8,29			
% do CDI	336,06	336,06	224,53	263,35			
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,53	0,53	1,49	3,10	6,29	16,40	32,61
% do CDI	97,64	97,64	97,16	98,52	98,63	100,24	99,77
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,53	0,53	1,50	3,07	6,19	16,16	32,45
% do CDI	97,40	97,40	97,72	97,40	97,03	98,79	99,28
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,53	0,53	1,49	3,04	6,13	16,04	32,26
% do CDI	97,15	97,15	96,89	96,67	96,14	98,05	98,68
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	7,61	7,61	14,58	26,19	20,79	55,84	90,82
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-4,87	-4,87	-6,87	-4,36	2,09	5,34	-99,09
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	12,23	12,23	22,22	31,91	17,58	52,13	87,87
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,25	-0,25	0,77	1,35	-1,12	1,63	-102,04
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	3,38	3,38	4,22	8,27	8,17	24,00	54,00
% do CDI	621,82	621,82	274,63	262,75	128,15	146,72	165,22
LINHARES	2,03	2,03	3,80	7,44	7,47		
Var. INPC + 6,00% p.p.	1,15	1,15	2,10	3,50	-2,26		
CDI	0,54	0,54	1,54	3,15	6,38	16,36	32,69
IBOVESPA	10,82	10,82	11,40	22,94	14,70	50,60	141,04
INPC + 6,00%	0,87	0,87	1,70	3,94	9,73	18,41	32,37
IPCA + 6,00%	0,83	0,83	1,71	4,09	9,95	19,79	33,81

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	0,58	0,58	1,69	3,70	6,96	18,04	34,94	53,36	70,72
IRF-M 1+	1,71	1,71	4,88	9,90	12,45	29,77	66,40	74,53	100,58
IRF-M TOTAL	1,39	1,39	3,96	8,08	10,83	26,44	55,22	67,93	90,75
IMA-B 5	1,54	1,54	3,07	6,93	10,09	24,15	40,85	64,08	88,43
IMA-B 5+	6,61	6,61	10,27	20,14	17,23	35,69	79,61	85,28	132,96
IMA-B TOTAL	4,37	4,37	7,05	14,01	14,11	30,65	63,00	75,40	112,59
IMA-GERAL ex-C TOTAL	1,91	1,91	3,92	7,88	10,04	24,12	49,91	63,69	89,27
IMA-GERAL TOTAL	1,91	1,91	3,88	7,94	10,20	24,27	50,05	63,83	89,68
IDKA 2	1,26	1,26	2,71	6,23	10,29	24,91	40,21	66,05	90,68
IDKA 20	11,06	11,06	16,67	32,70	23,18	44,99	131,86	109,71	189,37
CDI	0,54	0,54	1,54	3,15	6,38	16,36	32,69	50,44	66,86

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	10,82	10,82	11,40	22,94	14,70	50,60	141,04	107,63	104,45
IBRX 100	10,71	10,71	12,20	23,89	15,39	52,03	137,67	107,34	106,56
IBRX 50	10,44	10,44	10,44	21,80	13,22	49,74	134,65	101,72	102,28
SMALL CAP	9,41	9,41	17,06	23,72	13,39	58,58	154,51	105,53	64,01
IFIX	2,47	2,47	7,46	11,85	5,45	24,55	82,15	75,63	87,96
Índice Consumo - ICON	12,31	12,31	16,71	16,51	0,19	30,90	60,71	46,69	74,04
Índice Dividendos - IDIV	12,48	12,48	21,45	30,55	18,70	50,50	189,91	114,25	68,18

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	0,32	0,32	0,26	1,10	3,78	6,74	12,45	24,49	33,38
INPC	0,36	0,36	0,25	0,95	3,57	5,51	11,24	23,82	32,65
IGPM	0,01	0,01	-1,56	1,53	6,74	6,30	13,37	25,78	30,78
SELIC	0,54	0,54	1,54	3,15	6,39	16,38	32,73	50,52	67,08

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	1,66	1,66	-2,05	-6,62	10,58	38,58	25,89	85,93	128,32
MSCI ACWI	1,60	1,60	-0,43	-8,10	4,72	32,44	18,31	64,20	88,64
MSCI World	1,48	1,48	-1,45	-8,37	5,84	32,17	17,29	65,87	91,01

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,66	0,66	1,23	3,11	7,89	15,36	26,42	45,48	62,10
IPCA + 5,00%	0,75	0,75	1,47	3,60	8,92	17,57	30,08	51,12	70,00
IPCA + 5,50%	0,79	0,79	1,59	3,85	9,44	18,68	31,94	54,00	74,06
IPCA + 5,89%	0,82	0,82	1,68	4,04	9,84	19,55	33,40	56,27	77,29
IPCA + 6,00%	0,83	0,83	1,71	4,09	9,95	19,79	33,81	56,92	78,20
INPC + 4,00%	0,70	0,70	1,22	2,95	7,68	14,03	25,06	44,70	61,21
INPC + 6,00%	0,87	0,87	1,70	3,94	9,73	18,41	32,37	56,07	77,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

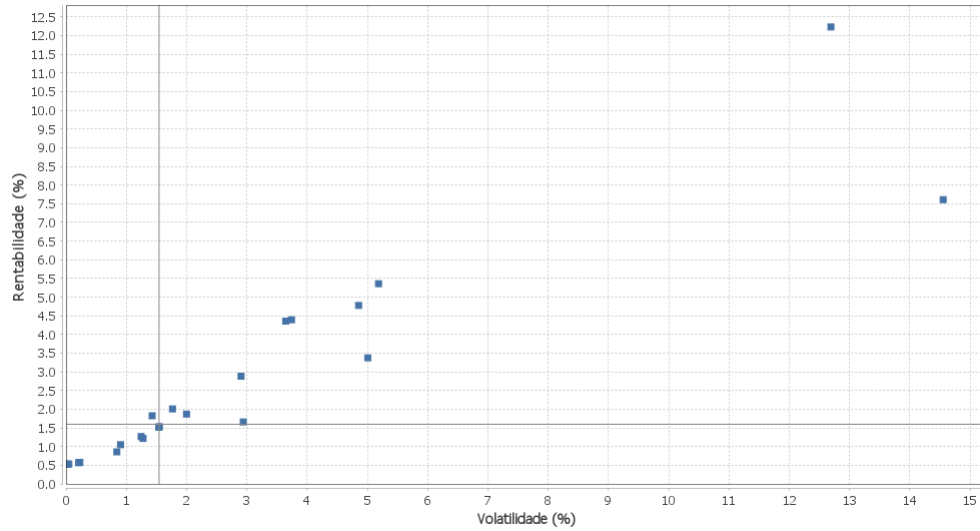
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
	03/01/2019	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.645,25	0,00	8.945,66689654	2,8667790000
	08/01/2019	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	48.629,74	0,00	16.846,13572592	2,8867000000
	09/01/2019	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	53.842,58	2.839,33045943	18,9631255600
	16/01/2019	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	314.996,06	0,00	95.477,55128423	3,2991635800
	23/01/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.999,67	3.748,72305962	2,1339719900
	23/01/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	29.791,97	13.960,80649958	2,1339719900
	24/01/2019	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	45.700,69	2.403,62137227	19,0132649500
	24/01/2019	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.185.622,33	341.881,85245570	3,4679300000
	24/01/2019	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	471.789,24	136.043,47261911	3,4679300000
	25/01/2019	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	1.260,00	66,25424824	19,0176484300
	25/01/2019	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	113.180,44	0,00	38.576,70968327	2,9339060000
	29/01/2019	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	1.247,61	65,57026609	19,0270693500
		Total				

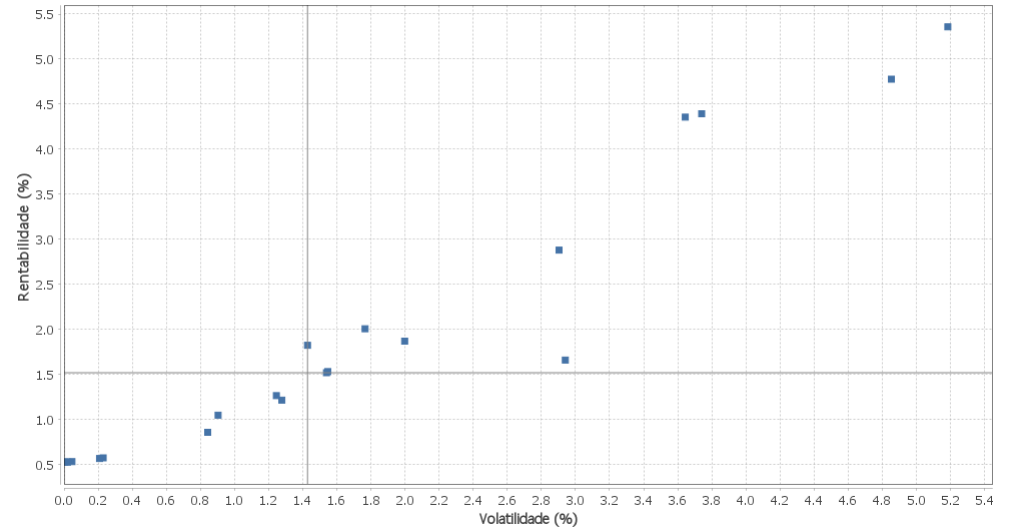
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

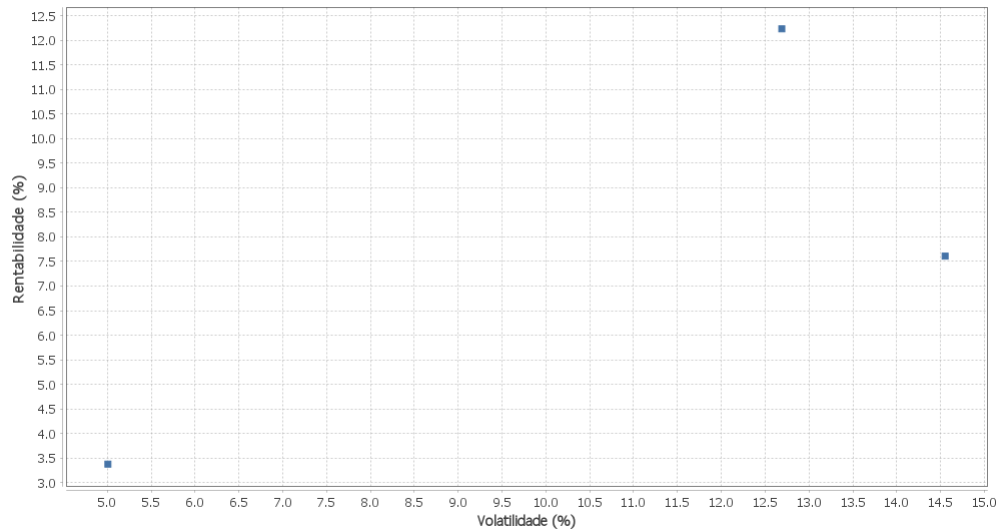
LINHARES - No Mês



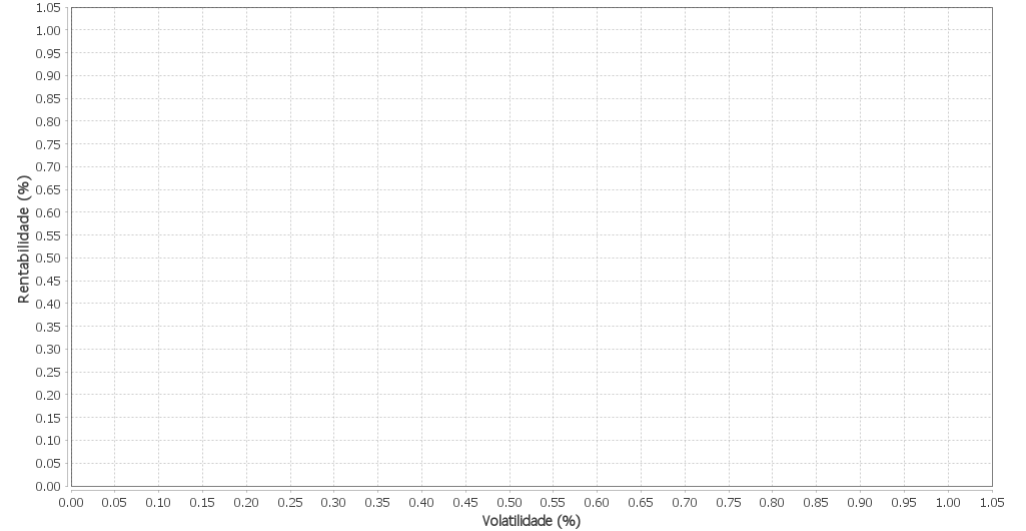
Renda Fixa - No Mês



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\$): 1.991.363,78

Value-At-Risk: 0,81%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,00	-0,00	-3,48	0,53	15.056.968,47	6,16
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,01	-0,00	-2,35	0,53	27.347.166,73	11,18
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,03	0,00	-0,76	0,53	1.057.633,11	0,43
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,02	-0,00	-0,20	0,53	29.013.239,45	11,87
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,21	0,13	0,01	0,12	0,57	24.347.733,50	9,96
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,23	0,13	0,00	0,14	0,58	10.911.366,82	4,46
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	0,84	0,38	0,02	0,37	0,86	18.115.458,24	7,41
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,90	0,50	-0,00	0,56	1,05	823.435,17	0,34
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,25	0,82	0,02	0,58	1,27	8.077.089,41	3,30
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,28	0,80	0,01	0,53	1,22	5.451.154,05	2,23
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	1,43	1,41	0,01	0,90	1,82	2.571.648,54	1,05
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,54	1,00	0,02	0,63	1,52	5.517.766,79	2,26
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,55	1,02	0,03	0,64	1,53	8.194.801,54	3,35
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,77	1,14	0,04	0,83	2,01	10.245.106,68	4,19
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,00	1,28	0,02	0,66	1,87	3.748.952,53	1,53
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,90	1,26	0,00	0,81	2,88	1.077.612,06	0,44
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,94	1,99	0,01	0,38	1,66	1.892.986,01	0,77
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,64	2,29	0,11	1,05	4,36	13.300.692,90	5,44
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,74	2,34	0,20	1,03	4,39	23.716.808,74	9,70
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º III, Alínea a	4,85	2,91	0,08	0,87	4,78	13.337.572,62	5,46
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	Artigo 8º III	5,01	3,59	0,01	0,57	3,38	910.440,39	0,37
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	5,18	3,49	0,11	0,93	5,36	15.230.740,89	6,23
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	12,69	9,13	0,06	0,92	12,23	2.725.709,28	1,11
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	14,55	11,68	0,05	0,49	7,61	1.827.620,32	0,75