



**LDB**  
EMPRESAS

**LINHARES**  
JUNHO 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 28.06.2019.

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 96,78%

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 (4,410000%)	2,50	0,32	1,44	914.325,16	0,34
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>2,50</b>	<b>0,32</b>	<b>1,43</b>	<b>914.325,16</b>	<b>0,34</b>

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	8,12	5,28	20,90	30.408.300,30	11,46	299.021.184,22	10,17
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,34	0,57	3,21	11.197.328,70	4,22	8.658.506.681,68	0,13
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,50	3,71	15,04	15.648.870,14	5,90	5.680.713.628,08	0,28
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,50	3,69	15,08	28.935.701,94	10,90	11.442.831.147,38	0,25
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,33	0,57	3,23	24.992.486,98	9,42	14.698.908.177,11	0,17
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,45	1,70	7,17	8.649.605,27	3,26	9.928.411.976,46	0,09
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	1,74	1,11	5,76	5.695.979,79	2,15	7.591.725.749,21	0,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	4,16	2,71	8,12	2.013.227,93	0,76	2.064.641.180,94	0,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,75	1,22	5,98	8.452.856,38	3,19	8.682.626.787,59	0,10
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,44	1,70	7,16	5.824.399,04	2,19	3.911.936.273,19	0,15
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1,35	1,70	5,86	19.014.098,09	7,16	128.756.021,28	14,77
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	3,29	1,92	8,07	3.875.184,08	1,46	543.428.370,78	0,71
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,77	2,17	8,23	10.869.570,92	4,10	7.006.317.796,94	0,16
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,47	2,73	10,92	1.161.839,25	0,44	6.521.414.048,89	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,43	0,61	4,36	827.568,75	0,31	1.006.284.922,13	0,08
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,37</b>	<b>2,56</b>	<b>9,88</b>	<b>177.567.017,56</b>	<b>66,91</b>		

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

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	7,40	5,28	19,99	15.273.856,82	5,76	265.561.734,38	5,75
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>7,40</b>	<b>5,28</b>	<b>19,99</b>	<b>15.273.856,82</b>	<b>5,76</b>		

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	0,04	0,44	3,01	18.895.464,87	7,12	462.809.717,45	4,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,06	0,48	3,06	1.084.314,89	0,41	2.612.884.918,15	0,04
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02	0,45	3,01	11.510.704,86	4,34	5.736.900.523,07	0,20
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,04	0,46	3,01	28.020.930,94	10,56	3.283.915.059,19	0,85
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,54	2,29	9,45	3.588.353,16	1,35	63.817.925,05	5,62
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>0,11</b>	<b>0,54</b>	<b>3,27</b>	<b>63.099.768,72</b>	<b>23,78</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,89</b>	<b>2,21</b>	<b>8,43</b>	<b>256.854.968,26</b>	<b>96,78</b>		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS**

**3,22%**

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	15,22	3,45	4,84	1.572.633,43	0,59	79.527.765,62	1,98
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,67	5,82	21,05	2.939.772,03	1,11	654.515.196,78	0,45
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	19,14	4,84	17,25	3.090.524,40	1,16	56.111.176,78	5,51
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>16,00</b>	<b>4,92</b>	<b>18,74</b>	<b>7.602.929,86</b>	<b>2,86</b>		

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	6,17	1,49	6,33	936.465,89	0,35	777.174.513,52	0,12
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>6,17</b>	<b>1,49</b>	<b>6,33</b>	<b>936.465,89</b>	<b>0,35</b>		

<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>			<b>14,23</b>	<b>4,54</b>	<b>14,17</b>	<b>8.539.395,75</b>	<b>3,22</b>		
--	--	--	--------------	-------------	--------------	---------------------	-------------	--	--

<b>Total</b>			<b>1,94</b>	<b>2,28</b>	<b>8,77</b>	<b>265.394.364,01</b>	<b>100,00</b>		
--------------	--	--	-------------	-------------	-------------	-----------------------	---------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	914.325,16	0,34	0,50	10,00	75,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	177.567.017,56	66,91	40,00	56,00	75,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	15.273.856,82	5,76	5,00	10,00	25,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	63.099.768,72	23,78	10,00	20,00	40,00	0,00	40,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>256.854.968,26</b>	<b>96,78</b>					100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	7.602.929,86	2,86	0,00	2,00	5,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	936.465,89	0,35	0,00	2,00	5,00	0,00	10,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>8.539.395,75</b>	<b>3,22</b>					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	0,32 67,85	1,43 120,52				2.899,37	13.089,37
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	2,56 546,63	9,88 321,27	6,25 406,25	9,88 321,27		4.432.676,46	15.500.816,95
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	5,28 1.125,31	19,99 650,18	12,79 831,88	19,99 650,18		765.424,41	2.544.362,22
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,54 114,90	3,27 106,41	1,67 108,87	3,27 106,41		335.216,84	2.157.499,05
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	4,92 0,87	18,74 3,86	9,30 3,48	18,74 3,86		356.860,88	975.904,87
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	1,49 -2,57	6,33 -8,55	2,94 -2,88	6,33 -8,55		13.717,09	55.764,62
<b>LINHARES (Total)</b>						<b>5.906.795,05</b>	<b>21.247.437,08</b>

**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 (4,410000%)	911.425,79	0,00	0,00	0,00	914.325,16	2.899,37	13.089,37
					914.325,16	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	28.882.935,62	0,00	0,00	0,00	30.408.300,30	1.525.364,68	4.513.948,93
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	18.697.146,61	0,00	0,00	0,00	19.014.098,09	316.951,48	1.052.754,26
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	10.638.689,96	0,00	0,00	0,00	10.869.570,92	230.880,96	826.151,39
BB PREV RF IDKA2	5.633.700,88	0,00	0,00	0,00	5.695.979,79	62.278,91	310.279,47
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	5.727.020,28	0,00	0,00	0,00	5.824.399,04	97.378,76	389.241,33
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	14.904.983,80	189.302,21	0,00	0,00	15.648.870,14	554.584,13	1.982.493,33
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.133.586,71	0,00	0,00	0,00	11.197.328,70	63.741,99	348.378,88

**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	3.802.344,46	0,00	0,00	0,00	3.875.184,08	72.839,62	291.346,24
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	822.519,77	0,00	0,00	0,00	827.568,75	5.048,98	34.810,23
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8.351.064,09	0,00	0,00	0,00	8.452.856,38	101.792,29	476.743,93
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8.505.165,23	0,00	0,00	0,00	8.649.605,27	144.440,04	578.526,10
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	27.904.858,34	0,00	0,00	0,00	28.935.701,94	1.030.843,60	3.648.334,76
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.849.982,56	0,00	0,00	0,00	24.992.486,98	142.504,42	782.244,83
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	1.960.129,50	0,00	0,00	0,00	2.013.227,93	53.098,43	151.160,39
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1.130.911,08	0,00	0,00	0,00	1.161.839,25	30.928,17	114.402,88
					177.567.017,56	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	14.508.432,41	0,00	0,00	0,00	15.273.856,82	765.424,41	2.544.362,22
					15.273.856,82	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	2.700.737,90	820.242,02	0,00	0,00	3.588.353,16	67.373,24	244.209,41
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	18.933.564,93	0,00	-121.122,14	0,00	18.895.464,87	83.022,08	661.936,74
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	27.893.354,21	0,00	0,00	0,00	28.020.930,94	127.576,73	818.260,95
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.458.671,72	0,00	0,00	0,00	11.510.704,86	52.033,14	400.859,41
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.079.103,24	0,00	0,00	0,00	1.084.314,89	5.211,65	32.232,54
					63.099.768,72	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	2.947.829,46	0,00	0,00	0,00	3.090.524,40	142.694,94	392.140,57
FIA CAIXA DIVIDENDOS	1.520.199,03	0,00	0,00	0,00	1.572.633,43	52.434,40	72.633,43



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	2.778.040,49	0,00	0,00	0,00	2.939.772,03	161.731,54	511.130,87
					7.602.929,86	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	922.748,80	0,00	0,00	0,00	936.465,89	13.717,09	55.764,62
					936.465,89	0,00	0,00

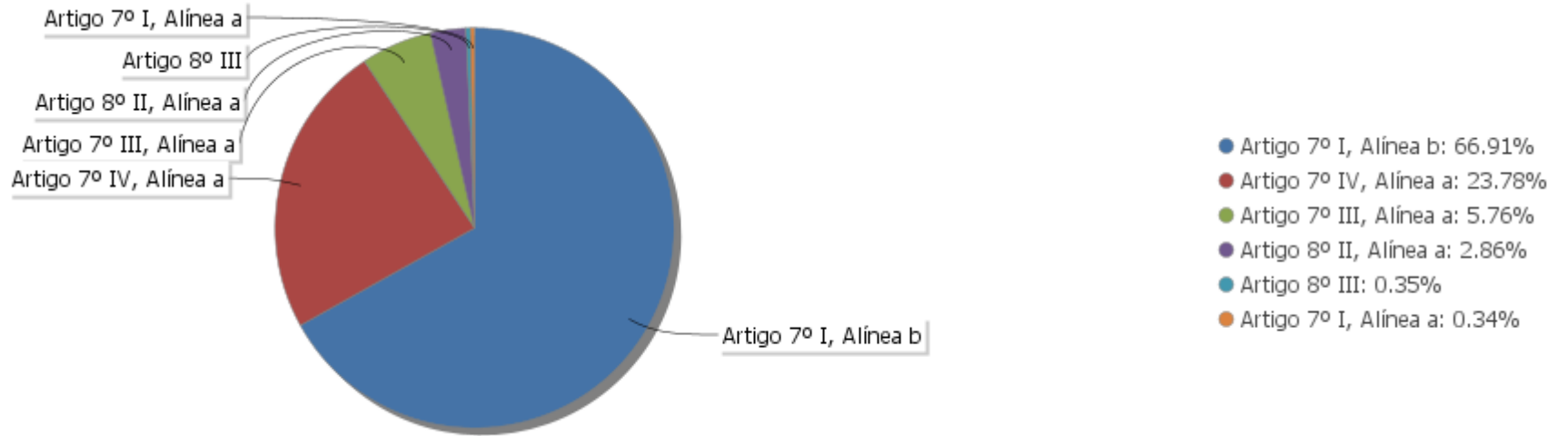
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

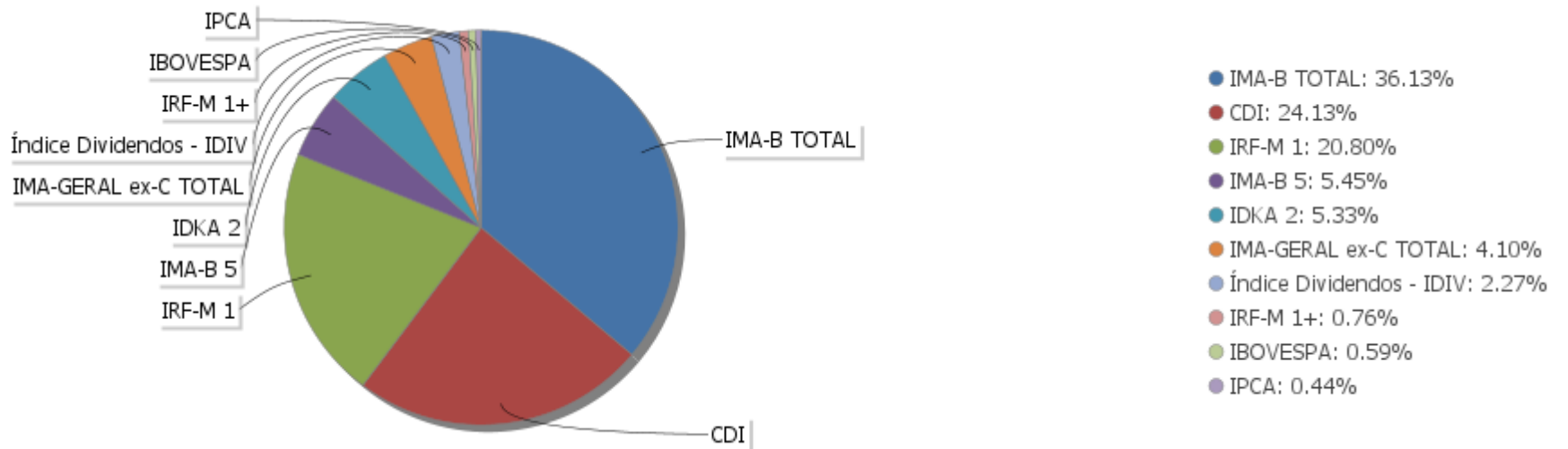
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	254.574.558,34	95,92	254.574.558,34	95,92
de 31 a 365 dias	6.030.296,43	2,27	260.604.854,77	98,20
acima de 365 dias	4.789.509,24	1,80	265.394.364,01	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

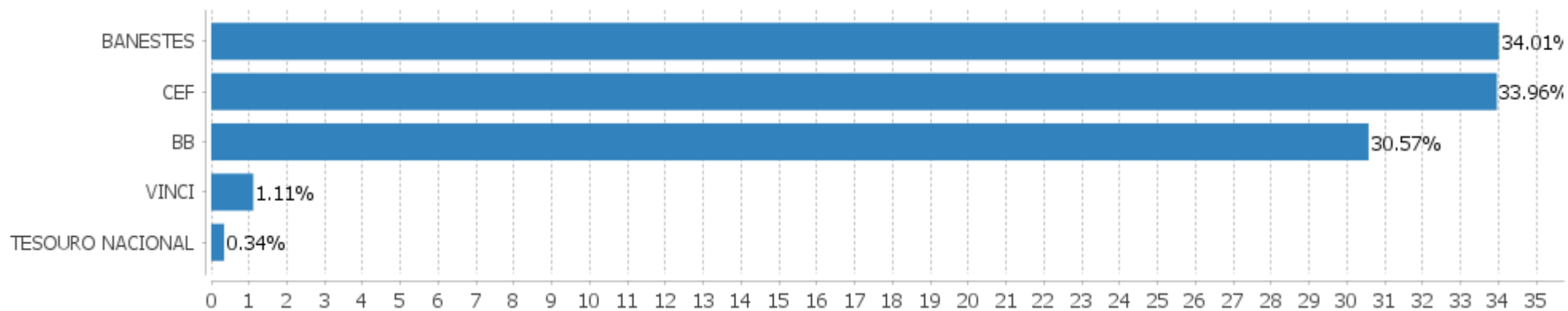


Alocação Por Estratégia



## 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							8,77
INPC + 6,00%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45							5,41
p.p. indexador	1,15	-0,43	-0,77	-0,11	1,51	1,83							3,37
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

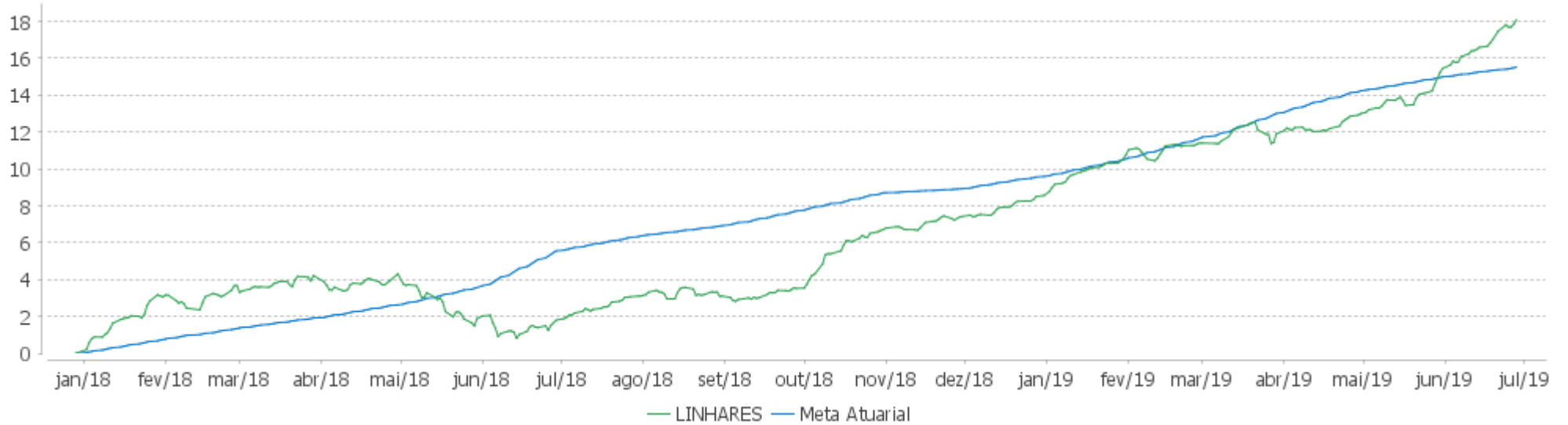
**Performance Sobre a Meta Atuarial**

**Relatório**

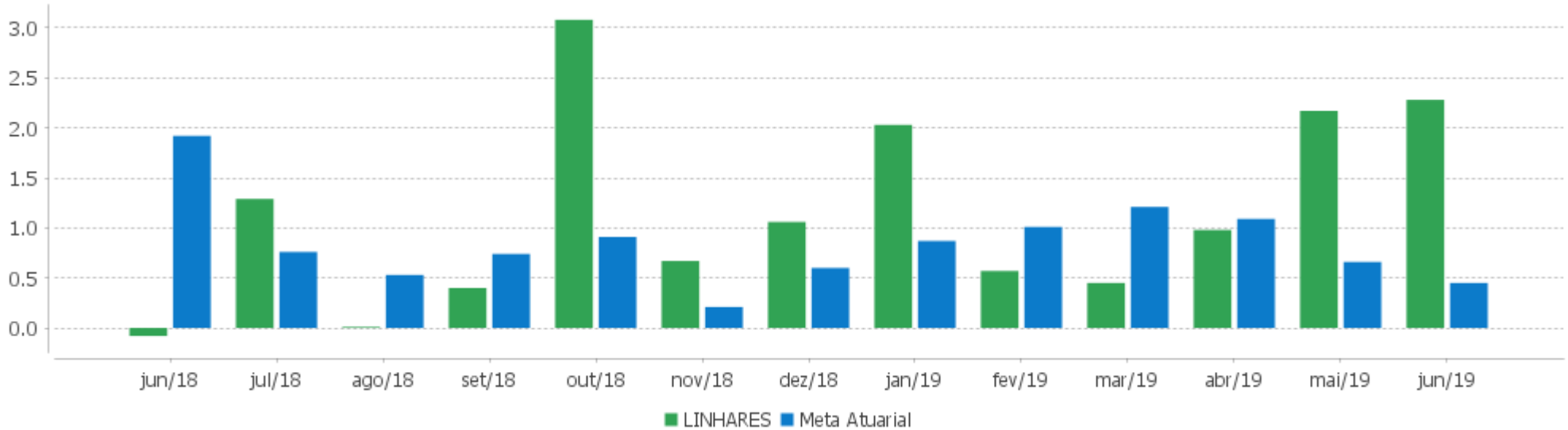
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	8	44,44	03 meses	5,53	2,22	3,32	1,87
Meses abaixo - Meta Atuarial	10	55,56	06 meses	8,77	5,41	3,37	2,05
			12 meses	16,02	9,44	6,58	1,94
			24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,08	2018-10	Desde 29/12/2017	18,09	15,52	2,57	2,42
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
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,69 -0,04	15,08 -0,12	9,06 -0,09	15,08 -0,12	28,54 -0,22	38,72 -0,59	57,00 -0,88
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,70 -0,02	7,17 -0,12	4,20 -0,06	7,17 -0,12	14,47 -0,18	25,32 -0,49	40,02 -0,78
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,57 -0,01	3,21 -0,11	1,73 -0,04	3,21 -0,11	7,04 -0,19	15,12 -0,47	30,28 -0,88
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,70 -0,02	7,16 -0,12	4,22 -0,05	7,16 -0,12	14,42 -0,23	25,32 -0,49	40,03 -0,76
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,61 -3,12	4,36 -10,85	2,12 -7,04	4,36 -10,85	9,92 -18,84	18,47 -20,85	26,37 -31,50
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,92 -1,82	8,07 -7,14	4,78 -4,37	8,07 -7,14	16,69 -12,07	28,09 -11,22	44,96 -12,92
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	2,71 -0,01	8,12 -0,23	5,50 -0,12	8,12 -0,23	19,04 -0,14	29,61 -0,63	52,91 -0,94
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	1,70 1,11	5,86 2,54	4,07 2,30	5,86 2,54	11,00 3,77	20,42 4,83	36,86 5,70
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	5,28 1,55	20,90 5,70	12,81 3,66	20,90 5,70	39,55 10,79	46,49 7,17	65,33 7,45
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,11 -0,13	5,76 -0,49	3,19 -0,49	5,76 -0,49	11,97 -1,27	22,82 -1,71	37,67 -2,91
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	2,17 0,22	8,23 0,49	5,14 0,45	8,23 0,49	15,98 0,34	25,74 0,55	
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	2,73 2,72	10,92 8,69	6,70 5,99	10,92 8,69	16,74 13,37	26,22 18,31	
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,22 -0,01	5,98 -0,27	3,39 -0,29	5,98 -0,27	12,17 -1,07	23,08 -1,46	37,97 -2,61
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,57 -0,01	3,23 -0,09	1,74 -0,03	3,23 -0,09	7,09 -0,13	15,23 -0,37	30,51 -0,65
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,71 -0,02	15,04 -0,17	9,08 -0,07	15,04 -0,17	28,39 -0,37	38,55 -0,77	56,73 -1,15
NTN-B 150535 (4,410000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,32 -3,42	4,49 -10,72	2,24 -6,91	4,49 -10,72	5,92 -22,84		
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,44	3,01	1,48	3,01	6,12	13,80	29,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	93,86	97,97	96,02	97,97	96,90	97,60	100,74
<b>BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF</b>	<b>2,29</b>	<b>9,45</b>	<b>5,52</b>	<b>9,45</b>			
% do CDI	488,59	307,55	359,19	307,55			
<b>BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI</b>	<b>0,46</b>	<b>3,01</b>	<b>1,50</b>	<b>3,01</b>	<b>6,19</b>	<b>14,07</b>	<b>28,94</b>
% do CDI	97,56	97,82	97,64	97,82	98,00	99,49	100,48
<b>FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP</b>	<b>0,48</b>	<b>3,06</b>	<b>1,58</b>	<b>3,06</b>	<b>6,22</b>	<b>13,89</b>	<b>28,38</b>
% do CDI	103,02	99,66	102,68	99,66	98,41	98,27	98,54
<b>FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP</b>	<b>0,45</b>	<b>3,01</b>	<b>1,50</b>	<b>3,01</b>	<b>6,17</b>	<b>13,82</b>	<b>28,50</b>
% do CDI	96,86	97,98	97,80	97,98	97,60	97,74	98,95
<b>BANESTES INSTITUCIONAL FI RF</b>	<b>5,28</b>	<b>19,99</b>	<b>12,79</b>	<b>19,99</b>	<b>35,82</b>	<b>43,06</b>	<b>62,71</b>
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,54	4,78	3,64	4,78	7,06	3,75	4,84
<b>FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO</b>	<b>1,49</b>	<b>6,33</b>	<b>2,94</b>	<b>6,33</b>	<b>14,39</b>	<b>25,65</b>	<b>42,98</b>
% do CDI	317,08	205,97	191,41	205,97	227,73	181,42	149,21
<b>BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL</b>	<b>4,84</b>	<b>17,25</b>	<b>12,62</b>	<b>17,25</b>	<b>45,74</b>	<b>65,70</b>	<b>72,47</b>
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,73	-1,41	2,98	-1,41	-2,01	4,87	-47,35
<b>FIA CAIXA DIVIDENDOS</b>	<b>3,45</b>	<b>13,61</b>	<b>5,86</b>	<b>13,61</b>	<b>41,58</b>	<b>47,38</b>	<b>57,65</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-0,61	-1,27	0,04	-1,27	2,81	-13,14	-38,30
<b>FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS</b>	<b>5,82</b>	<b>21,05</b>	<b>8,19</b>	<b>21,05</b>	<b>49,27</b>	<b>61,47</b>	<b>84,59</b>
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	2,71	2,38	-1,45	2,38	1,53	0,65	-35,22
<b>LINHARES</b>	<b>2,28</b>	<b>8,77</b>	<b>5,53</b>	<b>8,77</b>	<b>16,02</b>		
Var. INPC + 6,00% p.p.	1,83	3,37	3,32	3,37	6,58		
<b>CDI</b>	<b>0,47</b>	<b>3,07</b>	<b>1,54</b>	<b>3,07</b>	<b>6,32</b>	<b>14,14</b>	<b>28,80</b>
<b>IBOVESPA</b>	<b>4,06</b>	<b>14,88</b>	<b>5,82</b>	<b>14,88</b>	<b>38,76</b>	<b>60,52</b>	<b>95,95</b>
<b>INPC + 6,00%</b>	<b>0,45</b>	<b>5,41</b>	<b>2,22</b>	<b>5,41</b>	<b>9,44</b>	<b>20,01</b>	<b>30,44</b>
<b>IPCA + 6,00%</b>	<b>0,45</b>	<b>5,18</b>	<b>2,17</b>	<b>5,18</b>	<b>9,49</b>	<b>21,07</b>	<b>32,16</b>



**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	3,32	1,77	3,32	7,23	15,60	31,16	50,78	67,62
IRF-M 1+	2,72	8,35	5,62	8,35	19,18	30,24	53,86	81,03	97,12
IRF-M TOTAL	2,16	6,98	4,59	6,98	15,72	26,07	47,21	71,47	88,07
IMA-B 5	1,72	7,28	4,27	7,28	14,65	25,81	40,80	64,65	84,54
IMA-B 5+	5,06	21,12	12,50	21,12	40,78	49,39	70,93	100,22	129,00
IMA-B TOTAL	3,73	15,21	9,15	15,21	28,76	39,31	57,88	84,29	108,81
IMA-GERAL ex-C TOTAL	1,95	7,74	4,69	7,74	15,64	25,19	43,52	65,89	84,84
IMA-GERAL TOTAL	2,00	7,90	4,78	7,90	15,90	25,71	43,59	66,37	85,35
IDKA 2	1,23	6,25	3,68	6,25	13,24	24,54	40,58	64,47	84,83
IDKA 20	6,82	32,70	18,37	32,70	65,92	70,44	99,39	133,95	179,79
CDI	0,47	3,07	1,54	3,07	6,32	14,14	28,80	46,96	64,32

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	4,06	14,88	5,82	14,88	38,76	60,52	95,95	90,22	89,90
IBRX 100	4,10	15,59	6,40	15,59	40,78	61,42	97,57	91,48	92,30
IBRX 50	4,12	14,12	5,30	14,12	37,09	58,45	92,60	84,71	86,47
SMALL CAP	6,99	19,26	10,91	19,26	41,71	61,51	115,68	111,42	68,37
IFIX	2,88	11,67	5,77	11,67	23,57	26,61	60,31	79,81	89,25
Índice Consumo - ICON	4,01	21,36	13,81	21,36	34,17	36,18	49,61	44,93	63,15
Índice Dividendos - IDIV	3,11	18,67	9,64	18,67	47,74	60,82	119,82	110,96	63,17

**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	0,01	2,23	0,71	2,23	3,37	7,91	11,14	20,97	31,73
INPC	0,01	2,45	0,76	2,45	3,31	6,96	9,69	20,11	31,29
IGPM	0,80	4,38	2,17	4,38	6,51	13,88	13,00	26,79	33,88
SELIC	0,47	3,07	1,54	3,07	6,32	14,15	28,84	47,02	64,48

**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	3,95	16,06	2,07	16,06	7,56	40,62	67,34	76,12	161,12
MSCI ACWI	3,44	13,61	1,23	13,61	2,98	30,37	56,51	52,66	112,42
MSCI World	3,52	14,36	1,64	14,36	3,62	31,67	57,31	55,02	117,40

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,31	4,20	1,69	4,20	7,45	16,60	24,88	41,36	60,12
IPCA + 5,00%	0,38	4,69	1,93	4,69	8,47	18,83	28,49	46,84	67,93
IPCA + 5,50%	0,41	4,94	2,05	4,94	8,98	19,95	30,31	49,64	71,95
IPCA + 5,89%	0,44	5,12	2,14	5,12	9,38	20,83	31,75	51,85	75,13
IPCA + 6,00%	0,45	5,18	2,17	5,18	9,49	21,07	32,16	52,47	76,04
INPC + 4,00%	0,31	4,43	1,74	4,43	7,40	15,58	23,26	40,36	59,59
INPC + 6,00%	0,45	5,41	2,22	5,41	9,44	20,01	30,44	51,39	75,46

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

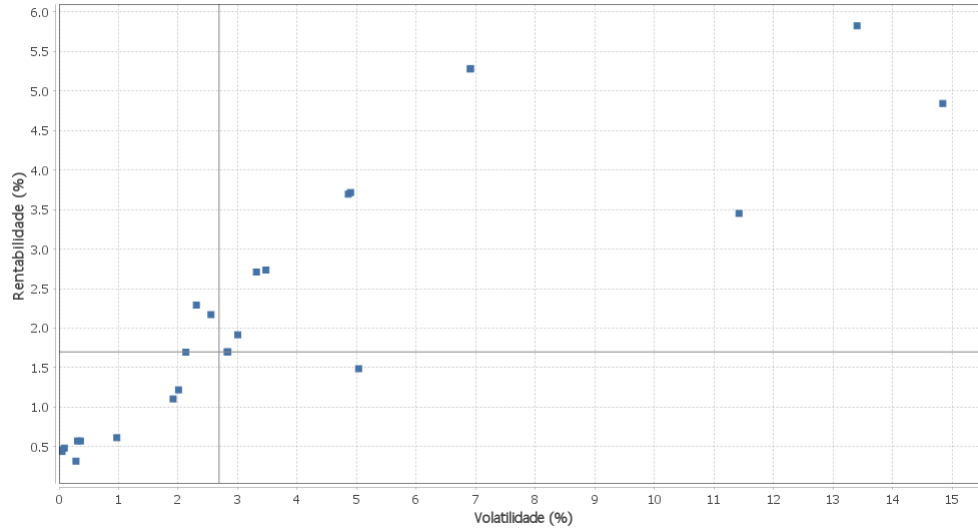
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
	06/06/2019	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	49.833,88	2.563,93108589	19,4365130500
	12/06/2019	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	21.839,14	1.122,58223603	19,4543787500
	21/06/2019	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	820.242,02	0,00	707.222,60567861	1,1598074100
	21/06/2019	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	47.788,32	2.452,93853881	19,4820698700
	24/06/2019	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	1.660,80	85,23097590	19,4858733300
	24/06/2019	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	189.302,21	0,00	32.923,64491711	5,7497342900

**Total**

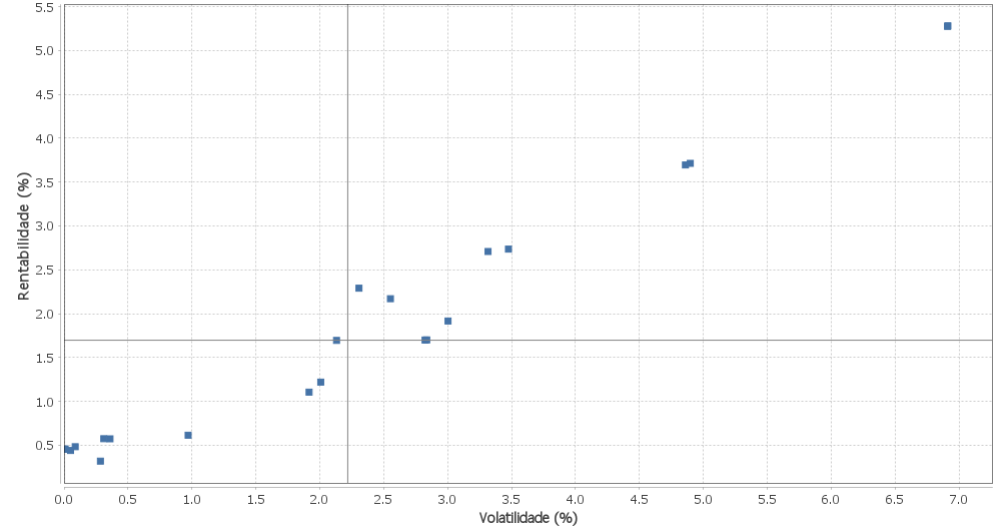
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

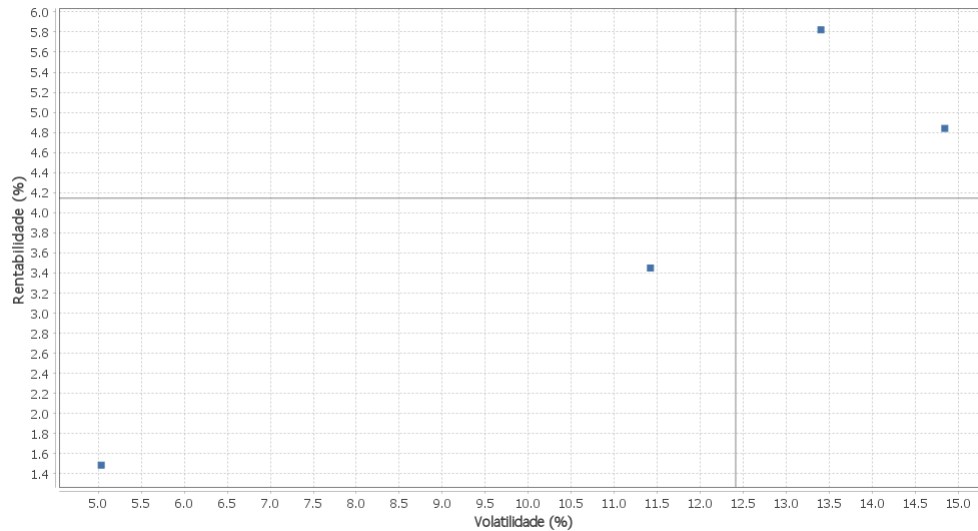
LINHARES - No Mês



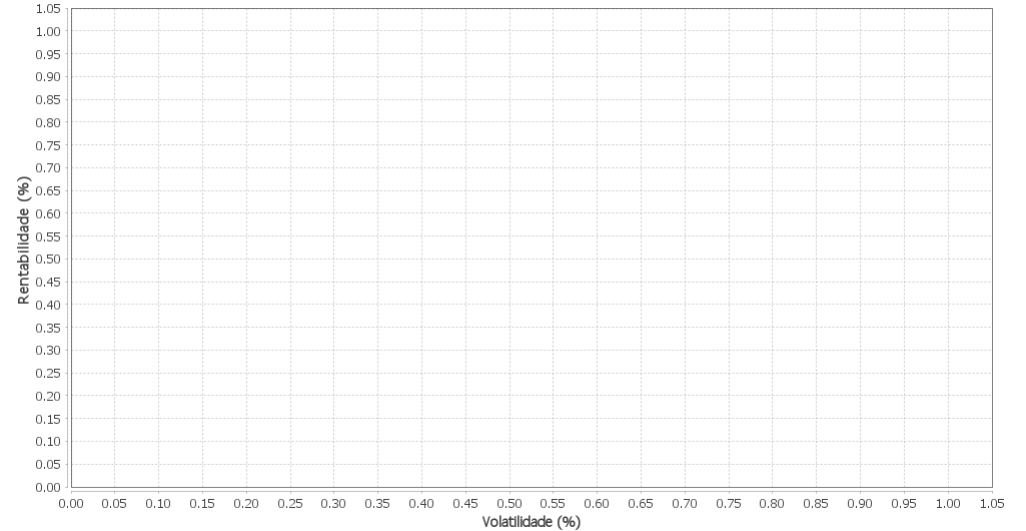
Renda Fixa - No Mês



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\$): 2.667.591,34

Value-At-Risk: 1,01%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,00	-0,00	-2,31	0,45	11.510.704,86	4,34
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,00	-0,00	-1,56	0,46	28.020.930,94	10,56
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,02	-0,00	-0,57	0,44	18.895.464,87	7,12
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,09	0,03	0,00	0,16	0,48	1.084.314,89	0,41
NTN-B 150535 (4,410000%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,28	0,10	-0,00	-0,53	0,32	914.325,16	0,34
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,31	0,12	0,01	0,34	0,57	24.992.486,98	9,42
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,36	0,12	0,00	0,29	0,57	11.197.328,70	4,22
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,97	0,41	0,00	0,15	0,61	827.568,75	0,31
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,92	0,68	0,01	0,33	1,11	5.695.979,79	2,15
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	0,75	0,02	0,37	1,22	8.452.856,38	3,19
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	2,13	0,84	0,04	0,58	1,70	19.014.098,09	7,16
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	2,31	1,42	0,01	0,79	2,29	3.588.353,16	1,35
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,55	1,16	0,04	0,67	2,17	10.869.570,92	4,10
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,82	1,04	0,03	0,44	1,70	8.649.605,27	3,26
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,84	0,99	0,02	0,43	1,70	5.824.399,04	2,19
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,00	1,21	0,01	0,48	1,92	3.875.184,08	1,46
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,32	1,47	0,01	0,68	2,71	2.013.227,93	0,76
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,48	1,90	0,01	0,65	2,73	1.161.839,25	0,44
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,86	2,13	0,18	0,66	3,69	28.935.701,94	10,90
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,90	2,18	0,10	0,66	3,71	15.648.870,14	5,90
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	Artigo 8º III	5,03	2,68	0,01	0,20	1,49	936.465,89	0,35
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	Artigo 7º III, Alínea a	6,91	3,48	0,13	0,70	5,28	15.273.856,82	5,76
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	6,91	3,36	0,24	0,70	5,28	30.408.300,30	11,46
FIA CAIXA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	11,42	6,65	0,02	0,26	3,45	1.572.633,43	0,59
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	13,40	9,42	0,07	0,40	5,82	2.939.772,03	1,11
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	14,85	8,90	0,06	0,29	4,84	3.090.524,40	1,16