



**LDB**  
EMPRESAS

**GUARAPARI - CONSOLIDADO**  
SETEMBRO 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 30.09.2020.

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

65,56%

## 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 150850 (3,650000%)	6,41	0,69	4,34	12.140.281,15	6,19
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>6,41</b>	<b>0,69</b>	<b>4,34</b>	<b>12.140.281,15</b>	<b>6,19</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
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	6,00	-0,66	4,32	178.003,34	0,09	4.983.832.924,90	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	23,29	-5,05	-9,84	3.226.736,25	1,65	288.574.129,48	1,12
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,72	-1,56	-0,93	7.507.458,83	3,83	5.533.318.681,28	0,14
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,79	-1,53	-1,00	5.593.980,52	2,85	5.834.527.804,73	0,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,13	2,97	15.525.740,20	7,92	10.130.144.603,43	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,74	-2,64	-4,82	8.866.163,16	4,52	1.755.979.575,38	0,50
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,88	-0,98	4,03	494.678,93	0,25	3.209.755.140,80	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,08	0,04	4,84	10.389.911,48	5,30	9.208.011.978,57	0,11
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,22	-0,75	1,86	13.871.709,81	7,08	10.452.752.168,75	0,13
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	-0,50	4,53	35.994.280,54	18,36	13.535.810.678,86	0,27
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>6,66</b>	<b>-0,86</b>	<b>2,05</b>	<b>101.648.663,06</b>	<b>51,85</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 ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,82	-1,52	-1,63	12.019.789,23	6,13	183.820.888,05	6,54
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>2,82</b>	<b>-1,52</b>	<b>-1,63</b>	<b>12.019.789,23</b>	<b>6,13</b>		

## Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado")

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	8,22	-0,63	4,58	2.733.750,00	1,39	186.232.441,88	1,47
		<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>	<b>8,22</b>	<b>-0,63</b>	<b>4,58</b>	<b>2.733.750,00</b>	<b>1,39</b>		
		Renda Fixa	5,70	-0,78	2,04	128.542.483,44	65,56		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

27,25%

## Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	44,49	-5,04	-17,78	4.947.956,50	2,52	900.328.465,10	0,55
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVSPA	43,08	-4,69	-18,09	9.489.237,75	4,84	110.541.465,03	8,58
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b>			<b>43,43</b>	<b>-4,81</b>	<b>-18,01</b>	<b>14.437.194,25</b>	<b>7,36</b>		

## 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
BB	BB	BB AÇÕES ENERGIA FI	36,51	-5,09	-15,80	5.073.118,31	2,59	418.612.050,90	1,21
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	38,48	-4,70	-23,62	1.365.756,68	0,70	890.322.162,57	0,15
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	60,10	-8,11	-36,98	880.477,91	0,45	472.017.380,08	0,19
CEF	CEF	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	46,97	-5,18	-18,90	370.516,20	0,19	496.563.544,01	0,07
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	41,38	-2,90	-15,40	7.673.763,72	3,91	578.311.222,57	1,33
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	45,71	-4,06	-14,13	389.145,91	0,20	718.937.900,79	0,05
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	45,33	-2,96	-4,05	8.498.182,88	4,33	157.034.448,33	5,41
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	42,87	-4,38	-21,59	2.017.073,89	1,03	406.655.961,35	0,50
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	41,05	-4,77	-19,95	4.836.894,94	2,47	862.681.891,51	0,56
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,13	-4,93	-17,58	3.490.818,03	1,78	783.577.685,83	0,45
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>40,52</b>	<b>-4,04</b>	<b>-15,47</b>	<b>34.595.748,47</b>	<b>17,65</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	FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	1,73	-0,45	1,41	2.909.261,66	1,48	505.717.833,93	0,58
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>1,73</b>	<b>-0,45</b>	<b>1,41</b>	<b>2.909.261,66</b>	<b>1,48</b>		

## Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	CXCE11B	26,08	1,06	-5,45	1.016.200,00	0,52	147.512.832,39	0,69
RIO BRAVO	VOTORANTIM	RBRD11	60,76	-4,13	-20,73	472.017,62	0,24	150.034.727,27	0,31
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>			<b>145,06</b>	<b>-0,65</b>	<b>-11,33</b>	<b>1.488.217,62</b>	<b>0,76</b>		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			37,46	-3,97	-15,32	53.430.422,00	27,25		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,18%

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	28,45	-1,99	52,76	8.744.666,36	4,46	1.671.279.124,17	0,52
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	28,02	-2,46	46,05	5.339.590,10	2,72	440.169.483,64	1,21
<b>Sub-total Artigo 9º A, III</b>			<b>28,12</b>	<b>-2,17</b>	<b>50,14</b>	<b>14.084.256,46</b>	<b>7,18</b>		
Investimentos no Exterior			28,12	-2,17	50,14	14.084.256,46	7,18		
<b>Total</b>			<b>13,32</b>	<b>-1,76</b>	<b>-0,97</b>	<b>196.057.161,90</b>	<b>100,00</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			ALM	Limite Legal
				Mínimo	Objetivo	Máximo		
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	12.140.281,15	6,19	0,00	6,69	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	101.648.663,06	51,85	0,00	38,65	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	12.019.789,23	6,13	0,00	18,65	40,00	0,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.733.750,00	1,39	0,00	1,39	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>128.542.483,44</b>	<b>65,56</b>					100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	14.437.194,25	7,36	0,00	2,39	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	34.595.748,47	17,65	0,00	18,97	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	2.909.261,66	1,48	0,00	1,54	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.488.217,62	0,76	0,00	0,74	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>53.430.422,00</b>	<b>27,25</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	14.084.256,46	7,18	0,00	5,14	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>14.084.256,46</b>	<b>7,18</b>					10,00



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,69 440,88	4,34 190,75	1,92 375,52	2,25 180,18	2,56 72,38	83.439,03	516.380,36
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,86 -549,84	2,05 90,21	0,33 65,05	3,72 297,38	4,12 116,15	-886.398,17	2.165.680,08
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-1,52 -968,06	-1,63 -71,67	-0,33 -63,89	-0,92 -73,37	1,86 52,59	-185.467,57	-160.428,84
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,63 -401,29	4,58 201,30	1,00 194,38	6,07 485,17	7,34 207,24	-17.329,50	119.736,00
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,81 -0,01	-18,01 0,18	-0,46 0,02	29,25 -0,31	-9,31 0,38	-729.322,02	-3.036.446,74
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,04 0,76	-15,47 2,72	-0,16 0,32	27,72 -1,83	-4,09 5,59	-1.456.834,62	-5.964.403,19
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,45 4,35	1,41 19,61	-0,37 0,11	0,25 -29,31	2,97 12,65	-13.056,04	40.586,61
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-0,65 4,15	-11,33 6,87	-5,17 -4,70	28,47 -1,09	-1,59 8,09	-9.647,51	-211.785,36
Artigo 9º A, III % do CDI	-2,17 -1.383,78	50,14 2.203,67	14,20 2.772,86	40,88 3.268,93	59,44 1.677,70	-312.720,69	4.703.690,16
<b>GUARAPARI - CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>-3.527.337,09</b>	<b>-1.826.990,92</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 150850 (3,650000%)	12.056.842,12	0,00	0,00	0,00	12.140.281,15	83.439,03	516.380,36
					12.140.281,15	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	3.398.280,68	0,00	0,00	0,00	3.226.736,25	-171.544,43	-233.228,30
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	13.976.892,86	0,00	0,00	0,00	13.871.709,81	-105.183,05	252.810,46

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	7.626.078,30	0,00	0,00	0,00	7.507.458,83	-118.619,47	-64.933,97
BB PREV RF IRF-M	179.181,29	0,00	0,00	0,00	178.003,34	-1.177,95	125.106,35
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1.900,23
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.386.097,20	0,00	0,00	0,00	10.389.911,48	3.814,28	479.319,66
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.106.857,59	0,00	0,00	0,00	8.866.163,16	-240.694,43	-449.018,99
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.681.089,68	0,00	0,00	0,00	5.593.980,52	-87.109,16	-56.447,21
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.810.508,14	0,00	-305.890,42	0,00	15.525.740,20	21.122,48	502.288,56
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	504.572,55	0,00	-5.000,00	0,00	494.678,93	-4.893,62	19.678,93
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	36.239.399,99	0,00	-63.006,63	0,00	35.994.280,54	-182.112,82	1.588.204,36
					101.648.663,06	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	12.205.256,80	0,00	0,00	0,00	12.019.789,23	-185.467,57	-160.428,84
					12.019.789,23	0,00	0,00

## Artigo 7º VII, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	2.751.079,50	0,00	0,00	0,00	2.733.750,00	-17.329,50	119.736,00
					2.733.750,00	0,00	0,00

## Artigo 8º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	5.210.815,75	0,00	0,00	0,00	4.947.956,50	-262.859,25	-940.992,29
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVSPA	9.955.700,52	0,00	0,00	0,00	9.489.237,75	-466.462,77	-2.095.454,45
					14.437.194,25	0,00	0,00

## Artigo 8º II, Alínea a

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	8.757.097,18	0,00	0,00	0,00	8.498.182,88	-258.914,30	-131.155,04
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	2.109.431,09	0,00	0,00	0,00	2.017.073,89	-92.357,20	-555.459,51
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1.433.057,78	0,00	0,00	0,00	1.365.756,68	-67.301,10	-422.410,31
BB AÇÕES ENERGIA FI	5.344.980,50	0,00	0,00	0,00	5.073.118,31	-271.862,19	-952.160,86
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	5.079.194,74	0,00	0,00	0,00	4.836.894,94	-242.299,80	-1.205.523,84
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	958.138,84	0,00	0,00	0,00	880.477,91	-77.660,93	-475.787,96
FIA CAIXA CONSUMO	405.602,00	0,00	0,00	0,00	389.145,91	-16.456,09	-30.854,09
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	390.763,44	0,00	0,00	0,00	370.516,20	-20.247,24	-49.483,80
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	3.671.719,45	0,00	0,00	0,00	3.490.818,03	-180.901,42	-744.791,18
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	7.902.598,07	0,00	0,00	0,00	7.673.763,72	-228.834,35	-1.396.776,60
					34.595.748,47	0,00	0,00

## Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	2.922.317,70	0,00	0,00	0,00	2.909.261,66	-13.056,04	40.586,61
					2.909.261,66	0,00	0,00

## Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CXCE11B	1.013.500,00	0,00	0,00	0,00	7.993,70	1.016.200,00	10.693,70	-66.921,76
RBRD11	492.660,38	0,00	0,00	0,00	301,55	472.017,62	-20.341,21	-144.863,60
						1.488.217,62	0,00	0,00

## Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	5.474.368,56	0,00	0,00	0,00	5.339.590,10	-134.778,46	1.683.580,42
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	8.922.608,59	0,00	0,00	0,00	8.744.666,36	-177.942,23	3.020.109,74
					14.084.256,46	0,00	0,00

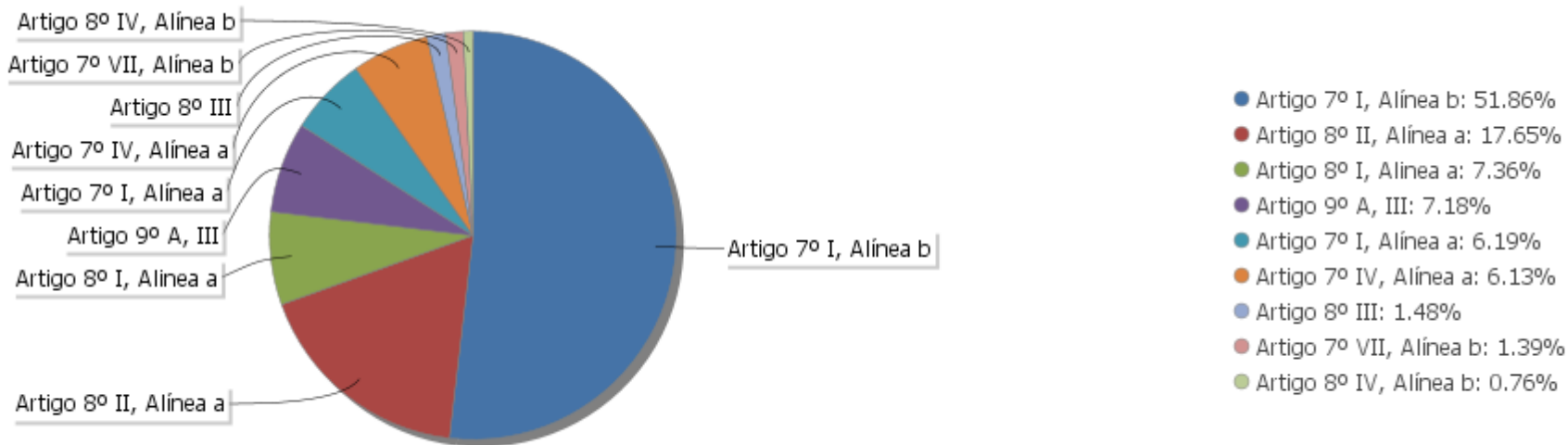
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

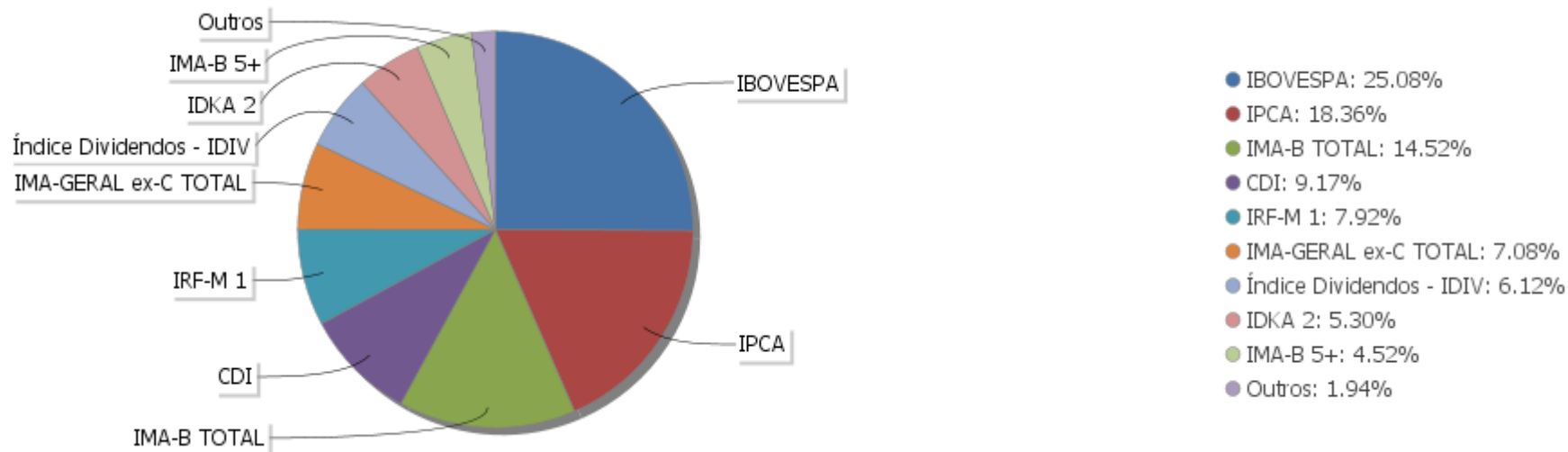
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	159.417.221,18	81,31	159.417.221,18	81,31
de 31 a 365 dias	24.499.659,57	12,50	183.916.880,75	93,81
acima de 365 dias	12.140.281,15	6,19	196.057.161,90	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

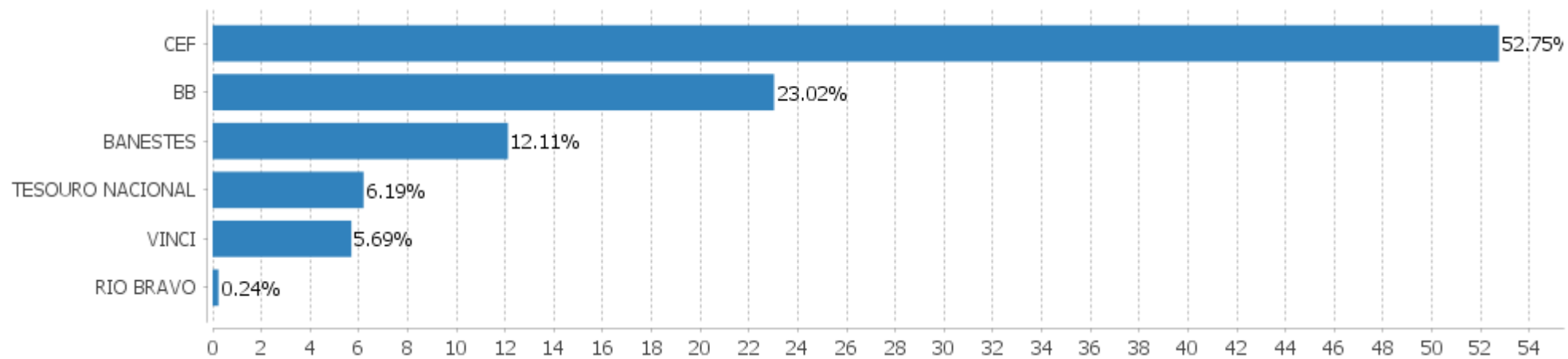


Alocação Por Estratégia



## 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	0,77	-2,12	-9,27	3,74	2,00	3,51	3,38	-0,51	-1,76				-0,97
INPC + 5,87%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,96	0,84	1,35				6,48
p.p. indexador	0,08	-2,70	-9,95	3,52	1,79	2,73	2,41	-1,35	-3,12				-7,45
2019	2,55	0,43	0,66	1,14	1,49	2,59	1,23	0,29	2,11	1,83	0,00	3,04	18,74
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	1,68	-0,58	-0,56	0,05	0,83	2,14	0,60	-0,34	1,67	1,25	-1,00	1,32	7,97
2018	1,29	0,58	1,16	0,41	-1,31	0,30	1,07	-0,09	0,62	2,66	1,08	0,41	8,45
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	0,55	-0,02	0,61	-0,29	-2,22	-1,62	0,30	-0,63	-0,12	1,75	0,86	-0,19	-1,14
2017	1,21	1,17	1,22	0,80	-0,24	1,39	1,86	1,05	1,01	0,45	0,10	0,85	11,41
INPC + 6,00%	0,93	0,66	0,85	0,50	0,87	0,19	0,66	0,50	0,44	0,86	0,64	0,72	8,12
p.p. indexador	0,28	0,51	0,36	0,30	-1,11	1,21	1,20	0,55	0,56	-0,41	-0,54	0,13	3,30

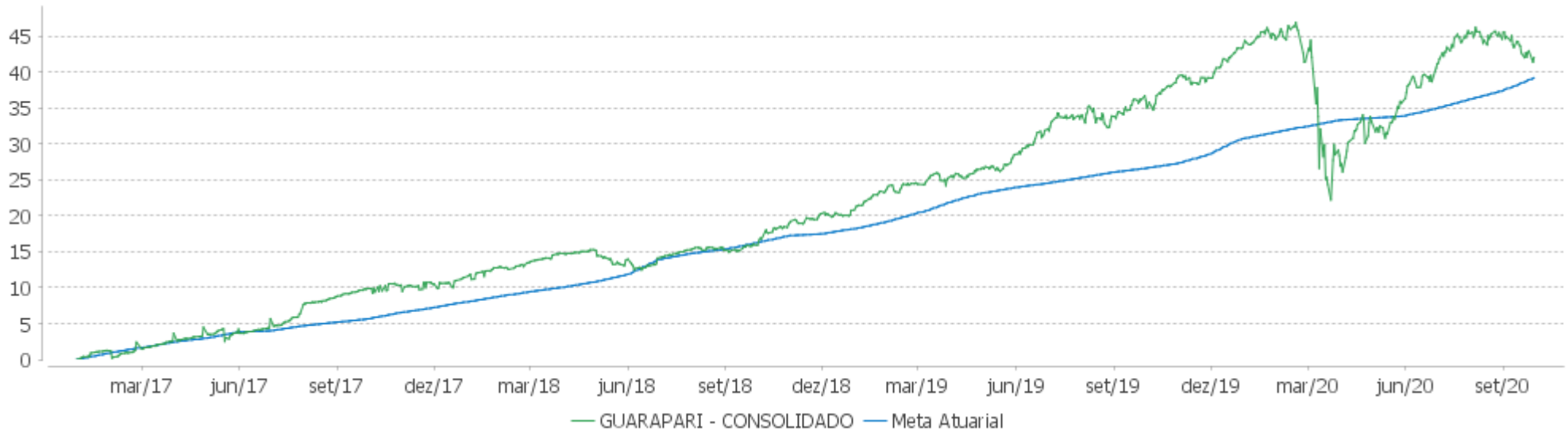
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

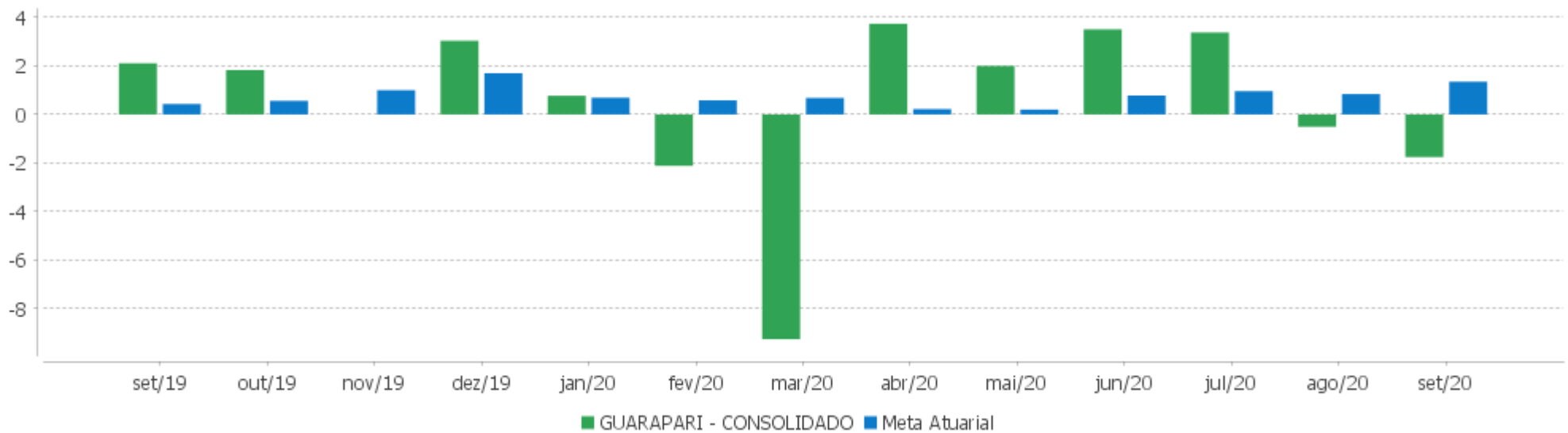
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	27	60,00	03 meses	1,04	3,19	-2,15	6,73
Meses abaixo - Meta Atuarial	18	40,00	06 meses	10,66	4,43	6,23	8,88
			12 meses	3,91	10,02	-6,11	13,32
			24 meses	22,53	20,00	2,53	9,86
Maior rentabilidade da Carteira	3,74	2020-04	36 meses	29,33	32,17	-2,84	8,36
Menor rentabilidade da Carteira	-9,27	2020-03	Desde 30/12/2016	42,09	39,76	2,33	7,75

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 IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,98 -0,06	5,16 -0,24	-0,68 -0,08	3,70 -0,20	7,33 -0,28	29,68 -0,32	35,97 -0,97
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-5,05 -3,54	-9,84 -9,12	-1,55 -2,51	3,14 -2,83	-7,24 -9,35	33,89 -0,25	32,47 -5,09
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,53 -0,02	-1,00 -0,28	0,89 -0,07	5,84 -0,12	1,68 -0,43	33,36 -0,78	36,41 -1,16
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,75 -0,04	1,86 -0,10	0,10 -0,15	3,07 0,08	3,70 -0,19	21,50 0,39	27,56 0,18
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,50 -1,14	4,53 3,19	-0,09 -1,34	3,18 2,37	6,41 3,27	25,88 19,76	33,17 22,25
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,04 0,02	4,84 -0,57	1,66 -0,33	5,27 -0,15	7,35 -0,65	20,53 -1,35	29,77 -2,49
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,56 -0,04	-0,93 -0,21	0,83 -0,13	5,77 -0,20	1,83 -0,28	33,39 -0,75	36,49 -1,07
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,13 -0,02	2,97 -0,15	0,47 -0,04	1,57 -0,10	4,34 -0,21	11,93 -0,39	19,28 -0,63
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,66 -0,10	4,32 -0,30	-0,35 -0,11	2,90 -0,25	6,21 -0,35	23,82 -0,67	30,66 -0,98
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-2,64 -0,04	-4,82 -0,27	0,65 -0,10	6,56 -0,22	-2,10 -0,43	40,97 -1,45	39,57 -1,69
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,63 -1,76	4,58 -1,27	1,00 -1,78	6,07 2,28	7,34 -1,98	25,93 6,72	33,28 1,29
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	-1,52 -968,06	-1,63 -71,67	-0,33 -63,89	-0,92 -73,37	1,86 52,59	22,52 224,33	
NTN-B 150850 (3,650000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,69 2,20	4,34 5,06	1,92 0,96	2,25 -3,71	2,56 0,46	9,32 -24,82	
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-4,69 0,11	-18,09 0,11	-0,46 0,02	28,86 -0,70	-9,73 -0,05	18,23 -1,00	25,46 -1,88
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	-5,04 -0,25	-17,78 0,41	-0,39 0,09	30,27 0,71	-8,20 1,48	24,95 5,72	26,70 -0,63
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-0,45 4,35	1,41 19,61	-0,37 0,11	0,25 -29,31	2,97 12,65	15,39 -3,84	
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	-2,96	-4,05	4,70	48,11	5,50	60,57	61,54

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,67	17,03	8,01	33,33	15,30	22,72	31,05
<b>BB AÇÕES ENERGIA FI</b> % do CDI	<b>-5,09</b> -3.240,28	<b>-15,80</b> -694,50	<b>-3,96</b> -773,99	<b>15,11</b> 1.208,29	<b>-5,46</b> -154,05	<b>66,13</b> 658,80	<b>63,41</b> 365,32
<b>FIA CAIXA CONSUMO</b> Var. Índice Consumo - ICON p.p.	<b>-4,06</b> -0,10	<b>-10,05</b> -0,79	<b>1,41</b> -0,42	<b>40,64</b> -1,37	<b>-1,18</b> -0,14	<b>50,69</b> -2,34	<b>22,40</b> -5,50
<b>FIA CAIXA INFRAESTRUTURA</b> Var. IBOVESPA p.p.	<b>-5,18</b> -0,39	<b>-16,85</b> 1,34	<b>-0,85</b> -0,38	<b>30,77</b> 1,21	<b>-5,21</b> 4,47	<b>60,72</b> 41,49	<b>44,82</b> 17,48
<b>BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA</b> Var. IBOVESPA p.p.	<b>-4,38</b> 0,42	<b>-21,59</b> -3,40	<b>-0,62</b> -0,14	<b>27,14</b> -2,42	<b>-12,24</b> -2,56	<b>12,08</b> -7,15	<b>22,35</b> -4,99
<b>FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS</b> Var. IBOVESPA p.p.	<b>-2,90</b> 1,90	<b>-15,40</b> 2,80	<b>0,62</b> 1,10	<b>29,23</b> -0,33	<b>-0,02</b> 9,66	<b>56,46</b> 37,23	<b>48,61</b> 21,27
<b>FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS</b> Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	<b>-4,93</b> -0,30	<b>-17,58</b> 3,49	<b>-0,96</b> 2,35	<b>19,42</b> 4,64	<b>-6,98</b> 2,83	<b>43,54</b> 5,70	<b>31,29</b> 0,79
<b>FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL</b> % do CDI	<b>-8,11</b> -5.163,62	<b>-36,98</b> -1.625,12	<b>-9,58</b> -1.871,47	<b>15,62</b> 1.249,23	<b>-21,21</b> -598,63	<b>39,66</b> 395,07	<b>9,57</b> 55,13
<b>BB AÇÕES DIVIDENDOS</b> Var. IBOVESPA p.p.	<b>-4,70</b> 0,10	<b>-23,62</b> -5,43	<b>-1,71</b> -1,24	<b>18,99</b> -10,57	<b>-16,46</b> -6,77	<b>13,75</b> -5,49	<b>13,73</b> -13,61
<b>BB AÇÕES VALOR FIC FIA</b> Var. IBOVESPA p.p.	<b>-4,77</b> 0,03	<b>-19,95</b> -1,76	<b>-2,30</b> -1,82	<b>22,29</b> -7,27	<b>-9,26</b> 0,42	<b>41,30</b> 22,06	
<b>CXCE11B</b> Var. IBOVESPA p.p.	<b>1,06</b> 5,85	<b>-5,45</b> 12,75	<b>2,95</b> 3,43	<b>22,36</b> -7,19	<b>14,50</b> 24,18	<b>43,08</b> 23,84	<b>23,76</b> -3,58
<b>RBRD11</b> Var. IBOVESPA p.p.	<b>-4,13</b> 0,66	<b>-20,73</b> -2,53	<b>-19,96</b> -19,48	<b>37,82</b> 8,26	<b>-21,95</b> -12,26	<b>10,04</b> -9,19	<b>20,59</b> -6,74
<b>FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I</b> Var. IBOVESPA p.p.	<b>-1,99</b> 2,80	<b>52,76</b> 70,95	<b>14,98</b> 15,46	<b>43,04</b> 13,48	<b>61,21</b> 70,90	<b>70,33</b> 51,09	<b>154,87</b> 127,53
<b>BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I</b> Var. IBOVESPA p.p.	<b>-2,46</b> 2,33	<b>46,05</b> 64,24	<b>12,94</b> 13,41	<b>37,50</b> 7,94	<b>56,62</b> 66,30	<b>52,67</b> 33,44	<b>131,20</b> 103,86
<b>GUARAPARI - CONSOLIDADO</b> Var. INPC + 5,87% p.p.	<b>-1,76</b> -3,12	<b>-0,97</b> -7,45	<b>1,04</b> -2,15	<b>10,66</b> 6,23	<b>3,91</b> -6,08	<b>22,53</b> 2,72	<b>29,33</b> -2,47
<b>CDI</b>	<b>0,16</b>	<b>2,28</b>	<b>0,51</b>	<b>1,25</b>	<b>3,54</b>	<b>10,04</b>	<b>17,36</b>
<b>IBOVESPA</b>	<b>-4,80</b>	<b>-18,20</b>	<b>-0,48</b>	<b>29,56</b>	<b>-9,68</b>	<b>19,23</b>	<b>27,34</b>
<b>INPC + 6,00%</b>	<b>1,36</b>	<b>6,58</b>	<b>3,22</b>	<b>4,50</b>	<b>10,12</b>	<b>20,11</b>	<b>32,29</b>
<b>IPCA + 6,00%</b>	<b>1,13</b>	<b>5,85</b>	<b>2,78</b>	<b>3,79</b>	<b>9,32</b>	<b>19,21</b>	<b>31,99</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	0,15	3,12	0,51	1,66	4,54	12,32	19,91	35,08	55,52
IRF-M 1+	-0,91	5,40	-0,59	3,90	7,61	30,00	36,94	63,26	107,88
IRF-M TOTAL	-0,56	4,62	-0,24	3,15	6,56	24,50	31,64	54,61	88,92
IMA-B 5	-0,12	4,51	1,30	5,11	7,24	23,75	31,84	49,57	77,74
IMA-B 5+	-2,60	-4,56	0,75	6,78	-1,67	42,42	41,26	65,69	123,18
IMA-B TOTAL	-1,51	-0,72	0,96	5,97	2,11	34,14	37,56	59,25	104,41
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,71	1,96	0,25	2,99	3,90	21,11	27,38	46,60	78,48
IMA-GERAL TOTAL	-0,60	2,41	0,53	3,43	4,35	21,85	28,42	47,44	79,98
IDKA 2	0,02	5,41	1,99	5,41	8,00	21,88	32,26	50,33	78,04
IDKA 20	-4,30	-11,82	0,58	7,11	-8,89	56,79	46,43	76,85	176,44
CDI	0,16	2,28	0,51	1,25	3,54	10,04	17,36	30,88	49,38

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-4,80	-18,20	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34	62,08	109,95
IBRX 100	-4,58	-17,42	-0,04	30,33	-8,59	23,26	30,47	66,26	112,57
IBRX 50	-4,62	-18,06	-0,37	31,30	-10,02	16,09	24,57	58,13	99,89
SMALL CAP	-5,44	-18,93	2,27	35,50	-1,78	54,49	42,68	101,86	167,19
IFIX	0,46	-12,59	-0,41	12,06	4,12	30,92	25,84	53,90	99,57
Índice Consumo - ICON	-3,96	-9,26	1,83	42,00	-1,04	53,03	27,90	53,75	79,98
Índice Dividendos - IDIV	-4,63	-21,08	-3,31	14,78	-9,81	37,85	30,49	85,32	152,90

**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	0,64	1,34	1,24	0,81	3,14	6,12	10,92	13,74	23,38
INPC	0,87	2,04	1,68	1,49	3,89	6,93	11,17	12,99	23,33
IGPM	4,34	14,40	9,59	12,51	17,94	21,91	34,14	32,20	46,30
SELIC	0,16	2,28	0,51	1,25	3,54	10,04	17,37	30,92	49,44

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,97	4,35	2,27	2,81	7,26	14,76	24,69	32,93	49,97
IPCA + 5,00%	1,05	5,10	2,53	3,30	8,29	16,97	28,31	38,09	57,28
IPCA + 5,50%	1,09	5,47	2,65	3,54	8,81	18,09	30,14	40,72	61,04
IPCA + 5,89%	1,12	5,76	2,75	3,74	9,21	18,96	31,58	42,80	64,03
IPCA + 6,00%	1,13	5,85	2,78	3,79	9,32	19,21	31,99	43,39	64,88
INPC + 4,00%	1,20	5,07	2,71	3,50	8,04	15,63	24,98	32,05	49,91
INPC + 6,00%	1,36	6,58	3,22	4,50	10,12	20,11	32,29	42,44	64,81

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

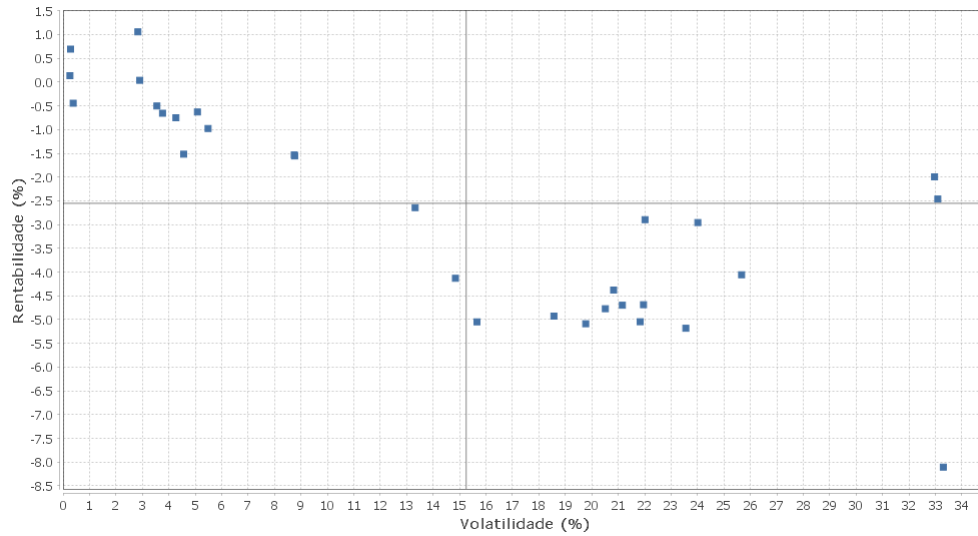
## Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
102	11/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.000,00	1.971,14014294	2,5366030000
104	24/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	170.000,00	65.469,17133744	2,5966420000
103	24/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	135.890,42	52.333,13641234	2,5966420000
106	24/09/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	63.006,63	42.301,00645660	1,4894830000
<b>Total</b>						

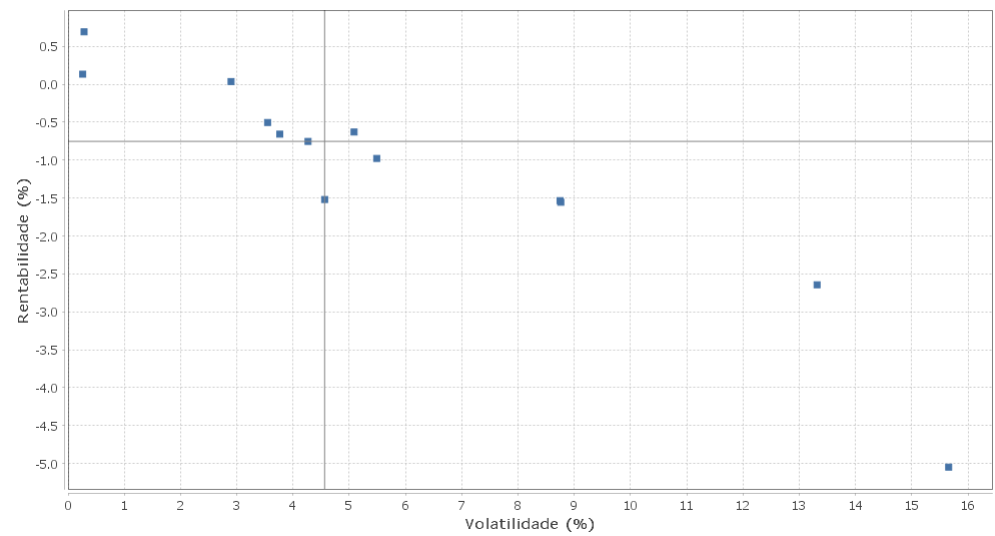
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

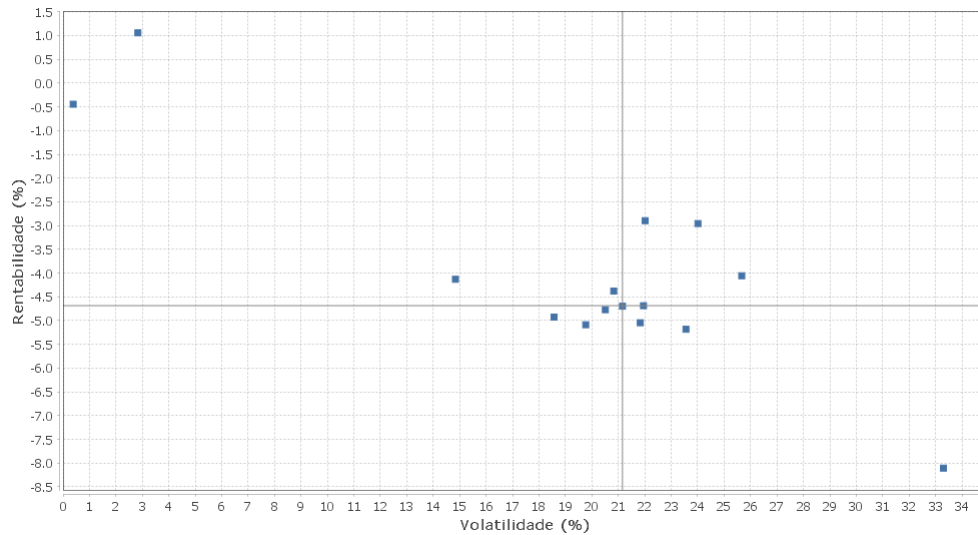
GUARAPARI - CONSOLIDADO - No Mês



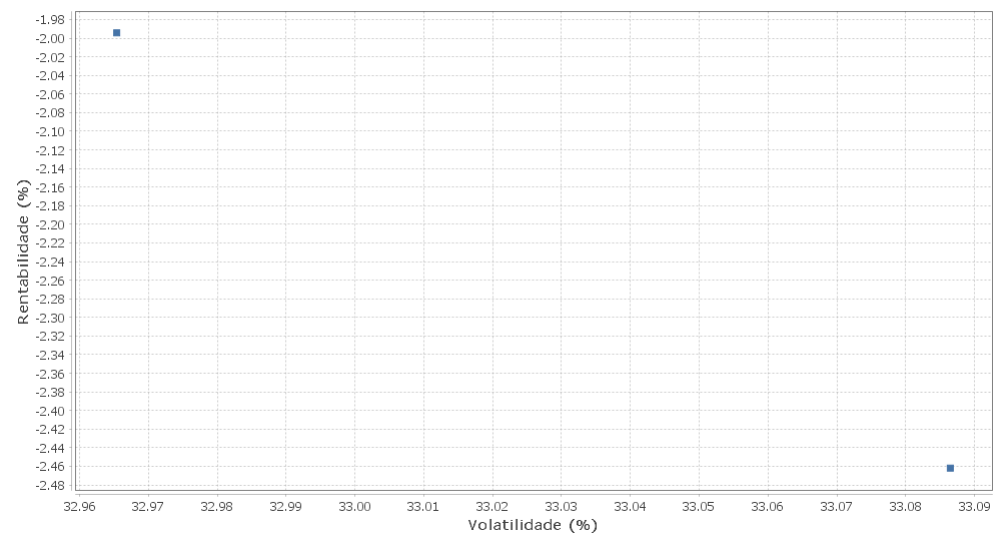
Renda Fixa - No Mês



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\$): 6.774.507,56

Value-At-Risk: 3,46%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,26	0,14	0,01	-0,09	0,13	15.525.740,20	7,92
NTN-B 150850 (3,650000%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,28	0,13	-0,00	1,88	0,69	12.140.281,15	6,19
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	Artigo 8º III	0,38	0,16	0,00	-1,57	-0,45	2.909.261,66	1,48
CXCE11B	Artigo 8º IV, Alínea b	2,83	3,26	-0,00	0,32	1,06	1.016.200,00	0,52
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,90	1,03	0,03	-0,04	0,04	10.389.911,48	5,30
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,55	1,33	0,17	-0,19	-0,50	35.994.280,54	18,36
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,76	1,34	0,00	-0,22	-0,66	178.003,34	0,09
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,27	1,43	0,07	-0,21	-0,75	13.871.709,81	7,08
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	4,56	1,15	0,01	-0,37	-1,52	12.019.789,23	6,13
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	Artigo 7º VII, Alínea b	5,08	1,75	0,02	-0,15	-0,63	2.733.750,00	1,39
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,49	1,97	0,00	-0,21	-0,98	494.678,93	0,25
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	8,75	3,24	0,07	-0,19	-1,53	5.593.980,52	2,85
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	8,76	3,22	0,09	-0,20	-1,56	7.507.458,83	3,83
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	13,32	5,13	0,17	-0,21	-2,64	8.866.163,16	4,52
RBRD11	Artigo 8º IV, Alínea b	14,84	0,49	0,00	-0,29	-4,13	472.017,62	0,24
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	15,66	5,47	-0,00	-0,33	-5,05	3.226.736,25	1,65
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	18,57	10,57	0,18	-0,27	-4,93	3.490.818,03	1,78
BB AÇÕES ENERGIA FI	Artigo 8º II, Alínea a	19,77	12,39	0,27	-0,27	-5,09	5.073.118,31	2,59
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,51	10,43	0,24	-0,24	-4,77	4.836.894,94	2,47
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,83	10,55	0,10	-0,22	-4,38	2.017.073,89	1,03
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	21,16	11,35	0,07	-0,23	-4,70	1.365.756,68	0,70
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	21,83	11,24	0,27	-0,24	-5,04	4.947.956,50	2,52
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	21,95	11,05	0,50	-0,22	-4,69	9.489.237,75	4,84
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	22,01	12,43	0,45	-0,14	-2,90	7.673.763,72	3,91
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	Artigo 8º II, Alínea a	23,55	11,87	0,02	-0,23	-5,18	370.516,20	0,19
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	24,01	11,94	0,47	-0,13	-2,96	8.498.182,88	4,33
FIA CAIXA CONSUMO	Artigo 8º II, Alínea a	25,66	11,82	0,02	-0,16	-4,06	389.145,91	0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	32,97	12,73	0,11	-0,07	-1,99	8.744.666,36	4,46

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	33,09	12,51	0,07	-0,08	-2,46	5.339.590,10	2,72
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	Artigo 8º II, Alínea a	33,30	19,03	0,07	-0,25	-8,11	880.477,91	0,45