



**LDB**  
EMPRESAS

**COTIA**  
JUNHO 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 03.08.2020.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Posição de Ativos e Enquadramento

## RENDA FIXA

89,24%

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-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,53	0,26	2,45	60.536.123,11	8,14	7.792.694.548,07	0,78
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	14,14	2,08	-0,67	8.321.612,65	1,12	1.203.949.182,72	0,69
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,40	2,02	-1,75	32.204.560,29	4,33	5.526.503.185,82	0,58
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,47	2,03	-1,88	28.335.574,17	3,81	5.979.262.081,07	0,47
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,26	2,48	145.984.873,64	19,64	11.257.382.974,77	1,30
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	1,10	3,04	129.179.023,87	17,38	8.746.335.681,60	1,48
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,10	1,21	2,88	34.834.261,77	4,69	6.212.458.601,64	0,56
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	4,01	1,18	3,12	56.109.726,60	7,55	7.740.606.629,29	0,72
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,96	0,75	4,63	102.704.139,78	13,81	12.211.119.756,17	0,84
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>4,04</b>	<b>0,87</b>	<b>2,27</b>	<b>598.209.895,88</b>	<b>80,47</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
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	14,21	1,99	-0,34	4.183.382,99	0,56	433.601.892,28	0,96
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,30	0,24	1,37	40.578.711,24	5,46	5.172.945.706,81	0,78
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,26	1,37	15.295.440,04	2,06	2.439.958.346,20	0,63
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,07	0,13	1,24	396.753,50	0,05	1.768.065.678,44	0,02
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,67	0,44	2,27	4.777.588,33	0,64	5.170.951.886,47	0,09
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>0,89</b>	<b>0,37</b>	<b>1,34</b>	<b>65.231.876,10</b>	<b>8,77</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>3,68</b>	<b>0,82</b>	<b>2,18</b>	<b>663.441.771,98</b>	<b>89,24</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

8,60%

## 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
CEF	CEF	FIA BRASIL IBX-50	44,49	9,45	-18,44	8.706.924,95	1,17	895.832.942,84	0,97
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	43,93	8,89	-17,46	11.021.849,12	1,48	828.382.101,16	1,33
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b>			<b>44,18</b>	<b>9,14</b>	<b>-17,93</b>	<b>19.728.774,07</b>	<b>2,65</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 DIVIDENDOS	37,97	6,59	-22,29	8.852.741,49	1,19	907.675.512,87	0,98
SAFRA	SAFRA	SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	39,44	11,52	-18,21	4.758.333,06	0,64	247.039.473,93	1,93
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	40,99	9,33	-15,92	10.479.280,01	1,41	529.679.544,23	1,98
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	38,70	4,58	-16,79	10.768.459,34	1,45	799.344.501,83	1,35
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	42,89	9,28	-22,25	2.996.730,10	0,40	3.271.734.214,80	0,09
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>39,22</b>	<b>7,55</b>	<b>-18,55</b>	<b>37.855.544,00</b>	<b>5,09</b>		

## Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO FI LP	3,15	0,46	0,93	6.329.237,80	0,85	476.427.633,26	1,33
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>3,15</b>	<b>0,46</b>	<b>0,93</b>	<b>6.329.237,80</b>	<b>0,85</b>		
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>			<b>36,78</b>	<b>7,28</b>	<b>-17,03</b>	<b>63.913.555,87</b>	<b>8,60</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,16%

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	26,27	4,37	32,85	16.084.886,61	2,16	1.181.944.568,52	1,36
<b>Sub-total Artigo 9º A, III</b>			<b>26,27</b>	<b>4,37</b>	<b>32,85</b>	<b>16.084.886,61</b>	<b>2,16</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>26,27</b>	<b>4,37</b>	<b>32,85</b>	<b>16.084.886,61</b>	<b>2,16</b>		
<b>Total</b>						<b>743.440.214,46</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	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	598.209.895,88	80,47	0,00	55,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	65.231.876,10	8,77	0,00	15,00	30,00	40,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>663.441.771,98</b>	<b>89,24</b>				
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	19.728.774,07	2,65	0,00	7,00	15,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	37.855.544,00	5,09	0,00	10,00	15,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	6.329.237,80	0,85	0,00	5,00	10,00	10,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>63.913.555,87</b>	<b>8,60</b>				
<b>Investimentos no Exterior</b>							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	16.084.886,61	2,16	0,00	3,00	5,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>16.084.886,61</b>	<b>2,16</b>				

## 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	0,87 408,01	2,27 129,20	2,83 384,92	2,27 129,20	6,90 149,84	5.135.675,57	13.239.203,01
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,37 173,82	1,34 76,48	0,95 129,07	1,34 76,48	4,28 93,00	242.460,93	889.982,27
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	9,14 0,39	-17,93 -0,12	30,98 0,80	-17,93 -0,12	-5,38 0,48	1.644.068,99	-3.284.309,01
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	7,55 -1,20	-18,55 -0,75	23,90 -6,28	-18,55 -0,75	-3,63 2,22	2.659.089,68	-7.652.766,20
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,46 -8,29	0,93 18,73	1,74 -28,44	0,93 18,73	5,64 11,50	29.156,80	64.731,67
Artigo 9º A, III % do CDI	4,37 2.057,88	32,85 1.872,61	24,40 3.320,23	32,85 1.872,61	54,59 1.185,93	668.627,36	3.779.261,14
						10.379.079,33	7.036.102,88

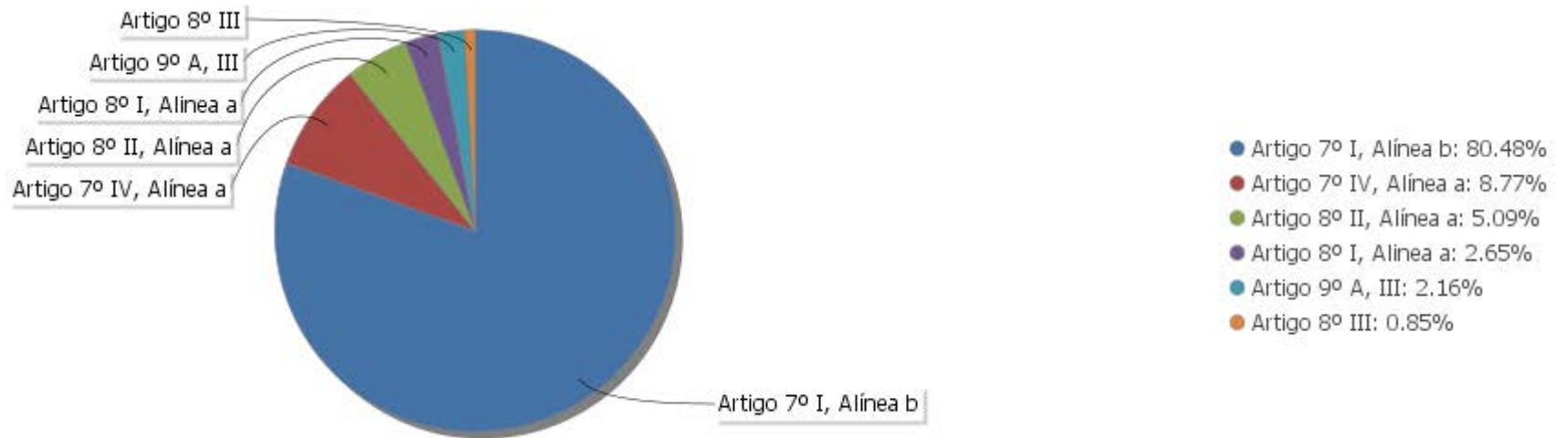
## Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	719.195.745,01	96,74	719.195.745,01	96,74
de 31 a 364 dias	24.244.469,45	3,26	743.440.214,46	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	743.440.214,46	100,00

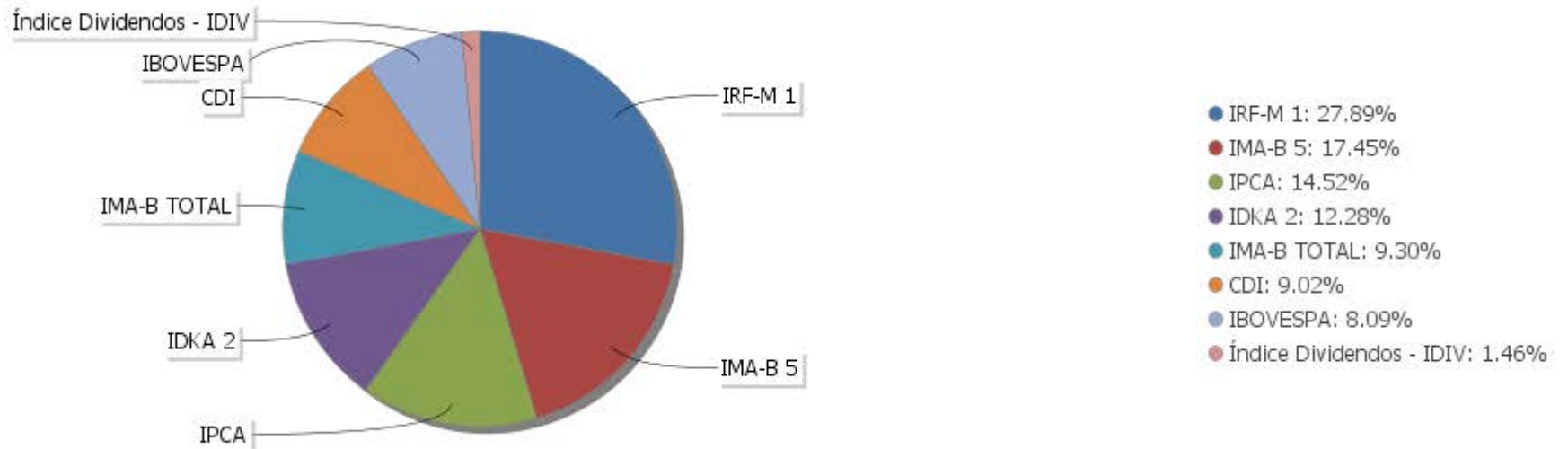


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



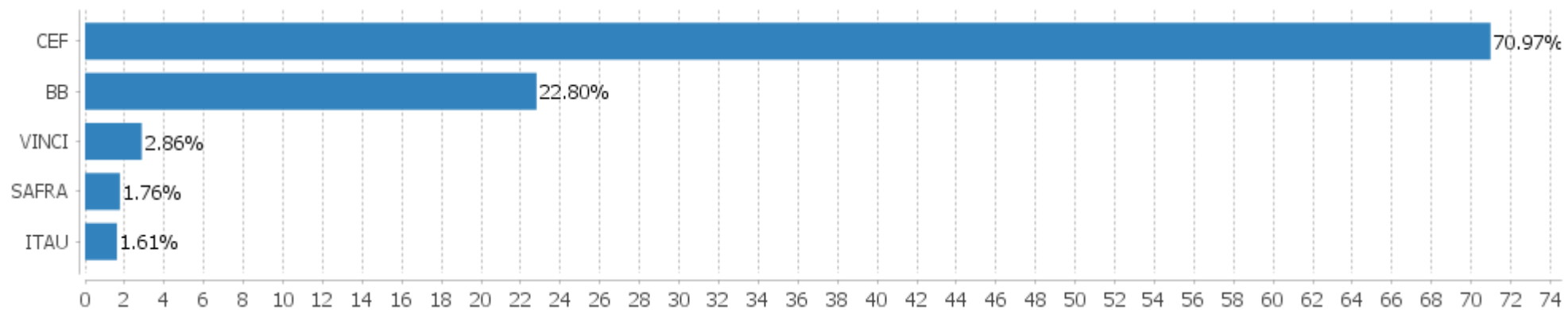
Alocação Por Estratégia





EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2020	0,49	-0,32	-3,56	1,40	1,62	1,41							0,95
IPCA + 6%	0,72	0,67	0,58	0,15	0,08	0,75							2,99
p.p. indexador	-0,23	-0,99	-4,14	1,24	1,54	0,67							-2,03
2019	1,23	0,48	0,57	0,84	0,95	1,23	0,79	0,30	1,39	1,36	-0,05	1,42	11,03
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	0,40	-0,41	-0,62	-0,22	0,31	0,78	0,07	-0,32	0,94	0,72	-1,02	-0,23	0,44
2018	0,86	0,51	0,95	0,49	-0,51	0,40	1,00	0,18	0,69	1,76	0,42	0,86	7,85
IPCA + 6%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	0,06	-0,23	0,37	-0,22	-1,40	-1,35	0,15	-0,27	-0,23	0,80	0,16	0,24	-2,07
2017	1,58	2,23	1,12	0,32	-0,10	0,50	2,52	1,12	1,18	0,19	-0,06	0,55	11,68
IPCA + 6%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	0,68	1,48	0,33	-0,23	-0,92	0,24	1,79	0,39	0,55	-0,72	-0,80	-0,35	2,64

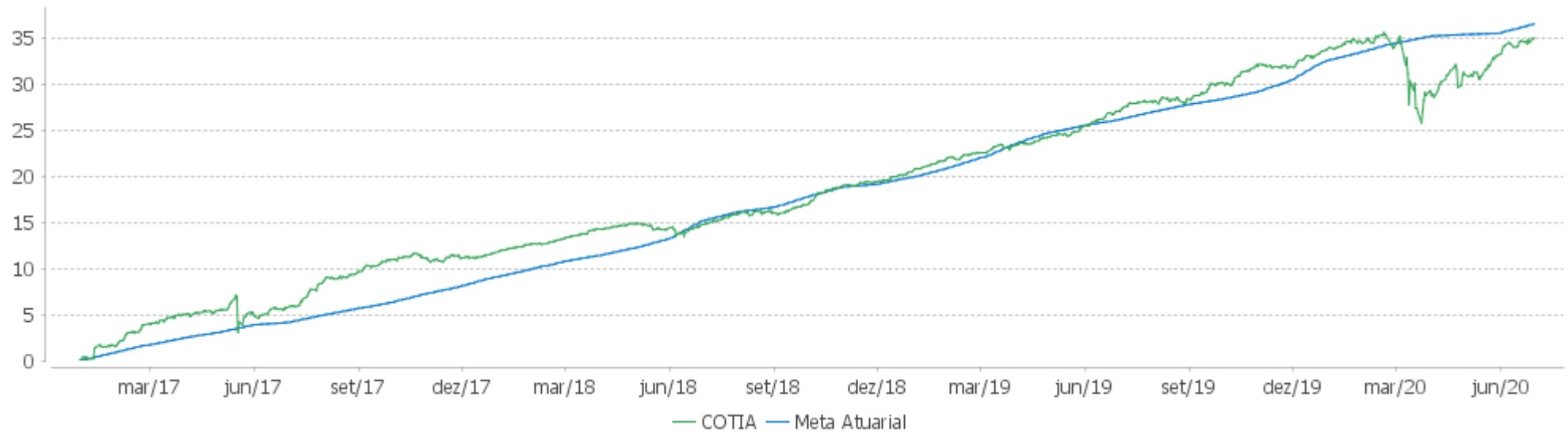
## PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

## RELATÓRIO TRIMESTRAL

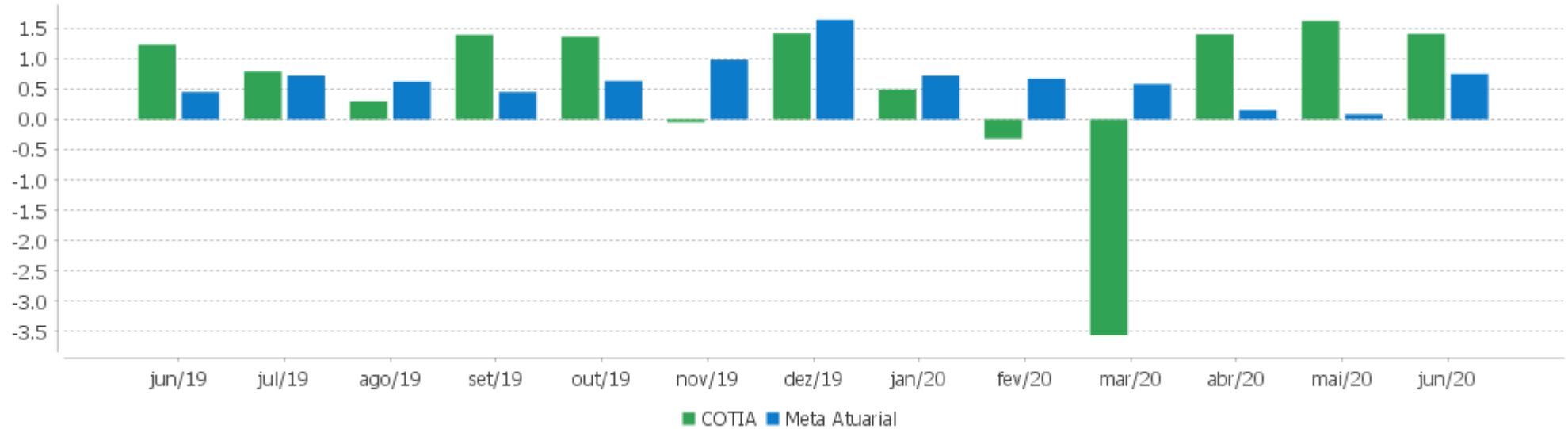
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	22	52,38	03 meses	4,50	0,98	3,51	5,03
Meses abaixo da Meta Atuarial	20	47,62	06 meses	0,95	2,99	-2,03	8,10
			12 meses	6,32	8,29	-1,97	5,78
			24 meses	17,68	18,56	-0,88	4,21
			36 meses	27,66	31,11	-3,44	3,59
Maior rentabilidade da Carteira	2,52	2017-07	Desde 30/12/2016	35,01	36,52	-1,50	4,08
Menor rentabilidade da Carteira	-3,56	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,03 -0,02	-1,88 -0,21	4,91 -0,05	-1,88 -0,21	4,52 -0,42	34,35 -0,78	45,00 -1,21
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,10 -0,02	3,04 -0,13	3,71 -0,06	3,04 -0,13	8,51 -0,30	24,21 -0,55	35,98 -0,92
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,21 0,22	2,88 -0,46	3,57 0,22	2,88 -0,46	8,18 -0,59	21,13 -2,04	32,87 -2,59
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,26 -0,03	2,45 -0,14	1,06 -0,09	2,45 -0,14	5,71 -0,30	13,15 -0,52	21,70 -0,85
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,75 0,49	4,63 4,53	3,27 3,70	4,63 4,53	9,82 7,69	28,20 22,63	38,61 28,41
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,18 0,19	3,12 -0,23	3,54 0,19	3,12 -0,23	8,19 -0,58	21,36 -1,81	33,16 -2,29
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,26 -0,02	2,48 -0,11	1,09 -0,06	2,48 -0,11	5,78 -0,23	13,28 -0,39	21,89 -0,66
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,08 0,03	-0,67 0,99	5,49 0,53	-0,67 0,99	6,12 1,17	39,56 4,43	50,45 4,24
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,02 -0,03	-1,75 -0,08	4,90 -0,06	-1,75 -0,08	4,74 -0,20	34,48 -0,65	45,12 -1,09
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	1,99 938,88	-0,34 -19,33	5,20 707,68	-0,34 -19,33	6,72 145,89	38,42 342,63	49,17 253,57
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,26 122,46	1,37 78,16	0,78 105,60	1,37 78,16	4,06 88,25	10,51 93,70	18,70 96,43
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,13 60,81	1,24 70,84	0,49 66,18	1,24 70,84	3,50 76,04	8,88 79,16	15,65 80,73
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,24 114,33	1,37 78,02	0,58 78,30	1,37 78,02	4,03 87,52	10,44 93,15	18,40 94,90
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,44 0,18	2,27 2,17	1,12 1,55	2,27 2,17	5,62 3,49	19,25 13,67	31,68 21,48
BB PREV MULTIMERCADO FI LP % do CDI	0,46 217,97	0,93 53,04	1,74 236,76	0,93 53,04	5,64 122,59	14,07 125,46	24,15 124,55
FIA BRASIL IBX-50 Var. IBOVESPA p.p.	9,45 0,70	-18,44 -0,63	31,25 1,07	-18,44 -0,63	-6,85 -1,00	25,17 -5,47	45,98 -5,15
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	8,89	-17,46	30,78	-17,46	-3,93	35,59	49,22

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	0,14	0,34	0,60	0,34	1,92	4,96	-1,90
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	9,33	-15,92	28,43	-15,92	5,63	56,90	79,52
Var. IBOVESPA p.p.	0,57	1,88	-1,75	1,88	11,48	26,26	28,40
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	11,52	-18,21	24,81	-18,21	-1,96	40,60	40,89
Var. IBOVESPA p.p.	2,76	-0,40	-5,37	-0,40	3,90	9,96	-10,23
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	9,28	-22,25	27,83	-22,25	-4,41	36,54	
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	4,58	-16,79	20,57	-16,79	-2,34	45,78	57,70
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-4,37	1,59	1,87	1,59	-2,18	-1,73	-2,87
BB AÇÕES DIVIDENDOS	6,59	-22,29	21,06	-22,29	-12,10	24,15	32,50
Var. IBOVESPA p.p.	-2,17	-4,49	-9,12	-4,49	-6,25	-6,49	-18,62
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4,37	32,85	24,40	32,85	54,59	66,72	118,22
Var. IBOVESPA p.p.	-4,39	50,66	-5,78	50,66	60,44	36,08	67,09
CDI	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,39
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
INPC + 6%	0,79	3,25	1,24	3,25	8,51	18,75	30,23
IPCA + 6%	0,75	2,99	0,98	2,99	8,29	18,56	31,11

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
<b>Renda Fixa</b>							
IRF-M 1	0,28	2,60	1,15	2,60	6,01	13,67	22,54
IRF-M 1+	1,04	6,03	4,53	6,03	11,80	33,23	45,60
IRF-M TOTAL	0,79	4,86	3,39	4,86	9,81	27,08	38,44
IMA-B 5	1,12	3,17	3,77	3,17	8,81	24,75	36,90
IMA-B 5+	2,84	-5,26	5,99	-5,26	1,97	43,55	52,33
IMA-B TOTAL	2,05	-1,66	4,96	-1,66	4,95	35,13	46,21
IMA-C TOTAL	3,74	7,46	7,95	7,46	13,21	41,24	63,14
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,90	1,71	2,74	1,71	6,32	22,95	33,11
IMA-GERAL TOTAL	0,99	1,87	2,89	1,87	6,52	23,45	33,90
IDKA 2	0,99	3,35	3,35	3,35	8,77	23,17	35,46
IDKA 20	4,18	-12,33	6,49	-12,33	-4,69	58,14	62,45
CDI	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,39
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
IBRX 100	8,97	-17,39	30,39	-17,39	-4,66	34,21	53,90
IBRX 50	9,33	-17,76	31,79	-17,76	-6,93	27,59	47,47
SMALL CAP	14,43	-20,73	32,49	-20,73	5,15	49,01	69,83
IFIX	5,59	-12,24	12,52	-12,24	6,86	32,05	35,30
Índice Consumo - ICON	10,08	-10,90	39,45	-10,90	13,99	52,93	55,22
Índice Dividendos - IDIV	8,95	-18,38	18,70	-18,38	-0,15	47,52	60,57
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	0,26	0,10	-0,43	0,10	2,13	5,57	10,21
INPC	0,30	0,36	-0,18	0,36	2,35	5,74	9,47
IGPM	1,56	4,39	2,66	4,39	7,31	14,30	22,21
SELIC	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,40
<b>Meta Atuarial</b>							

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

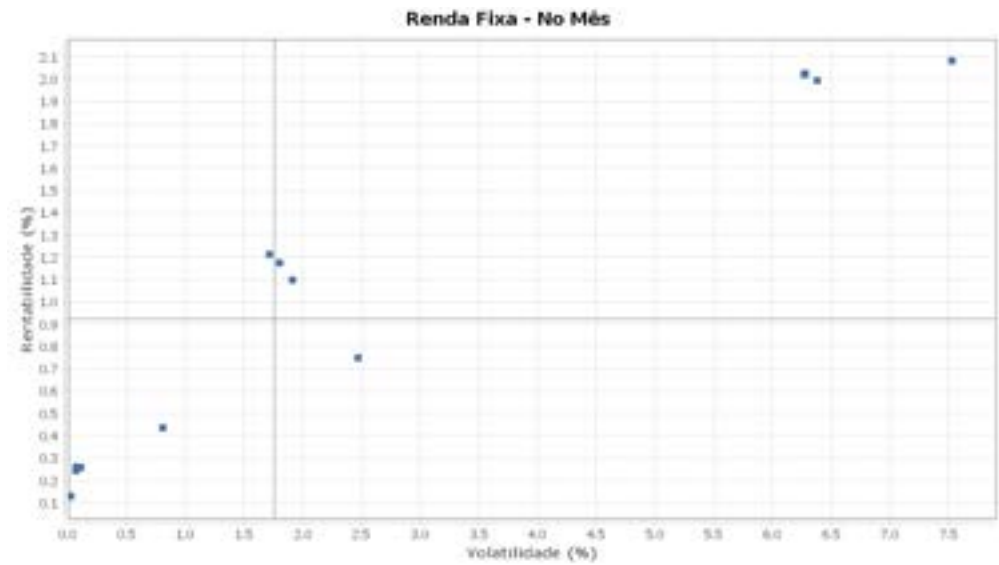
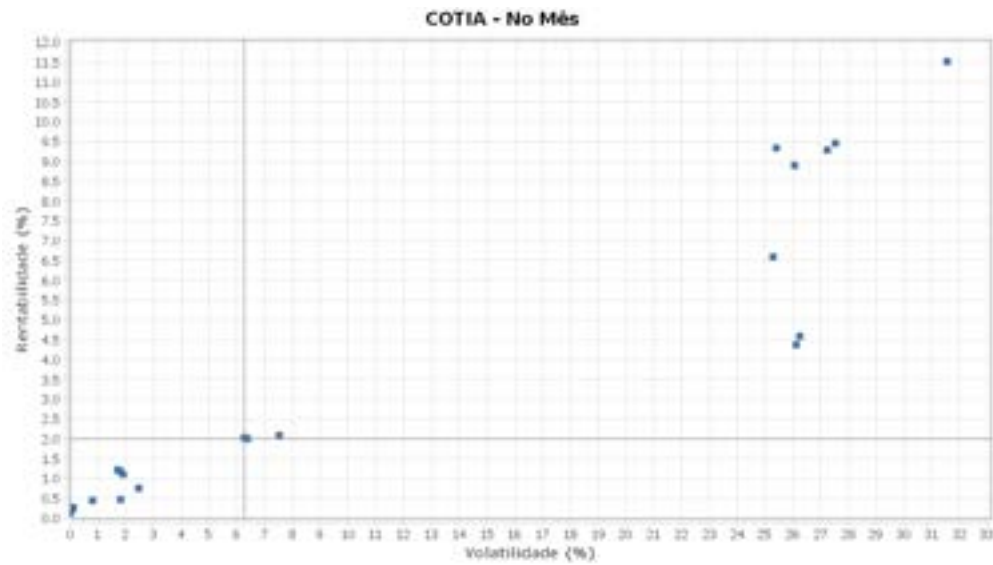
## Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
140	01/06/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	560.000,00	0,00	128.608,79730105	4,3542900000
141	01/06/2020	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	48.396,80	0,00	20.464,18631500	2,3649511030
154	01/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	16.417,88	7.805,50958000	2,1033706810
155	03/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.176,49	3.411,39473700	2,1036820870
156	05/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	46.028,49	21.876,85680100	2,1039809520
145	05/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	10.863,72	0,00	4.776,89219500	2,2742233980
147	05/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	103.053,57	45.313,74098500	2,2742233980
157	08/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.680,00	3.174,70626100	2,1041316740
146	08/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	13.024,45	0,00	5.726,42590300	2,2744466130
150	08/06/2020	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	20.765,25	0,00	3.439,25011600	6,0377260440
151	09/06/2020	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,00	0,00	0,66354100	6,0282562420
158	12/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	15.090,00	7.170,00191600	2,1046019480
159	15/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	976,85	464,11684000	2,1047501760
142	15/06/2020	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	127.824,47	0,00	51.906,85563700	2,4625739400
160	18/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	40,00	19,00054100	2,1052032300
143	23/06/2020	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	8.574,20	0,00	3.346,25941100	2,5623237610
152	23/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	6.235,93	0,00	2.961,75937500	2,1054816440
163	26/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	96.049,30	45.612,76887500	2,1057546465
139	26/06/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.766.972,83	0,00	477.514,02161600	3,7003580000
144	29/06/2020	BB PREV RF IDKA2	267.977,78	0,00	97.202,54157900	2,7569009580
148	29/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.845.776,68	810.117,74371900	2,2784054470
162	30/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	85.329,79	40.518,88254400	2,1059265370
149	30/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	197.904,30	86.851,37918800	2,2786546610
153	30/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	6.463,46	0,00	3.069,29455300	2,1058454601



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,13	396.753,50	0,05
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,02	0,24	40.578.711,24	5,46
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,02	0,26	15.295.440,04	2,06
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,11	0,02	0,26	145.984.873,64	19,64
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,11	0,02	0,26	60.536.123,11	8,14
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,81	0,10	0,44	4.777.588,33	0,64
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,71	0,24	1,21	34.834.261,77	4,69
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	0,24	1,18	56.109.726,60	7,55
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	Artigo 8º III	1,81	0,21	0,46	6.329.237,80	0,85
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,91	0,25	1,10	129.179.023,87	17,38
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,47	0,29	0,75	102.704.139,78	13,81
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,27	0,74	2,02	32.204.560,29	4,33
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,28	0,75	2,03	28.335.574,17	3,81
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	6,38	0,76	1,99	4.183.382,99	0,56
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	7,53	0,88	2,08	8.321.612,65	1,12
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	25,29	2,92	6,59	8.852.741,49	1,19
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	25,41	3,06	9,33	10.479.280,01	1,41
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	26,07	3,11	8,89	11.021.849,12	1,48
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	26,12	2,91	4,37	16.084.886,61	2,16
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	26,25	2,93	4,58	10.768.459,34	1,45
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	27,24	3,24	9,28	2.996.730,10	0,40
FIA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	27,53	3,28	9,45	8.706.924,95	1,17
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	31,55	3,79	11,52	4.758.333,06	0,64