



LDB
EMPRESAS

COTIA
MARÇO 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 22.04.2020.

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

RENDIA FIXA 91,44%

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 PREVID RF IRF-M1	0,45	0,60	1,38	59.589.272,69	8,39	6.969.533.398,64	0,85
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	12,57	-6,73	-5,84	7.888.401,52	1,11	1.204.323.174,71	0,66
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	11,10	-6,98	-6,33	30.494.804,80	4,29	5.743.378.118,49	0,53
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	11,16	-7,10	-6,46	27.010.524,03	3,80	5.890.819.394,91	0,46
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,44	0,59	1,38	144.411.753,61	20,32	10.517.651.272,61	1,37
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	4,58	-1,80	-0,64	124.561.191,77	17,53	9.363.308.744,85	1,33
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	3,77	-1,66	-0,66	33.374.177,05	4,70	6.723.745.548,10	0,50
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	3,65	-1,45	-0,41	54.190.249,65	7,63	8.199.299.170,30	0,66
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	5,32	-0,13	1,31	97.941.402,49	13,78	11.020.077.699,37	0,89
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,59	-1,51	-0,55	579.461.777,61	81,55		

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	12,89	-6,12	-5,27	3.976.588,53	0,56	389.255.098,96	1,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,11	0,14	0,79	38.589.303,03	5,43	5.503.080.783,31	0,70
BB	BB	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,16	-0,03	0,59	22.145.709,25	3,12	2.725.355.805,79	0,81
BB	BB	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,05	0,25	0,75	1.151.582,11	0,16	1.561.401.900,27	0,07
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	1,32	0,53	1,13	4.418.105,77	0,62	5.019.962.419,71	0,09
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,70	-0,26	0,39	70.281.288,69	9,89		
Renda Fixa			3,25	-1,37	-0,44	649.743.066,30	91,44		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

6,84%

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	FI ACOES CAIXA BRASIL IBX-50	41,51	-30,83	-37,86	6.447.641,96	0,91	861.718.774,51	0,75
BB	BB	BB PREV ACOES GV	40,98	-30,82	-36,89	7.097.391,45	1,00	598.696.495,88	1,19
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			41,22	-30,83	-37,34	13.545.033,41	1,91		

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 ACOES DIVIDENDOS FICFI	34,90	-29,38	-35,81	6.940.365,07	0,98	751.642.834,81	0,92
SAFRA	SAFRA	SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	35,42	-27,75	-34,47	3.269.542,66	0,46	191.365.742,65	1,71
VINCI	CEF	FIC ACOES CAIXA VALOR RPPS	37,74	-31,10	-34,53	7.928.726,54	1,12	375.488.566,24	2,11
VINCI	CEF	FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	35,44	-27,40	-30,98	8.744.677,98	1,23	668.247.605,13	1,31
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	38,94	-32,44	-39,18	2.344.238,77	0,33	2.717.755.336,40	0,09
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			35,90	-29,36	-34,26	29.227.551,02	4,11		

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 MM FI LP	2,98	-1,10	-0,80	5.806.788,67	0,82	466.945.578,58	1,24
Sub-total Artigo 8º III			2,98	-1,10	-0,80	5.806.788,67	0,82		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			33,95	-27,53	-32,71	48.579.373,10	6,84		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,72%

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 NIVEL I	23,76	6,30	6,80	12.239.502,81	1,72	876.229.505,18	1,40
Sub-total Artigo 9º A, III			23,76	6,30	6,80	12.239.502,81	1,72		
Investimentos no Exterior			23,76	6,30	6,80	12.239.502,81	1,72		
Total						710.561.942,21	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	579.461.777,61	81,55	0,00	55,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	70.281.288,69	9,89	0,00	15,00	30,00	40,00
	Total Renda Fixa	649.743.066,30	91,44				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	13.545.033,41	1,91	0,00	7,00	15,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	29.227.551,02	4,11	0,00	10,00	15,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	5.806.788,67	0,82	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	48.579.373,10	6,84				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	12.239.502,81	1,72	0,00	3,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	12.239.502,81	1,72				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

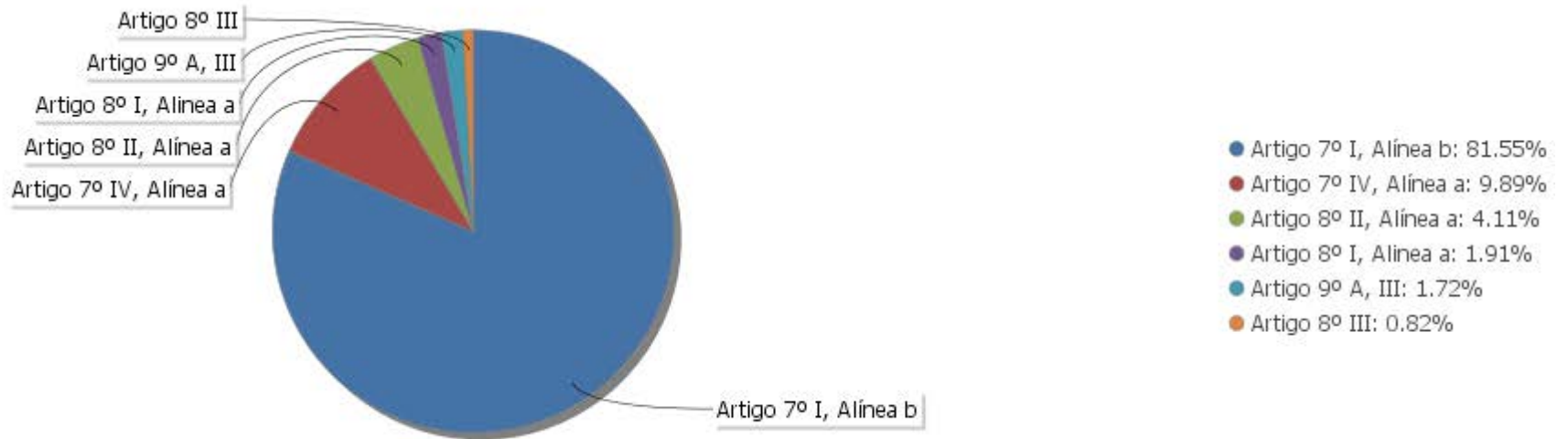
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-1,51 -445,73	-0,55 -53,99	-0,55 -53,99	1,53 67,70	7,36 135,37	-8.840.222,88	-3.174.887,39
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,26 -76,79	0,39 38,48	0,39 38,48	1,61 71,33	4,85 89,14	-186.838,83	258.376,32
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-30,83 -0,92	-37,34 -0,48	-37,34 -0,48	-30,36 -0,07	-23,70 -0,23	-5.880.574,38	-7.862.958,60
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-29,36 0,54	-34,26 2,60	-34,26 2,60	-25,65 4,64	-15,31 8,17	-11.854.367,81	-14.861.813,16
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-1,10 28,81	-0,80 36,06	-0,80 36,06	1,55 31,84	6,19 29,66	-56.804,04	-41.112,05
Artigo 9º A, III % do CDI	6,30 1.863,01	6,80 671,49	6,80 671,49	12,71 561,33	27,06 497,76	693.193,21	743.877,34
						-26.125.614,73	-24.938.517,54

Análise de Liquidez

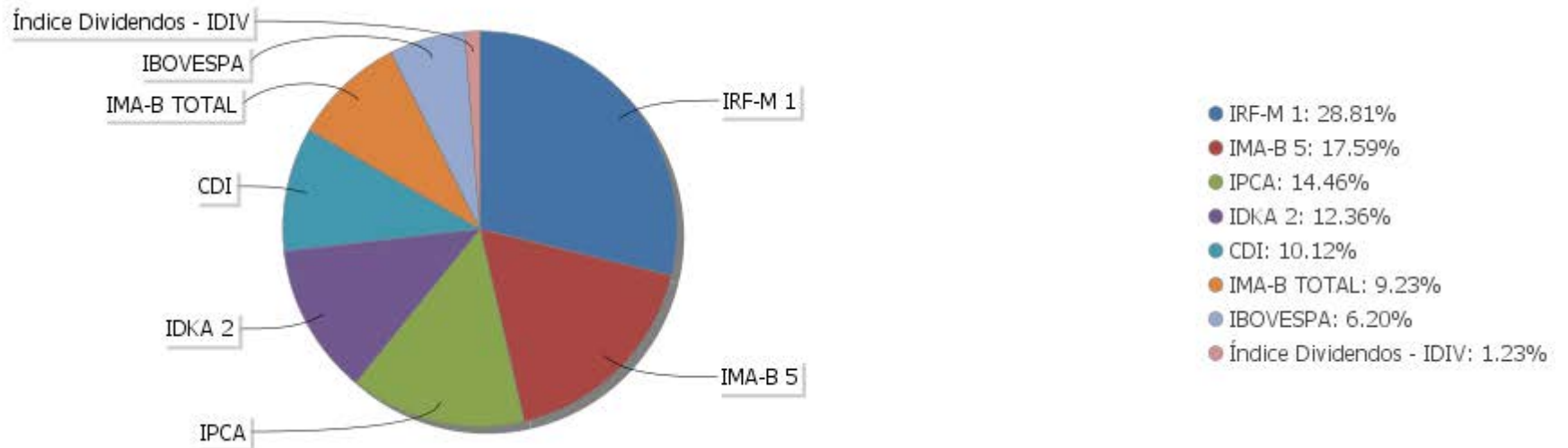
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	691.544.298,92	97,32	691.544.298,92	97,32
de 31 a 364 dias	19.017.643,29	2,68	710.561.942,21	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	710.561.942,21	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

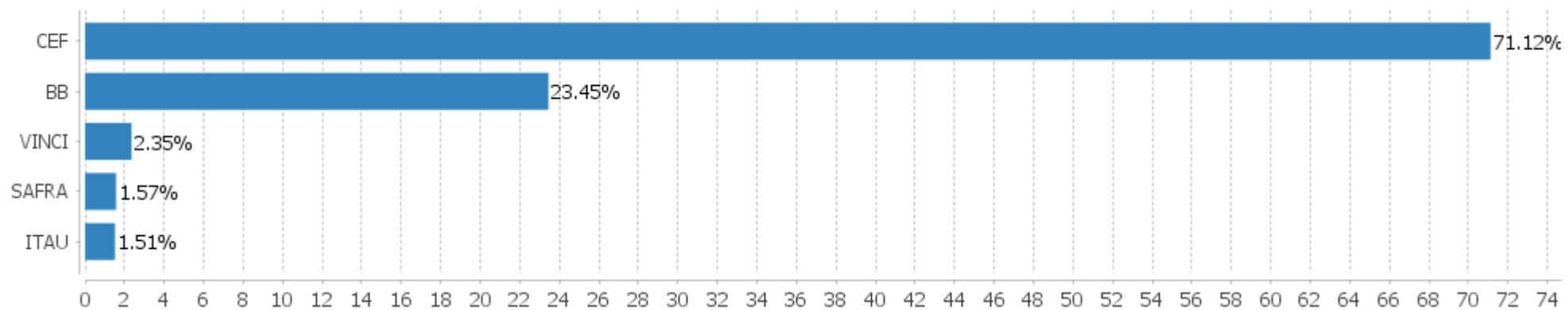


Alocação Por Estratégia



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										-3,39
IPCA + 6%	0,72	0,67	0,58										1,98
p.p. indexador	-0,23	-0,99	-4,14										-5,37
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

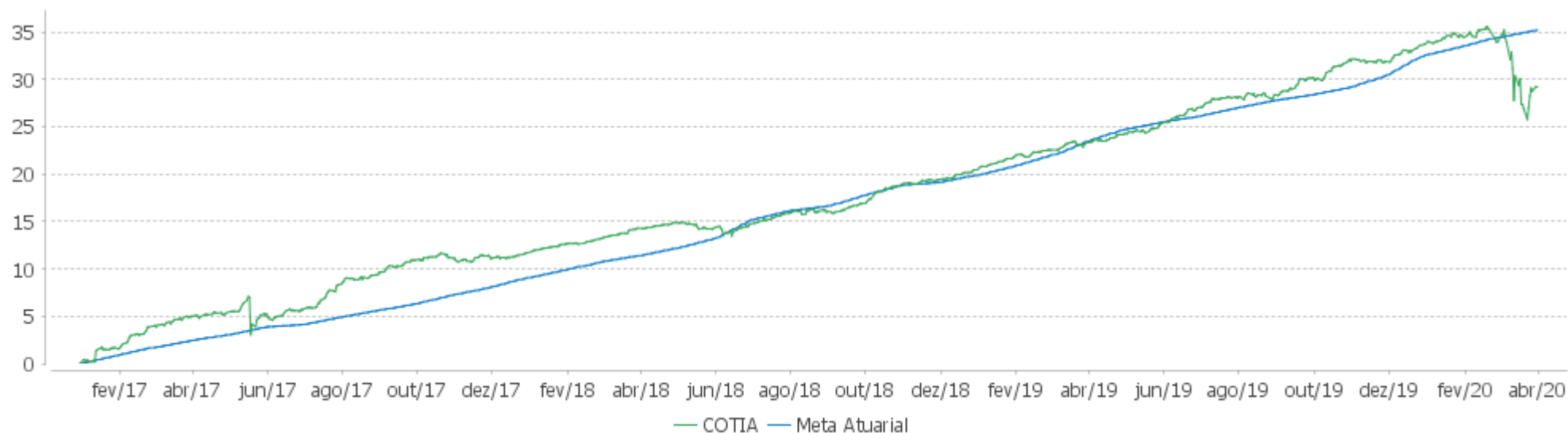
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

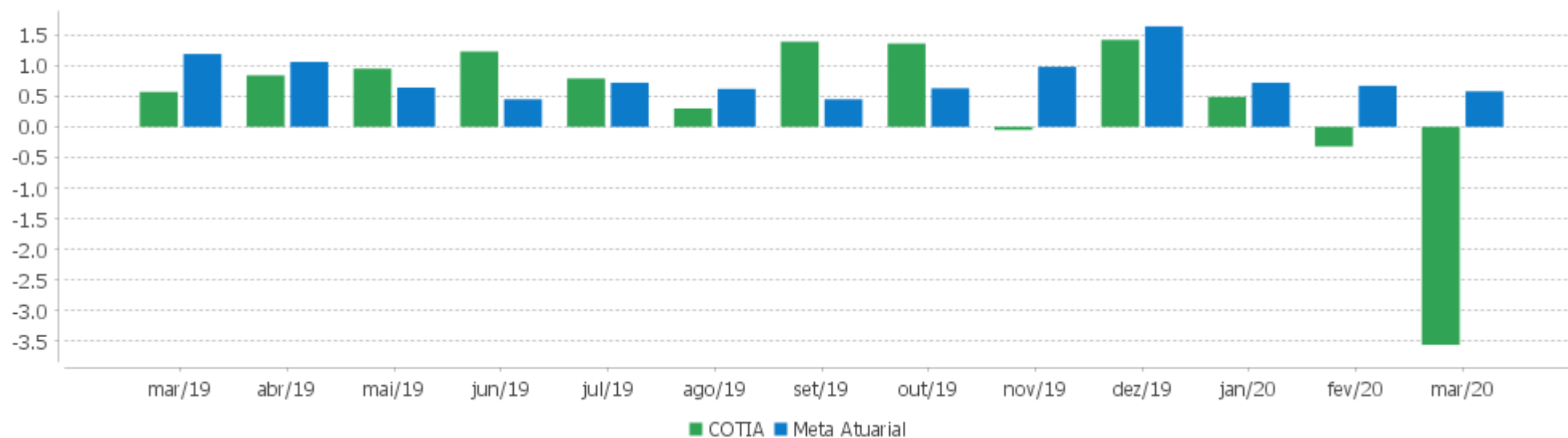
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	19	48,72	03 meses	-3,39	1,98	-5,37	10,20
Meses abaixo da Meta Atuarial	20	51,28	06 meses	-0,74	5,33	-6,07	7,28
			12 meses	4,85	9,55	-4,70	5,26
			24 meses	13,04	21,38	-8,34	3,89
Maior rentabilidade da Carteira	2,52	2017-07	36 meses	23,05	31,96	-8,91	4,07
Menor rentabilidade da Carteira	-3,56	2020-03	Desde 30/12/2016	29,20	35,19	-5,99	4,00

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
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	-6,12 -1.807,52	-5,27 -520,27	-5,27 -520,27	-2,62 -115,93	11,82 217,40	26,66 219,90	39,54 183,66
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	-0,03 -9,77	0,59 58,36	0,59 58,36	1,74 76,63	4,81 88,50	11,34 93,51	20,78 96,50
BB PREVID RF FLUXO FIC % do CDI	0,25 73,55	0,75 74,38	0,75 74,38	1,73 76,27	4,31 79,23	9,74 80,32	17,73 82,36
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,14 42,04	0,79 77,94	0,79 77,94	1,91 84,42	4,99 91,77	11,48 94,69	20,75 96,38
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,53 0,46	1,13 0,60	1,13 0,60	2,34 0,03	9,75 6,45	18,58 10,56	30,29 19,37
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	-7,10 -0,13	-6,46 -0,15	-6,46 -0,15	-3,94 -0,30	8,66 -0,48	23,36 -0,75	36,31 -1,12
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	-1,80 -0,04	-0,64 -0,07	-0,64 -0,07	1,86 -0,17	9,03 -0,31	18,84 -0,55	32,82 -0,85
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	-1,66 -0,45	-0,66 -0,66	-0,66 -0,66	1,94 -0,52	7,78 -1,34	17,10 -2,04	30,56 -3,36
BB PREVID RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,60 -0,01	1,38 -0,06	1,38 -0,06	2,70 -0,13	6,40 -0,26	13,27 -0,53	23,59 -0,83
FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,13 -0,20	1,31 0,78	1,31 0,78	3,13 0,82	13,46 10,16	23,65 15,62	35,73 24,81
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-1,45 -0,24	-0,41 -0,41	-0,41 -0,41	1,98 -0,48	8,03 -1,08	17,44 -1,70	30,97 -2,96
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,59 -0,02	1,38 -0,05	1,38 -0,05	2,73 -0,11	6,46 -0,20	13,39 -0,41	23,77 -0,64
BB PREV IMAB TPB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-6,98 -0,01	-6,33 -0,02	-6,33 -0,02	-3,73 -0,09	8,93 -0,22	23,52 -0,58	36,42 -1,00
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-6,73 0,24	-5,84 0,47	-5,84 0,47	-2,91 0,73	9,71 0,57	26,82 2,72	39,96 2,54
FIC ACOES CAIXA VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	-31,10 -1,20	-34,53 2,33	-34,53 2,33	-22,63 7,65	-9,40 14,07	3,86 18,32	38,10 25,73
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-27,75 2,15	-34,47 2,39	-34,47 2,39	-26,44 3,85	-14,17 9,30	-10,42 4,05	4,19 -8,18
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	-32,44	-39,18	-39,18	-31,38	-17,47	-4,42	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-27,40 -1,87	-30,98 0,25	-30,98 0,25	-22,11 -0,69	-12,36 -4,59	1,73 -3,15	28,59 1,41
BB ACOES DIVIDENDOS FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-29,38 0,53	-35,81 1,05	-35,81 1,05	-29,79 0,50	-21,20 2,27	-13,42 1,04	5,74 -6,63
BB PREV MM FI LP % do CDI	-1,10 -323,86	-0,80 -78,60	-0,80 -78,60	1,55 68,44	6,19 113,80	13,65 112,58	26,38 122,50
FI ACOES CAIXA BRASIL IBX-50 Var. IBOVESPA p.p.	-30,83 -0,93	-37,86 -1,00	-37,86 -1,00	-31,29 -1,00	-25,49 -2,02	-19,51 -5,05	7,13 -5,24
BB PREV ACOES GV Var. IBOVESPA p.p.	-30,82 -0,92	-36,89 -0,03	-36,89 -0,03	-29,53 0,76	-21,90 1,57	-9,95 4,51	13,11 0,75
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I Var. IBOVESPA p.p.	6,30 36,21	6,80 43,65	6,80 43,65	12,71 43,00	27,06 50,53	62,46 76,92	91,78 79,42
CDI	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,12	21,53
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
INPC + 6%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65
IPCA + 6%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,60	1,43	1,43	2,83	6,66	13,79	24,42
IRF-M 1+	-0,47	1,44	1,44	3,57	12,96	24,50	42,11
IRF-M TOTAL	-0,11	1,42	1,42	3,31	11,09	21,25	36,85
IMA-B 5	-1,75	-0,57	-0,57	2,03	9,34	19,39	33,68
IMA-B 5+	-10,93	-10,62	-10,62	-7,92	8,24	26,94	39,94
IMA-B TOTAL	-6,97	-6,31	-6,31	-3,64	9,14	24,10	37,42
IMA-C TOTAL	-3,52	-0,45	-0,45	1,38	13,06	32,40	46,04
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-1,93	-1,00	-1,00	0,87	8,34	18,40	31,22
IMA-GERAL TOTAL	-1,98	-0,99	-0,99	0,89	8,47	18,79	31,60
IDKA 2	-1,21	-0,00	-0,00	2,46	9,11	19,14	33,92
IDKA 20	-16,46	-17,67	-17,67	-14,94	5,94	33,16	42,21
CDI	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,12	21,53
Renda Variável							
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
IBRX 100	-30,09	-36,64	-36,64	-29,86	-22,20	-12,35	15,05
IBRX 50	-30,37	-37,60	-37,60	-31,47	-25,64	-17,77	8,61
SMALL CAP	-35,07	-40,17	-40,17	-27,52	-11,98	-1,62	31,66
IFIX	-15,85	-22,00	-22,00	-7,08	0,45	5,79	22,69
Índice Consumo - ICON	-31,51			-30,32	-6,98	-7,63	14,29
Índice Dividendos - IDIV	-25,53	-31,24	-31,24	-21,42	-7,78	4,87	27,17
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,07	0,53	0,53	2,31	3,30	8,03	10,93
INPC	0,18	0,54	0,54	2,36	3,31	8,13	9,82
IGPM	1,24	1,69	1,69	4,83	6,82	15,66	15,90
SELIC	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,13	21,55
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,41	1,51	1,51	4,33	7,47	16,84	24,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,50	1,74	1,74	4,83	8,51	19,10	28,29
IPCA + 5,5%	0,54	1,86	1,86	5,08	9,03	20,24	30,12
IPCA + 5,89%	0,57	1,96	1,96	5,28	9,44	21,13	31,55
IPCA + 6%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96
INPC + 4%	0,52	1,52	1,52	4,39	7,48	16,96	23,44
INPC + 6%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

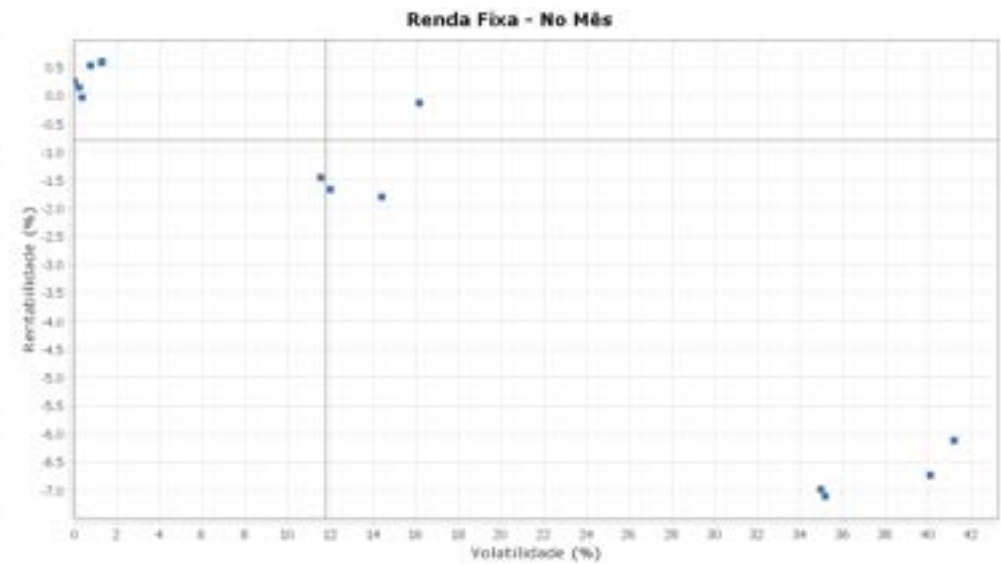
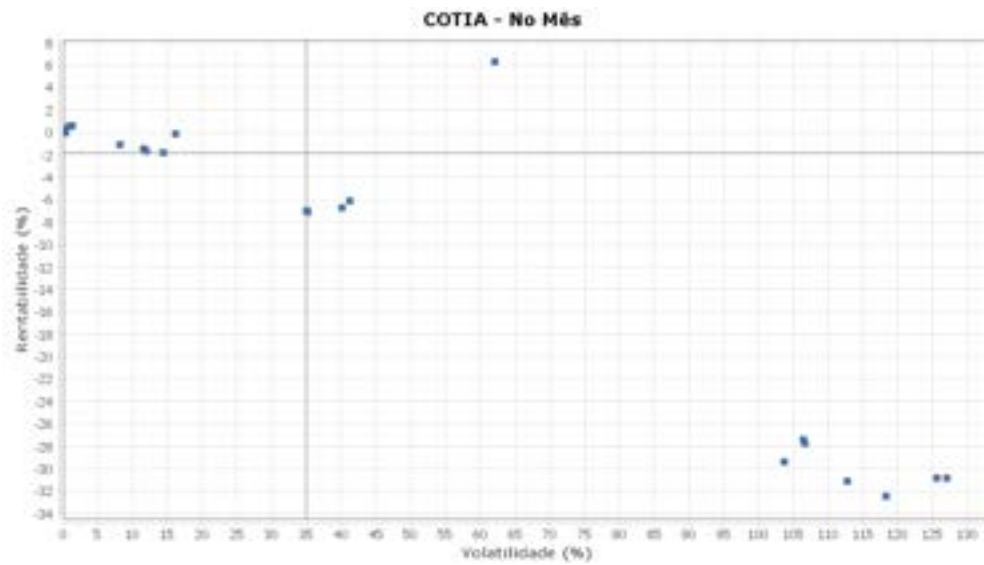
Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
02/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	17.800,00	8.513,54294500	2,0907864230
03/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.341,58	0,00	3.686,83606600	2,2625307580
03/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	24.659,85	11.793,01783200	2,0910550930
04/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	17,91	8,56407900	2,0912932530
05/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	97.965,58	43.285,85648800	2,2632237860
05/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	2.067,78	988,63705200	2,0915461290
09/03/2020	BB PREV IMAB TPB	19.704,41	0,00	3.234,40874900	6,0921211660
09/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	5.663,75	2.707,28350000	2,0920417090
10/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	17.200,00	8.220,70574900	2,0922777830
11/03/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	16.549,86	0,00	4.498,58680600	3,6789020000
11/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	938,80	448,64190400	2,0925374840
13/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	11.734,37	5.606,39083300	2,0930346010
16/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	14.400,00	6.879,11428300	2,0932927420
17/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.598,52	2.470,99409100	2,2656954220
17/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	6.680,00	3.190,77313500	2,0935364930
18/03/2020	BB PREV IMAB TPB	120.795,18	0,00	21.434,51500900	5,6355452850
19/03/2020	BB PREV IMAB TPB	262.690,72	0,00	46.514,56663800	5,6474936560
26/03/2020	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	22.000.000,00	0,00	15.387.789,78880200	1,4297050000
26/03/2020	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	0,00	22.000.000,00	7.458.185,84884400	2,9497790000
26/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.786.606,69	789.554,91941600	2,2628023030
26/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	188.902,06	83.481,46886300	2,2628023030
26/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	135.540,94	64.694,09412600	2,0951053080
27/03/2020	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	23.000.000,00	0,00	16.070.059,87145300	1,4312330000
27/03/2020	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	0,00	23.000.000,00	7.779.282,14717000	2,9565710000
27/03/2020	BB ACOES DIVIDENDOS FICFI	10.863,71	0,00	831,71461800	13,0618240000
27/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	18.198,89	8.685,55484300	2,0953054040
30/03/2020	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	30.000.000,00	0,00	20.888.775,62530500	1,4361780000
30/03/2020	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	448.102,03	0,00	312.010,09206300	1,4361780000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
30/03/2020	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	0,00	30.000.000,00	10.107.237,79361100	2,9681700000
30/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	19.679,87	9.391,40189400	2,0955199470
31/03/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	512.025,51	0,00	28.890,76663247	17,7228080000
31/03/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	550.000,00	0,00	151.845,11136044	3,6221120000
31/03/2020	FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	350.000,00	0,00	238.241,58649837	1,4690970000
31/03/2020	FIC ACOES CAIXA VALOR RPPS	350.000,00	0,00	287.276,60140289	1,2183380000
31/03/2020	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	262.025,67	0,00	787,84373100	332,5858410000
31/03/2020	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	30.000,00	0,00	20.857,52226500	1,4383300000
31/03/2020	FI ACOES CAIXA BRASIL IBX-50	350.000,00	0,00	380.175,68461400	0,9206270000
31/03/2020	BB PREV IMAB TPB	688.102,03	0,00	119.200,98961100	5,7726201120
31/03/2020	BB PREV MM FI LP	680.000,00	0,00	238.083,36051900	2,8561424810
31/03/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	106,50	47,10079000	2,2611085640
31/03/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	254,13	121,26055400	2,0957351030

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVID RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,25	1.151.582,11	0,16
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,24	0,03	0,14	38.589.303,03	5,43
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,38	0,04	-0,03	22.145.709,25	3,12
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,77	0,10	0,53	4.418.105,77	0,62
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,30	0,16	0,59	144.411.753,61	20,32
BB PREVID RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	1,31	0,16	0,60	59.589.272,69	8,39
BB PREV MM FI LP	Artigo 8º III	8,19	0,80	-1,10	5.806.788,67	0,82
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	11,57	1,13	-1,45	54.190.249,65	7,63
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	12,01	1,17	-1,66	33.374.177,05	4,70
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	14,42	1,41	-1,80	124.561.191,77	17,53
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	16,18	1,67	-0,13	97.941.402,49	13,78
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	34,99	3,30	-6,98	30.494.804,80	4,29
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	35,19	3,31	-7,10	27.010.524,03	3,80
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	40,11	3,84	-6,73	7.888.401,52	1,11
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	41,23	3,99	-6,12	3.976.588,53	0,56
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	Artigo 9º A, III	62,09	6,71	6,30	12.239.502,81	1,72
BB ACOES DIVIDENDOS FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	103,70	9,16	-29,38	6.940.365,07	0,98
FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	106,44	9,57	-27,40	8.744.677,98	1,23
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	106,66	9,57	-27,75	3.269.542,66	0,46
FIC ACOES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	112,77	9,99	-31,10	7.928.726,54	1,12
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	118,33	10,48	-32,44	2.344.238,77	0,33
BB PREV ACOES GV	Artigo 8º I, Alínea a	125,63	11,34	-30,82	7.097.391,45	1,00
FI ACOES CAIXA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	127,07	11,49	-30,83	6.447.641,96	0,91