



LDB
EMPRESAS

COTIA
SETEMBRO 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 28.01.2020.

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 91,71%

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	0,30	0,62	5,12	58.021.282,16	8,36	7.803.027.907,11	0,74
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	6,21	2,06	2,06	7.854.889,82	1,13	1.428.213.102,86	0,55
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	5,19	2,85	19,32	28.713.866,53	4,14	6.210.669.016,03	0,46
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	5,20	2,85	19,37	26.150.085,63	3,77	11.475.861.578,54	0,23
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,28	0,63	5,15	150.565.311,27	21,69	11.445.572.813,24	1,32
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	2,14	1,72	10,08	196.369.299,71	28,28	10.040.403.127,50	1,96
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	1,54	1,41	8,36	32.252.458,98	4,65	7.885.241.073,51	0,41
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	1,55	1,42	8,58	53.136.409,56	7,65	8.745.766.983,49	0,61
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	3,70	2,12	1,85	20.350.434,90	2,93	8.195.196.996,57	0,25
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,39	1,40	8,18	573.414.038,56	82,59		

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	5,54	3,13	3,01	3.605.236,56	0,52	259.872.108,05	1,39
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02	0,45	4,55	19.422.753,87	2,80	4.986.484.305,67	0,39
BB	BB	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,02	0,45	4,55	33.629.674,63	4,84	3.076.678.877,78	1,09
BB	BB	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,02	0,37	3,82	2.867.274,82	0,41	1.489.281.051,07	0,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	2,19	0,78	0,83	3.816.837,16	0,55	5.159.078.114,65	0,07
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,09	0,60	4,70	63.341.777,04	9,12		
Renda Fixa			1,12	1,32	7,52	636.755.815,60	91,71		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,09%

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	20,54	3,35	17,07	8.031.866,05	1,16	561.994.353,26	1,43
BB	BB	BB PREV ACOES GOVERNANÇA FI	20,00	3,03	19,92	8.372.570,43	1,21	575.197.683,84	1,46
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			20,36	3,20	18,43	16.404.436,48	2,36		

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	18,26	1,76	17,52	8.124.784,48	1,17	1.001.508.810,20	0,81
SAFRA	SAFRA	SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	19,99	2,17	2,17	2.843.631,95	0,41	73.815.931,79	3,85
VINCI	CEF	FIC ACOES CAIXA VALOR RPPS	17,95	1,43	27,37	6.858.817,69	0,99	254.015.057,05	2,70
VINCI	CEF	FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,92	1,05	25,88	7.529.507,99	1,08	707.345.831,99	1,06
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,95	3,42	7,19	3.416.418,97	0,49	3.465.972.947,23	0,10
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			16,07	1,70	23,88	28.773.161,08	4,14		

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	1,45	1,30	6,51	4.037.674,97	0,58	524.934.374,47	0,77
Sub-total Artigo 8º III			1,45	1,30	6,51	4.037.674,97	0,58		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			15,40	2,21	20,02	49.215.272,53	7,09		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,20%

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	17,45	2,66	27,41	8.325.247,82	1,20	589.391.271,12	1,41
Sub-total Artigo 9º A, III			17,45	2,66	27,41	8.325.247,82	1,20		
Investimentos no Exterior			15,45	2,66	27,41	8.325.247,82	1,20		
Total						694.296.335,95	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	573.414.038,56	82,59	0,00	54,00	90,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	63.341.777,04	9,12	0,00	20,00	30,00	40,00
	Total Renda Fixa	636.755.815,60	91,71				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	16.404.436,48	2,36	0,00	5,00	10,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	28.773.161,08	4,14	5,00	10,00	15,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	4.037.674,97	0,58	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	49.215.272,53	7,09				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	8.325.247,82	1,20				10,00
	Total Investimentos no Exterior	8.325.247,82	1,20				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

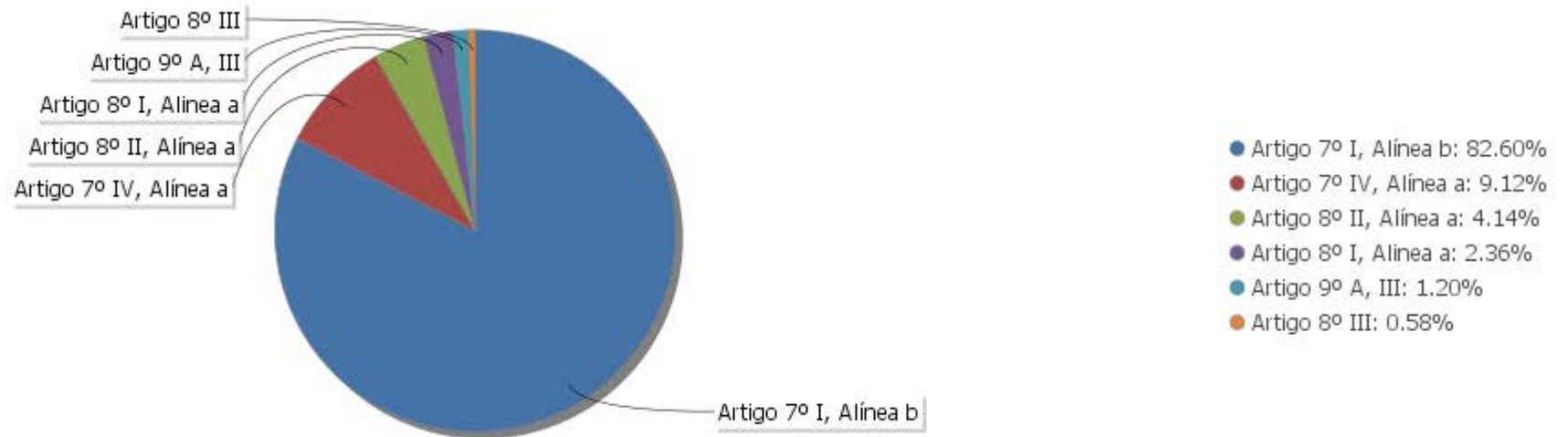
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,40 302,21	8,18 175,36	2,39 154,92	5,74 184,98	11,92 190,07	7.854.322,61	39.612.357,42
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,60 130,27	4,70 100,87	1,66 107,69	3,18 102,50	6,26 99,85	411.486,64	5.416.216,81
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	3,20 -0,37	18,43 -0,75	3,74 -0,00	9,56 -0,21	29,53 -2,49	493.218,42	1.453.141,29
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	1,70 -1,87	23,88 4,70	4,61 0,87	13,91 4,13	27,37 -4,64	471.634,62	2.776.479,15
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	1,30 -2,27	6,51 -12,67	2,25 -1,49	4,57 -5,21		51.793,56	191.543,46
Artigo 9º A, III % do CDI	2,66 573,80	27,41 587,76	10,26 665,58	12,74 410,48		201.055,01	1.278.913,65
						9.483.510,86	50.728.651,78

Análise de Liquidez

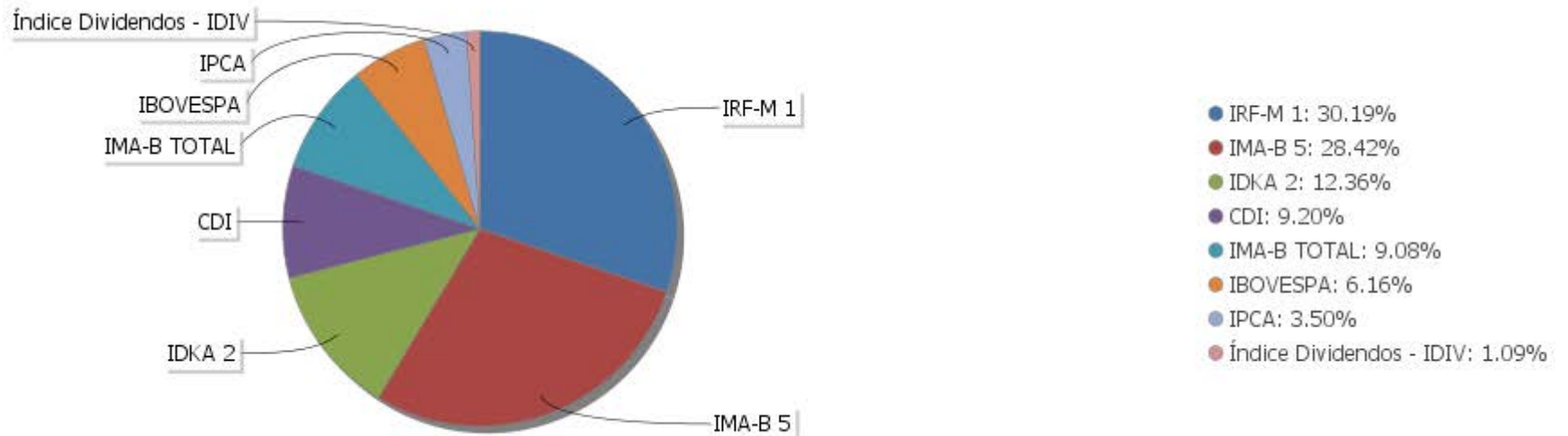
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	679.908.010,27	97,93	679.908.010,27	97,93
de 31 a 364 dias	14.388.325,68	2,07	694.296.335,95	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	694.296.335,95	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

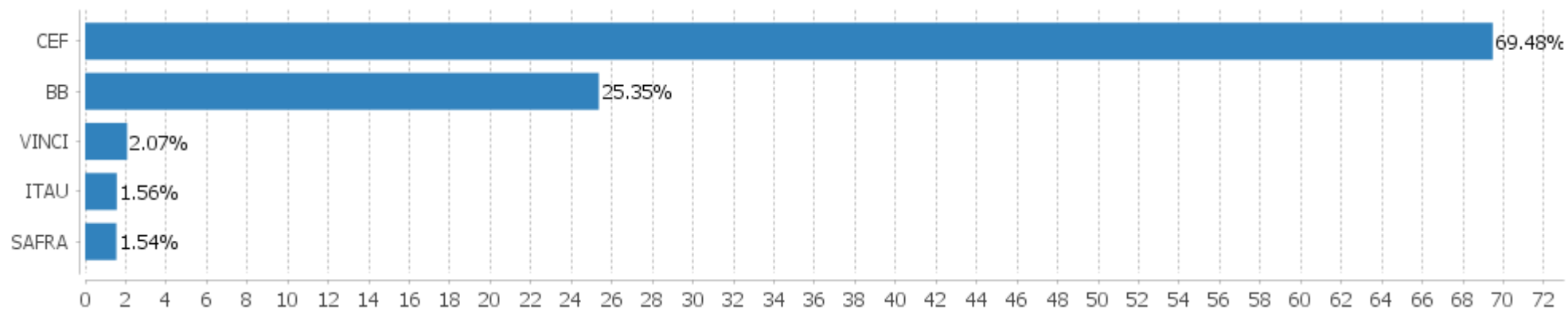


Alocação Por Estratégia



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	1,23	0,48	0,57	0,84	0,95	1,23	0,79	0,30	1,39				8,07
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45				7,07
p.p. indexador	0,40	-0,41	-0,62	-0,22	0,31	0,78	0,07	-0,32	0,94				0,99
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

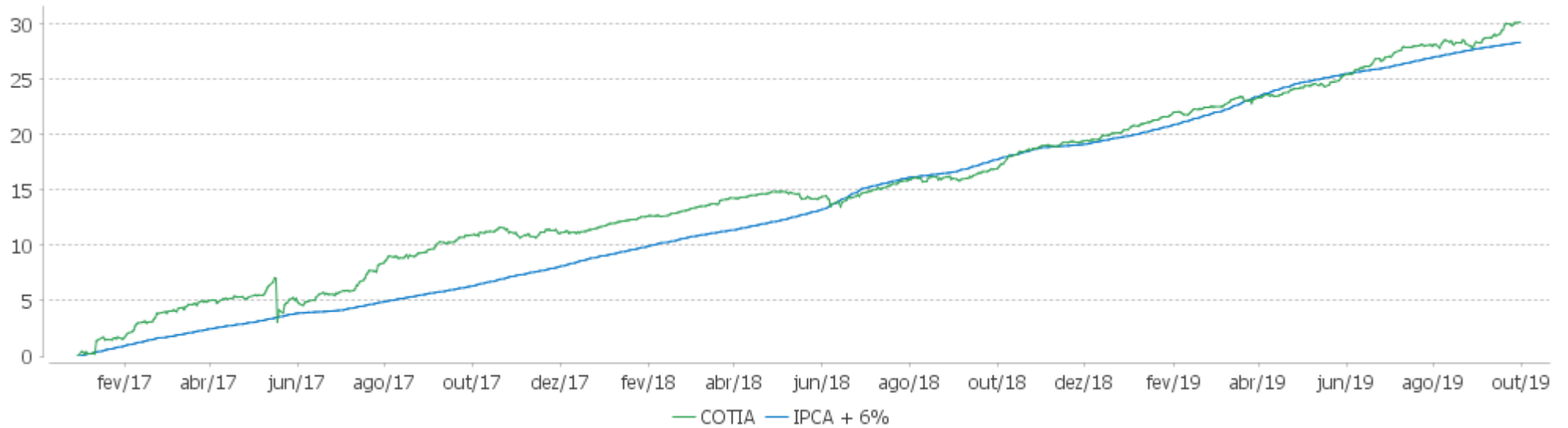
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

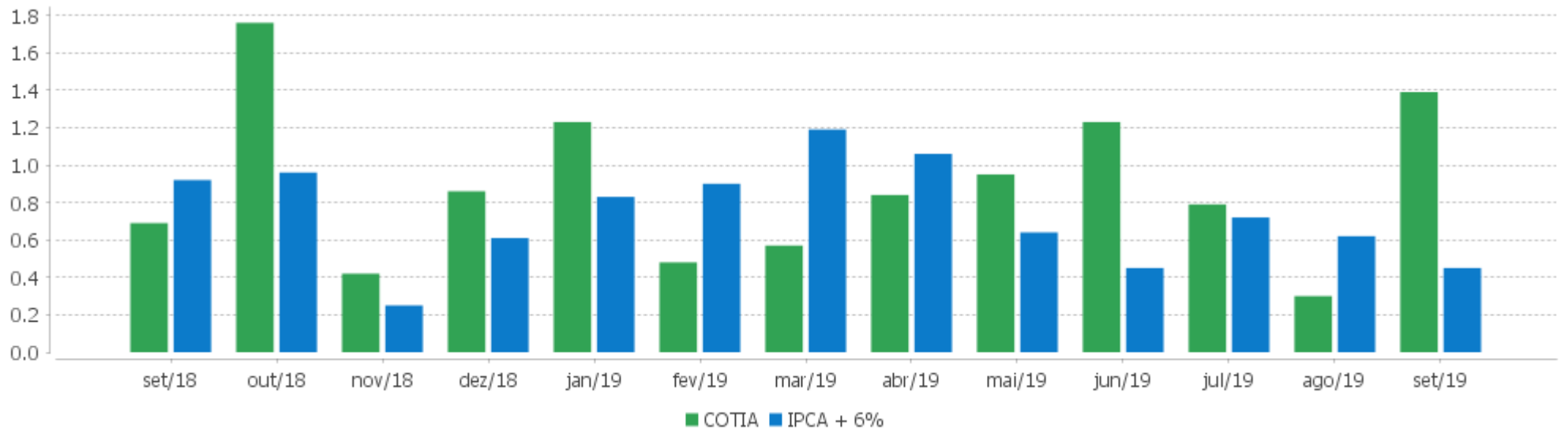
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	18	54,55	03 meses	2,50	1,80	0,70	1,83
Meses abaixo da Meta Atuarial	15	45,45	06 meses	5,63	4,01	1,63	1,62
			12 meses	11,37	9,04	2,33	1,46
			24 meses	17,35	20,73	-3,38	1,54
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,52	2017-07	Desde 30/12/2016	30,17	28,34	1,82	3,04
Menor rentabilidade da Carteira	-0,51	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
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	3,13 675,12	21,10 452,45	4,17 270,87	14,83 478,09	32,97 525,64	35,78 268,19	56,56 214,20
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,45 97,16	4,55 97,63	1,50 97,34	3,02 97,47	6,12 97,49	13,21 99,02	26,40 99,98
BB PREVID RF FLUXO FIC % do CDI	0,37 80,30	3,82 81,83	1,25 81,18	2,54 81,77	5,13 81,83	10,94 81,97	22,63 85,68
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,45 96,19	4,55 97,60	1,49 96,93	3,02 97,34	6,13 97,66	13,00 97,44	26,06 98,69
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,78 0,82	10,59 8,10	2,06 1,80	7,25 6,27	13,67 10,78	20,84 13,29	39,02 28,74
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,85 -0,01	19,37 -0,18	3,72 -0,05	13,12 -0,15	31,16 -0,21	34,16 -0,56	55,13 -0,83
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	1,72 -0,02	10,08 -0,19	2,72 -0,06	7,04 -0,13	15,21 -0,19	22,44 -0,49	38,69 -0,78
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,41 -0,18	8,36 -0,77	2,46 -0,25	5,73 -0,76	12,10 -0,74	20,62 -1,83	35,98 -3,21
FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	2,12 2,16	14,38 11,88	3,11 2,85	10,02 9,05	18,30 15,40	25,15 17,60	
BB PREVID RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,62 -0,02	5,12 -0,19	1,85 -0,07	3,60 -0,12	7,22 -0,22	14,20 -0,49	28,34 -0,87
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,42 -0,17	8,58 -0,55	2,46 -0,26	5,93 -0,56	12,28 -0,57	20,88 -1,57	36,32 -2,87
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,94 0,08	19,71 0,16	3,61 -0,16	12,99 -0,27	34,31 2,94	36,41 1,69	57,19 1,23
BB PREV IMAB TPB Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,85 -0,01	19,32 -0,22	3,72 -0,04	13,15 -0,12	31,00 -0,37	34,05 -0,68	54,78 -1,19
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,63 -0,02	5,15 -0,15	1,86 -0,06	3,63 -0,09	7,28 -0,17	14,32 -0,38	28,55 -0,66
FI ACOES CAIXA BRASIL IBX-50 Var. IBOVESPA p.p.	3,35 -0,22	17,07 -2,11	3,28 -0,46	8,43 -1,35	27,54 -4,48	35,49 -5,50	71,08 -8,38
BB PREV ACOES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	3,03 -0,54	19,92 0,74	4,24 0,49	10,82 1,04	36,11 4,09	38,02 -2,97	77,04 -2,42
BB PREV MM FI LP % do CDI	1,30 280,20	6,51 139,62	2,25 146,12	4,57 147,20	8,42 134,23	16,47 123,43	30,59 115,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FIC ACOES CAIXA VALOR RPPS	1,43	27,37	6,31	17,10	56,50	48,64	74,28
Var. IBOVESPA p.p.	-2,14	8,19	2,57	7,33	24,48	7,65	-5,18
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	2,22	24,40	6,79	16,68	49,89	33,75	61,31
Var. IBOVESPA p.p.	-1,35	5,22	3,05	6,90	17,88	-7,24	-18,15
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	3,42	28,77	8,98	20,27	46,74	60,66	
FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	1,05	25,88	3,99	12,51	54,32	41,14	66,09
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,85	-1,15	-3,05	-4,86	1,48	-3,54	-39,38
BB ACOES DIVIDENDOS FICFI	1,76	17,52	3,41	12,23	36,15	36,13	62,82
Var. IBOVESPA p.p.	-1,81	-1,66	-0,33	2,45	4,13	-4,86	-16,64
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2,66	27,41	10,26	12,74	5,65	58,09	78,88
Var. IBOVESPA p.p.	-0,91	8,22	6,52	2,96	-26,37	17,10	-0,58
CDI	0,46	4,66	1,54	3,10	6,27	13,34	26,41
IBOVESPA	3,57	19,18	3,74	9,78	32,02	40,99	79,46
INPC + 6%	0,44	7,21	1,71	3,96	9,07	20,13	29,35
IPCA + 6%	0,45	7,07	1,80	4,01	9,04	20,73	31,16

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	0,64	5,31	1,92	3,72	7,44	14,70	29,21
IRF-M 1+	1,87	11,89	3,27	9,07	20,81	27,25	51,71
IRF-M TOTAL	1,44	9,99	2,81	7,53	16,83	23,54	45,09
IMA-B 5	1,74	10,27	2,78	7,17	15,40	22,93	39,47
IMA-B 5+	3,73	26,55	4,48	17,54	44,85	43,66	68,51
IMA-B TOTAL	2,86	19,55	3,77	13,27	31,37	34,72	55,96
IMA-C TOTAL	1,74	17,25	3,44	11,52	23,71	39,55	50,80
IMA-GERAL ex-C TOTAL	1,46	10,53	2,59	7,40	16,57	22,60	41,10
IMA-GERAL TOTAL	1,46	10,72	2,61	7,52	16,78	23,07	41,30
IDKA 2	1,60	9,13	2,72	6,49	12,85	22,46	39,19
IDKA 20	4,78	39,62	5,22	24,54	72,09	60,71	94,10
CDI	0,46	4,66	1,54	3,10	6,27	13,34	26,41
Renda Variável							
IBOVESPA	3,57	19,18	3,74	9,78	32,02	40,99	79,46
IBRX 100	3,21	20,50	4,25	10,92	34,84	42,73	81,88
IBRX 50	3,69	17,61	3,06	8,52	29,03	38,44	75,75
SMALL CAP	2,08	30,58	9,49	21,44	57,29	45,27	105,52
IFIX	1,04	14,15	2,21	8,11	25,74	20,86	47,81
Índice Consumo - ICON	2,64	42,35	17,30	33,49	54,64	29,25	55,37
Índice Dividendos - IDIV	1,89	27,02	7,04	17,36	52,83	44,68	105,47
Indicadores Econômicos							
IPCA	-0,04	2,49	0,26	0,97	2,89	7,55	10,28
INPC	-0,05	2,63	0,17	0,93	2,92	7,01	8,76
IGPM	-0,01	4,10	-0,28	1,90	3,38	13,77	12,11
SELIC	0,46	4,66	1,54	3,10	6,27	13,35	26,43
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,29	5,55	1,30	3,00	6,99	16,25	23,93

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

IPCA + 5%	0,37	6,31	1,55	3,51	8,02	18,48	27,51
IPCA + 5,5%	0,41	6,69	1,68	3,76	8,53	19,60	29,33
IPCA + 5,89%	0,44	6,99	1,77	3,95	8,93	20,48	30,76
IPCA + 6%	0,45	7,07	1,80	4,01	9,04	20,73	31,16
INPC + 4%	0,28	5,69	1,20	2,96	7,02	15,67	22,22
INPC + 6%	0,44	7,21	1,71	3,96	9,07	20,13	29,35

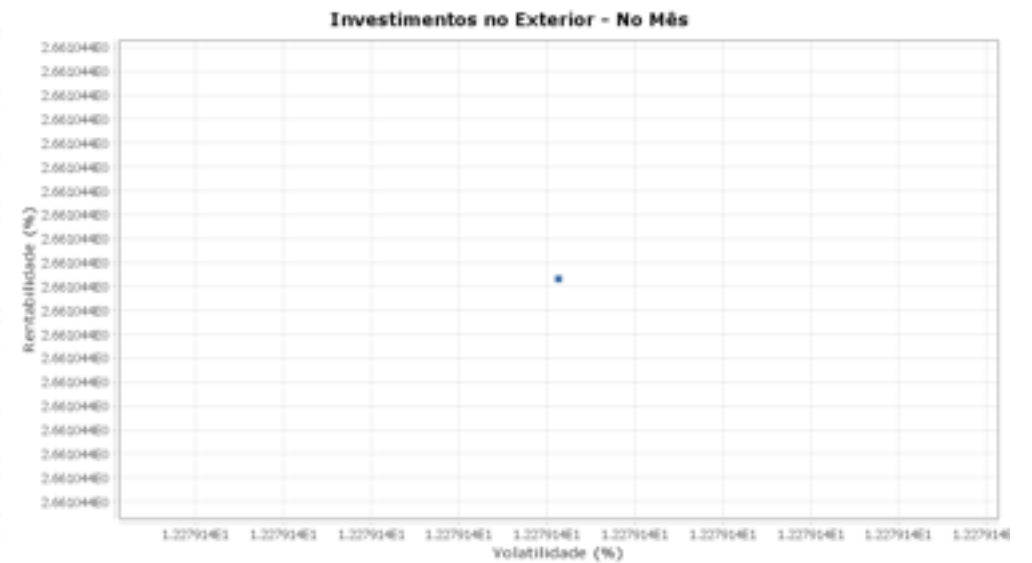
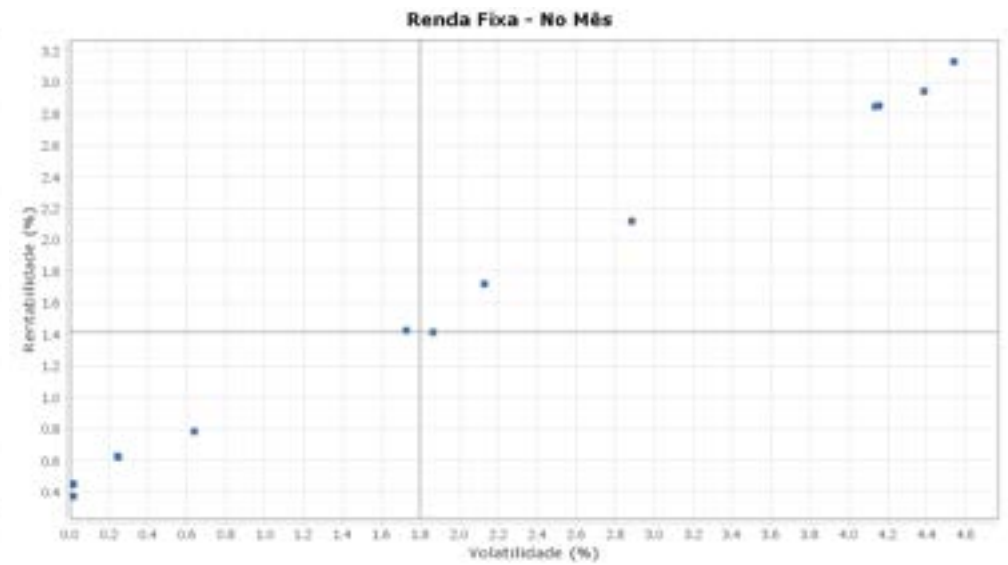
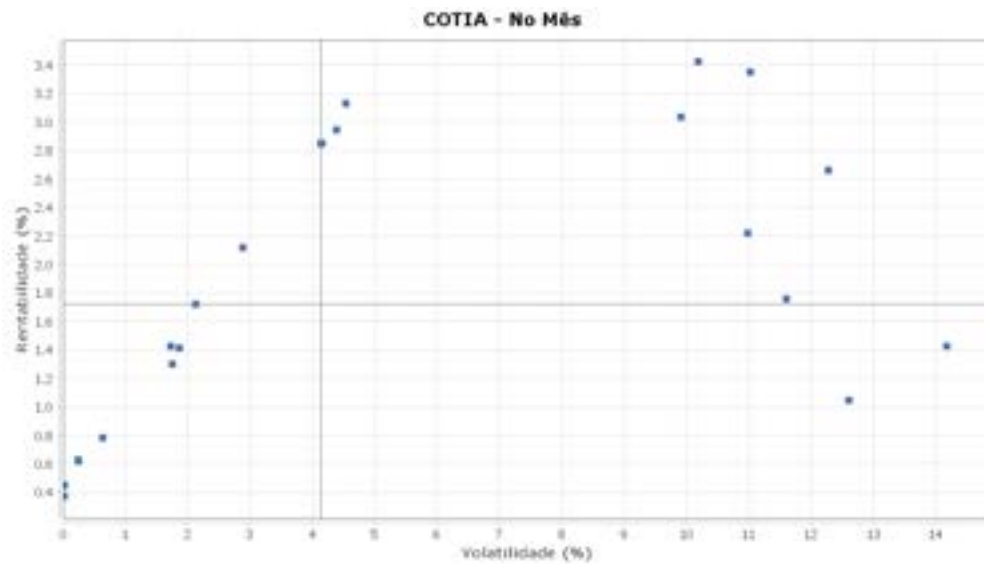
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
02/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	1.410,45	687,05667800	2,0528874030
03/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	27.154,19	13.224,81527400	2,0532755610
05/09/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.576,01	3.421,07705700	2,2145101890
06/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	776,48	377,95767600	2,0544099230
06/09/2019	BB PREV IMAB TPB	20.130,19	0,00	3.435,53620200	5,8594026700
06/09/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	77.120,29	34.817,37862200	2,2149941510
10/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	15.154,20	7.373,78665900	2,0551448940
11/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	5.281,60	2.569,45648200	2,0555319920
12/09/2019	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	10.000.000,00	2.776.208,44855700	3,6020350000
12/09/2019	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	7.500.000,00	0,00	22.345,35645795	335,6402040000
13/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	14.400,00	7.002,89536900	2,0562923250
13/09/2019	SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	2.500.000,00	0,00	21.487,37279067	116,3474020000
16/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	9.269,18	4.506,88651200	2,0566703810
19/09/2019	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	1.449.578,66	0,00	1.045.169,23684700	1,3869320000
20/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	1.042,17	506,36911300	2,0581231620
20/09/2019	BB PREV IMAB TPB	1.038.711,44	0,00	173.638,65923100	5,9820286830
20/09/2019	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	500.000,00	0,00	155.015,59146818	3,2254820000
20/09/2019	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	200.000,00	0,00	9.539,80779000	20,9647830000
20/09/2019	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	287.395,00	0,00	16.617,29768000	17,2949300000
20/09/2019	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	200.000,00	0,00	585,19232843	341,7679800000
23/09/2019	BB ACOES DIVIDENDOS FICFI	500.000,00	0,00	27.281,00581795	18,3277700000
23/09/2019	BB PREV ACOES GOVERNANÇA FI	500.000,00	0,00	181.856,36107300	2,7494226600
23/09/2019	SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	287.395,00	0,00	2.433,47241454	118,1007840000
24/09/2019	BB PREV IMAB TPB	230.453,23	0,00	38.654,49624400	5,9618738410
26/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	32,15	15,61055900	2,0595034390
27/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	68.216,55	33.117,35267500	2,0598430880
27/09/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.495.067,46	672.817,65414200	2,2220990350
30/09/2019	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	15.883,43	7.709,80903700	2,0601586790

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,02	0,45	19.422.753,87	2,80
BB PREVID RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,02	0,37	2.867.274,82	0,41
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,02	0,45	33.629.674,63	4,84
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,24	0,06	0,63	150.565.311,27	21,69
BB PREVID RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	0,25	0,06	0,62	58.021.282,16	8,36
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,64	0,10	0,78	3.816.837,16	0,55
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,73	0,25	1,42	53.136.409,56	7,65
BB PREV MM FI LP	Artigo 8º III	1,75	0,24	1,30	4.037.674,97	0,58
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,86	0,26	1,41	32.252.458,98	4,65
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	2,13	0,30	1,72	196.369.299,71	28,28
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,88	0,40	2,12	20.350.434,90	2,93
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	4,14	0,56	2,85	28.713.866,53	4,14
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	4,15	0,56	2,85	26.150.085,63	3,77
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	4,39	0,59	2,94	7.854.889,82	1,13
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	4,54	0,62	3,13	3.605.236,56	0,52
BB PREV ACOES GOVERNANÇ A FI	Artigo 8º I, Alínea a	9,91	1,17	3,03	8.372.570,43	1,21
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	10,19	1,22	3,42	3.416.418,97	0,49
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	10,98	1,24	2,22	2.843.631,95	0,41
FI ACOES CAIXA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	11,02	1,30	3,35	8.031.866,05	1,16
BB ACOES DIVIDENDOS FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	11,60	1,29	1,76	8.124.784,48	1,17
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	12,28	1,40	2,66	8.325.247,82	1,20
FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	12,60	1,36	1,05	7.529.507,99	1,08
FIC ACOES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	14,18	1,54	1,43	6.858.817,69	0,99