



LDB
EMPRESAS

COTIA
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 05.11.2020.

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

83,34%

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	0,54	0,04	2,83	41.908.710,74	5,60	7.413.658.574,68	0,57
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	14,59	-2,12	-0,22	8.359.321,81	1,12	1.126.582.665,78	0,74
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,72	-1,56	-0,93	32.534.572,29	4,35	5.533.318.681,28	0,59
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,79	-1,53	-1,00	28.588.734,57	3,82	5.834.527.804,73	0,49
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,13	2,97	114.333.361,68	15,28	10.130.144.603,43	1,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,01	-0,16	4,29	130.739.162,73	17,47	17.747.142.317,32	0,74
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,16	0,11	4,55	35.908.858,13	4,80	7.070.754.781,93	0,51
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,08	0,04	4,84	57.043.729,65	7,62	9.208.011.978,57	0,62
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	-0,50	4,53	102.611.144,31	13,71	13.535.810.678,86	0,76
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,13	-0,29	2,99	552.027.595,91	73,78		

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	14,52	-1,67	0,38	4.213.707,74	0,56	634.471.413,86	0,66
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,30	-0,00	1,77	25.718.098,60	3,44	4.760.770.417,77	0,54
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,02	1,82	13.155.739,51	1,76	2.533.726.732,47	0,52
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,08	-0,00	1,42	2.724.647,13	0,36	1.878.414.583,86	0,15
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,65	-0,23	2,47	4.787.564,91	0,64	4.773.930.449,92	0,10
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	6,84	-0,88	-1,79	10.898.397,93	1,46	2.073.034.805,37	0,53
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	1,03	-0,09	0,07	10.006.808,03	1,34	1.613.398.573,38	0,62
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,04	-0,25	1,47	71.504.963,85	9,56		

Renda Fixa

3,78

-0,29

2,85

623.532.559,76

83,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

12,79%

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	45,16	-4,95	-18,85	8.662.940,25	1,16	951.590.330,36	0,91
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	44,49	-5,04	-17,78	12.220.137,18	1,63	900.328.465,10	1,36
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			44,78	-5,01	-18,28	20.883.077,43	2,79		

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	38,48	-4,70	-23,62	9.398.117,25	1,26	890.322.162,57	1,06
SAFRA	SAFRA	SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	39,97	-4,05	-20,51	4.624.583,91	0,62	241.440.301,16	1,92
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	43,91	-4,26	-7,22	3.247.472,71	0,43	799.315.189,79	0,41
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	41,38	-2,90	-15,40	10.656.325,69	1,42	578.311.222,57	1,84
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,13	-4,93	-17,58	10.774.957,62	1,44	783.577.685,83	1,38
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	41,71	-4,00	-3,89	6.914.849,64	0,92	1.846.376.502,59	0,37
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	43,48	-4,96	-20,69	3.056.721,50	0,41	3.159.975.144,49	0,10
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	44,55	-5,38	-7,42	2.777.465,12	0,37	829.854.206,90	0,33
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	43,54	-4,28	-7,54	7.499.578,20	1,00	409.615.889,73	1,83
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	46,31	-0,68	-0,68	2.979.531,36	0,40	112.681.607,88	2,64
SAFRA	SAFRA	SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	48,04	-5,84	-6,72	2.798.382,77	0,37	124.644.566,62	2,25
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			39,71	-4,35	-18,95	64.727.985,77	8,65		

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	3,01	-0,77	0,10	6.277.082,63	0,84	456.791.771,96	1,37
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	1,41	-0,57	-0,26	3.792.068,85	0,51	55.327.907,23	6,85
Sub-total Artigo 8º III			2,99	-0,69	0,38	10.069.151,48	1,35		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	37,25	-4,13	-17,35	95.680.214,68	12,79
---	-------	-------	--------	---------------	-------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,87%

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	18.631.145,03	2,49	1.671.279.124,17	1,11
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	31,96	-2,53	9,10	10.350.075,09	1,38	1.629.396.528,45	0,64
Sub-total Artigo 9º A, III			28,37	-2,50	52,17	28.981.220,12	3,87		
Investimentos no Exterior			28,37	-2,50	52,17	28.981.220,12	3,87		
Total			5,98	-0,74	1,72	748.193.994,56	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	552.027.595,91	73,78	0,00	55,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	71.504.963,85	9,56	0,00	15,00	30,00	40,00
	Total Renda Fixa	623.532.559,76	83,34				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	20.883.077,43	2,79	0,00	7,00	15,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	64.727.985,77	8,65	0,00	10,00	15,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	10.069.151,48	1,35	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	95.680.214,68	12,79				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	28.981.220,12	3,87	0,00	3,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	28.981.220,12	3,87				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

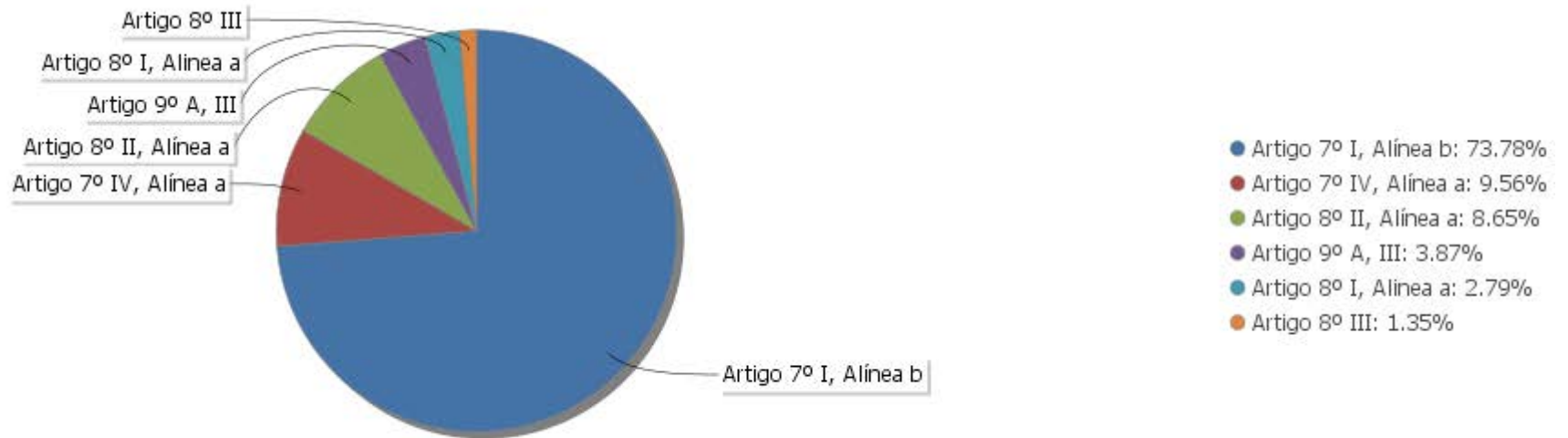
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,29 -185,99	2,99 131,36	0,71 137,96	3,55 284,24	5,14 145,14	-1.621.032,91	17.612.077,38
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,25 -158,28	1,47 64,82	0,13 25,68	1,08 86,45	2,71 76,59	-176.281,24	963.318,65
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-5,01 -0,21	-18,28 -0,09	-0,44 0,04	30,41 0,85	-9,19 0,50	-1.073.071,80	-3.436.187,41
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,35 0,44	-18,95 -0,75	-0,49 -0,01	23,29 -6,27	-8,33 1,35	-2.870.232,36	-9.535.066,02
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,69 4,10	0,38 18,57	-0,55 -0,07	1,18 -28,38	2,75 12,43	-67.947,55	2.771,58
Artigo 9º A, III % do CDI	-2,50 -1.594,70	52,17 2.292,61	14,54 2.839,07	42,48 3.396,84	60,59 1.710,16	187.322,05	7.011.472,64
						-5.621.243,81	12.618.386,82

Análise de Liquidez

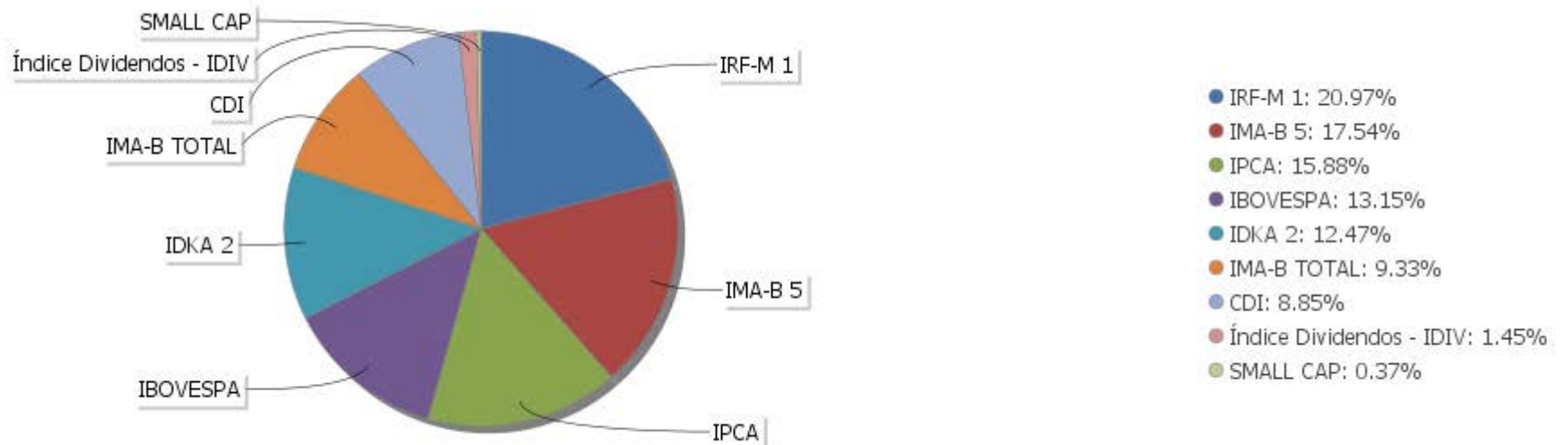
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	703.534.565,43	94,03	703.534.565,43	94,03
de 31 a 364 dias	44.659.429,13	5,97	748.193.994,56	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	748.193.994,56	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

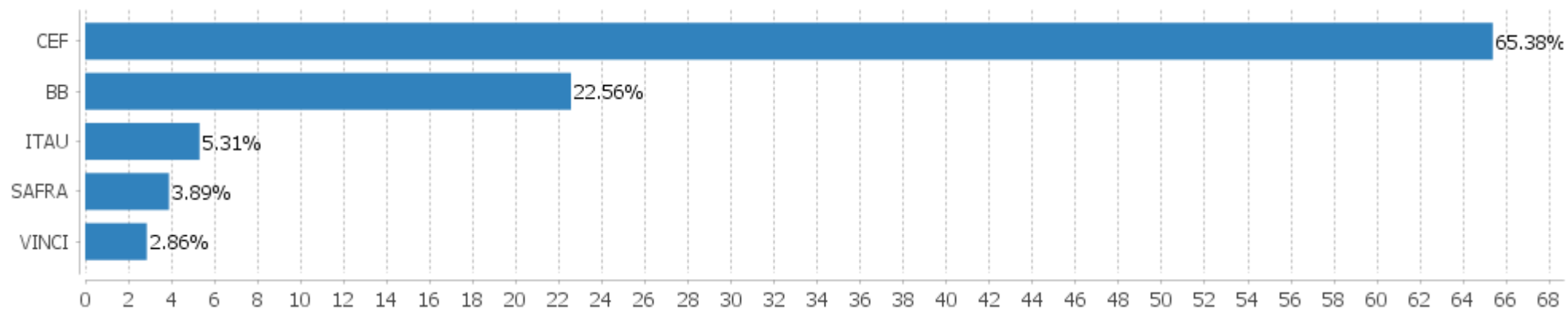


Alocação Por Estratégia



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	1,59	-0,08	-0,74				1,72
IPCA + 5,85%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12				5,73
p.p. indexador	-0,21	-0,98	-4,13	1,26	1,55	0,68	0,71	-0,80	-1,86				-4,02
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

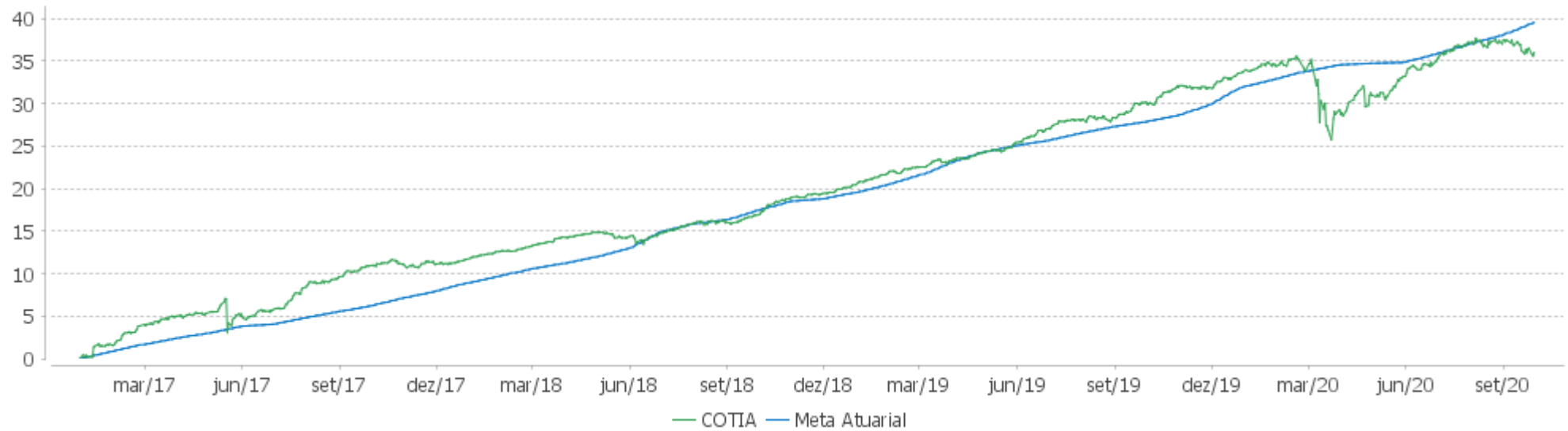
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

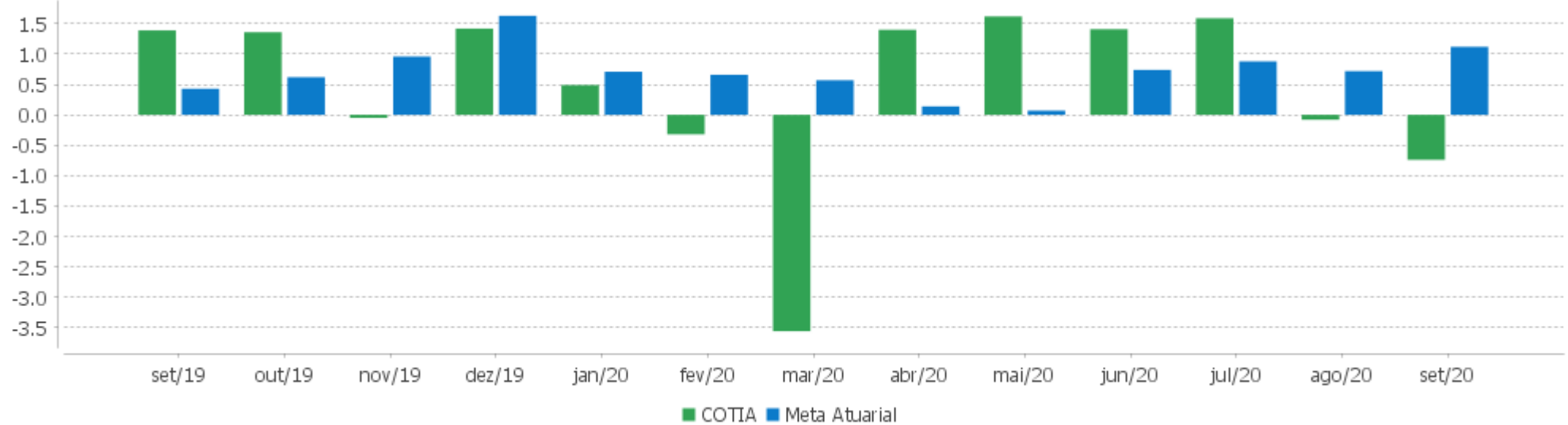
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	23	51,11	03 meses	0,75	2,74	-1,99	3,49
Meses abaixo da Meta Atuarial	22	48,89	06 meses	5,29	3,72	1,57	4,31
			12 meses	4,50	9,21	-4,70	5,98
			24 meses	16,39	19,08	-2,69	4,36
			36 meses	22,64	31,85	-9,21	3,68
Maior rentabilidade da Carteira	2,52	2017-07	Desde 30/12/2016	36,03	40,16	-4,13	4,04
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
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	-1,67 -1.062,65	0,38 16,84	0,72 141,56	5,96 476,77	3,18 89,80	37,20 370,61	40,10 231,03
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,02 15,30	1,82 79,94	0,44 86,28	1,22 97,65	2,98 84,04	9,27 92,40	16,58 95,53
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	-0,00 -0,19	1,42 62,49	0,18 34,55	0,66 53,10	2,40 67,81	7,66 76,30	13,60 78,36
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	-0,88 -1,52	2,89 2,04	-0,03 -1,28	2,85 2,04			
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	-0,09 -57,32	3,31 145,46	0,42 81,59	1,62 129,57			
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	-0,00 -1,68	1,77 77,58	0,39 76,38	0,97 77,46	2,90 81,81	9,20 91,67	16,28 93,76
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	-0,23 -0,87	2,47 1,12	0,20 -1,05	1,32 0,51	3,69 0,56	17,87 11,75	25,30 14,38
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
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,16 -0,04	4,29 -0,22	1,21 -0,09	4,96 -0,15	6,91 -0,33	23,18 -0,58	30,91 -0,93
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,11 0,10	4,55 -0,86	1,61 -0,38	5,24 -0,17	7,28 -0,72	20,27 -1,61	29,41 -2,85
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,04 -0,11	2,83 -0,29	0,36 -0,14	1,43 -0,23	4,17 -0,37	11,70 -0,63	18,97 -0,94
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
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,12 -0,60	-0,22 0,50	0,45 -0,51	5,97 0,00	2,89 0,78	38,19 4,05	40,35 2,78
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
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	-4,28	-10,15	2,46	38,42	1,63		

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.	0,51	8,05	2,94	8,86	11,31		
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	-4,00	-11,63	3,54	35,88	-0,77	43,28	50,76
Var. IBOVESPA p.p.	0,80	6,57	4,01	6,32	8,92	24,04	23,42
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	-4,93	-3,47	2,40	43,93	7,75		
Var. IBOVESPA p.p.	-0,13	14,72	2,87	14,37	17,43		
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	-2,90	-15,40	0,62	29,23	-0,02	56,46	48,61
Var. IBOVESPA p.p.	1,90	2,80	1,10	-0,33	9,66	37,23	21,27
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	-4,05	-20,51	-2,81	21,30	-10,77	33,75	19,34
Var. IBOVESPA p.p.	0,74	-2,31	-2,33	-8,26	-1,09	14,51	-8,00
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	-4,96	-20,69	2,00	30,39	-10,53	31,29	43,75
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	-4,26	-16,02	0,71	31,74	-5,26	30,94	33,21
Var. IBOVESPA p.p.	0,53	2,17	1,18	2,18	4,42	11,70	5,88
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-4,93	-17,58	-0,96	19,42	-6,98	43,54	33,91
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,30	3,49	2,35	4,64	2,83	5,70	3,42
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	-5,84	-18,54	1,07	37,47	-2,42		
Var. SMALL CAP p.p.	-0,40	0,39	-1,20	1,97	-0,63		
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-4,70	-23,62	-1,71	18,99	-16,46	13,75	13,73
Var. IBOVESPA p.p.	0,10	-5,43	-1,24	-10,57	-6,77	-5,49	-13,61
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	-5,38	-14,85	-0,22	32,92	-2,46		
Var. IBOVESPA p.p.	-0,58	3,34	0,25	3,37	7,23		
FIA BRASIL IBX-50	-4,95	-18,85	-0,51	30,59	-10,27	14,44	21,57
Var. IBOVESPA p.p.	-0,16	-0,65	-0,03	1,03	-0,59	-4,79	-5,76
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-5,04	-17,78	-0,39	30,27	-8,20	24,95	26,70
Var. IBOVESPA p.p.	-0,25	0,41	0,09	0,71	1,48	5,72	-0,63
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	-0,57	1,92	0,44	1,61			
% do CDI	-361,33	134,14	84,96	128,92			
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	-0,77	0,10	-0,82	0,90	2,46	11,09	19,34
% do CDI	-490,25	4,34	-160,92	72,08	69,57	110,50	111,41
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-1,99	52,76	14,98	43,04	61,21	70,33	154,87
Var. IBOVESPA p.p.	2,80	70,95	15,46	13,48	70,90	51,09	127,53
SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	-2,53	42,55	15,35	40,62	48,85	70,31	
Var. IBOVESPA p.p.	2,26	60,75	15,82	11,07	58,54	51,08	
CDI	0,16	2,28	0,51	1,25	3,54	10,04	17,36
IBOVESPA	-4,80	-18,20	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34
INPC + 6%	1,36	6,58	3,22	4,50	10,12	20,11	32,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 6%	1,13	5,85	2,78	3,79	9,32	19,21	31,99

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	0,15	3,12	0,51	1,66	4,54	12,32	19,91
IRF-M 1+	-0,91	5,40	-0,59	3,90	7,61	30,00	36,94
IRF-M TOTAL	-0,56	4,62	-0,24	3,15	6,56	24,50	31,64
IMA-B 5	-0,12	4,51	1,30	5,11	7,24	23,75	31,84
IMA-B 5+	-2,60	-4,56	0,75	6,78	-1,67	42,42	41,26
IMA-B TOTAL	-1,51	-0,72	0,96	5,97	2,11	34,14	37,56
IMA-C TOTAL	2,95	17,78	9,60	18,32	19,95	48,39	67,40
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,71	1,96	0,25	2,99	3,90	21,11	27,38
IMA-GERAL TOTAL	-0,60	2,41	0,53	3,43	4,35	21,85	28,42
IDKA 2	0,02	5,41	1,99	5,41	8,00	21,88	32,26
IDKA 20	-4,30	-11,82	0,58	7,11	-8,89	56,79	46,43
CDI	0,16	2,28	0,51	1,25	3,54	10,04	17,36
Renda Variável							
IBOVESPA	-4,80	-18,20	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34
IBRX 100	-4,58	-17,42	-0,04	30,33	-8,59	23,26	30,47
IBRX 50	-4,62	-18,06	-0,37	31,30	-10,02	16,09	24,57
SMALL CAP	-5,44	-18,93	2,27	35,50	-1,78	54,49	42,68
IFIX	0,46	-12,59	-0,41	12,06	4,12	30,92	25,84
Índice Consumo - ICON	-3,96	-9,26	1,83	42,00	-1,04	53,03	27,90
Índice Dividendos - IDIV	-4,63	-21,08	-3,31	14,78	-9,81	37,85	30,49
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,64	1,34	1,24	0,81	3,14	6,12	10,92
INPC	0,87	2,04	1,68	1,49	3,89	6,93	11,17
IGPM	4,34	14,40	9,59	12,51	17,94	21,91	34,14
SELIC	0,16	2,28	0,51	1,25	3,54	10,04	17,37
Meta Atuarial							

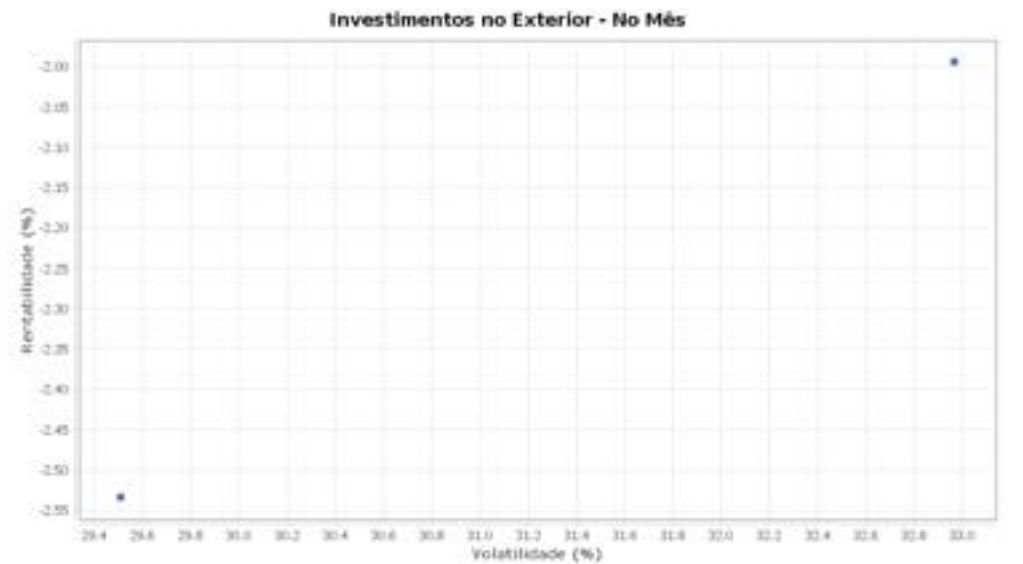
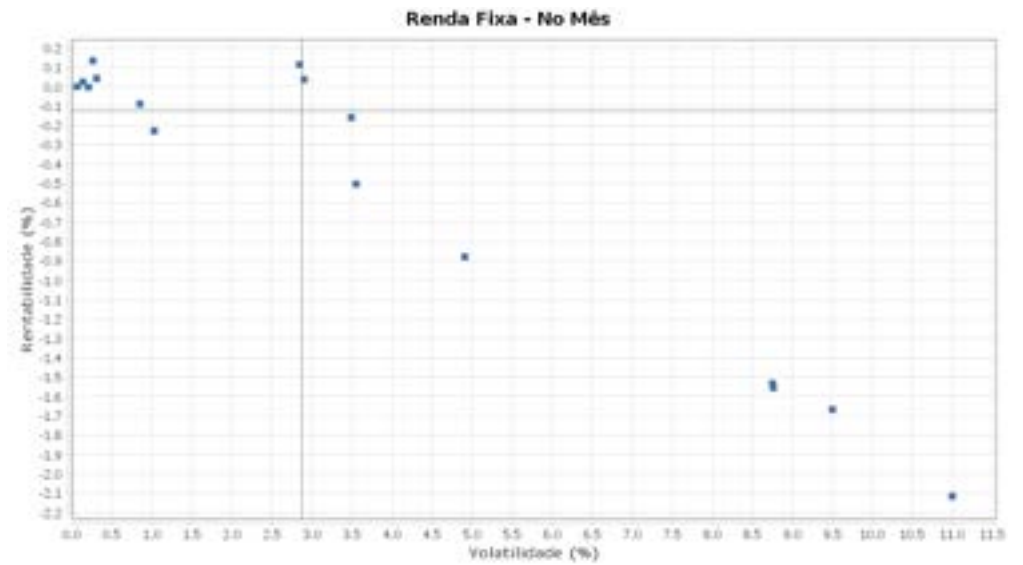
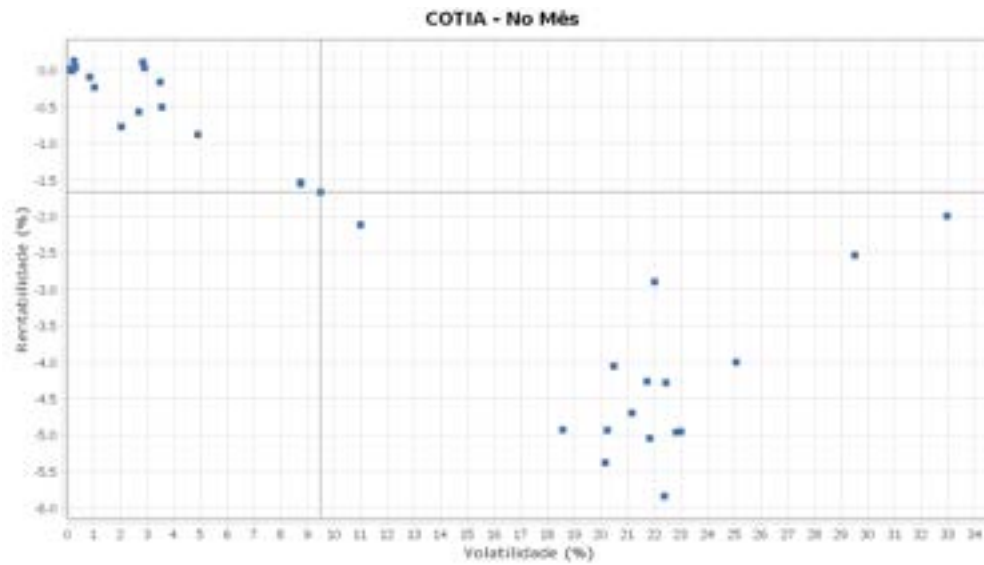
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
258	01/09/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	10.863,72	0,00	10.446,80138200	1,0399087340
264	01/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	13.033,88	6.177,97499500	2,1097333690
265	03/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.370,04	3.967,07883800	2,1098748830
266	04/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.880,93	3.261,18023100	2,1099508500
255	08/09/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	100.067,79	36.947,15947900	2,7084027950
267	08/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.983,12	4.731,27554200	2,1100271820
261	09/09/2020	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	20.769,25	0,00	3.328,31717300	6,2401655010
268	10/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	690,00	326,99077900	2,1101512440
274	11/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	4.777,22	0,00	2.263,89754900	2,1101749950
269	14/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	15.484,84	7.338,16607100	2,1101784630
270	15/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	101,18	47,94885100	2,1101652880
251	16/09/2020	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	3.755.000,00	0,00	144.459,38623419	25,9934650000
262	16/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.300.000,00	4.354.069,87970400	2,5952730000
271	16/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.296,70	2.510,20423400	2,1100673520
252	17/09/2020	SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	7.545.000,00	0,00	14.182,05443600	532,0103680000
263	21/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.000.000,00	1.155.851,55644700	2,5954890000
253	23/09/2020	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	3.000.000,00	0,00	23.773,95457700	126,1885140000
254	23/09/2020	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	700.000,00	0,00	273.128,25416100	2,5628985260
259	23/09/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1.066.653,71	0,00	1.036.553,12561800	1,0290391140
260	23/09/2020	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	400.000,00	0,00	392.553,52152900	1,0189693330
272	28/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	92.539,29	43.860,14019400	2,1098721890
256	29/09/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	1.933.730,92	714.129,93574600	2,7078138350
257	30/09/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	213.352,86	78.780,33494300	2,7081994530
273	30/09/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	86.565,55	41.033,08977300	2,1096522460

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,04	0,00	-2,43	-0,00	2.724.647,13	0,36
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,14	0,06	0,00	-0,97	0,02	13.155.739,51	1,76
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,21	0,08	0,00	-0,78	-0,00	25.718.098,60	3,44
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,26	0,14	0,01	-0,09	0,13	114.333.361,68	15,28
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,31	0,14	0,00	-0,37	0,04	41.908.710,74	5,60
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,85	0,23	0,00	-0,29	-0,09	10.006.808,03	1,34
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	1,02	0,41	0,00	-0,38	-0,23	4.787.564,91	0,64
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	Artigo 8º III	2,03	0,78	0,01	-0,46	-0,77	6.277.082,63	0,84
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	Artigo 8º III	2,69	0,63	0,00	-0,27	-0,57	3.792.068,85	0,51
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,84	0,94	0,03	-0,02	0,11	35.908.858,13	4,80
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,90	1,03	0,05	-0,04	0,04	57.043.729,65	7,62
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,49	1,02	0,13	-0,09	-0,16	130.739.162,73	17,47
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,55	1,33	0,14	-0,19	-0,50	102.611.144,31	13,71
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	4,90	1,54	0,02	-0,21	-0,88	10.898.397,93	1,46
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	8,75	3,24	0,10	-0,19	-1,53	28.588.734,57	3,82
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	8,76	3,22	0,11	-0,20	-1,56	32.534.572,29	4,35
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	9,50	3,28	0,01	-0,19	-1,67	4.213.707,74	0,56
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	10,99	3,74	0,03	-0,21	-2,12	8.359.321,81	1,12
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	18,57	10,57	0,14	-0,27	-4,93	10.774.957,62	1,44
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	Artigo 8º II, Alínea a	20,17	11,08	0,04	-0,27	-5,38	2.777.465,12	0,37
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,24	12,18	0,04	-0,25	-4,93	2.979.531,36	0,40
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	20,48	14,36	0,08	-0,21	-4,05	4.624.583,91	0,62
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	21,16	11,35	0,13	-0,23	-4,70	9.398.117,25	1,26
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	21,73	10,79	0,04	-0,20	-4,26	3.247.472,71	0,43
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	21,83	11,24	0,17	-0,24	-5,04	12.220.137,18	1,63
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	22,01	12,43	0,16	-0,14	-2,90	10.656.325,69	1,42
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,38	17,07	0,05	-0,27	-5,84	2.798.382,77	0,37
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	22,44	11,04	0,10	-0,20	-4,28	7.499.578,20	1,00
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	22,82	12,64	0,05	-0,22	-4,96	3.056.721,50	0,41
FIA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	22,99	11,46	0,12	-0,22	-4,95	8.662.940,25	1,16

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	25,07	11,69	0,10	-0,17	-4,00	6.914.849,64	0,92
SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	Artigo 9º A, III	29,51	11,58	0,02	-0,09	-2,53	10.350.075,09	1,38
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	32,97	12,73	0,04	-0,07	-1,99	18.631.145,03	2,49