



LDB
EMPRESAS

GUARAPARI CONSOLIDADO
JULHO 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 28.09.2020.

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 **65,85%**

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%)	7,67	0,65	3,03	12.237.696,47	6,13
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		7,67	0,65	3,03	12.237.696,47	6,13

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	5,87	1,13	5,86	180.631,89	0,09	5.350.645.859,80	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	22,79	7,49	-1,55	3.523.206,86	1,77	336.367.162,90	1,05
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,54	0,23	2,69	70.160,28	0,04	7.835.713.656,67	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,47	4,36	2,54	7.770.109,33	3,90	5.823.784.558,48	0,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,54	4,38	2,42	5.787.014,58	2,90	6.313.416.954,01	0,09
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,24	2,73	16.218.995,23	8,13	10.907.406.871,77	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,32	7,29	1,46	9.451.194,85	4,74	2.059.270.796,72	0,46
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO	8,70	1,50	6,31	510.594,76	0,26	3.049.933.927,01	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	4,02	0,83	3,97	10.304.532,74	5,17	7.954.778.997,85	0,13
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,08	1,77	3,55	14.102.226,43	7,07	10.799.663.748,52	0,13
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	0,98	5,65	36.727.333,17	18,41	12.451.209.797,34	0,29
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,55	2,14	3,89	104.646.000,12	52,46		

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	2,54	1,86	0,53	11.711.729,82	5,87	182.307.109,20	6,42
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,54	1,86	0,53	11.711.729,82	5,87		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

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	8,13	1,86	5,47	2.757.040,50	1,38	184.385.326,60	1,50
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			8,13	1,86	5,47	2.757.040,50	1,38		
Renda Fixa			5,65	1,97	3,60	131.352.466,91	65,85		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

27,88%

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	44,20	8,44	-10,49	4.386.054,54	2,20	912.996.606,09	0,48
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVSPA	42,71	8,08	-11,06	10.303.032,49	5,16	118.687.515,39	8,68
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			43,09	8,18	-10,90	14.689.087,03	7,36		

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 AÇÕES ENERGIA FI	36,31	7,73	-5,55	5.690.723,61	2,85	497.024.587,42	1,14
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	38,20	6,77	-17,03	1.483.627,56	0,74	972.576.793,16	0,15
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	59,15	6,94	-25,46	1.041.346,23	0,52	575.045.117,36	0,18
CEF	CEF	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	46,64	8,53	-11,22	405.588,52	0,20	534.839.440,79	0,08
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	41,21	8,86	-8,47	8.302.548,85	4,16	594.347.288,74	1,40
CEF	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	45,40	7,41	-9,05	412.167,83	0,21	737.824.163,56	0,06
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	45,00	8,36	-0,70	8.795.007,84	4,41	154.315.606,33	5,70
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	42,64	7,46	-15,22	2.181.061,35	1,09	429.632.224,85	0,51
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	40,86	6,38	-12,84	5.266.351,75	2,64	921.115.521,73	0,57
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	39,01	8,32	-9,87	3.817.628,11	1,91	862.156.434,48	0,44
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			40,29	7,92	-8,63	37.396.051,65	18,75		

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	1,76	0,05	1,85	2.921.653,94	1,46	507.871.987,12	0,58
Sub-total Artigo 8º III			1,76	0,05	1,85	2.921.653,94	1,46		

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	30,30	17,66	-11,05	40.028,00	0,02	147.701.406,79	0,03
RIO BRAVO	VOTORANTIM	RBRD11	69,21	-17,28	-21,97	562.953,70	0,28	150.023.338,76	0,38
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			108,65	-15,48	-66,34	602.981,70	0,30		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			37,08	7,22	-10,50	55.609.774,32	27,88		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,28%

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	26,66	1,88	35,34	7.747.823,57	3,88	1.279.266.331,34	0,61
BB	BB	BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	26,48	0,98	30,58	4.774.173,64	2,39	276.723.998,51	1,73
Sub-total Artigo 9º A, III			26,40	1,53	33,49	12.521.997,21	6,28		
Investimentos no Exterior			26,40	1,53	33,49	12.521.997,21	6,28		
Total						199.484.238,44	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 a	Títulos do Tesouro Nacional	12.237.696,47	6,13	0,00	6,69	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	104.646.000,12	52,46	0,00	38,65	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	11.711.729,82	5,87	0,00	18,65	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.757.040,50	1,38	0,00	1,39	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	131.352.466,91	65,85				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	14.689.087,03	7,36	0,00	2,39	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	37.396.051,65	18,75	0,00	18,97	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	2.921.653,94	1,46	0,00	1,54	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	602.981,70	0,30	0,00	0,74	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	55.609.774,32	27,88				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	12.521.997,21	6,28	0,00	5,14	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	12.521.997,21	6,28				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

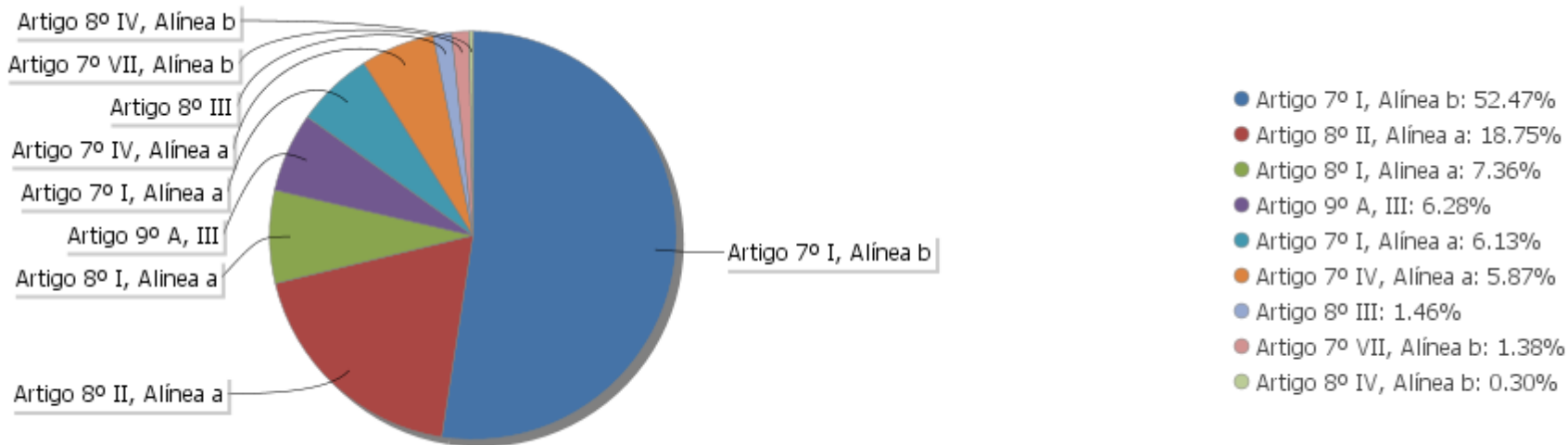
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,65 332,82	3,03 155,42	0,78 121,11	1,91 121,42	3,81 90,38	78.645,75	363.572,99
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	2,14 1.103,23	3,89 199,51	4,53 703,28	3,36 213,90	7,99 189,59	2.240.794,39	4.011.385,83
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,86 959,39	0,53 27,26	2,86 443,55	-0,08 -5,26	5,74 136,29	201.418,33	98.001,75
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	1,86 954,94	5,47 280,29	6,05 939,30	4,62 294,58	10,69 253,70	50.233,50	143.026,50
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,18 -0,08	-10,90 0,11	27,35 -0,48	-9,52 0,02	1,54 0,46	1.102.108,89	-1.784.553,96
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	7,92 -0,34	-8,63 2,38	24,75 -3,08	-9,86 -0,32	6,10 5,02	2.745.031,66	-3.164.100,01
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,05 -8,21	1,85 12,86	0,43 -27,40	1,53 11,06	4,66 3,58	1.598,56	52.978,89
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-15,48 -23,74	-66,34 -55,33	-57,18 -85,01	-65,69 -56,16	-60,92 -62,00	-110.340,15	-1.219.619,71
Artigo 9º A, III % do CDI	1,53 788,18	33,49 1.715,50	7,86 1.221,05	26,98 1.719,19	52,58 1.247,49	188.911,84	3.141.430,91
						6.498.402,77	1.642.123,19

Análise de Liquidez

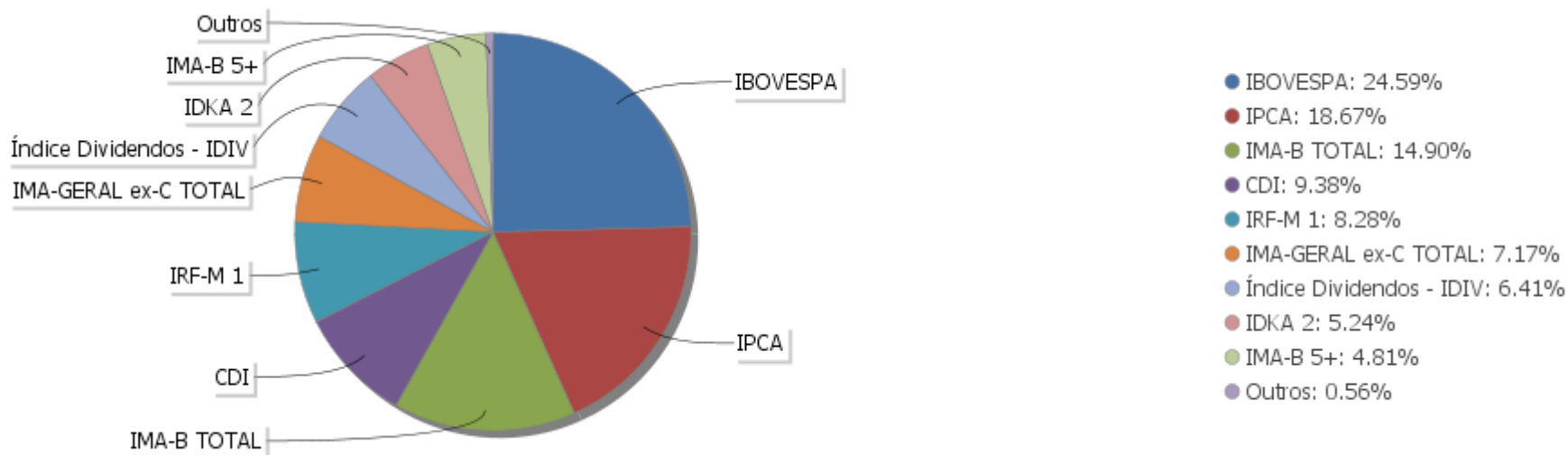
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	158.143.351,48	79,28	158.143.351,48	79,28
de 31 a 364 dias	29.103.190,49	14,59	187.246.541,97	93,87
acima de 365 dias	12.237.696,47	6,13	199.484.238,44	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

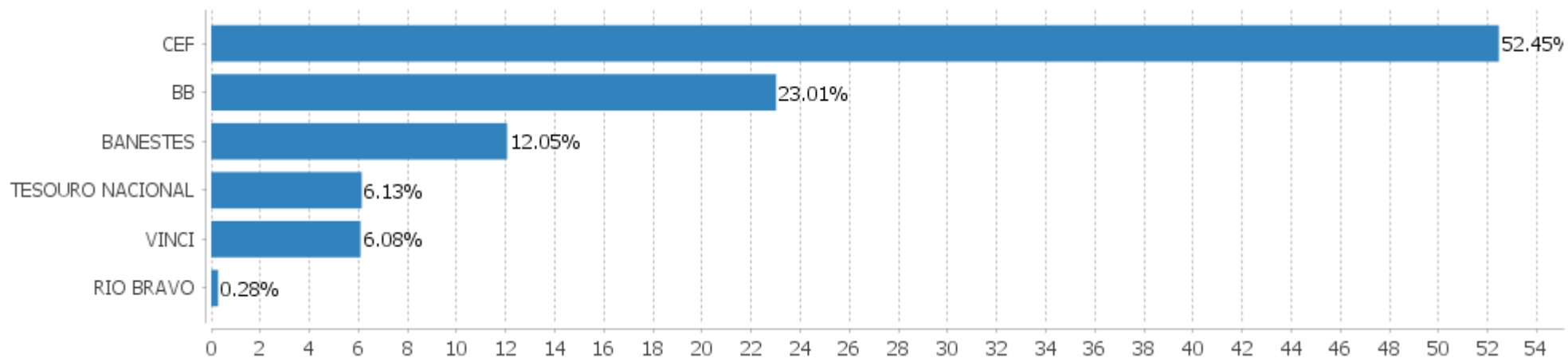


Alocação Por Estratégia



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	2,99	3,34						0,79
INPC + 5,87%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,96						4,19
p.p. indexador	0,08	-2,70	-9,95	3,52	1,79	2,21	2,38						-3,40
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%	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%	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%	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

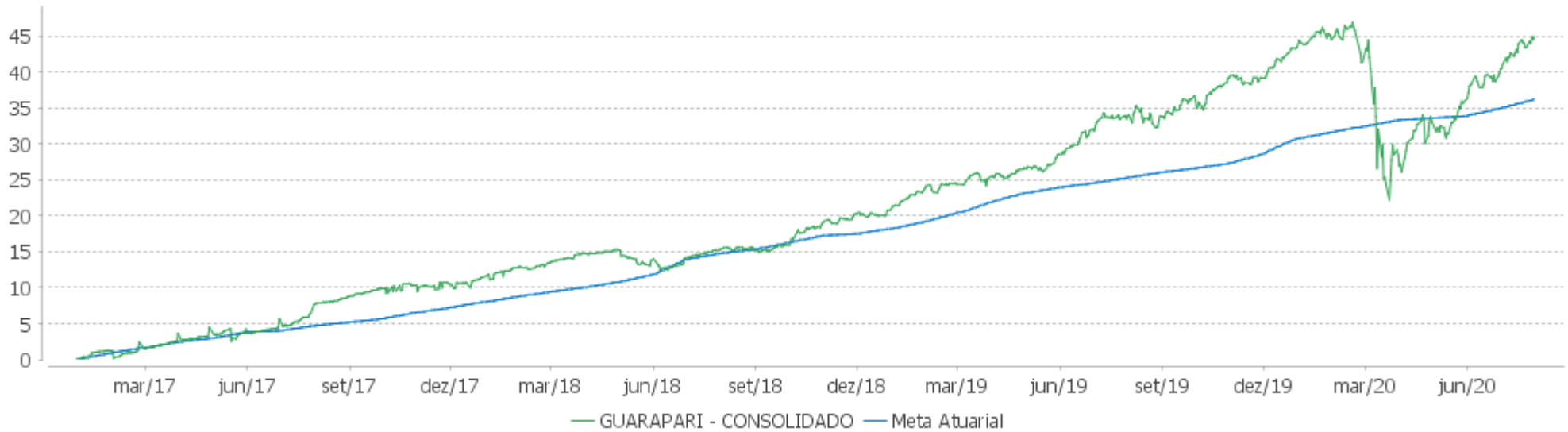
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

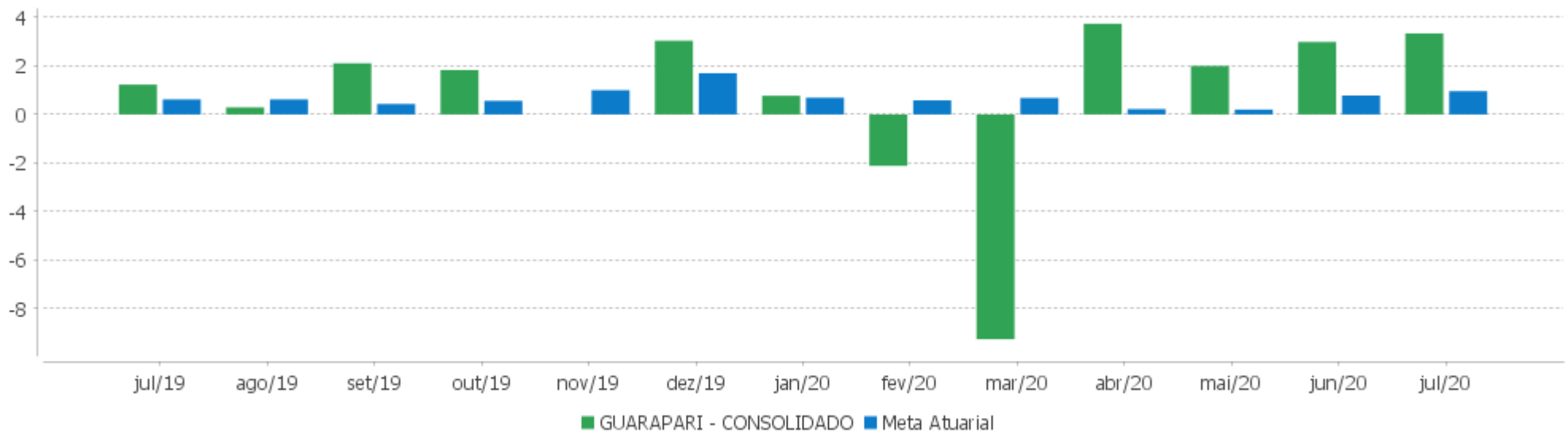
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	27	62,79	03 meses	8,56	1,96	6,60	7,30
Meses abaixo da Meta Atuarial	16	37,21	06 meses	0,02	3,47	-3,45	18,13
			12 meses	8,30	8,80	-0,51	13,22
			24 meses	25,37	18,92	6,45	9,64
			36 meses	34,35	30,55	3,80	8,16
Maior rentabilidade da Carteira	3,74	2020-04	Desde 30/12/2016	44,61	36,75	7,86	7,76
Menor rentabilidade da Carteira	-9,27	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 IRF-M 1+ TITULO Var. IRF-M 1+ p.p.	1,50 0,03	7,47 -0,12	4,47 -0,03	6,32 -0,08	11,77 -0,24	32,19 -0,62	42,77 -1,01
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	7,49 3,11	-1,55 -4,20	10,74 2,60	-2,09 -4,47	4,08 -4,07	44,21 6,35	49,90 3,15
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,38 -0,01	2,42 -0,23	8,09 -0,05	2,17 -0,22	7,72 -0,43	37,07 -0,79	45,56 -1,19
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,77 0,11	3,55 0,15	3,83 0,26	3,05 0,17	7,10 0,02	23,78 0,51	32,81 0,56
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,23 -0,01	2,69 -0,15	0,88 -0,06	2,26 -0,13	5,22 -0,29	12,65 -0,54	20,70 -0,86
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,98 0,62	5,65 5,19	3,14 2,90	4,79 4,54	9,68 7,38	28,24 22,64	37,15 26,81
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,83 -0,11	3,97 -0,34	3,96 0,24	3,50 -0,26	8,10 -0,58	20,93 -1,44	31,10 -2,25
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,13 0,04	5,86 -0,14	3,31 -0,01	4,96 -0,12	9,57 -0,24	26,04 -0,55	35,92 -0,87
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,36 -0,02	2,54 -0,11	8,07 -0,07	2,27 -0,11	7,94 -0,22	37,20 -0,66	45,69 -1,07
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,24 0,00	2,73 -0,11	0,90 -0,04	2,30 -0,09	5,30 -0,21	12,79 -0,41	20,92 -0,64
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	7,29 -0,03	1,46 -0,22	11,43 -0,08	1,50 -0,14	7,35 -0,46	47,92 -1,45	54,33 -1,86
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF Var. IPCA + 6% p.p.	1,86 0,96	5,47 1,56	6,05 4,31	4,62 1,46	10,69 2,22	28,48 9,86	35,88 4,56
NTN-B 150850 (3,650000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,65 -3,74	3,03 0,38	0,78 -7,36	1,91 -0,48	3,81 -4,35	6,71 -31,16	
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	1,86 959,39	0,53 27,26	2,86 443,55	-0,08 -5,26	6,90 163,77	26,22 242,12	
CXCE11B Var. IBOVESPA p.p.	-1,16 -9,43	-11,05 -0,04	5,51 -22,32	-9,01 0,52	7,46 6,38	288,31 258,40	1.186,78 1.130,66
RBRD11 Var. IBOVESPA p.p.	-17,28 -25,54	-21,97 -10,96	13,38 -14,45	-20,92 -11,39	-17,43 -18,51	8,95 -20,96	13,66 -42,45
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	0,05	1,85	0,43	1,53	4,66		

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.	-8,21	12,86	-27,40	11,06	3,58		
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	8,36	-0,70	27,26	-2,67	12,67	62,04	86,72
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,83	12,35	5,40	8,98	9,17	15,55	23,54
BB AÇÕES ENERGIA FI	7,73	-5,55	21,28	-7,59	6,99	78,21	90,96
% do CDI	3.976,66	-284,44	3.305,77	-483,56	165,97	722,29	487,02
FIA CAIXA CONSUMO	7,41	-4,73	26,85	-7,85	11,99	50,68	52,12
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,21	-0,63	-0,69	-0,36	-0,17	-3,76	-5,91
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	8,53	-8,98	29,55	-9,99	7,29	67,90	73,73
Var. IBOVESPA p.p.	0,27	2,03	1,72	-0,46	6,21	37,99	17,61
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	7,46	-15,22	25,57	-14,03	-2,29	22,77	50,39
Var. IBOVESPA p.p.	-0,80	-4,21	-2,26	-4,49	-3,37	-7,13	-5,73
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	8,86	-8,47	27,39	-10,22	11,49	61,50	86,31
Var. IBOVESPA p.p.	0,60	2,54	-0,44	-0,68	10,41	31,60	30,19
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	6,94	-25,46	27,45	-28,08	-6,86	54,79	37,38
% do CDI	3.569,23	-1.304,43	4.263,65	-1.789,21	-162,67	506,00	200,16
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	8,32	-9,87	21,78	-11,23	4,70	50,50	59,72
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,79	3,18	-0,08	0,43	1,20	4,00	-3,47
BB AÇÕES DIVIDENDOS	6,77	-17,03	19,26	-16,68	-7,01	24,01	35,50
Var. IBOVESPA p.p.	-1,50	-6,02	-8,57	-7,15	-8,09	-5,90	-20,61
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	6,38	-12,84	22,84	-11,57	0,02	50,60	
Var. IBOVESPA p.p.	-1,89	-1,83	-4,99	-2,03	-1,06	20,69	
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	8,08	-11,06	27,18	-9,51	0,68	28,59	53,18
Var. IBOVESPA p.p.	-0,18	-0,05	-0,65	0,02	-0,40	-1,32	-2,94
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	8,44	-10,49	27,78	-9,51	3,49	35,87	54,71
Var. IBOVESPA p.p.	0,18	0,52	-0,05	0,03	2,41	5,97	-1,40
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1,88	35,34	9,28	27,06	55,47	69,34	132,22
Var. IBOVESPA p.p.	-6,39	46,35	-18,55	36,60	54,39	39,44	76,11
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	0,98	30,58	5,63	26,86	48,10	56,54	114,56
Var. IBOVESPA p.p.	-7,29	41,59	-22,20	36,40	47,02	26,64	58,45
CDI	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,68
IBOVESPA	8,27	-11,01	27,83	-9,54	1,08	29,91	56,12
INPC + 6%	0,98	4,26	1,99	3,54	8,88	19,01	30,64
IPCA + 6%	0,90	3,91	1,73	3,16	8,47	18,63	31,32

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	0,24	2,84	0,94	2,39	5,51	13,20	21,56
IRF-M 1+	1,47	7,59	4,50	6,40	12,02	32,81	43,78
IRF-M TOTAL	1,08	6,00	3,32	5,08	9,81	26,59	36,79
IMA-B 5	0,99	4,19	4,28	3,61	8,83	24,16	34,43
IMA-B 5+	7,32	1,68	11,51	1,64	7,81	49,37	56,19
IMA-B TOTAL	4,39	2,65	8,14	2,38	8,16	37,86	46,75
IMA-C TOTAL	4,26	12,04	11,01	9,27	15,97	43,97	64,91
IMA-GERAL ex-C TOTAL	1,66	3,39	3,57	2,88	7,07	23,27	32,25
IMA-GERAL TOTAL	1,74	3,64	3,79	3,07	7,33	23,84	33,11
IDKA 2	0,94	4,31	3,72	3,76	8,68	22,37	33,35
IDKA 20	12,08	-1,74	17,28	-0,38	4,95	69,37	71,28
CDI	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,68
Renda Variável							
IBOVESPA	8,27	-11,01	27,83	-9,54	1,08	29,91	56,12
IBRX 100	8,41	-10,43	28,20	-9,30	2,17	33,69	59,04
IBRX 50	8,15	-11,06	29,00	-9,35	0,23	26,69	52,24
SMALL CAP	9,50	-13,20	31,66	-13,59	7,86	55,28	71,97
IFIX	-2,61	-14,53	4,97	-11,18	2,77	26,86	32,28
Índice Consumo - ICON	7,62	-4,11	27,54	-7,49	12,15	54,44	58,02
Índice Dividendos - IDIV	6,53	-13,05	21,87	-11,65	3,50	46,49	63,19
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,36	0,46	0,24	0,25	2,31	5,60	10,34
INPC	0,44	0,80	0,49	0,61	2,69	5,94	9,76
IGPM	2,23	6,71	4,11	6,21	9,27	16,26	25,84
SELIC	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,69
Meta Atuarial							

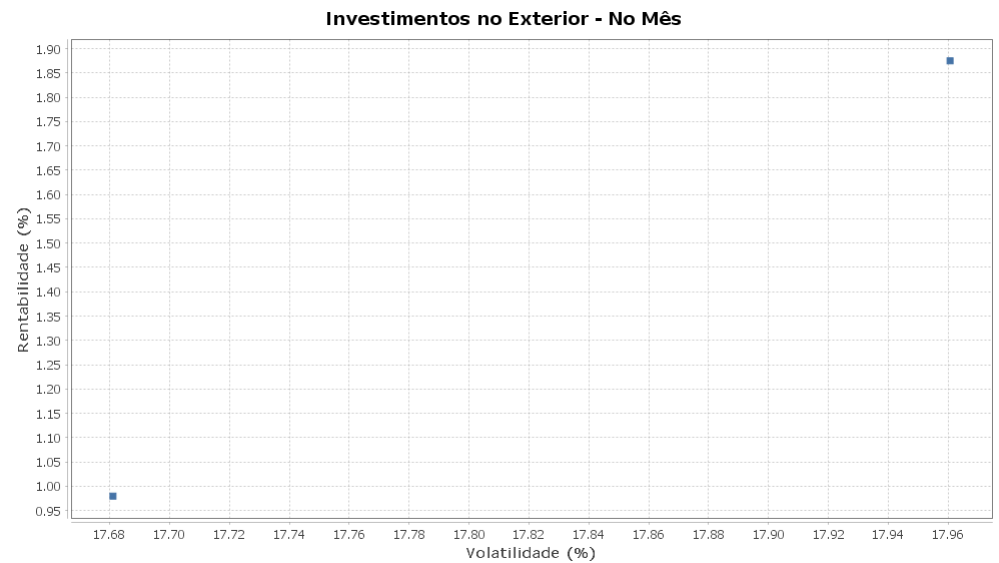
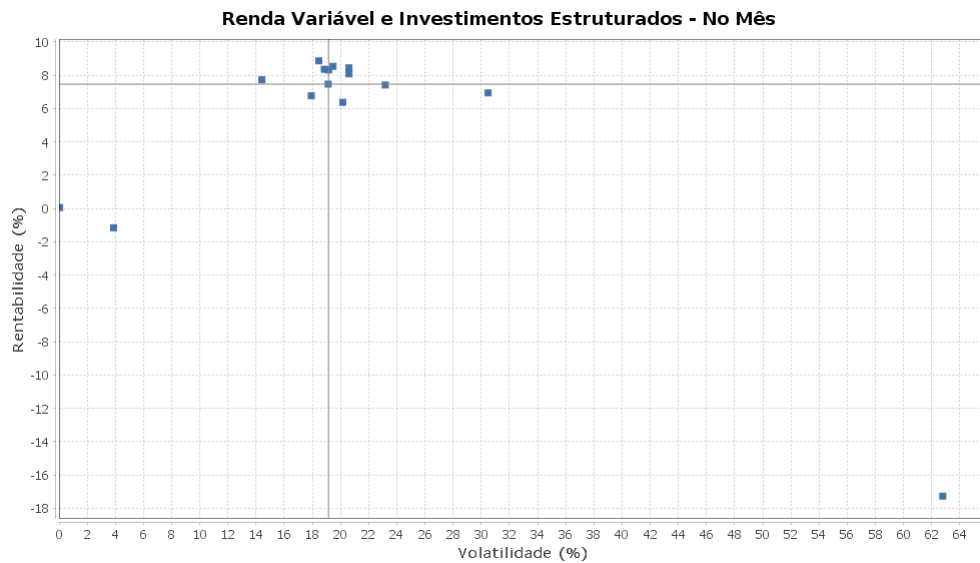
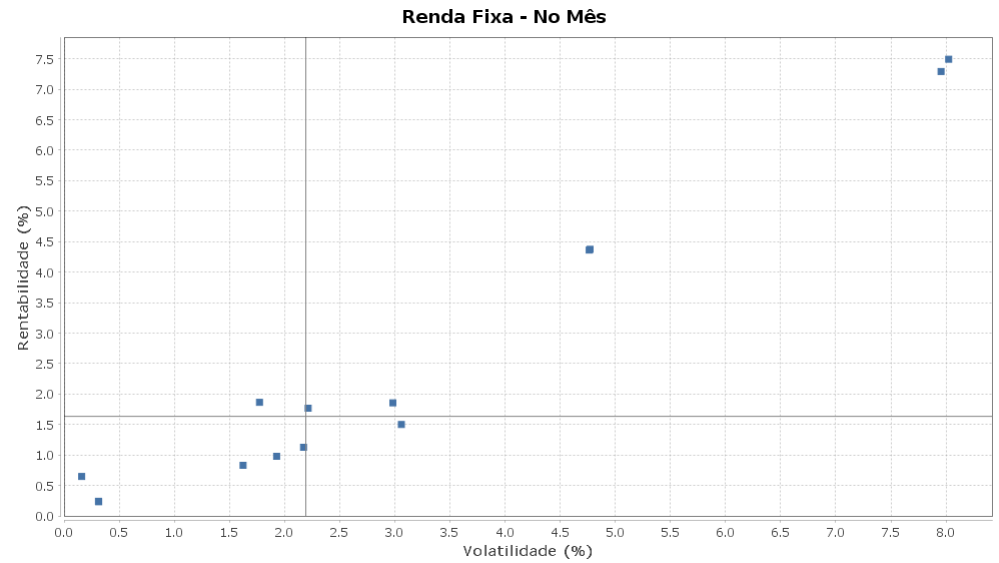
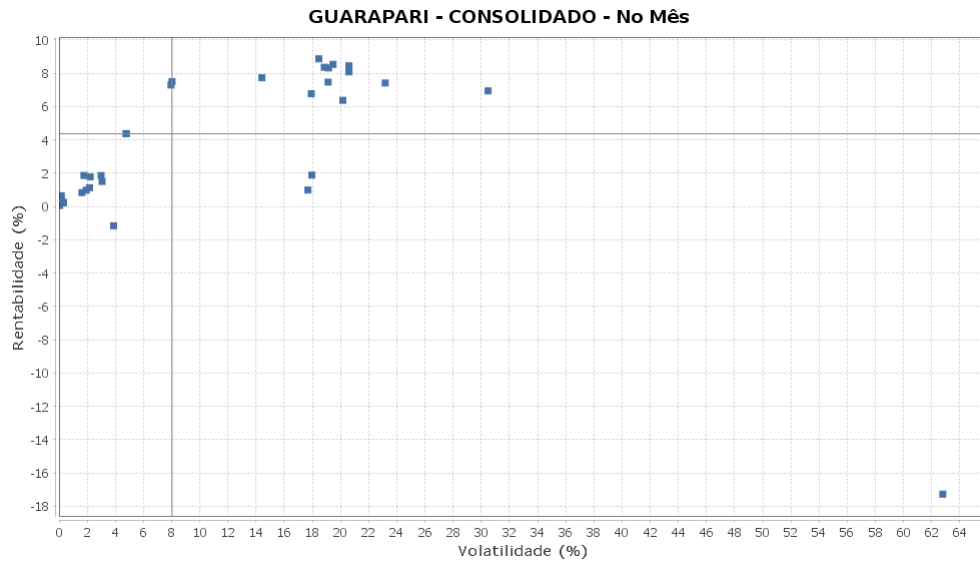
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
83	01/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	132.414,30	51.237,47952400	2,5843250000
82	14/07/2020	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	417.915,67	0,00	333.287,05958117	1,2539210800
85	14/07/2020	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	1.045.717,49	0,00	833.957,97863885	1,2539210800
81	22/07/2020	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	109.095,27	0,00	39.147,40103200	2,7867819350
78	28/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	170.000,00	65.658,58863900	2,5891510000
84	28/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	131.939,07	50.958,42989100	2,5891510000
80	30/07/2020	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	1.000.000,00	158.341,55886200	6,3154613810
79	30/07/2020	BB PREV RF IRF-M	0,00	923.000,00	150.976,73674400	6,1135246390

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	Artigo 8º III	0,05	0,37	0,00	-2,91	0,05	2.921.653,94	1,46
NTN-B 150850 (3,650000%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,16	0,10	-0,00	2,82	0,65	12.237.696,47	6,13
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,31	0,34	0,01	0,15	0,24	16.218.995,23	8,13
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,31	0,34	0,00	0,12	0,23	70.160,28	0,04
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,62	2,28	0,09	0,39	0,83	10.304.532,74	5,17
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	1,77	1,03	0,00	0,94	1,86	11.711.729,82	5,87
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,93	2,83	0,42	0,41	0,98	36.727.333,17	18,41
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,17	2,83	0,00	0,43	1,13	180.631,89	0,09
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,21	3,09	0,19	0,71	1,77	14.102.226,43	7,07
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF	Artigo 7º VII, Alínea b	2,98	3,98	0,05	0,56	1,86	2.757.040,50	1,38
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO	Artigo 7º I, Alínea b	3,06	4,49	0,01	0,43	1,50	510.594,76	0,26
CXCE11B	Artigo 8º IV, Alínea b	3,87	0,15	0,00	-0,35	-1,16	40.028,00	0,02
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,76	5,98	0,20	0,87	4,36	7.770.109,33	3,90
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,77	5,93	0,15	0,88	4,38	5.787.014,58	2,90
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,95	9,28	0,38	0,89	7,29	9.451.194,85	4,74
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	Artigo 7º I, Alínea b	8,02	18,50	-0,04	0,91	7,49	3.523.206,86	1,77
BB AÇÕES ENERGIA FI	Artigo 8º II, Alínea a	14,41	28,03	0,76	0,52	7,73	5.690.723,61	2,85
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	17,68	17,62	0,22	0,04	0,98	4.774.173,64	2,39
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	17,92	27,75	0,20	0,37	6,77	1.483.627,56	0,74
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	17,96	15,75	0,35	0,09	1,88	7.747.823,57	3,88
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	18,45	25,89	1,05	0,47	8,86	8.302.548,85	4,16
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	Artigo 8º II, Alínea a	18,84	29,84	1,26	0,43	8,36	8.795.007,84	4,41
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	19,12	24,84	0,27	0,38	7,46	2.181.061,35	1,09
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	19,14	26,52	0,50	0,42	8,32	3.817.628,11	1,91
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	Artigo 8º II, Alínea a	19,47	31,19	0,06	0,43	8,53	405.588,52	0,20
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,16	27,64	0,71	0,31	6,38	5.266.351,75	2,64
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	20,60	25,48	1,28	0,38	8,08	10.303.032,49	5,16
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	20,60	26,44	0,57	0,40	8,44	4.386.054,54	2,20
FIA CAIXA CONSUMO	Artigo 8º II, Alínea a	23,17	29,93	0,06	0,31	7,41	412.167,83	0,21
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	Artigo 8º II, Alínea a	30,48	35,52	0,17	0,22	6,94	1.041.346,23	0,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RBRD11	Artigo 8º IV, Alínea b	62,79	1,08	-0,00	-0,28	-17,28	562.953,70	0,28